

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成31年1月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31年1月24日から平成31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）

（愛称として「らっぶちゃん」という名称を用いることがあります。）

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「らっぶ安定」、「安定成長型」は「らっぶ安成」、「成長型」は「らっぶ成長」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】

2019年1月24日から2019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せん。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は株式、債券および不動産投信であり、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	年6回(隔月)	欧州		(部分ヘッジ)
一般	年12回(毎月)	アジア		
公債	日々	オセアニア		
社債	その他	中南米		
その他債券			ファンド・オブ・ファン	なし
クレジット属性 ()			ズ	
不動産投信	()	アフリカ		
その他資産				
(投資信託証券(資				
産複合(株式、債				
券、不動産投信)		中近東(中東)		
資産配分変更型)				
資産複合		エマージング		
()				
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。

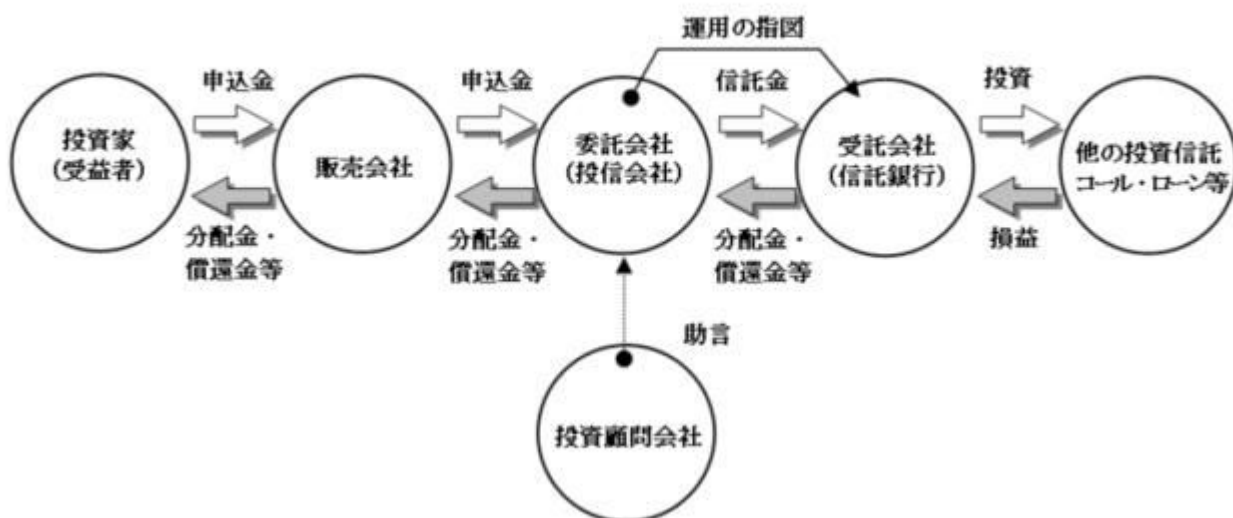
日興グローバルラップ株式会社

「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（2018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

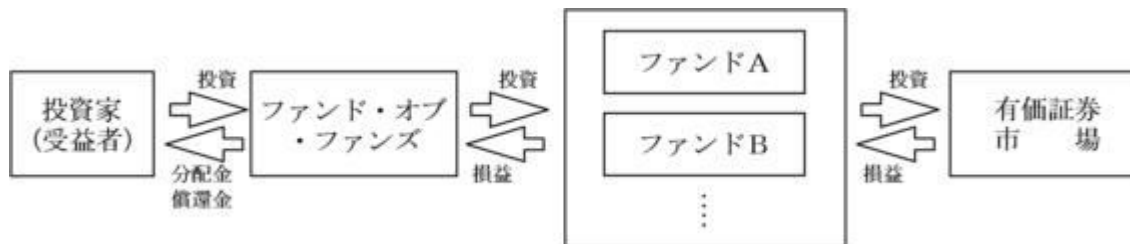
（2018年11月30日現在）

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	10,584,000	60.0
住友生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区城見一丁目4番35号	3,528,000	20.0
三井住友海上火災保険株式会社	東京都千代田区神田駿河台三丁目9番地	3,528,000	20.0

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・パ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
購入の可否***	日本において一般投資者の購入が可能です。

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0.40%程度
購入の可否***	日本において一般投資者の購入が可能です。

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・パークレイズ・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・パークレイズ・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
購入の可否***	日本において一般投資者の購入が可能です。

*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の直近の目録見書等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(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。)、新興国の株式指数を対象とした先物取引および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)の動きと連動する投資成果を目指します。 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%

▶ 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、委託会社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。

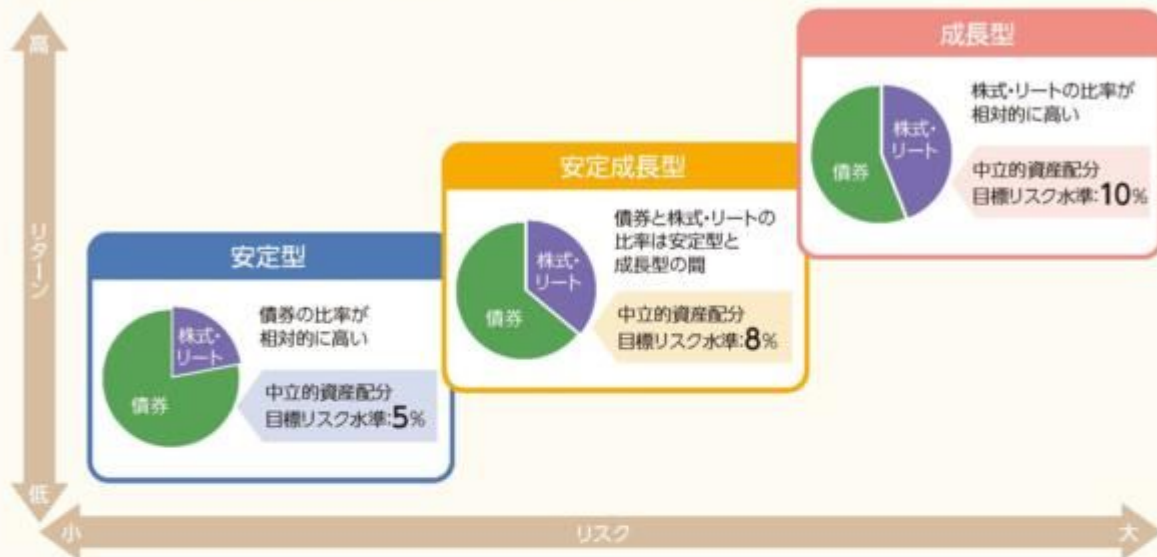


※日興グローバルラップは委託会社の子会社です(100%出資)。

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2018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〕

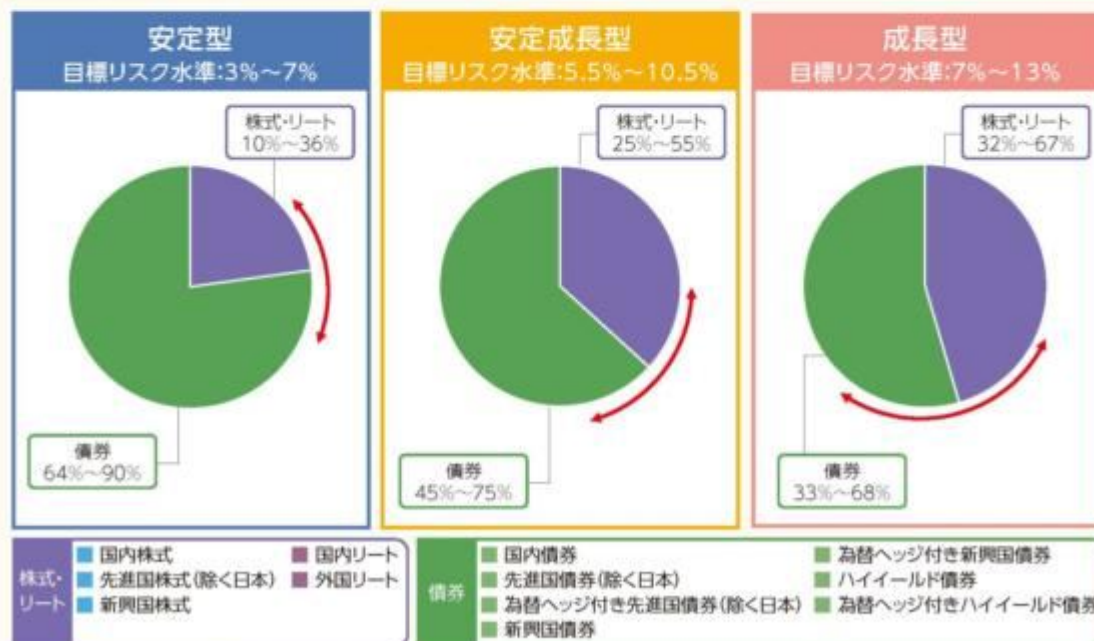


※資産配分の決定にあたっては、エドモンドゥ・ロスチャイルド・アセット・マネジメント(ルクセンブルグ)から投資助言を受けます。

※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2018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2018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。

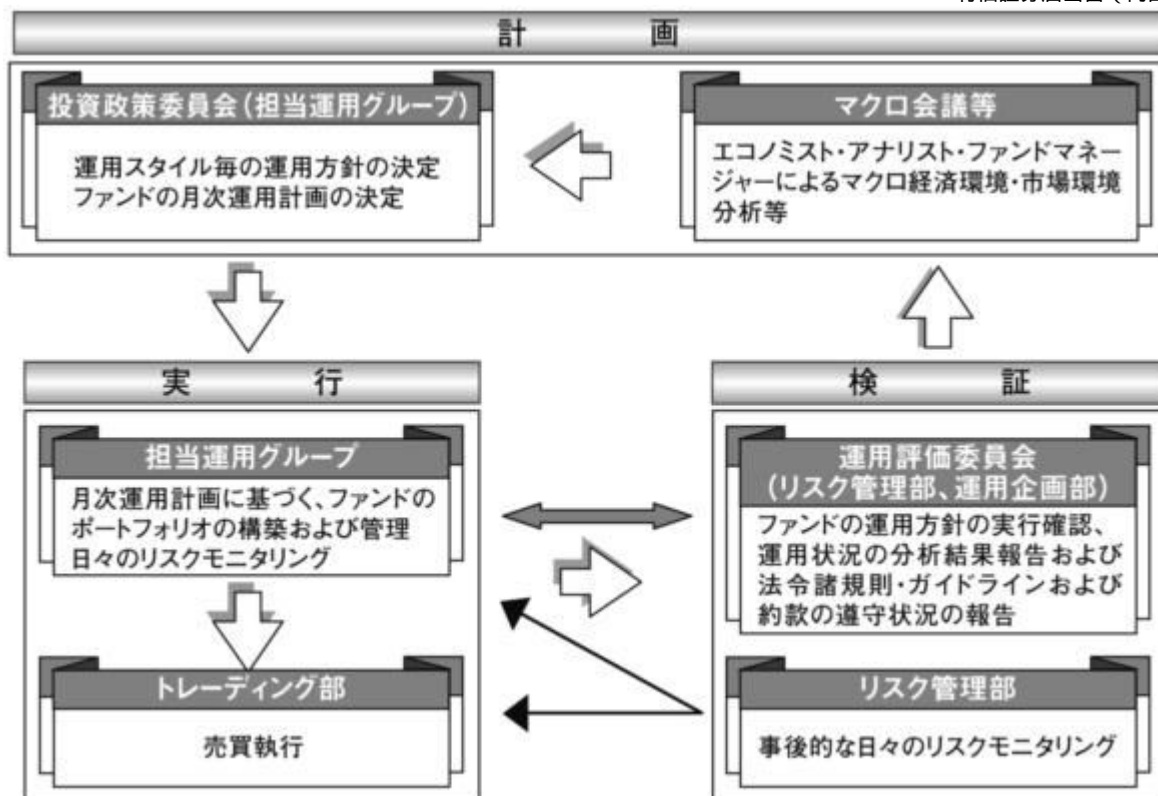
売買執行については、組織的に分離されたトレーディング部が、最良と思われる手法をもって売買を執行します。

(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10名程度で構成されています。

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

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

およびコンプライアンス委員会への報告が義務づけられています。

（参考情報）投資リスクの定量的比較

〔 ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移 〕

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

■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。



■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。

各資産クラスの指数

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

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。

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

4【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

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。			
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		

実質的な負担	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。

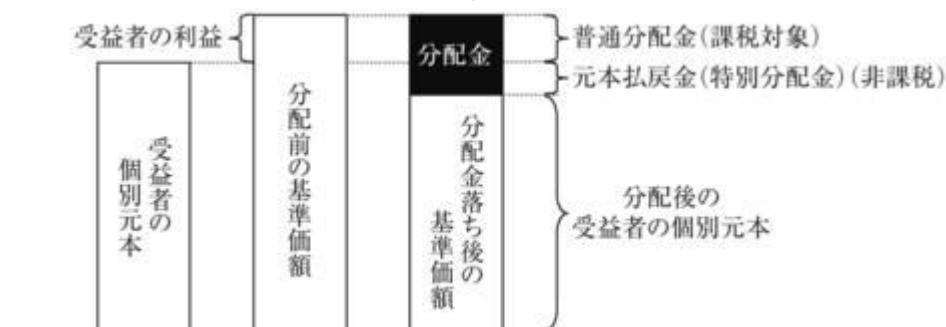
八 収益分配金の課税について

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

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



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



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

二 個人、法人別の課税の取扱いについて

(イ) 個人の受益者に対する課税

・収益分配時

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

・一部解約時および償還時

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

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

(ロ) 法人の受益者に対する課税

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

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「NISA(ニーサ)」、未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA(ニーサ)」の適用対象です。ただし、販売会社によっては当ファンドをNISA、ジュニアNISAでの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、2018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)

2018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	3,234,569,529	13.71
親投資信託受益証券	日本	20,058,982,919	85.00
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		304,504,446	1.29
合計(純資産総額)		23,598,056,894	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	買建		105,435,750	0.44
	売建		3,118,225,500	13.21

アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)

2018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	3,561,807,178	22.87
親投資信託受益証券	日本	11,796,365,663	75.73
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		217,928,311	1.40
合計(純資産総額)		15,576,101,152	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		144,846,750	0.92
	売建		3,484,362,750	22.36

アセットアロケーション・ファンド(成長型)

2018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	3,366,622,280	29.08
親投資信託受益証券	日本	8,068,277,784	69.68
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		144,096,698	1.24
合計(純資産総額)		11,578,996,762	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		100,339,500	0.86
	売建		3,279,380,250	28.32

(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

2018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	9,173,858,909	1.3717	12,583,782,266	1.3651	12,523,234,796	53.07
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	3,659,129,426	1.2601	4,610,868,990	1.2602	4,611,234,902	19.54
アメリカ	投資信託受益証券	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ETF	428,722	4,058.82	1,740,106,242	3,952.16	1,694,377,982	7.18
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）	443,898,286	2.6461	1,174,599,255	2.5937	1,151,338,984	4.88
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	315,400,400	3.3487	1,056,189,540	3.4678	1,093,745,507	4.63
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	91,875	12,508.93	1,149,258,201	11,739.60	1,078,576,320	4.57
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	55,005	8,736.05	480,526,722	8,392.24	461,615,227	1.96
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	165,904,091	1.9913	330,364,817	2.1241	352,396,879	1.49
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	63,685,311	1.7439	111,060,814	1.7461	111,200,921	0.47
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	83,167,154	1.3775	114,562,755	1.3023	108,308,584	0.46
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	51,803,019	1.9136	99,130,258	2.0756	107,522,346	0.46

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別の投資比率

2018年11月30日現在

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	13.71
親投資信託受益証券	85.00
合計	98.71

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

2018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	4,782,599,603	1.3719	6,561,248,396	1.3651	6,528,726,718	41.92
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)	618,202,967	2.6783	1,655,733,007	2.5937	1,603,433,035	10.29
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	376,040	4,058.82	1,526,279,387	3,952.16	1,486,170,284	9.54
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	365,627,690	3.3463	1,223,499,940	3.4678	1,267,923,703	8.14
アメリカ	投資信託受益証券	iシェアーズ J.P.モルガン・ミドル建てエマージング・マーケット債券ETF	98,896	12,515.74	1,237,756,722	11,739.60	1,161,000,095	7.45
アメリカ	投資信託受益証券	バンガード・ミドル建て新興国政府債券ETF	108,986	8,736.05	952,107,723	8,392.24	914,636,799	5.87
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	578,424,180	1.2588	728,120,358	1.2602	728,930,151	4.68
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	506,367,397	1.3929	705,360,367	1.3023	659,442,261	4.23
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	292,756,197	1.9809	579,920,751	2.1241	621,843,438	3.99
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	180,813,690	1.7438	315,302,913	1.7461	315,718,784	2.03
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	33,892,645	1.9184	65,019,651	2.0756	70,347,573	0.45

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別の投資比率

2018年11月30日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	22.87
親投資信託受益証券	75.73
合計	98.60

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

2018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	2,201,938,786	1.3715	3,019,959,045	1.3651	3,005,866,636	25.96
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）	611,775,561	2.6864	1,643,473,868	2.5937	1,586,762,272	13.70
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	313,707	4,058.82	1,273,280,841	3,952.16	1,239,820,288	10.71
アメリカ	投資信託受益証券	iシェアーズ J.P.モルガン・ミドル建てエマージング・マーケット債券ETF	103,902	12,511.20	1,299,938,931	11,739.60	1,219,768,563	10.53
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	327,166,698	3.3503	1,096,106,589	3.4678	1,134,548,675	9.80
アメリカ	投資信託受益証券	バンガード・ミドル建て新興国政府債券ETF	108,080	8,734.92	944,070,218	8,392.24	907,033,429	7.83
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	506,083,183	1.2590	637,158,728	1.2602	637,766,027	5.51
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	454,934,555	1.3958	635,001,288	1.3023	592,461,270	5.12
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	262,612,139	1.9806	520,129,603	2.1241	557,814,444	4.82
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	286,012,337	1.7438	498,748,314	1.7461	499,406,141	4.31
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	25,849,065	1.9211	49,658,639	2.0756	53,652,319	0.46

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別の投資比率

2018年11月30日現在

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	29.08
親投資信託受益証券	69.68
合計	98.76

【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）

2018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	931,000.00	105,703,308	105,435,750	0.44
	米ドル	売建	27,534,000.00	3,130,133,955	3,118,225,500	13.21

(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）

2018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	1,279,000.00	145,166,417	144,846,750	0.92
	米ドル	売建	30,767,000.00	3,497,669,477	3,484,362,750	22.36

(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）

2018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	886,000.00	100,575,556	100,339,500	0.86
	米ドル	売建	28,957,000.00	3,291,904,152	3,279,380,250	28.32

(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
第3期 (2018年 4月26日)	30,744,053,222	30,744,053,222	9,815	9,815
2017年11月末日	38,808,126,418		10,162	
12月末日	37,521,872,764		10,175	
2018年 1月末日	35,728,073,393		10,070	
2月末日	33,891,274,150		9,919	
3月末日	32,719,733,242		9,860	
4月末日	30,747,890,147		9,836	
5月末日	29,223,550,860		9,816	
6月末日	27,920,467,681		9,819	
7月末日	26,749,142,559		9,838	
8月末日	26,071,001,856		9,824	
9月末日	25,328,177,564		9,835	
10月末日	24,086,023,633		9,697	
11月末日	23,598,056,894		9,728	

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
第3期 (2018年 4月26日)	20,024,628,165	20,024,628,165	10,020	10,020
2017年11月末日	25,944,724,766		10,408	
12月末日	24,910,021,246		10,455	
2018年 1月末日	23,731,595,498		10,387	
2月末日	22,249,283,007		10,155	
3月末日	21,270,927,157		10,027	
4月末日	19,907,798,002		10,047	
5月末日	18,879,406,646		9,997	

6月末日	18,262,254,971		9,976	
7月末日	17,850,625,615		10,059	
8月末日	17,107,437,625		10,028	
9月末日	16,981,737,993		10,116	
10月末日	16,059,243,105		9,829	
11月末日	15,576,101,152		9,892	

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
第3期 (2018年 4月26日)	14,776,735,458	14,776,735,458	10,111	10,111
2017年11月末日	19,397,480,502		10,536	
12月末日	18,387,956,760		10,605	
2018年 1月末日	17,472,740,707		10,549	
2月末日	16,499,414,133		10,267	
3月末日	15,633,816,147		10,088	
4月末日	14,714,523,759		10,139	
5月末日	13,763,905,730		10,072	
6月末日	13,134,686,650		10,037	
7月末日	13,112,692,628		10,157	
8月末日	12,671,169,073		10,110	
9月末日	12,578,049,021		10,248	
10月末日	11,810,728,897		9,886	
11月末日	11,578,996,762		9,957	

【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
第3期	2017年 4月27日 ~ 2018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
第3期	2017年 4月27日～2018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
第3期	2017年 4月27日～2018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	1.8
第4期（中間期）	1.4

（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	0.2
第4期（中間期）	2.2

（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	0.4

第4期(中間期)	2.6
----------	-----

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

(4) 【設定及び解約の実績】

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	3,005,688,776	20,274,975,700
第4期(中間期)	223,334,550	6,640,904,358

(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	1,994,684,295	14,122,473,521
第4期(中間期)	332,870,408	3,926,013,457

(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	2,148,349,345	14,391,885,041
第4期(中間期)	507,595,020	3,150,933,184

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

(参考)

(1) 投資状況

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

2018年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	168,579,248,010	97.14
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,968,526,368	2.86
合計(純資産総額)		173,547,774,378	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	日本	4,870,560,000	2.80
合計	買建	-	4,870,560,000	2.80

外国株式インデックス・マザーファンド

2018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	106,321,788,356	61.02
	イギリス	10,324,993,236	5.93
	カナダ	6,162,541,736	3.54
	フランス	6,158,828,876	3.53
	スイス	5,906,779,172	3.39
	ドイツ	5,553,233,155	3.19
	オーストラリア	3,785,121,149	2.17
	オランダ	2,942,889,328	1.69
	アイルランド	2,896,800,418	1.66
	スペイン	1,914,150,632	1.10
	香港	1,533,451,366	0.88
	スウェーデン	1,506,999,761	0.86
	イタリア	1,180,973,694	0.68
	デンマーク	1,068,853,227	0.61
	ジャージー	822,049,393	0.47
シンガポール	758,581,214	0.44	
フィンランド	751,460,914	0.43	

	バミューダ	738,202,734	0.42
	ベルギー	619,690,936	0.36
	ノルウェー	464,113,809	0.27
	ケイマン諸島	383,575,710	0.22
	イスラエル	348,369,078	0.20
	キュラソー	299,777,777	0.17
	ルクセンブルグ	181,268,738	0.10
	オーストリア	146,704,845	0.08
	ニュージーランド	139,934,041	0.08
	ポルトガル	94,930,721	0.05
	リベリア	85,981,262	0.05
	パプアニューギニア	37,016,606	0.02
	英ヴァージン諸島	30,958,043	0.02
	マン島	25,981,823	0.01
	モーリシャス	6,741,278	0.00
	小計	163,192,743,028	93.66
投資証券	アメリカ	2,933,542,721	1.68
	オーストラリア	485,289,934	0.28
	フランス	211,041,873	0.12
	イギリス	124,084,185	0.07
	香港	123,408,202	0.07
	シンガポール	73,407,798	0.04
	カナダ	32,179,699	0.02
	小計	3,982,954,412	2.29
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,069,690,167	4.05
合計(純資産総額)		174,245,387,607	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	4,842,027,015	2.77
	買建	ドイツ	1,151,511,810	0.66
	買建	イギリス	440,096,649	0.25
	買建	オーストラリア	298,361,050	0.17
合計	買建	-	6,731,996,524	3.85

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		96,444,300	0.05
	売建		35,780,600	0.02

エマージング株式インデックス・マザーファンド

2018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	ケイマン諸島	297,253,202	6.75
	韓国	286,902,160	6.52
	台湾	228,692,849	5.20
	中国	198,668,080	4.51
	インド	189,490,510	4.31
	ブラジル	149,553,218	3.40
	南アフリカ	123,372,723	2.80
	香港	97,451,943	2.21
	メキシコ	52,454,952	1.19
	タイ	48,636,931	1.10
	マレーシア	48,156,672	1.09
	インドネシア	45,745,206	1.04
	ポーランド	25,499,364	0.58
	チリ	22,025,940	0.50
	フィリピン	21,335,322	0.48
	バミューダ	19,203,466	0.44
	トルコ	13,087,879	0.30
	コロンビア	8,417,998	0.19
	アメリカ	6,825,674	0.16
	ハンガリー	6,798,295	0.15
ギリシャ	3,941,650	0.09	
チェコ	3,575,869	0.08	
エジプト	2,347,306	0.05	

	マン島	1,264,968	0.03
	ペルー	1,119,949	0.03
	ルクセンブルグ	951,678	0.02
	シンガポール	694,158	0.02
	小計	1,903,467,962	43.24
投資信託受益証券	アメリカ	111,712,285	2.54
	香港	14,905,314	0.34
	小計	126,617,599	2.88
投資証券	南アフリカ	5,827,913	0.13
	ブラジル	3,581,670	0.08
	メキシコ	1,374,438	0.03
	小計	10,784,021	0.25
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,360,728,424	53.63
合計(純資産総額)		4,401,598,006	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	2,359,682,405	53.60
合計	買建	-	2,359,682,405	53.60

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		2,028,501,768	46.08
	売建		287,527,458	6.53

Jリート・インデックス・マザーファンド

2018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	9,641,017,910	98.61
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		135,733,664	1.39
合計(純資産総額)		9,776,751,574	100.00

外国リート・インデックス・マザーファンド

2018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	3,592,384,647	72.31
	オーストラリア	347,803,628	7.00
	イギリス	245,286,176	4.94
	フランス	213,019,550	4.29
	シンガポール	174,255,007	3.51
	香港	102,760,037	2.07
	カナダ	90,545,056	1.82
	スペイン	39,841,932	0.80
	ベルギー	38,408,730	0.77
	ニュージーランド	21,442,071	0.43
	オランダ	18,310,851	0.37
	ドイツ	13,543,256	0.27
	アイルランド	11,104,291	0.22
	イタリア	5,540,511	0.11
	イスラエル	3,456,576	0.07
	ガーンジー	1,906,881	0.04
マン島	1,860,768	0.04	
	小計	4,921,469,968	99.07
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		46,348,610	0.93
合計(純資産総額)		4,967,818,578	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		8,000,070	0.16

国内債券パッシブ・マザーファンド

2018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	139,965,246,130	73.33
地方債証券	日本	18,230,630,646	9.55
特殊債券	日本	23,880,863,061	12.51
社債券	日本	7,295,997,000	3.82

	オーストラリア	200,740,000	0.11
	フランス	199,260,000	0.10
	小計	7,695,997,000	4.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,090,233,943	0.58
合計(純資産総額)		190,862,970,780	100.00

外国債券パッシブ・マザーファンド

2018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	77,784,485,755	45.47
	フランス	16,942,462,240	9.90
	イタリア	15,164,157,895	8.86
	ドイツ	11,458,082,800	6.70
	イギリス	11,106,748,885	6.49
	スペイン	9,942,535,972	5.81
	ベルギー	4,131,225,807	2.42
	オーストラリア	3,591,478,943	2.10
	カナダ	3,441,803,629	2.01
	オランダ	3,429,300,492	2.00
	オーストリア	2,679,118,707	1.57
	アイルランド	1,471,657,654	0.86
	メキシコ	1,312,345,673	0.77
	フィンランド	1,100,402,051	0.64
	デンマーク	1,050,401,958	0.61
	南アフリカ	1,035,944,580	0.61
	ポーランド	1,006,256,601	0.59
	マレーシア	842,071,506	0.49
	シンガポール	671,163,687	0.39
	スウェーデン	634,892,382	0.37
ノルウェー	416,636,760	0.24	
	小計	169,213,173,977	98.92
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,849,698,830	1.08
合計(純資産総額)		171,062,872,807	100.00

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

2018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	20,382,093,077	45.24
	フランス	4,425,017,430	9.82
	イタリア	3,969,295,444	8.81
	イギリス	2,915,521,176	6.47
	ドイツ	2,861,522,158	6.35
	スペイン	2,648,642,540	5.88
	ベルギー	1,048,575,286	2.33
	オランダ	956,316,184	2.12
	オーストラリア	942,998,651	2.09
	カナダ	897,784,359	1.99
	オーストリア	724,452,305	1.61
	アイルランド	442,451,334	0.98
	シンガポール	392,703,302	0.87
	メキシコ	338,541,929	0.75
	フィンランド	308,867,192	0.69
	デンマーク	274,141,966	0.61
	南アフリカ	265,438,980	0.59
	ポーランド	261,427,638	0.58
	スウェーデン	161,391,497	0.36
ノルウェー	103,980,939	0.23	
小計	44,321,163,387	98.38	
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		728,339,178	1.62
合計(純資産総額)		45,049,502,565	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		44,467,232,000	98.70

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2018年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	795,500	7,046.98	5,605,880,236	6,803.00	5,411,786,500	3.12

日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	4,902,000	787.15	3,858,613,440	624.50	3,061,299,000	1.76
日本	株式	ソニー	電気機器	478,400	5,243.34	2,508,416,368	5,937.00	2,840,260,800	1.64
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	292,800	9,470.72	2,773,029,000	9,526.00	2,789,212,800	1.61
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	479,100	5,842.45	2,799,120,520	4,680.00	2,242,188,000	1.29
日本	株式	キーエンス	電気機器	35,000	64,590.99	2,260,684,658	61,600.00	2,156,000,000	1.24
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	495,800	4,549.93	2,255,856,600	4,183.00	2,073,931,400	1.20
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	602,000	3,732.74	2,247,113,429	3,202.00	1,927,604,000	1.11
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	9,556,000	203.38	1,943,582,860	188.30	1,799,394,800	1.04
日本	株式	KDDI	情報・通信業	617,200	3,193.46	1,971,006,008	2,664.00	1,644,220,800	0.95
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	488,700	2,664.46	1,302,125,172	3,123.00	1,526,210,100	0.88
日本	株式	任天堂	その他製品	44,000	44,785.40	1,970,557,612	34,610.00	1,522,840,000	0.88
日本	株式	三菱商事	卸売業	493,200	2,833.32	1,397,397,416	3,062.00	1,510,178,400	0.87
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	63,900	20,823.45	1,330,618,853	23,325.00	1,490,467,500	0.86
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	294,500	4,612.07	1,358,257,207	4,943.00	1,455,713,500	0.84
日本	株式	花王	化学	173,300	7,463.99	1,293,510,560	8,358.00	1,448,441,400	0.83
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	255,000	4,973.05	1,268,128,476	5,605.00	1,429,275,000	0.82
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	503,000	2,901.54	1,459,476,421	2,628.50	1,322,135,500	0.76
日本	株式	ファナック	電気機器	67,800	27,614.68	1,872,275,645	19,390.00	1,314,642,000	0.76
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	126,900	10,835.10	1,374,974,560	10,320.00	1,309,608,000	0.75
日本	株式	日本電産	電気機器	85,900	15,290.36	1,313,442,473	15,120.00	1,298,808,000	0.75
日本	株式	村田製作所	電気機器	74,900	15,283.75	1,144,753,090	17,315.00	1,296,893,500	0.75
日本	株式	信越化学工業	化学	123,200	11,676.08	1,438,494,016	10,135.00	1,248,632,000	0.72
日本	株式	キャノン	電気機器	384,400	4,254.49	1,635,429,790	3,220.00	1,237,768,000	0.71
日本	株式	ダイキン工業	機械	97,400	12,952.41	1,261,565,316	12,610.00	1,228,214,000	0.71
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	281,900	5,999.82	1,691,351,628	4,255.00	1,199,484,500	0.69
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	413,600	3,681.63	1,522,724,110	2,823.50	1,167,799,600	0.67
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	658,000	1,435.50	944,559,224	1,744.50	1,147,881,000	0.66
日本	株式	三菱電機	電気機器	713,200	1,834.29	1,308,221,452	1,498.00	1,068,373,600	0.62
日本	株式	日立製作所	電気機器	321,100	4,163.77	1,336,989,720	3,288.00	1,055,776,800	0.61

□ 種類別・業種別の投資比率

2018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	0.12
		鉱業	0.31
		建設業	2.88
		食料品	4.25
		繊維製品	0.65
		パルプ・紙	0.28

化学	7.13
医薬品	5.08
石油・石炭製品	0.73
ゴム製品	0.80
ガラス・土石製品	0.89
鉄鋼	0.98
非鉄金属	0.78
金属製品	0.58
機械	4.92
電気機器	12.64
輸送用機器	7.81
精密機器	1.78
その他製品	2.02
電気・ガス業	1.84
陸運業	4.46
海運業	0.16
空運業	0.58
倉庫・運輸関連業	0.19
情報・通信業	7.34
卸売業	4.82
小売業	5.14
銀行業	6.51
証券、商品先物取引業	0.90
保険業	2.33
その他金融業	1.17
不動産業	2.36
サービス業	4.71
合計	97.14

外国株式インデックス・マザーファンド

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

2018年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	204,177	19,238.83	3,928,128,328	20,373.53	4,159,807,970	2.39
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	303,031	9,474.74	2,871,141,452	12,503.25	3,788,875,169	2.17
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	17,122	132,519.34	2,268,996,201	189,899.98	3,251,467,593	1.87

アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	111,237	15,844.95	1,762,544,793	16,549.59	1,840,927,800	1.06
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	141,482	11,770.24	1,665,277,534	12,488.50	1,766,899,117	1.01
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	13,023	116,099.09	1,511,958,578	123,489.40	1,608,202,469	0.92
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	175,561	9,322.69	1,636,701,692	8,970.93	1,574,946,881	0.90
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	99,482	19,878.80	1,977,583,707	15,736.01	1,565,450,702	0.90
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	12,384	117,829.51	1,459,200,743	124,201.99	1,538,117,476	0.88
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	52,994	21,581.99	1,143,716,190	24,702.41	1,309,079,992	0.75
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	39,819	25,295.86	1,007,256,132	32,060.94	1,276,634,908	0.73
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	400,264	3,207.79	1,283,965,618	3,181.69	1,273,519,488	0.73
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	129,019	9,657.58	1,246,011,443	9,704.27	1,252,036,501	0.72
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	242,394	4,108.74	995,936,032	5,164.01	1,251,727,391	0.72
アメリカ	株式	WELLS FARGO & COMPANY	銀行	192,363	6,432.61	1,237,396,984	6,131.91	1,179,554,296	0.68
アメリカ	株式	VISA INC	ソフトウェア・サービス	74,010	12,472.62	923,098,784	15,783.67	1,168,149,935	0.67
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	171,136	5,656.47	968,027,276	6,745.79	1,154,447,774	0.66
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	104,122	10,127.19	1,054,464,058	10,532.28	1,096,642,620	0.63
アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION	エネルギー	79,150	13,285.06	1,051,513,101	13,485.90	1,067,409,737	0.61
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	301,751	3,952.16	1,192,568,262	3,468.77	1,046,707,200	0.60
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	194,765	4,257.39	829,191,421	5,371.66	1,046,213,269	0.60
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	192,982	4,990.41	963,059,419	5,412.51	1,044,518,742	0.60
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	111,371	6,279.42	699,346,376	8,840.44	984,569,501	0.57
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	47,771	20,112.55	960,796,985	19,932.14	952,178,270	0.55
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	167,322	5,157.21	862,914,942	5,557.76	929,935,619	0.53
スイス	株式	NOVARTIS AG-REG SHS	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	90,055	9,525.45	857,815,030	10,292.00	926,846,420	0.53
アメリカ	株式	BOEING CO	資本財	22,998	30,833.20	709,102,005	38,870.28	893,938,773	0.51
アメリカ	株式	MASTERCARD INC-CL A	ソフトウェア・サービス	38,382	16,850.29	646,748,023	22,315.01	856,494,722	0.49
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CLASS A	メディア・娯楽	189,992	4,218.81	801,541,023	4,472.98	849,831,822	0.49

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	29,067	28,166.33	818,710,743	28,953.37	841,587,896	0.48
-----	----	----------------------------------	------------------------	--------	-----------	-------------	-----------	-------------	------

ロ 種類別・業種別の投資比率

2018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	6.24
		素材	4.21
		資本財	6.63
		商業・専門サービス	1.07
		運輸	1.92
		自動車・自動車部品	1.20
		耐久消費財・アパレル	1.64
		消費者サービス	1.85
		メディア・娯楽	2.03
		小売	4.57
		食品・生活必需品小売り	1.60
		食品・飲料・タバコ	4.73
		家庭用品・パーソナル用品	1.95
		ヘルスケア機器・サービス	4.90
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.50
		銀行	8.37
		各種金融	4.22
		保険	3.68
		不動産	0.77
		ソフトウェア・サービス	11.20
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.11		
電気通信サービス	2.43		
公益事業	3.14		
半導体・半導体製造装置	2.69		
投資証券			2.29
合計			95.94

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(上位30銘柄)

2018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 (%)
------	----	-----	----	----	-------------	-------------	------------------	------------	-----------------

ケイマン諸島	株式	TENCENT HOLDINGS LIMITED	ソフトウェア・サービス	20,900	6,188.80	129,346,104	4,527.12	94,616,808	2.15
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	17,888	4,613.01	82,517,589	4,384.03	78,421,707	1.78
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES MSCI RUSSIA ETF		20,110	4,240.17	85,269,977	3,847.76	77,378,608	1.76
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	半導体・半導体製造装置	90,000	891.83	80,264,749	842.72	75,844,800	1.72
ケイマン諸島	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	ソフトウェア・サービス	4,249	20,647.60	87,731,658	17,733.09	75,347,906	1.71
南アフリカ	株式	NASPERS LIMITED-N SHS	メディア・娯楽	1,630	27,655.36	45,078,242	23,406.00	38,151,780	0.87
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	357,000	114.03	40,709,129	96.34	34,395,665	0.78
香港	株式	CHINA MOBILE LTD	電気通信サービス	23,000	1,024.22	23,557,158	1,110.01	25,530,345	0.58
中国	株式	PING AN INSURANCE (GROUP) CO OF CHINA LT	保険	19,500	1,172.99	22,873,490	1,099.85	21,447,231	0.49
ケイマン諸島	株式	BAIDU INC - SPON ADR	ソフトウェア・サービス	1,026	28,945.29	29,697,872	20,789.97	21,330,513	0.48
中国	株式	INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK OF CHINA	銀行	258,000	95.18	24,557,885	80.09	20,664,562	0.47
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES MSCI QATAR ETF		9,231	1,840.68	16,991,382	2,214.93	20,446,059	0.46
インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	エネルギー	10,590	1,551.13	16,426,476	1,916.34	20,294,041	0.46
ブラジル	株式	ITAU UNIVANCO HOLDING SA	銀行	17,700	1,027.16	18,180,891	1,070.14	18,941,549	0.43
インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORPORATION	銀行	5,873	3,040.98	17,859,729	3,208.33	18,842,534	0.43
ブラジル	株式	VALE SA	素材	11,600	1,292.09	14,988,270	1,530.88	17,758,208	0.40
韓国	株式	HYNIX SEMICONDUCTOR INC	半導体・半導体製造装置	2,133	7,983.12	17,028,001	7,264.39	15,494,965	0.35
香港	投資信託受益証券	CHINAAMC CSI 300 INDEX ETF		28,400	594.57	16,885,865	524.83	14,905,314	0.34
中国	株式	BANK OF CHINA LTD	銀行	291,000	60.28	17,543,310	49.76	14,482,866	0.33
ブラジル	株式	BANCO BRADESCO S.A.-PREF	銀行	12,320	1,061.19	13,073,963	1,145.80	14,116,315	0.32
インド	株式	INFOSYS LIMITED	ソフトウェア・サービス	12,984	1,016.09	13,192,924	1,084.12	14,076,240	0.32
台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	48,800	392.62	19,160,325	266.43	13,001,882	0.30
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES MSCI UAE ETF		7,671	1,925.30	14,769,020	1,638.50	12,568,986	0.29
香港	株式	CNOOC LTD	エネルギー	65,000	157.55	10,241,396	186.01	12,091,183	0.27
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3,200	3,843.72	12,299,924	3,515.36	11,249,152	0.26
インド	株式	TATA CONSULTANCY SVS LTD	ソフトウェア・サービス	3,414	2,841.31	9,700,244	3,215.30	10,977,041	0.25
ブラジル	株式	PETROLEO BRASILEIRO SA-PETROBRAS-PR	エネルギー	14,400	654.02	9,418,022	741.00	10,670,469	0.24
メキシコ	株式	AMERICA MOVIL SAB DE C.V.	電気通信サービス	123,300	100.25	12,361,742	78.37	9,663,231	0.22
中国	株式	CHINA PETROLEUM&CHEMICAL-H	エネルギー	94,000	89.26	8,390,871	95.62	8,988,365	0.20
ブラジル	株式	PETROLEO BRASILEIRO SA-PETROBRAS	エネルギー	10,900	704.88	7,683,248	819.90	8,936,954	0.20

ロ 種類別・業種別の投資比率

2018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	2.77
		素材	3.16
		資本財	1.53
		商業・専門サービス	0.07
		運輸	0.74
		自動車・自動車部品	1.19
		耐久消費財・アパレル	0.51
		消費者サービス	0.53
		メディア・娯楽	1.03
		小売	0.80
		食品・生活必需品小売り	0.75
		食品・飲料・タバコ	1.63
		家庭用品・パーソナル用品	0.55
		ヘルスケア機器・サービス	0.30
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	0.98
		銀行	7.57
		各種金融	1.24
		保険	1.72
		不動産	1.07
		ソフトウェア・サービス	5.97
テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.43		
電気通信サービス	2.01		
公益事業	1.17		
半導体・半導体製造装置	2.52		
投資信託受益証券			2.88
投資証券			0.25
合計			46.37

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）

2018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	1,055	639,383.14	674,549,212	707,000	745,885,000	7.63
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	1,089	587,952.41	640,280,174	627,000	682,803,000	6.98

日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	3,229	156,741.8	506,119,272	151,600	489,516,400	5.01
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	2,058	204,727.54	421,329,277	217,700	448,026,600	4.58
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	2,401	172,778.16	414,840,362	180,700	433,860,700	4.44
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	2,171	176,488.95	383,157,510	184,700	400,983,700	4.10
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	1,364	262,215.85	357,662,419	257,300	350,957,200	3.59
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	1,462	216,112.18	315,956,007	235,100	343,716,200	3.52
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	1,061	282,996.41	300,259,191	313,500	332,623,500	3.40
日本	投資証券	G L P 投資法人	2,697	113,174.95	305,232,840	114,200	307,997,400	3.15
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	690	398,710.84	275,110,479	443,500	306,015,000	3.13
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	337	695,297.67	234,315,314	745,000	251,065,000	2.57
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	3,155	83,113.52	262,223,155	79,000	249,245,000	2.55
日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人	522	488,421.37	254,955,955	477,000	248,994,000	2.55
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	362	508,633	184,125,146	551,000	199,462,000	2.04
日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人	2,808	71,759.5	201,500,676	69,900	196,279,200	2.01
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	3,811	46,892.11	178,705,831	47,100	179,498,100	1.84
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	251	687,000.93	172,437,233	702,000	176,202,000	1.80
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	1,248	140,140.77	174,895,680	140,600	175,468,800	1.79
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	370	443,558.6	164,116,682	441,500	163,355,000	1.67
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	718	212,611.07	152,654,748	226,600	162,698,800	1.66
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	973	144,438.62	140,538,777	155,600	151,398,800	1.55
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	880	166,449.27	146,475,357	166,000	146,080,000	1.49
日本	投資証券	イオンリート投資法人	1,118	120,287.11	134,480,988	126,900	141,874,200	1.45
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	1,268	116,548.8	147,783,878	111,000	140,748,000	1.44
日本	投資証券	日本リート投資法人	352	358,074.71	126,042,297	371,500	130,768,000	1.34
日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	779	161,503.27	125,811,047	164,600	128,223,400	1.31
日本	投資証券	プレミアム投資法人	1,035	113,175.49	117,136,632	122,900	127,201,500	1.30
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	728	152,534.66	111,045,232	167,300	121,794,400	1.25
日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	416	259,968.85	108,147,041	284,700	118,435,200	1.21

ロ 種類別の投資比率

2018年11月30日現在

種類	投資比率（％）
投資証券	98.61
合計	98.61

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）

2018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	11,752	20,523.31	241,190,044	20,946.56	246,163,997	4.96

アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	24,312	7,500.44	182,350,784	7,622.91	185,328,300	3.73
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	5,755	24,084.00	138,603,463	24,039.75	138,348,785	2.78
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	14,283	7,460.65	106,560,499	8,105.16	115,766,030	2.33
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	14,489	7,643.34	110,744,402	7,973.53	115,528,576	2.33
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,386	20,698.69	111,483,172	21,340.30	114,938,871	2.31
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD STAPLED	5,323	23,474.18	124,953,082	19,980.52	106,356,337	2.14
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	7,920	13,917.09	110,223,396	12,900.40	102,171,202	2.06
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	13,909	6,649.57	92,488,916	7,086.20	98,561,977	1.98
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	5,932	14,642.16	86,857,345	14,730.67	87,382,366	1.76
香港	投資証券	LINK REIT	78,100	1,109.04	86,616,744	1,094.77	85,502,279	1.72
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORPORATION	11,527	6,690.87	77,125,665	7,246.19	83,526,881	1.68
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,614	27,804.44	72,680,814	29,427.30	76,922,988	1.55
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	213,487	338.32	72,227,047	333.15	71,123,365	1.43
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	29,237	2,378.33	69,535,269	2,189.97	64,028,182	1.29
アメリカ	投資証券	HCP, INC.	18,218	3,031.91	55,235,489	3,267.93	59,535,258	1.20
アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	4,195	14,270.70	59,865,620	13,886.45	58,253,694	1.17
アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	6,695	8,638.69	57,836,054	8,008.71	53,618,331	1.08
オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	59,756	856.31	51,169,853	887.29	53,021,164	1.07
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	4,892	10,492.85	51,331,064	10,710.43	52,395,440	1.05
アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	4,408	11,747.54	51,783,196	11,598.90	51,127,966	1.03
アメリカ	投資証券	UDR INC	10,351	4,522.17	46,809,052	4,753.25	49,200,977	0.99
アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	13,816	3,198.19	44,186,218	3,185.10	44,005,382	0.89
アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	5,700	7,570.53	43,152,073	7,692.13	43,845,148	0.88
アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	6,148	7,418.11	45,606,557	7,128.18	43,824,084	0.88
アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	2,842	14,747.53	41,912,491	14,852.08	42,209,635	0.85
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	10,900	4,063.36	44,290,631	3,829.61	41,742,776	0.84
アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	3,488	11,502.84	40,121,939	11,664.71	40,686,529	0.82
オーストラリア	投資証券	DEXUS	42,837	872.46	37,373,861	899.75	38,542,865	0.78
アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	3,518	10,726.31	37,735,191	10,634.40	37,411,849	0.75

□ 種類別の投資比率

2018年11月30日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	99.07
合計	99.07

国内債券パッシブ・マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

2018年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313回利付国債(10年)	2,105,000,000	104.03	2,189,915,700	103.30	2,174,465,000	1.300	2021/3/20	1.14
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	2,030,000,000	104.60	2,123,380,000	104.18	2,114,854,000	0.800	2023/6/20	1.11
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	1,900,000,000	100.65	1,912,442,100	100.46	1,908,778,000	0.100	2028/3/20	1.00
日本	国債証券	第315回利付国債(10年)	1,800,000,000	104.10	1,873,908,000	103.39	1,861,128,000	1.200	2021/6/20	0.98
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	1,770,000,000	100.71	1,782,567,000	100.58	1,780,372,200	0.100	2027/12/20	0.93
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	1,681,000,000	100.95	1,696,969,500	100.97	1,697,406,560	0.100	2026/9/20	0.89
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	1,600,000,000	101.02	1,616,475,200	101.09	1,617,552,000	0.100	2026/3/20	0.85
日本	国債証券	第352回利付国債(10年)	1,600,000,000	100.07	1,601,199,000	100.14	1,602,320,000	0.100	2028/9/20	0.84
日本	国債証券	第59回利付国債(20年)	1,455,000,000	108.30	1,575,808,650	107.40	1,562,670,000	1.700	2022/12/20	0.82
日本	特殊債券	第103回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1,500,000,000	102.41	1,536,255,000	101.72	1,525,905,000	1.300	2020/3/19	0.80
日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	1,407,000,000	102.49	1,442,073,100	102.51	1,442,329,770	0.300	2025/12/20	0.76
日本	国債証券	第348回利付国債(10年)	1,405,000,000	100.43	1,411,041,500	100.70	1,414,863,100	0.100	2027/9/20	0.74
日本	国債証券	第325回利付国債(10年)	1,365,000,000	103.94	1,418,849,250	103.50	1,412,897,850	0.800	2022/9/20	0.74
日本	国債証券	第346回利付国債(10年)	1,400,000,000	100.83	1,411,620,000	100.87	1,412,194,000	0.100	2027/3/20	0.74
日本	国債証券	第345回利付国債(10年)	1,398,000,000	100.89	1,410,442,200	100.92	1,410,945,480	0.100	2026/12/20	0.74
日本	国債証券	第343回利付国債(10年)	1,350,000,000	100.99	1,363,460,600	101.05	1,364,296,500	0.100	2026/6/20	0.71
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	1,315,000,000	103.00	1,354,463,000	103.09	1,355,633,500	0.400	2025/6/20	0.71
日本	国債証券	第351回利付国債(10年)	1,350,000,000	100.05	1,350,805,700	100.28	1,353,834,000	0.100	2028/6/20	0.71
日本	国債証券	第330回利付国債(10年)	1,285,000,000	104.78	1,346,423,000	104.38	1,341,385,800	0.800	2023/9/20	0.70
日本	国債証券	第334回利付国債(10年)	1,265,000,000	104.11	1,317,004,150	103.87	1,314,006,100	0.600	2024/6/20	0.69
日本	国債証券	第335回利付国債(10年)	1,250,000,000	103.61	1,295,187,500	103.43	1,292,975,000	0.500	2024/9/20	0.68
日本	国債証券	第61回利付国債(20年)	1,215,000,000	105.34	1,279,917,450	104.81	1,273,441,500	1.000	2023/3/20	0.67
日本	特殊債券	第89回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1,251,000,000	101.79	1,273,467,960	101.09	1,264,748,490	1.300	2019/9/30	0.66
日本	国債証券	第128回利付国債(5年)	1,215,000,000	100.70	1,223,590,050	100.60	1,222,290,000	0.100	2021/6/20	0.64
日本	国債証券	第347回利付国債(10年)	1,170,000,000	100.76	1,178,892,000	100.76	1,178,985,600	0.100	2027/6/20	0.62
日本	国債証券	第154回利付国債(20年)	1,050,000,000	113.39	1,190,661,000	112.23	1,178,499,000	1.200	2035/9/20	0.62
日本	国債証券	第132回利付国債(20年)	970,000,000	119.96	1,163,679,900	118.61	1,150,604,300	1.700	2031/12/20	0.60
日本	国債証券	第69回利付国債(20年)	1,020,000,000	112.72	1,149,815,400	111.67	1,139,105,400	2.100	2024/3/20	0.60
日本	国債証券	第147回利付国債(20年)	960,000,000	119.68	1,148,995,200	118.28	1,135,574,400	1.600	2033/12/20	0.59
日本	国債証券	第64回利付国債(20年)	1,025,000,000	110.62	1,133,926,750	109.66	1,124,086,750	1.900	2023/9/20	0.59

ロ 種類別の投資比率

2018年11月30日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	73.33
地方債証券	9.55
特殊債券	12.51
社債券	4.03
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）

2018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 2.875	8,300,000	11,153.14	925,711,181	11,189.20	928,704,079	2.875	2028/8/15	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	7,000,000	11,415.08	799,055,740	11,029.63	772,074,702	2.375	2024/8/15	0.45
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3	5,000,000	14,798.32	739,916,346	14,389.82	719,491,407	3.000	2022/4/25	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	6,200,000	11,686.52	724,564,461	11,283.17	699,556,734	2.750	2023/11/15	0.41
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 2.75	4,500,000	15,714.28	707,142,781	15,436.65	694,649,462	2.750	2027/10/25	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	6,100,000	11,250.43	686,276,659	11,292.92	688,868,394	2.750	2023/8/31	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	6,300,000	11,324.83	713,464,790	10,933.01	688,779,746	2.250	2024/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	6,000,000	11,770.73	706,244,372	11,458.69	687,521,822	3.625	2020/2/15	0.40
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.5	3,300,000	21,276.30	702,117,937	20,607.48	680,046,988	4.500	2041/4/25	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	6,000,000	11,256.97	675,418,509	11,294.69	677,681,849	2.750	2023/4/30	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3	5,900,000	11,296.39	666,487,151	11,386.89	671,826,619	3.000	2025/9/30	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	6,200,000	11,127.59	689,910,828	10,656.42	660,698,581	2.250	2027/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	6,200,000	11,028.75	683,782,634	10,550.05	654,103,137	2.000	2026/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	6,000,000	11,363.84	681,830,596	10,815.99	648,959,755	2.375	2027/5/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	5,700,000	11,505.85	655,833,906	11,119.17	633,792,893	2.500	2024/5/15	0.37
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 2.25	4,300,000	14,623.01	628,789,692	14,507.90	623,840,036	2.250	2024/5/25	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	6,000,000	10,754.82	645,289,706	10,363.88	621,833,333	1.625	2026/2/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	5,500,000	11,563.30	635,981,620	11,304.00	621,720,304	2.625	2020/11/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.75	5,700,000	11,095.23	632,428,591	10,813.33	616,360,175	1.750	2023/5/15	0.36
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 5.75	2,900,000	21,657.41	628,064,936	20,965.98	608,013,615	5.750	2032/10/25	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	5,500,000	11,249.48	618,721,769	10,955.17	602,534,564	2.000	2023/2/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	5,600,000	11,125.73	623,041,076	10,744.19	601,674,675	2.000	2025/2/15	0.35

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	5,500,000	11,291.39	621,026,984	10,842.59	596,342,475	2.250	2025/11/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	5,000,000	13,384.14	669,207,055	11,925.87	596,293,718	3.625	2044/2/15	0.35
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.25	3,800,000	16,237.89	617,039,861	15,686.89	596,102,038	4.250	2023/10/25	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.5	5,800,000	10,598.09	614,689,684	10,199.00	591,542,161	1.500	2026/8/15	0.35
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 1.75	4,100,000	14,205.01	582,405,703	14,198.75	582,149,002	1.750	2024/11/25	0.34
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.75	2,900,000	20,570.92	596,556,788	19,948.61	578,509,849	4.750	2035/4/25	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	5,000,000	11,915.23	595,761,827	11,542.02	577,101,328	3.625	2021/2/15	0.34
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 5.5	3,000,000	19,811.54	594,346,347	19,185.74	575,572,456	5.500	2029/4/25	0.34

ロ 種類別の投資比率

2018年11月30日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	98.92
合計	98.92

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）

2018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	3,000,000	11,173.24	335,197,471	11,154.63	334,638,988	2.000	2021/1/15	0.74
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	2,500,000	10,811.38	270,284,654	10,802.69	270,067,464	2.125	2025/5/15	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	2,300,000	11,164.38	256,780,836	11,143.10	256,291,497	2.000	2021/2/28	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.375	2,300,000	11,129.81	255,985,662	11,135.13	256,107,996	1.375	2020/3/31	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	2,300,000	11,020.77	253,477,796	10,979.10	252,519,507	2.000	2022/11/30	0.56
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 0.75	1,900,000	13,003.55	247,067,607	13,058.91	248,119,343	0.750	2028/5/25	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	2,200,000	10,818.65	238,010,417	10,744.19	236,372,194	2.000	2025/2/15	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.875	2,100,000	11,195.26	235,100,649	11,189.20	234,973,321	2.875	2028/8/15	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	2,000,000	11,519.86	230,397,291	11,458.69	229,173,941	3.625	2020/2/15	0.51
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.25	1,400,000	15,829.26	221,609,683	15,686.89	219,616,540	4.250	2023/10/25	0.49
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	1,800,000	11,340.79	204,134,303	11,304.00	203,472,099	2.625	2020/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	1,900,000	10,671.49	202,758,479	10,550.05	200,450,961	2.000	2026/11/15	0.44
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.75	1,400,000	14,368.64	201,160,974	14,232.34	199,252,838	3.750	2021/4/25	0.44
イタリア	国債証券	BTPS 0.7	1,500,000	12,810.48	192,157,206	12,934.76	194,021,418	0.700	2020/5/1	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.5	1,800,000	10,760.14	193,682,652	10,725.57	193,060,341	1.500	2023/2/28	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	1,700,000	11,162.49	189,762,462	11,210.48	190,578,183	2.750	2025/8/31	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.5	1,700,000	11,129.81	189,206,793	11,128.92	189,191,722	1.500	2020/5/31	0.42

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	1,800,000	10,450.76	188,113,757	10,363.88	186,549,999	1.625	2026/2/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	1,800,000	10,422.39	187,603,143	10,326.65	185,879,817	1.625	2026/5/15	0.41
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 2.75	1,200,000	15,520.49	186,245,989	15,436.65	185,239,857	2.750	2027/10/25	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	1,700,000	10,830.17	184,113,054	10,679.47	181,551,114	2.250	2027/8/15	0.40
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.75	900,000	20,226.11	182,035,040	19,948.61	179,537,539	4.750	2035/4/25	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.875	1,600,000	11,359.88	181,758,108	11,195.41	179,126,579	2.875	2028/5/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.875	1,600,000	11,009.24	176,147,992	10,976.44	175,623,193	1.875	2022/5/31	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	1,600,000	10,855.00	173,680,018	10,823.97	173,183,587	1.625	2022/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	1,600,000	10,958.71	175,339,518	10,815.99	173,055,934	2.375	2027/5/15	0.38
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3	1,200,000	14,493.82	173,925,913	14,389.82	172,677,938	3.000	2022/4/25	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.375	1,500,000	11,461.35	171,920,348	11,415.25	171,228,890	3.375	2019/11/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	1,500,000	11,366.40	170,496,050	11,319.51	169,792,785	2.750	2021/8/15	0.38
ドイツ	国債証券	DEUTSCHLAND REP 0.25	1,300,000	13,012.01	169,156,217	13,042.37	169,550,893	0.250	2027/2/15	0.38

ロ 種類別の投資比率

2018年11月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	98.38
合計	98.38

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）

2018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	292	日本円	4,738,480,360	4,870,560,000	2.80

（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

2018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 1812	買建	311	米ドル	42,677,645.5	4,842,632,434	42,672,310	4,842,027,015	2.77
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	DJ EUR 1812	買建	281	ユーロ	8,993,122	1,161,821,430	8,913,320	1,151,511,810	0.66
	オース トラリ ア	シドニー先 物取引所	SPI200 1812	買建	25	オースト ラリアドル	3,670,787.5	304,969,026	3,591,250	298,361,050	0.17
	イギリ ス	ロンドン国 際金融先物 オプション 取引所	FTSE 1812	買建	43	英ポンド	3,030,581	439,464,550	3,034,940	440,096,649	0.25

（注）主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

2018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	500,000.00	56,795,000	56,715,000	0.03
	ユーロ	買建	210,000.00	27,111,000	27,127,800	0.01
	スイスフラン	買建	40,000.00	4,573,600	4,556,000	0.00
	スウェーデンクローナ	買建	90,000.00	1,130,400	1,125,900	0.00
	デンマーククローネ	買建	90,000.00	1,557,000	1,557,900	0.00
	香港ドル	買建	150,000.00	2,176,650	2,175,000	0.00

シンガポールドル	買建	20,000.00	1,653,800	1,657,200	0.00
イスラエルシェケル	買建	50,000.00	1,524,490	1,529,500	0.00
カナダドル	売建	40,000.00	3,420,400	3,416,000	0.00
英ポンド	売建	190,000.00	27,673,500	27,548,100	0.01
ノルウェークローネ	売建	50,000.00	663,500	663,500	0.00
オーストラリアドル	売建	50,000.00	4,145,000	4,153,000	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

2018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 1812	買建	415	米ドル	21,077,915	2,391,711,015	20,795,650	2,359,682,405	53.60

(注) 主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

2018年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	17,897,491.80	1,981,769,593	2,028,501,768	46.08
	米ドル	売建	2,536,243.75	284,000,000	287,457,865	6.53
	メキシコペソ	売建	12,427.65	69,593	69,593	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。

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

2018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	70,528.70	8,000,000	8,000,070	0.16

(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

2018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	179,500,000.00	20,212,207,050	20,348,120,000	45.16
	カナダドル	売建	10,500,000.00	899,811,630	896,280,000	1.98
	メキシコペソ	売建	64,100,000.00	353,421,631	358,319,000	0.79
	ユーロ	売建	135,400,000.00	17,326,177,660	17,489,618,000	38.82
	英ポンド	売建	20,500,000.00	2,971,735,592	2,971,270,000	6.59
	スウェーデンクローナ	売建	12,900,000.00	159,335,382	161,379,000	0.35
	ノルウェークローネ	売建	7,900,000.00	105,862,212	104,833,000	0.23
	デンマーククローネ	売建	15,900,000.00	272,857,215	275,229,000	0.61
	ポーランドズロチ	売建	8,800,000.00	258,752,208	264,968,000	0.58
	オーストラリアドル	売建	11,400,000.00	913,729,600	946,314,000	2.10
	シンガポールドル	売建	4,700,000.00	382,779,280	389,254,000	0.86
	南アフリカランド	売建	31,600,000.00	240,307,572	261,648,000	0.58

(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:2018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
2018年4月	0円
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
2018年4月	0円
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
2018年4月	0円
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

■アセットアロケーション・ファンド(安定型)

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	85.00
投資信託受益証券	アメリカ	13.71
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.29
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券/パッシブ・マザーファンド	53.07
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	19.54
アメリカ	投資信託受益証券	SPDR ブルームバーグ・パークレイズ・ハイ・イールド債券ETF	7.18
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)	4.88
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	4.63
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	4.57
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	1.96
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	1.49
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	0.47
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	0.46

■アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	75.73
投資信託受益証券	アメリカ	22.87
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.40
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券/パッシブ・マザーファンド	41.92
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)	10.29
アメリカ	投資信託受益証券	SPDR ブルームバーグ・パークレイズ・ハイ・イールド債券ETF	9.54
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	8.14
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	7.45
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	5.87
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	4.68
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	4.23
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	3.99
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	2.03

■アセットアロケーション・ファンド(成長型)

資産別構成

資産の種類	国・地域	比率(%)
親投資信託受益証券	日本	69.68
投資信託受益証券	アメリカ	29.08
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1.24
合計(純資産総額)		100.00

主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券/パッシブ・マザーファンド	25.96
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)	13.70
アメリカ	投資信託受益証券	SPDR ブルームバーグ・パークレイズ・ハイ・イールド債券ETF	10.71
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	10.53
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	9.80
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	7.83
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	5.51
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	5.12
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	4.82
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	4.31

※比率は、各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。

▶ 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313回利付国債(10年)	1.300	2021/03/20	1.14
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	0.800	2023/06/20	1.11
日本	国債証券	第350回利付国債(10年)	0.100	2028/03/20	1.00
日本	国債証券	第315回利付国債(10年)	1.200	2021/06/20	0.98
日本	国債証券	第349回利付国債(10年)	0.100	2027/12/20	0.93
日本	国債証券	第344回利付国債(10年)	0.100	2026/09/20	0.89
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	0.100	2026/03/20	0.85
日本	国債証券	第352回利付国債(10年)	0.100	2028/09/20	0.84
日本	国債証券	第59回利付国債(20年)	1.700	2022/12/20	0.82
日本	特殊債券	第103回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.300	2020/03/19	0.80

■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 2.875	2.875	2028/08/15	0.54
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	2.375	2024/08/15	0.45
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3	3.000	2022/04/25	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	2.750	2023/11/15	0.41
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 2.75	2.750	2027/10/25	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	2.750	2023/08/31	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	2.250	2024/11/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	3.625	2020/02/15	0.40
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.5	4.500	2041/04/25	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	2.750	2023/04/30	0.40

■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	2.000	2021/01/15	0.74
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	2.125	2025/05/15	0.60
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	2.000	2021/02/28	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.375	1.375	2020/03/31	0.57
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	2.000	2022/11/30	0.56
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 0.75	0.750	2028/05/25	0.55
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	2.000	2025/02/15	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.875	2.875	2028/08/15	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	3.625	2020/02/15	0.51
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.25	4.250	2023/10/25	0.49

※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(%)
オランダ	政府機関債	Petrobras Global Finance BV 5.999 01/27/2028	5.999	2028/01/27	0.49
メキシコ	政府機関債	Petroleos Mexicanos 6.75 09/21/2047	6.750	2047/09/21	0.48
カタール	国債証券	State of Qatar 5.103 04/23/2048	5.103	2048/04/23	0.47
メキシコ	政府機関債	Petroleos Mexicanos 6.5 03/13/2027	6.500	2027/03/13	0.45
アルゼンチン	国債証券	Argentine Republic 7.5 04/22/2026	7.500	2026/04/22	0.45
ロシア連邦	国債証券	Russia-Eurobond 4.875 09/16/2023	4.875	2023/09/16	0.44
メキシコ	国債証券	United Mexican States 4.75 03/08/2044	4.750	2044/03/08	0.42
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	0.42
パナマ共和国(パナマ)	政府機関債	Sinopec Group Overseas Development 2015 Ltd. 25 04/28/2020	2.500	2020/04/28	0.42
コロンビア	国債証券	Republic of Colombia 5.0 06/15/2045	5.000	2045/06/15	0.41

※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」の公開情報を基に委託会社作成
※国・地域は発行国基準です。

■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

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	0.86
ポーランド	国債証券	POLAND (REPUBLIC OF) 5% 3/23/2022	5.000	2022/03/23	0.82
ロシア連邦	国債証券	RUSSIAN FEDERATION RegS 5.25% 6/23/2047	5.250	2047/06/23	0.77
ペルー	国債証券	PERU (REPUBLIC OF) 8.75% 11/21/2033	8.750	2033/11/21	0.74
ペルー	国債証券	PERU (REPUBLIC OF) 5.63% 11/18/2050	5.630	2050/11/18	0.67
コロンビア	国債証券	COLOMBIA REPUBLIC OF (GOVERNMENT) 5% 6/15/2045	5.000	2045/06/15	0.65
パナマ共和国(パナマ)	政府機関債	1MDB GLOBAL INVESTMENTS LTD RegS 4.4% 3/9/2023	4.400	2023/03/09	0.63
カザフスタン	国債証券	KAZAKHSTAN (REPUBLIC OF) MTN RegS 5.13% 07/21/2025	5.130	2025/07/21	0.62
ハンガリー	国債証券	HUNGARY (REPUBLIC OF) 6.38% 3/29/2021	6.380	2021/03/29	0.62
イラク	国債証券	IRAQ (REPUBLIC OF) RegS 5.8% 01/15/2028	5.800	2028/01/15	0.59

※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。

※「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」の公開情報を基に委託会社作成
※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(%)
アメリカ	投資信託	STATE ST INST US GOV MM-G	—	—	0.84
フランス	社債券	ALTICE FRANCE SA 7.375 05/01/2026	7.375	2016/05/01	0.72
アメリカ	社債券	SPRINT CORP 7.875 09/15/2023	7.875	2023/09/15	0.65
アメリカ	社債券	FIRST DATA CORPORATION 7 12/01/2023	7.000	2023/12/01	0.55
アメリカ	社債券	CCO HLDGS LLC/CAP CORP 5.125 05/01/2027	5.125	2027/05/01	0.44
アメリカ	社債券	CHS/COMMUNITY HEALTH SYS 6.25 03/31/2023	6.250	2023/03/31	0.40
アメリカ	社債券	PRIME SECSRVC BRW/FINANC 9.25 05/15/2023	9.250	2023/05/15	0.39
ルクセンブルグ	社債券	INTELSAT JACKSON HLDG 8.5 10/15/2024	8.500	2024/10/15	0.39
ルクセンブルグ	社債券	ALTICE LUXEMBOURG SA 7.75 05/15/2022	7.750	2022/05/15	0.38
アメリカ	社債券	HCA INC 5.375 02/01/2025	5.375	2025/02/01	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。

※「SPDR ブルームバーグ・パークレイズ・ハイ・イールド債券ETF」の公開情報を基に委託会社作成
※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	3.12
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.76
日本	株式	ソニー	電気機器	1.64
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.61
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1.29
日本	株式	キーエンス	電気機器	1.24
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.20
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1.11
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	1.04
日本	株式	KDDI	情報・通信業	0.95

※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(2.80%)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	2.17
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	1.87
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	1.06
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	1.01
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	0.92
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	0.90
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	0.90
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	0.88
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	0.75

※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(3.85%)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	業種	比率(%)
ケイマン諸島	株式	TENCENT HOLDINGS LIMITED	ソフトウェア・サービス	2.15
韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1.78
アメリカ	投資信託受益証券	ISHARES MSCI RUSSIA ETF	—	1.76
台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	半導体・半導体製造装置	1.72
ケイマン諸島	株式	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	ソフトウェア・サービス	1.71
南アフリカ	株式	NASPERS LIMITED-N SHS	メディア・娯楽	0.87
中国	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	0.78
香港	株式	CHINA MOBILE LTD	電気通信サービス	0.58
中国	株式	PING AN INSURANCE (GROUP) CO OF CHINA LT	保険	0.49
ケイマン諸島	株式	BAIDU INC - SPON ADR	ソフトウェア・サービス	0.48

※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(53.60%)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。

■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	7.63
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	6.98
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	5.01
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	4.58
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	4.44
日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	4.10
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	3.59
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	3.52
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	3.40
日本	投資証券	GLP投資法人	3.15

■外国リート・インデックス・マザーファンド

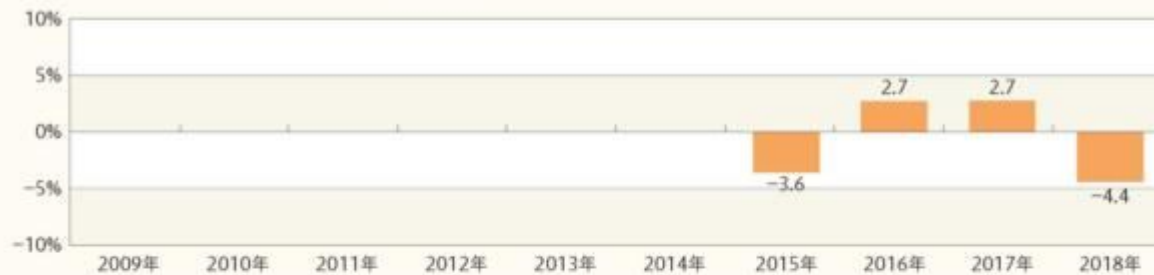
主要投資銘柄(上位10銘柄)

国・地域	種類	銘柄名	比率(%)
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	4.96
アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	3.73
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	2.78
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	2.33
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	2.33
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	2.31
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD STAPLED	2.14
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	2.06
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	1.98
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	1.76

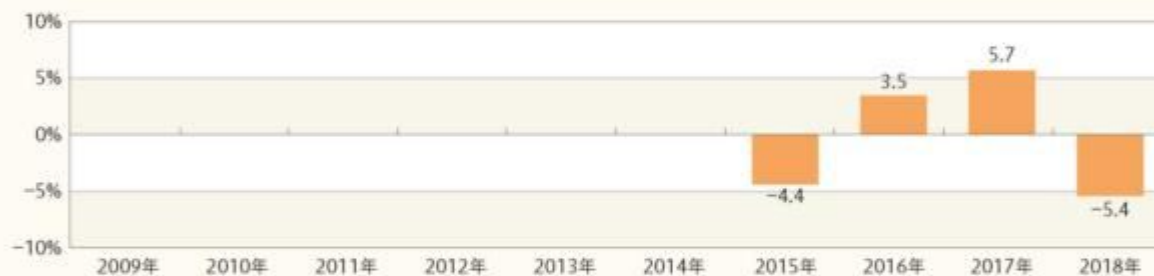
※比率は、各マザーファンドのそれぞれの純資産総額に対する時価の比率です。

年間収益率の推移(暦年ベース)

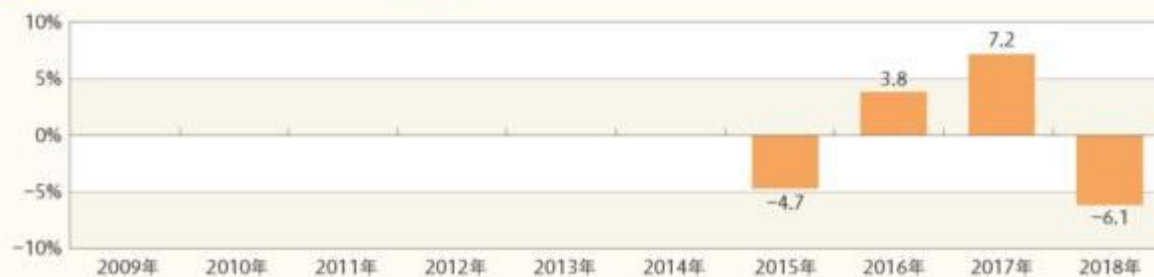
■アセットアロケーション・ファンド(安定型)



■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。

※2018年のファンドの収益率は、年初から2018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時までには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、当ファンドの知れ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、知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れ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にあっても、相手方となる他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、併合を行うことはできません。

二 反対受益者の受益権買取請求の不適用

当ファンドは、受益者が一部解約の実行の請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支

払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約または重大な信託約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権の買取請求の規定の適用を受けません。

ホ 販売会社との契約の更改等

委託会社と販売会社との間で締結される販売契約(名称の如何を問わず、ファンドの募集・販売の取扱い、受益者からの一部解約実行請求の受け付け、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、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、)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。

八 一部解約実行請求権

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

二 書面決議における議決権

委託会社が、当ファンドの解約(監督官庁の命令による解約等の場合を除きます。)または、重大な信託約款の変更等を行おうとする場合において、受益者は、それぞれの書面決議手続きにおいて、受益権の口数に応じて議決権を有しこれを行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3期（平成29年 4月27日から平成30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2期 （平成29年 4月26日現在）	第3期 （平成30年 4月26日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	898,961	214,604,008
金銭信託	457,066,030	862,565,153
コール・ローン	950,988,014	131,303,003
投資信託受益証券	7,765,746,256	4,480,324,018
親投資信託受益証券	39,631,886,119	25,611,713,868
派生商品評価勘定	10,430,730	744,410
未収入金	946,607,084	295,133,727
流動資産合計	49,763,623,194	31,596,388,187
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	4,054,641	94,458,992
未払金	546,000,000	213,118,060
未払解約金	454,404,320	363,542,225
未払受託者報酬	6,593,091	5,806,263
未払委託者報酬	199,292,372	174,187,710
未払利息	2,758	384
その他未払費用	1,338,285	1,221,331
流動負債合計	1,211,685,467	852,334,965
負債合計		
	1,211,685,467	852,334,965
純資産の部		
元本等		
元本	48,593,117,939	31,323,831,015
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	41,180,212	579,777,793
元本等合計	48,551,937,727	30,744,053,222
純資産合計		
	48,551,937,727	30,744,053,222
負債純資産合計		
	49,763,623,194	31,596,388,187

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第2期		第3期	
	自	平成28年 4月27日 至 平成29年 4月26日	自	平成29年 4月27日 至 平成30年 4月26日
営業収益				
受取配当金		302,735,983		258,954,330
有価証券売買等損益		1,541,854,874		202,105,693
為替差損益		3,940,173		110,744,563
営業収益合計		1,848,531,030		53,895,926
営業費用				
支払利息		479,933		742,598
受託者報酬		9,736,311		12,798,604
委託者報酬		294,636,585		383,957,853
その他費用		3,135,127		3,745,111
営業費用合計		307,987,956		401,244,166
営業利益又は営業損失()		1,540,543,074		455,140,092
経常利益又は経常損失()		1,540,543,074		455,140,092
当期純利益又は当期純損失()		1,540,543,074		455,140,092
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()		97,661,177		122,608,032
期首剰余金又は期首欠損金()		681,942,051		41,180,212
剰余金増加額又は欠損金減少額		173,657,907		39,150,543
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		173,657,907		8,878,312
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		30,272,231
剰余金減少額又は欠損金増加額		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		975,777,965		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金()		41,180,212		579,777,793

（ 3 ）【注記表】

（ 重要な会計方針の注記 ）

項 目	第3期	
	自 平成29年 4月27日 至 平成30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2期		第3期	
	（平成29年 4月26日現在）		（平成30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	48,593,117,939口		31,323,831,015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	41,180,212円	元本の欠損	579,777,793円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	0.9992円	1口当たり純資産額	0.9815円
	(10,000口当たりの純資産額)	9,992円	(10,000口当たりの純資産額)	9,815円

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項 目	第2期	第3期
	自 平成28年 4月27日 至 平成29年 4月26日	自 平成29年 4月27日 至 平成30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（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（376,125,260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（327,209,511円）、および分配準備積立金（762,631,532円）より、分配対象収益は1,465,966,303円（1万口当たり467.98円）ですが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

．金融商品の状況に関する事項

項 目	第3期
	自 平成29年 4月27日 至 平成30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3期 自 平成29年 4月27日 至 平成30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3期 (平成30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

第3期（自 平成29年 4月27日 至 平成30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	163,408,565円
親投資信託受益証券	20,067,592円
合計	183,476,157円

（デリバティブ取引に関する注記）

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

第3期（平成30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	39,900,310	-	40,644,720	744,410
	米ドル	39,900,310	-	40,644,720	744,410
	売建	4,323,247,209	-	4,417,706,201	94,458,992
	米ドル	4,323,247,209	-	4,417,706,201	94,458,992

合計	4,363,147,519	-	4,458,350,921	93,714,582
----	---------------	---	---------------	------------

(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3期 自 平成29年 4月27日 至 平成30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2期	第3期
	(平成29年 4月26日現在)	(平成30年 4月26日現在)
期首元本額	14,040,607,518円	48,593,117,939円
期中追加設定元本額	39,440,607,065円	3,005,688,776円
期中一部解約元本額	4,888,096,644円	20,274,975,700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	140,415	15,489,178.65	
		SPDR ブルームバーグ・バークレイズ・ハイ・イールド債券ETF	560,320	20,042,646.40	
		バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF	70,276	5,410,549.24	
	米ドル 小計		771,011	40,942,374.29 (4,480,324,018)	
投資信託受益証券合計				4,480,324,018 (4,480,324,018)	
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）	496,212,971	1,351,733,754	
		外国株式インデックス・マザーファンド	464,151,919	1,552,541,753	
		ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	11,612,319,177	15,932,101,910	
		外国債券パッシブ・マザーファンド	76,402,108	133,229,995	
		国内債券パッシブ・マザーファンド	4,525,451,502	5,704,331,618	
		Jリート・インデックス・マザーファンド	278,763,514	548,829,606	
		外国リート・インデックス・マザーファンド	158,048,622	292,500,584	
		エマージング株式インデックス・マザーファンド	68,332,612	96,444,648	
親投資信託受益証券合計			17,679,682,425	25,611,713,868	
合計				30,092,037,886 (4,480,324,018)	

（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	14.6%	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2期 （平成29年 4月26日現在）	第3期 （平成30年 4月26日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	861,955	145,649,567
金銭信託	329,533,628	607,385,019
コール・ローン	685,639,516	92,458,496
投資信託受益証券	8,432,441,682	4,766,641,797
親投資信託受益証券	23,024,760,829	14,869,556,265
派生商品評価勘定	12,985,359	1,171,913
未収入金	775,003,431	195,037,682
流動資産合計	33,261,226,400	20,677,900,739
資産合計		
33,261,226,400		
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	4,267,647	102,305,417
未払金	556,000,000	137,002,501
未払解約金	317,515,995	293,992,971
未払受託者報酬	4,501,157	3,843,861
未払委託者報酬	136,067,059	115,315,793
未払利息	1,988	271
その他未払費用	914,756	811,760
流動負債合計	1,019,268,602	653,272,574
負債合計		
1,019,268,602		
純資産の部		
元本等		
元本	32,112,350,663	19,984,561,437
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	129,607,135	40,066,728
元本等合計	32,241,957,798	20,024,628,165
純資産合計		
32,241,957,798		
負債純資産合計		
33,261,226,400		

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期		第3期	
	自	平成28年 4月27日 至 平成29年 4月26日	自	平成29年 4月27日 至 平成30年 4月26日
営業収益				
受取配当金		325,338,002		279,952,765
有価証券売買等損益		1,757,316,328		292,211,519
為替差損益		63,902,844		116,786,923
営業収益合計		2,018,751,486		455,377,361
営業費用				
支払利息		352,434		492,460
受託者報酬		7,032,474		8,529,334
委託者報酬		212,850,211		255,879,985
その他費用		2,656,195		2,954,847
営業費用合計		222,891,314		267,856,626
営業利益又は営業損失（ ）		1,795,860,172		187,520,735
経常利益又は経常損失（ ）		1,795,860,172		187,520,735
当期純利益又は当期純損失（ ）		1,795,860,172		187,520,735
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（ ）		141,394,865		263,150,239
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		937,888,984		129,607,135
剰余金増加額又は欠損金減少額		203,570,922		54,423,777
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		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		-		54,423,777
剰余金減少額又は欠損金増加額		790,540,110		68,334,680
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		68,334,680
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		790,540,110		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		129,607,135		40,066,728

(3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第3期	
	自 平成29年 4月27日 至 平成30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2期		第3期	
	(平成29年 4月26日現在)		(平成30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	32,112,350,663口		19,984,561,437口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.0040円	1口当たり純資産額	1.0020円
	(10,000口当たりの純資産額)	10,040円	(10,000口当たりの純資産額)	10,020円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第2期	第3期
	自 平成28年 4月27日 至 平成29年 4月26日	自 平成29年 4月27日 至 平成30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（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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（301,470,230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（272,634,700円）、および分配準備積立金（738,228,286円）より、分配対象収益は1,312,333,216円（1万口当たり656.66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3期
	自 平成29年 4月27日 至 平成30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3期 自 平成29年 4月27日 至 平成30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3期 (平成30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

第3期（自 平成29年 4月27日 至 平成30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	178,930,678円
親投資信託受益証券	174,530,298円
合計	4,400,380円

（デリバティブ取引に関する注記）

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

第3期（平成30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	57,282,187	-	58,454,100	1,171,913
	米ドル	57,282,187	-	58,454,100	1,171,913
	売建	4,632,596,247	-	4,734,901,664	102,305,417
	米ドル	4,632,596,247	-	4,734,901,664	102,305,417

合計	4,689,878,434	-	4,793,355,764	101,133,504
----	---------------	---	---------------	-------------

(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3期 自 平成29年 4月27日 至 平成30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2期	第3期
	(平成29年 4月26日現在)	(平成30年 4月26日現在)
期首元本額	13,328,989,150円	32,112,350,663円
期中追加設定元本額	22,569,690,166円	1,994,684,295円
期中一部解約元本額	3,786,328,653円	14,122,473,521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	140,034	15,447,150.54	
		SPDR ブルームバーグ・バークレイズ・ハイ・イールド債券ETF	486,759	17,411,369.43	
		バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF	138,983	10,700,301.17	
	米ドル 小計		765,776	43,558,821.14 (4,766,641,797)	
投資信託受益証券合計				4,766,641,797 (4,766,641,797)	
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）	726,003,004	1,977,704,783	
		外国株式インデックス・マザーファンド	509,991,846	1,705,871,725	
		ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	5,981,900,100	8,207,166,937	
		外国債券パッシブ・マザーファンド	232,152,798	404,828,049	
		国内債券パッシブ・マザーファンド	592,212,196	746,483,473	
		Jリート・インデックス・マザーファンド	431,657,987	849,848,244	
		外国リート・インデックス・マザーファンド	101,106,811	187,118,375	
		エマージング株式インデックス・マザーファンド	560,106,759	790,534,679	
親投資信託受益証券合計			9,135,131,501	14,869,556,265	
合計				19,636,198,062 (4,766,641,797)	

（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	23.8%	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2期 （平成29年 4月26日現在）	第3期 （平成30年 4月26日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	1,297,860	118,199,908
金銭信託	306,879,503	396,394,375
コール・ローン	638,504,526	60,340,685
投資信託受益証券	8,794,885,399	4,437,304,646
親投資信託受益証券	17,548,426,415	10,059,087,760
派生商品評価勘定	18,973,263	1,438,664
未収入金	882,390,299	187,418,452
流動資産合計	28,191,357,265	15,260,184,490
資産合計		
28,191,357,265		
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	5,841,012	96,587,537
未払金	458,800,000	101,484,791
未払解約金	553,126,368	196,356,285
未払受託者報酬	4,146,248	2,852,184
未払委託者報酬	125,357,141	85,565,606
未払利息	1,852	176
その他未払費用	845,468	602,453
流動負債合計	1,148,118,089	483,449,032
負債合計		
1,148,118,089		
純資産の部		
元本等		
元本	26,858,575,783	14,615,040,087
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	184,663,393	161,695,371
元本等合計	27,043,239,176	14,776,735,458
純資産合計		
27,043,239,176		
負債純資産合計		
28,191,357,265		

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期		第3期	
	自	平成28年 4月27日 至 平成29年 4月26日	自	平成29年 4月27日 至 平成30年 4月26日
営業収益				
受取配当金		288,992,975		270,231,330
有価証券売買等損益		2,105,764,120		413,197,959
為替差損益		54,451,344		117,498,241
営業収益合計		2,340,305,751		565,931,048
営業費用				
支払利息		325,567		393,068
受託者報酬		6,658,861		6,554,552
委託者報酬		201,573,152		196,636,545
その他費用		2,493,855		2,563,494
営業費用合計		211,051,435		206,147,659
営業利益又は営業損失（ ）		2,129,254,316		359,783,389
経常利益又は経常損失（ ）		2,129,254,316		359,783,389
当期純利益又は当期純損失（ ）		2,129,254,316		359,783,389
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（ ）		310,636,910		339,336,659
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,148,788,338		184,663,393
剰余金増加額又は欠損金減少額		412,959,525		72,710,062
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		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		-		72,710,062
剰余金減少額又は欠損金増加額		898,125,200		116,124,814
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		116,124,814
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		898,125,200		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		184,663,393		161,695,371

(3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第3期	
	自 平成29年 4月27日 至 平成30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2期		第3期	
	(平成29年 4月26日現在)		(平成30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	26,858,575,783口		14,615,040,087口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.0069円	1口当たり純資産額	1.0111円
	(10,000口当たりの純資産額)	10,069円)	(10,000口当たりの純資産額)	10,111円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第2期	第3期
	自 平成28年 4月27日 至 平成29年 4月26日	自 平成29年 4月27日 至 平成30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（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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（227,790,996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（226,675,913円）、および分配準備積立金（688,188,081円）より、分配対象収益は1,142,654,990円（1万口当たり781.81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3期
	自 平成29年 4月27日 至 平成30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3期 自 平成29年 4月27日 至 平成30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3期 (平成30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

第3期（自 平成29年 4月27日 至 平成30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	167,031,391円
親投資信託受益証券	227,572,700円
合計	60,541,309円

（デリバティブ取引に関する注記）

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

第3期（平成30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	69,471,076	-	70,909,740	1,438,664
	米ドル	69,471,076	-	70,909,740	1,438,664
	売建	4,351,783,348	-	4,448,370,885	96,587,537
	米ドル	4,351,783,348	-	4,448,370,885	96,587,537

合計	4,421,254,424	-	4,519,280,625	95,148,873
----	---------------	---	---------------	------------

(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3期 自 平成29年 4月27日 至 平成30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2期	第3期
	(平成29年 4月26日現在)	(平成30年 4月26日現在)
期首元本額	13,657,972,258円	26,858,575,783円
期中追加設定元本額	19,324,709,567円	2,148,349,345円
期中一部解約元本額	6,124,106,042円	14,391,885,041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	140,956	15,548,856.36	
		SPDR ブルームバーグ・バークレイズ・ハイ・イールド債券ETF	404,116	14,455,229.32	
		バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF	136,968	10,545,166.32	
	米ドル 小計		682,040	40,549,252.00 (4,437,304,646)	
投資信託受益証券合計				4,437,304,646 (4,437,304,646)	
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）	720,204,682	1,961,909,574	
		外国株式インデックス・マザーファンド	447,374,259	1,496,422,158	
		ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	2,690,389,470	3,691,214,352	
		外国債券パッシブ・マザーファンド	367,591,210	641,005,551	
		国内債券パッシブ・マザーファンド	532,706,643	671,476,723	
		Jリート・インデックス・マザーファンド	382,042,477	752,165,228	
		外国リート・インデックス・マザーファンド	72,762,326	134,661,236	
		エマージング株式インデックス・マザーファンド	503,211,661	710,232,938	
親投資信託受益証券合計			5,716,282,728	10,059,087,760	
合計				14,496,392,406 (4,437,304,646)	

（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	30.0%	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。

（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29年 4月26日現在）	（平成30年 4月26日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	663,157,244	1,454,346,918
コール・ローン	1,379,788,804	221,386,312
株式	201,459,449,040	179,158,324,620
派生商品評価勘定	21,258,040	106,239,600
未収入金	201,000,000	2,416,189,377
未収配当金	1,893,108,381	1,671,275,900
差入委託証拠金	53,020,000	-
流動資産合計	205,670,781,509	185,027,762,727
資産合計	205,670,781,509	185,027,762,727
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	10,689,480	-
前受金	10,750,000	106,380,000
未払金	10,603,200	392,589,700
未払解約金	831,780,740	438,216,960
未払利息	4,002	648
その他未払費用	55,629	216,792
流動負債合計	863,883,051	937,404,100
負債合計	863,883,051	937,404,100
純資産の部		
元本等		
元本	88,558,263,766	67,579,087,442
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	116,248,634,692	116,511,271,185
元本等合計	204,806,898,458	184,090,358,627
純資産合計	204,806,898,458	184,090,358,627
負債純資産合計	205,670,781,509	185,027,762,727

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30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29年 4月26日現在）	（平成30年 4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 3,077,000,000円</p>	<p>代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>株式 2,867,600,000円</p>
2. 当計算期間の末日における受益権の総数	88,558,263,766口	67,579,087,442口
3. 1単位当たり純資産の額	<p>1口当たり純資産額 2.3127円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 23,127円)</p>	<p>1口当たり純資産額 2.7241円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 27,241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29年 4月27日 至 平成30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、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成30年 4月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 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

（平成30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	4,207,010,400	-	4,313,250,000	106,239,600
東証株価指数先物	4,207,010,400	-	4,313,250,000	106,239,600
合計	4,207,010,400	-	4,313,250,000	106,239,600

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 平成29年 4月27日

至 平成30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(T O P I X)	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
SMAM・世界バランスファンドVA〈適格機関投資家限定〉	2,280,387,276円
SMAM・世界バランスファンドVA2〈適格機関投資家限定〉	1,271,327,298円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA〈適格機関投資家限定〉	21,880円
SMAM・FGグローバルバランス25VA〈適格機関投資家限定〉	24,630円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド〈適格機関投資家限定〉	227,744円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04〈適格機関投資家限定〉	115,594,073円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-05〈適格機関投資家限定〉	55,350,457円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン〈適格機関投資家限定〉	73,118,668円
合計	88,558,263,766円

（平成30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	88,558,263,766円
同期中における追加設定元本額	9,688,625,992円
同期中における一部解約元本額	30,667,802,316円
平成30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	10,000,363,906円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	656,170,114円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	3,169,289,242円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	2,344,599,102円
S M A M ・ グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	98,967,258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）	6,694,581円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025（4資産タイプ）	22,118,808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）	54,658,747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）	66,139,864円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040（4資産タイプ）	37,344,477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）	102,465,695円
国内株式指数ファンド（T O P I X）	1,621,512,742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	4,934,985,885円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	496,212,971円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	726,003,004円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	720,204,682円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	4,154,910円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	312,825円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	1,613,667円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	11,322,900円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	11,768,701円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	44,737,280円
三井住友・DCつみたてN I S A ・世界分散ファンド	2,302,624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）	6,957,446,229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＞	30,109,855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＞	1,987,099,738円
S M A M ・ バランスファンドV A 2 5 ＜適格機関投資家専用＞	3,897,902,109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＞	2,575,394,920円
S M A M ・ バランスファンドV A 5 0 ＜適格機関投資家専用＞	9,494,460,725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＞	57,836,559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＞	229,663,802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＞	1,265,342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＞	1,036,963,093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＞	56,979,338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＞	390,180,737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＞	1,122,612,897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＞	1,151,955,345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＞	3,286,550,963円

SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	57,101,087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)	1,486,536,936円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	70,337,724円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	113,704,142円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,676,254,768円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	111,559,736円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	47,156,820円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	22,080,403円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	228,097,979円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	409,768,676円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	168,669,491円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	122,157,944円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	59,438,718円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	11,086,429円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	78,683,152円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,016,895,360円
SMAM・国内株式インデックスファンド・VA(適格機関投資家専用)	198,971,078円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	21,028,969円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA<適格機関投資家限定>	1,787,366,166円
SMAM・グローバルバランスファンド(債券重視型)VA<適格機関投資家限定>	265,581,987円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	1,738,315,243円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	293,505,531円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	7,252,033円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	70,808,588円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-05<適格機関投資家限定>	33,953,240円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	72,401,416円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	8,189円
合計	67,579,087,442円

附属明細表

有価証券明細表

(a)株式

(単位:円)

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	3,400	3,725.00	12,665,000	
日本水産	90,300	591.00	53,367,300	
マルハニチロ	15,200	3,670.00	55,784,000	
カネコ種苗	3,800	1,663.00	6,319,400	
サカタのタネ	11,400	3,945.00	44,973,000	
ホクト	7,700	1,937.00	14,914,900	

日鉄鉱業	2,300	6,600.00	15,180,000
三井松島産業	6,100	1,578.00	9,625,800
国際石油開発帝石	387,000	1,394.50	539,671,500
石油資源開発	12,500	2,830.00	35,375,000
K & O エナジーグループ	5,200	1,735.00	9,022,000
ヒノキヤグループ	2,300	3,955.00	9,096,500
ショーボンドホールディングス	7,500	8,290.00	62,175,000
ミライト・ホールディングス	23,900	1,755.00	41,944,500
タマホーム	8,700	1,130.00	9,831,000
TATERU	7,400	1,875.00	13,875,000
安藤・間	61,700	878.00	54,172,600
東急建設	30,300	1,175.00	35,602,500
コムシスホールディングス	28,100	2,976.00	83,625,600
ミサワホーム	8,000	933.00	7,464,000
高松コンストラクショングループ	4,900	3,005.00	14,724,500
東建コーポレーション	2,900	10,490.00	30,421,000
大成建設	78,900	5,890.00	464,721,000
大林組	236,500	1,232.00	291,368,000
清水建設	241,200	1,065.00	256,878,000
飛島建設	81,500	178.00	14,507,000
長谷工コーポレーション	92,500	1,681.00	155,492,500
松井建設	10,800	878.00	9,482,400
銭高組	1,400	5,430.00	7,602,000
鹿島建設	347,000	1,044.00	362,268,000
不動テトラ	71,700	189.00	13,551,300
鉄建建設	5,100	3,305.00	16,855,500
西松建設	19,100	2,967.00	56,669,700
三井住友建設	61,400	666.00	40,892,400
大豊建設	29,000	646.00	18,734,000
前田建設工業	58,000	1,330.00	77,140,000
奥村組	13,500	4,515.00	60,952,500
東鉄工業	9,200	3,225.00	29,670,000
イチケン	2,000	2,469.00	4,938,000
浅沼組	31,000	405.00	12,555,000
戸田建設	93,000	892.00	82,956,000
熊谷組	12,400	3,695.00	45,818,000
北野建設	21,000	399.00	8,379,000
三井ホーム	12,000	726.00	8,712,000
矢作建設工業	12,500	832.00	10,400,000
ピーエス三菱	12,100	711.00	8,603,100
日本ハウスホールディングス	18,800	585.00	10,998,000
大東建託	28,400	18,135.00	515,034,000

新日本建設	10,300	1,197.00	12,329,100
N I P P O	17,900	2,497.00	44,696,300
東亜道路工業	2,000	3,960.00	7,920,000
前田道路	25,000	2,344.00	58,600,000
日本道路	2,400	5,350.00	12,840,000
東亜建設工業	6,900	2,760.00	19,044,000
若築建設	5,800	1,730.00	10,034,000
東洋建設	26,400	527.00	13,912,800
五洋建設	96,300	841.00	80,988,300
世紀東急工業	13,900	719.00	9,994,100
福田組	2,700	6,850.00	18,495,000
住友林業	50,800	1,798.00	91,338,400
日成ビルド工業	12,500	1,367.00	17,087,500
大和ハウス工業	233,900	3,993.00	933,962,700
ライト工業	15,300	1,180.00	18,054,000
積水ハウス	258,500	1,987.00	513,639,500
北陸電気工事	5,400	1,208.00	6,523,200
ユアテック	13,200	906.00	11,959,200
中電工	9,400	2,999.00	28,190,600
関電工	30,200	1,264.00	38,172,800
きんでん	52,800	1,878.00	99,158,400
東京エネシス	9,800	1,294.00	12,681,200
トーエネック	2,700	3,415.00	9,220,500
住友電設	6,500	2,346.00	15,249,000
日本電設工業	11,800	2,238.00	26,408,400
協和エクシオ	28,900	2,825.00	81,642,500
新日本空調	7,100	1,625.00	11,537,500
N D S	1,800	4,360.00	7,848,000
九電工	15,700	5,170.00	81,169,000
三機工業	16,900	1,224.00	20,685,600
日揮	68,600	2,669.00	183,093,400
中外炉工業	3,400	2,995.00	10,183,000
ヤマト	9,100	757.00	6,888,700
太平電業	5,700	2,846.00	16,222,200
高砂熱学工業	21,600	2,050.00	44,280,000
朝日工業社	2,300	3,580.00	8,234,000
明星工業	15,800	772.00	12,197,600
大気社	9,800	3,775.00	36,995,000
ダイダン	5,600	2,626.00	14,705,600
日比谷総合設備	9,100	2,155.00	19,610,500
東芝プラントシステム	17,200	2,264.00	38,940,800
O S J Bホールディングス	40,000	319.00	12,760,000

千代田化工建設	53,300	1,116.00	59,482,800
新興プランテック	16,100	1,008.00	16,228,800
日本製粉	21,700	1,782.00	38,669,400
日清製粉グループ本社	85,400	2,346.00	200,348,400
日東富士製粉	1,200	4,770.00	5,724,000
昭和産業	5,900	2,922.00	17,239,800
鳥越製粉	9,400	989.00	9,296,600
中部飼料	8,700	2,273.00	19,775,100
フィード・ワン	50,900	239.00	12,165,100
日本甜菜製糖	5,000	2,402.00	12,010,000
三井製糖	5,400	4,360.00	23,544,000
日新製糖	3,800	2,120.00	8,056,000
森永製菓	16,600	5,330.00	88,478,000
中村屋	2,600	4,865.00	12,649,000
江崎グリコ	19,900	5,840.00	116,216,000
名糖産業	5,300	1,777.00	9,418,100
井村屋グループ	3,200	3,385.00	10,832,000
不二家	5,600	2,646.00	14,817,600
山崎製パン	57,600	2,369.00	136,454,400
モロゾフ	1,600	6,620.00	10,592,000
亀田製菓	4,500	5,380.00	24,210,000
寿スピリッツ	6,800	5,140.00	34,952,000
カルビー	32,500	3,700.00	120,250,000
森永乳業	14,300	4,800.00	68,640,000
六甲バター	4,700	2,619.00	12,309,300
ヤクルト本社	41,300	7,820.00	322,966,000
明治ホールディングス	46,600	8,680.00	404,488,000
雪印メグミルク	17,300	3,265.00	56,484,500
プリマハム	49,000	647.00	31,703,000
日本ハム	30,500	4,775.00	145,637,500
丸大食品	36,000	537.00	19,332,000
S Foods	4,900	4,585.00	22,466,500
伊藤ハム米久ホールディングス	44,900	990.00	44,451,000
サッポロホールディングス	26,200	3,080.00	80,696,000
アサヒグループホールディングス	148,700	5,505.00	818,593,500
キリンホールディングス	341,100	3,086.00	1,052,634,600
宝ホールディングス	54,100	1,292.00	69,897,200
オエノンホールディングス	28,800	470.00	13,536,000
養命酒製造	3,200	2,464.00	7,884,800
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールデ	49,600	4,720.00	234,112,000
サントリー食品インターナショナル	53,900	5,400.00	291,060,000
ダイドーグループホールディングス	3,500	6,810.00	23,835,000

伊藤園	23,400	4,325.00	101,205,000
キーコーヒー	6,900	2,178.00	15,028,200
日清オイリオグループ	8,000	3,210.00	25,680,000
不二製油グループ本社	19,400	3,490.00	67,706,000
かどや製油	1,000	6,460.00	6,460,000
J-オイルミルズ	3,800	3,760.00	14,288,000
キッコーマン	55,000	4,530.00	249,150,000
味の素	163,000	2,005.00	326,815,000
キューピー	39,700	2,522.00	100,123,400
ハウス食品グループ本社	27,100	3,835.00	103,928,500
カゴメ	28,700	3,925.00	112,647,500
焼津水産化学工業	5,800	1,252.00	7,261,600
アリアケジャパン	6,200	9,340.00	57,908,000
ニチレイ	33,900	3,155.00	106,954,500
東洋水産	38,800	4,275.00	165,870,000
日清食品ホールディングス	30,700	7,890.00	242,223,000
永谷園ホールディングス	9,000	1,460.00	13,140,000
一正蒲鉾	4,600	1,358.00	6,246,800
フジッコ	7,700	2,506.00	19,296,200
ロック・フィールド	7,700	2,105.00	16,208,500
日本たばこ産業	438,800	2,951.50	1,295,118,200
ケンコーマヨネーズ	5,000	3,830.00	19,150,000
わらべや日洋ホールディングス	4,900	2,772.00	13,582,800
なとり	5,300	1,939.00	10,276,700
北の達人コーポレーション	21,800	855.00	18,639,000
ユーグレナ	28,600	1,014.00	29,000,400
ミヨシ油脂	4,900	1,450.00	7,105,000
理研ビタミン	3,000	4,270.00	12,810,000
片倉工業	10,000	1,378.00	13,780,000
ゲンゼ	5,500	6,680.00	36,740,000
東洋紡	28,100	2,108.00	59,234,800
ユニチカ	22,500	730.00	16,425,000
富士紡ホールディングス	4,500	4,235.00	19,057,500
倉敷紡績	74,000	362.00	26,788,000
シキボウ	5,700	1,402.00	7,991,400
日本毛織	20,500	1,137.00	23,308,500
帝国繊維	8,300	2,245.00	18,633,500
帝人	60,000	2,051.00	123,060,000
東レ	538,100	1,024.50	551,283,450
サカイオーベックス	2,700	2,415.00	6,520,500
住江織物	2,700	2,883.00	7,784,100
アツギ	7,900	1,239.00	9,788,100

ダイニック	4,600	1,062.00	4,885,200
セーレン	16,900	2,109.00	35,642,100
小松精練	13,000	1,090.00	14,170,000
ワコールホールディングス	20,700	3,285.00	67,999,500
ホギメディカル	9,300	4,465.00	41,524,500
レナウン	28,200	166.00	4,681,200
T S Iホールディングス	25,900	877.00	22,714,300
三陽商会	4,900	2,657.00	13,019,300
オンワードホールディングス	46,200	864.00	39,916,800
ルックホールディングス	17,000	339.00	5,763,000
ゴールドウイン	4,300	6,670.00	28,681,000
デサント	16,700	1,873.00	31,279,100
特種東海製紙	4,200	4,245.00	17,829,000
王子ホールディングス	308,000	759.00	233,772,000
日本製紙	33,000	2,083.00	68,739,000
三菱製紙	12,500	695.00	8,687,500
北越紀州製紙	40,300	679.00	27,363,700
中越パルプ工業	3,700	1,989.00	7,359,300
巴川製紙所	18,000	300.00	5,400,000
大王製紙	28,500	1,533.00	43,690,500
レンゴー	72,400	934.00	67,621,600
トモク	5,000	2,043.00	10,215,000
ザ・パック	5,200	4,145.00	21,554,000
クラレ	123,800	1,838.00	227,544,400
旭化成	462,000	1,508.50	696,927,000
共和レザー	6,300	975.00	6,142,500
昭和電工	49,500	3,615.00	178,942,500
住友化学	540,000	643.00	347,220,000
住友精化	3,100	5,280.00	16,368,000
日産化学工業	42,900	4,910.00	210,639,000
ラサ工業	3,400	2,264.00	7,697,600
クレハ	6,300	7,500.00	47,250,000
テイカ	5,900	2,951.00	17,410,900
石原産業	13,900	1,279.00	17,778,100
日東エフシー	6,500	742.00	4,823,000
日本曹達	52,000	632.00	32,864,000
東ソー	106,700	1,943.00	207,318,100
トクヤマ	21,800	3,340.00	72,812,000
セントラル硝子	15,200	2,577.00	39,170,400
東亜合成	44,600	1,296.00	57,801,600
大阪ソーダ	6,700	3,070.00	20,569,000
関東電化工業	18,400	1,031.00	18,970,400

デンカ	27,200	3,985.00	108,392,000
信越化学工業	123,300	10,860.00	1,339,038,000
日本カーバイド工業	3,200	2,260.00	7,232,000
堺化学工業	5,400	2,857.00	15,427,800
エア・ウォーター	60,200	2,108.00	126,901,600
大陽日酸	56,400	1,628.00	91,819,200
日本化学工業	3,300	3,485.00	11,500,500
日本パーカラライジング	39,000	1,715.00	66,885,000
高压ガス工業	12,300	963.00	11,844,900
四国化成工業	10,600	1,539.00	16,313,400
ステラ ケミファ	4,200	3,575.00	15,015,000
保土谷化学工業	2,600	4,790.00	12,454,000
日本触媒	11,700	7,410.00	86,697,000
大日精化工業	5,700	4,615.00	26,305,500
カネカ	99,000	1,082.00	107,118,000
三菱瓦斯化学	60,900	2,580.00	157,122,000
三井化学	66,800	3,365.00	224,782,000
J S R	74,500	2,034.00	151,533,000
東京応化工業	13,300	3,950.00	52,535,000
大阪有機化学工業	7,000	1,445.00	10,115,000
三菱ケミカルホールディングス	495,100	1,049.00	519,359,900
K Hネオケム	11,700	3,310.00	38,727,000
ダイセル	100,100	1,264.00	126,526,400
住友ベークライト	61,000	1,011.00	61,671,000
積水化学工業	152,200	1,881.00	286,288,200
日本ゼオン	62,900	1,541.00	96,928,900
アイカ工業	20,900	3,995.00	83,495,500
宇部興産	37,300	3,345.00	124,768,500
積水樹脂	11,400	2,389.00	27,234,600
タキロンシーアイ	16,400	676.00	11,086,400
旭有機材	5,200	1,819.00	9,458,800
日立化成	36,300	2,543.00	92,310,900
ニチバン	4,100	3,475.00	14,247,500
リケンテクノス	18,300	532.00	9,735,600
大倉工業	20,000	625.00	12,500,000
積水化成品工業	10,000	1,407.00	14,070,000
群栄化学工業	2,300	3,710.00	8,533,000
ミライアル	3,500	1,576.00	5,516,000
ダイキョーニシカワ	14,400	1,973.00	28,411,200
森六ホールディングス	3,600	2,838.00	10,216,800
日本化薬	48,400	1,380.00	66,792,000
カーリットホールディングス	8,100	1,058.00	8,569,800

日本精化	8,000	1,262.00	10,096,000
扶桑化学工業	5,700	2,822.00	16,085,400
トリケミカル研究所	1,800	4,515.00	8,127,000
A D E K A	32,200	1,963.00	63,208,600
日油	28,700	3,240.00	92,988,000
新日本理化	17,300	259.00	4,480,700
ハリマ化成グループ	8,000	906.00	7,248,000
花王	173,900	7,870.00	1,368,593,000
第一工業製薬	15,000	734.00	11,010,000
三洋化成工業	4,500	5,200.00	23,400,000
大日本塗料	9,000	1,560.00	14,040,000
日本ペイントホールディングス	57,100	4,425.00	252,667,500
関西ペイント	77,700	2,477.00	192,462,900
中国塗料	21,600	1,077.00	23,263,200
日本特殊塗料	5,100	2,305.00	11,755,500
藤倉化成	12,300	688.00	8,462,400
太陽ホールディングス	5,500	4,695.00	25,822,500
D I C	29,000	3,725.00	108,025,000
サカタインクス	15,300	1,677.00	25,658,100
東洋インキS Cホールディングス	69,000	683.00	47,127,000
T & K T O K A	5,700	1,334.00	7,603,800
富士フイルムホールディングス	146,700	4,383.00	642,986,100
資生堂	131,800	6,997.00	922,204,600
ライオン	98,500	2,318.00	228,323,000
高砂香料工業	4,600	3,425.00	15,755,000
マンダム	13,500	3,940.00	53,190,000
ミルボン	9,500	4,735.00	44,982,500
ファンケル	17,100	4,075.00	69,682,500
コーセー	11,900	20,310.00	241,689,000
シーズ・ホールディングス	8,600	5,190.00	44,634,000
ポーラ・オルビスホールディングス	30,100	4,750.00	142,975,000
ノエビアホールディングス	4,400	7,800.00	34,320,000
エステー	5,700	2,436.00	13,885,200
アグロ カネショウ	3,500	2,742.00	9,597,000
コニシ	11,500	1,772.00	20,378,000
長谷川香料	8,600	2,301.00	19,788,600
星光P M C	5,000	1,235.00	6,175,000
小林製薬	19,800	9,170.00	181,566,000
荒川化学工業	6,900	1,998.00	13,786,200
メック	5,400	1,828.00	9,871,200
日本高純度化学	3,100	2,558.00	7,929,800
タカラバイオ	18,600	2,098.00	39,022,800

J C U	8,900	2,539.00	22,597,100
デクセリアルズ	19,000	1,184.00	22,496,000
アース製薬	5,300	5,750.00	30,475,000
北興化学工業	10,000	692.00	6,920,000
大成ラミック	3,100	3,170.00	9,827,000
クミアイ化学工業	33,400	703.00	23,480,200
日本農薬	21,200	707.00	14,988,400
アキレス	6,200	2,272.00	14,086,400
有沢製作所	12,800	1,053.00	13,478,400
日東電工	53,500	8,360.00	447,260,000
レック	4,400	3,755.00	16,522,000
きもと	18,500	310.00	5,735,000
藤森工業	5,900	3,705.00	21,859,500
前澤化成工業	7,000	1,210.00	8,470,000
J S P	4,000	3,560.00	14,240,000
エフピコ	5,700	6,590.00	37,563,000
天馬	5,900	2,088.00	12,319,200
信越ポリマー	14,600	1,128.00	16,468,800
東リ	21,200	387.00	8,204,400
ニフコ	26,000	3,815.00	99,190,000
日本バルカー工業	6,000	3,095.00	18,570,000
ユニ・チャーム	150,500	3,075.00	462,787,500
協和発酵キリン	87,600	2,359.00	206,648,400
武田薬品工業	260,500	4,556.00	1,186,838,000
アステラス製薬	725,700	1,544.50	1,120,843,650
大日本住友製薬	52,300	2,039.00	106,639,700
塩野義製薬	99,600	5,580.00	555,768,000
田辺三菱製薬	85,100	2,095.00	178,284,500
あすか製薬	8,600	1,681.00	14,456,600
日本新薬	18,500	7,840.00	145,040,000
中外製薬	73,300	5,680.00	416,344,000
科研製薬	12,900	6,480.00	83,592,000
エーザイ	84,800	7,288.00	618,022,400
ロート製薬	39,100	3,165.00	123,751,500
小野薬品工業	167,400	2,508.50	419,922,900
久光製薬	20,900	8,430.00	176,187,000
持田製薬	5,200	7,630.00	39,676,000
参天製薬	133,900	1,819.00	243,564,100
扶桑薬品工業	3,400	2,923.00	9,938,200
日本ケミファ	1,400	4,670.00	6,538,000
ツムラ	25,600	3,940.00	100,864,000
日医工	18,100	1,772.00	32,073,200

キッセイ薬品工業	12,900	3,095.00	39,925,500
生化学工業	14,000	1,831.00	25,634,000
栄研化学	11,600	2,525.00	29,290,000
鳥居薬品	4,600	2,856.00	13,137,600
JCRファーマ	5,100	5,650.00	28,815,000
東和薬品	3,400	6,920.00	23,528,000
富士製薬工業	2,800	4,450.00	12,460,000
沢井製薬	14,500	4,770.00	69,165,000
ゼリア新薬工業	15,300	2,231.00	34,134,300
第一三共	202,400	3,739.00	756,773,600
キョーリン製薬ホールディングス	19,800	2,140.00	42,372,000
大幸薬品	4,400	2,087.00	9,182,800
ダイト	4,300	3,885.00	16,705,500
大塚ホールディングス	146,900	5,564.00	817,351,600
大正製薬ホールディングス	15,600	10,470.00	163,332,000
ペプチドリーム	32,700	4,385.00	143,389,500
日本コークス工業	75,000	117.00	8,775,000
昭和シェル石油	66,000	1,505.00	99,330,000
ニチレキ	9,800	1,218.00	11,936,400
ユシロ化学工業	4,900	1,816.00	8,898,400
富士石油	20,100	452.00	9,085,200
MORESCO	3,600	1,951.00	7,023,600
出光興産	59,400	4,190.00	248,886,000
JXTGホールディングス	1,130,300	701.40	792,792,420
コスモエネルギーホールディングス	19,800	3,590.00	71,082,000
横浜ゴム	40,800	2,589.00	105,631,200
東洋ゴム工業	42,700	1,882.00	80,361,400
ブリヂストン	233,700	4,640.00	1,084,368,000
住友ゴム工業	72,400	1,980.00	143,352,000
藤倉ゴム工業	7,700	783.00	6,029,100
オカモト	26,000	1,099.00	28,574,000
ニッタ	7,100	4,145.00	29,429,500
住友理工	13,900	1,140.00	15,846,000
三ツ星ベルト	18,000	1,230.00	22,140,000
バンドー化学	13,700	1,317.00	18,042,900
日東紡績	10,900	2,398.00	26,138,200
旭硝子	71,400	4,520.00	322,728,000
日本板硝子	26,100	892.00	23,281,200
日本山村硝子	47,000	187.00	8,789,000
日本電気硝子	31,000	3,085.00	95,635,000
オハラ	3,200	2,490.00	7,968,000
住友大阪セメント	141,000	488.00	68,808,000

太平洋セメント	44,700	4,040.00	180,588,000
日本ヒューム	10,500	834.00	8,757,000
日本コンクリート工業	20,500	458.00	9,389,000
三谷セキサン	4,200	2,529.00	10,621,800
アジアパイルホールディングス	12,100	647.00	7,828,700
東海カーボン	64,400	1,345.00	86,618,000
日本カーボン	3,900	4,860.00	18,954,000
東洋炭素	5,000	3,235.00	16,175,000
ノリタケカンパニーリミテド	4,200	4,690.00	19,698,000
TOTO	54,400	6,070.00	330,208,000
日本碍子	86,000	1,928.00	165,808,000
日本特殊陶業	60,700	2,664.00	161,704,800
MARUWA	2,600	8,590.00	22,334,000
品川リフラクトリーズ	2,500	3,010.00	7,525,000
黒崎播磨	1,900	5,020.00	9,538,000
フジインコーポレーテッド	6,700	2,387.00	15,992,900
ニチアス	39,000	1,359.00	53,001,000
ニチハ	10,800	4,160.00	44,928,000
新日鐵住金	312,700	2,365.50	739,691,850
神戸製鋼所	128,800	1,131.00	145,672,800
中山製鋼所	10,400	766.00	7,966,400
合同製鐵	4,600	2,246.00	10,331,600
ジェイ エフ イー ホールディングス	189,000	2,328.50	440,086,500
日新製鋼	20,200	1,363.00	27,532,600
東京製鐵	37,400	912.00	34,108,800
共英製鋼	8,000	2,079.00	16,632,000
大和工業	15,200	3,285.00	49,932,000
東京鐵鋼	4,100	1,706.00	6,994,600
大阪製鐵	4,800	2,371.00	11,380,800
淀川製鋼所	10,300	3,125.00	32,187,500
丸一鋼管	25,000	3,710.00	92,750,000
モリ工業	2,800	3,360.00	9,408,000
大同特殊鋼	12,600	5,610.00	70,686,000
日本冶金工業	61,600	291.00	17,925,600
山陽特殊製鋼	8,300	2,797.00	23,215,100
愛知製鋼	3,900	4,660.00	18,174,000
日立金属	75,200	1,364.00	102,572,800
日本金属	2,300	2,383.00	5,480,900
大平洋金属	4,600	3,765.00	17,319,000
新日本電工	44,700	368.00	16,449,600
栗本鐵工所	4,400	2,074.00	9,125,600
三菱製鋼	5,500	2,673.00	14,701,500

日本精線	1,300	4,840.00	6,292,000
シンニッタン	15,800	478.00	7,552,400
大紀アルミニウム工業所	13,800	758.00	10,460,400
日本軽金属ホールディングス	205,200	290.00	59,508,000
三井金属鉱業	18,900	4,700.00	88,830,000
東邦亜鉛	3,800	5,060.00	19,228,000
三菱マテリアル	46,000	3,285.00	151,110,000
住友金属鉱山	89,700	4,633.00	415,580,100
DOWAホールディングス	17,700	4,095.00	72,481,500
古河機械金属	11,300	2,211.00	24,984,300
大阪チタニウムテクノロジーズ	7,200	2,096.00	15,091,200
東邦チタニウム	12,400	1,337.00	16,578,800
UACJ	10,300	2,821.00	29,056,300
CKサンエツ	1,400	6,210.00	8,694,000
古河電気工業	23,300	5,290.00	123,257,000
住友電気工業	261,100	1,677.00	437,864,700
フジクラ	85,600	748.00	64,028,800
昭和電線ホールディングス	8,700	955.00	8,308,500
タツタ電線	16,000	686.00	10,976,000
平河ヒューテック	5,000	1,486.00	7,430,000
リョービ	8,700	2,822.00	24,551,400
アーレスティ	11,000	991.00	10,901,000
アサヒホールディングス	12,100	2,000.00	24,200,000
稲葉製作所	5,200	1,414.00	7,352,800
宮地エンジニアリンググループ	2,600	2,175.00	5,655,000
トーカロ	20,400	1,329.00	27,111,600
アルファC o	3,300	1,818.00	5,999,400
SUMCO	64,700	2,711.00	175,401,700
川田テクノロジーズ	1,600	6,220.00	9,952,000
RS Technologies	1,200	6,810.00	8,172,000
東洋製罐グループホールディングス	47,300	1,674.00	79,180,200
ホッカンホールディングス	24,000	391.00	9,384,000
コロナ	5,200	1,288.00	6,697,600
横河ブリッジホールディングス	13,200	2,340.00	30,888,000
駒井ハルテック	2,700	2,492.00	6,728,400
三和ホールディングス	67,300	1,385.00	93,210,500
文化シャッター	21,000	1,071.00	22,491,000
三協立山	9,800	1,620.00	15,876,000
アルインコ	7,500	1,093.00	8,197,500
LIXILグループ	102,600	2,436.00	249,933,600
日本フィルコン	8,000	639.00	5,112,000
ノーリツ	15,700	1,981.00	31,101,700

長府製作所	7,300	2,600.00	18,980,000
リンナイ	12,500	10,690.00	133,625,000
日東精工	12,800	806.00	10,316,800
岡部	14,900	1,060.00	15,794,000
ジーテクト	7,800	2,111.00	16,465,800
東プレ	12,400	3,485.00	43,214,000
高周波熱錬	14,500	1,108.00	16,066,000
東京製綱	6,100	2,352.00	14,347,200
パイオラックス	10,100	3,090.00	31,209,000
エイチワン	7,700	1,358.00	10,456,600
日本発條	69,900	1,190.00	83,181,000
三益半導体工業	6,800	1,920.00	13,056,000
日本製鋼所	23,200	3,565.00	82,708,000
三浦工業	30,500	3,325.00	101,412,500
タクマ	24,100	1,199.00	28,895,900
ツガミ	19,000	1,374.00	26,106,000
オークマ	8,300	6,340.00	52,622,000
東芝機械	40,000	737.00	29,480,000
アマダホールディングス	106,800	1,333.00	142,364,400
アイダエンジニアリング	17,900	1,290.00	23,091,000
滝澤鉄工所	3,200	1,955.00	6,256,000
F U J I	20,400	2,033.00	41,473,200
牧野フライス製作所	35,000	1,040.00	36,400,000
オーエスジー	32,600	2,444.00	79,674,400
旭ダイヤモンド工業	21,300	1,072.00	22,833,600
D M G 森精機	39,100	2,059.00	80,506,900
ソディック	15,500	1,385.00	21,467,500
ディスコ	9,500	22,220.00	211,090,000
日東工器	4,800	2,935.00	14,088,000
パンチ工業	7,000	1,207.00	8,449,000
豊和工業	4,800	1,121.00	5,380,800
東洋機械金属	6,800	804.00	5,467,200
津田駒工業	27,000	249.00	6,723,000
島精機製作所	8,900	6,930.00	61,677,000
オプトラン	6,500	3,225.00	20,962,500
フリーー	6,700	936.00	6,271,200
ヤマシンフィルタ	11,000	1,229.00	13,519,000
日阪製作所	11,700	1,169.00	13,677,300
やまびこ	13,900	1,575.00	21,892,500
平田機工	2,400	10,440.00	25,056,000
ペガサスミシン製造	9,000	773.00	6,957,000
ナブテスコ	38,600	3,995.00	154,207,000

三井海洋開発	7,600	2,904.00	22,070,400
レオン自動機	6,600	2,045.00	13,497,000
S M C	22,200	42,780.00	949,716,000
新川	7,100	1,002.00	7,114,200
ホソカワミクロン	2,400	7,330.00	17,592,000
ユニオンツール	3,400	3,805.00	12,937,000
オイレス工業	9,000	2,359.00	21,231,000
日精エー・エス・ビー機械	2,100	6,680.00	14,028,000
サトーホールディングス	9,300	3,100.00	28,830,000
技研製作所	4,900	2,535.00	12,421,500
日精樹脂工業	6,700	1,450.00	9,715,000
小松製作所	341,600	3,759.00	1,284,074,400
住友重機械工業	40,200	4,195.00	168,639,000
日立建機	33,000	4,265.00	140,745,000
日工	3,000	2,466.00	7,398,000
巴工業	4,100	2,179.00	8,933,900
井関農機	7,500	2,119.00	15,892,500
T O W A	6,200	1,503.00	9,318,600
北川鉄工所	4,000	2,814.00	11,256,000
ローツェ	3,800	2,389.00	9,078,200
クボタ	379,200	1,847.00	700,382,400
三菱化工機	3,000	2,289.00	6,867,000
月島機械	14,500	1,532.00	22,214,000
帝国電機製作所	6,100	1,635.00	9,973,500
新東工業	16,800	1,179.00	19,807,200
澁谷工業	6,200	3,745.00	23,219,000
アイチ コーポレーション	13,500	743.00	10,030,500
小森コーポレーション	18,300	1,394.00	25,510,200
鶴見製作所	6,400	2,119.00	13,561,600
住友精密工業	18,000	398.00	7,164,000
酒井重工業	1,800	4,710.00	8,478,000
荏原製作所	29,200	4,205.00	122,786,000
西島製作所	9,000	1,028.00	9,252,000
北越工業	8,900	1,203.00	10,706,700
ダイキン工業	96,400	12,650.00	1,219,460,000
オルガノ	3,100	3,280.00	10,168,000
トーヨーカネツ	3,400	3,355.00	11,407,000
栗田工業	38,300	3,560.00	136,348,000
椿本チエイン	40,000	946.00	37,840,000
大同工業	4,000	1,545.00	6,180,000
アネスト岩田	12,000	1,190.00	14,280,000
ダイフク	35,900	6,070.00	217,913,000

加藤製作所	3,700	2,561.00	9,475,700
タダノ	35,000	1,655.00	57,925,000
フジテック	22,100	1,525.00	33,702,500
C K D	19,500	2,297.00	44,791,500
キトー	6,000	2,073.00	12,438,000
平和	21,800	2,177.00	47,458,600
理想科学工業	6,800	2,166.00	14,728,800
S A N K Y O	18,000	3,825.00	68,850,000
日本金銭機械	7,900	1,231.00	9,724,900
マースエンジニアリング	5,200	2,419.00	12,578,800
福島工業	4,400	5,010.00	22,044,000
ダイコク電機	4,100	1,811.00	7,425,100
竹内製作所	11,800	2,566.00	30,278,800
アマノ	22,200	2,740.00	60,828,000
J U K I	10,900	1,600.00	17,440,000
サンデンホールディングス	9,000	1,619.00	14,571,000
蛇の目ミシン工業	8,900	730.00	6,497,000
マックス	10,700	1,417.00	15,161,900
グローリー	21,400	3,800.00	81,320,000
新晃工業	7,500	1,768.00	13,260,000
大和冷機工業	11,500	1,231.00	14,156,500
セガサミーホールディングス	70,500	1,764.00	124,362,000
日本ピストンリング	3,800	2,259.00	8,584,200
リケン	3,300	6,290.00	20,757,000
T P R	7,600	3,300.00	25,080,000
ツバキ・ナカシマ	7,500	2,580.00	19,350,000
ホシザキ	22,200	10,100.00	224,220,000
大豊工業	6,400	1,540.00	9,856,000
日本精工	143,900	1,474.00	212,108,600
N T N	163,500	477.00	77,989,500
ジェイテクト	74,200	1,678.00	124,507,600
不二越	67,000	570.00	38,190,000
日本トムソン	23,000	800.00	18,400,000
T H K	44,200	3,935.00	173,927,000
ユーシン精機	7,200	1,555.00	11,196,000
イーグル工業	8,600	1,987.00	17,088,200
日本ピラー工業	8,100	1,543.00	12,498,300
キッツ	29,400	920.00	27,048,000
マキタ	91,900	4,850.00	445,715,000
日立造船	54,000	587.00	31,698,000
三菱重工業	118,700	4,272.00	507,086,400
I H I	54,400	3,585.00	195,024,000

スター精密	11,800	1,993.00	23,517,400
日清紡ホールディングス	43,600	1,517.00	66,141,200
イビデン	43,000	1,719.00	73,917,000
コニカミノルタ	164,300	931.00	152,963,300
ブラザー工業	86,100	2,419.00	208,275,900
ミネベアミツミ	130,800	2,204.00	288,283,200
日立製作所	1,695,000	808.90	1,371,085,500
三菱電機	705,800	1,750.50	1,235,502,900
富士電機	213,000	731.00	155,703,000
東洋電機製造	4,000	1,860.00	7,440,000
安川電機	81,800	4,580.00	374,644,000
シンフォニアテクノロジー	48,000	380.00	18,240,000
明電舎	61,000	427.00	26,047,000
オリジン電気	3,300	1,780.00	5,874,000
山洋電気	3,500	9,290.00	32,515,000
デンヨー	7,400	1,930.00	14,282,000
東芝テック	49,000	639.00	31,311,000
芝浦メカトロニクス	13,000	445.00	5,785,000
マブチモーター	19,600	5,510.00	107,996,000
日本電産	85,000	17,170.00	1,459,450,000
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	3,000	2,923.00	8,769,000
東光高岳	4,500	1,933.00	8,698,500
ダブル・スコープ	10,700	1,653.00	17,687,100
ダイヘン	39,000	853.00	33,267,000
ヤーマン	10,100	2,375.00	23,987,500
JVCケンウッド	54,000	388.00	20,952,000
ミマキエンジニアリング	7,500	863.00	6,472,500
第一精工	3,900	2,244.00	8,751,600
日新電機	17,100	1,085.00	18,553,500
大崎電気工業	17,600	800.00	14,080,000
オムロン	74,900	5,980.00	447,902,000
日東工業	11,500	1,860.00	21,390,000
I D E C	9,000	2,477.00	22,293,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	127,000	586.00	74,422,000
サクサホールディングス	2,400	2,167.00	5,200,800
メルコホールディングス	3,700	3,695.00	13,671,500
日本電気	91,000	2,989.00	271,999,000
富士通	727,000	666.30	484,400,100
沖電気工業	29,000	1,477.00	42,833,000
電気興業	4,700	3,310.00	15,557,000
サンケン電気	43,000	723.00	31,089,000
アイホン	5,200	1,838.00	9,557,600

ルネサスエレクトロニクス	35,800	1,135.00	40,633,000
セイコーエプソン	104,600	2,057.00	215,162,200
ワコム	57,000	558.00	31,806,000
アルバック	16,400	6,010.00	98,564,000
E I Z O	6,600	5,100.00	33,660,000
ジャパンディスプレイ	82,700	150.00	12,405,000
日本信号	19,700	1,040.00	20,488,000
京三製作所	19,000	723.00	13,737,000
能美防災	9,400	2,377.00	22,343,800
ホーチキ	5,600	2,218.00	12,420,800
エレコム	6,400	2,449.00	15,673,600
パナソニック	806,900	1,617.00	1,304,757,300
シャープ	65,000	3,340.00	217,100,000
アンリツ	51,400	1,321.00	67,899,400
富士通ゼネラル	22,000	1,757.00	38,654,000
ソニー	472,500	5,443.00	2,571,817,500
T D K	36,800	9,560.00	351,808,000
タムラ製作所	27,800	834.00	23,185,200
アルプス電気	60,000	2,638.00	158,280,000
池上通信機	34,000	171.00	5,814,000
パイオニア	119,100	178.00	21,199,800
日本電波工業	9,500	685.00	6,507,500
日本トリム	1,900	5,180.00	9,842,000
ローランド ディー . ジー .	4,200	2,562.00	10,760,400
フォスター電機	8,500	2,682.00	22,797,000
クラリオン	39,000	346.00	13,494,000
S M K	21,000	414.00	8,694,000
ヨコオ	5,500	2,250.00	12,375,000
ホシデン	18,300	1,345.00	24,613,500
ヒロセ電機	12,000	15,340.00	184,080,000
日本航空電子工業	18,000	1,911.00	34,398,000
T O A	8,300	1,282.00	10,640,600
マクセルホールディングス	14,100	2,188.00	30,850,800
古野電気	10,500	894.00	9,387,000
ユニデンホールディングス	26,000	277.00	7,202,000
アルパイン	17,500	2,088.00	36,540,000
スミダコーポレーション	8,000	1,503.00	12,024,000
アイコム	4,700	2,738.00	12,868,600
リオン	3,700	2,496.00	9,235,200
本多通信工業	6,400	1,107.00	7,084,800
船井電機	9,200	779.00	7,166,800
横河電機	70,700	2,387.00	168,760,900

新電元工業	2,600	6,950.00	18,070,000
アズビル	21,200	5,090.00	107,908,000
日本光電工業	29,400	3,095.00	90,993,000
チノー	3,700	1,635.00	6,049,500
共和電業	14,300	436.00	6,234,800
堀場製作所	14,100	7,970.00	112,377,000
アドバンテスト	39,400	2,307.00	90,895,800
エスベック	6,400	2,562.00	16,396,800
キーエンス	34,700	65,500.00	2,272,850,000
日置電機	3,600	4,305.00	15,498,000
シスメックス	55,000	9,640.00	530,200,000
日本マイクロニクス	12,100	1,191.00	14,411,100
メガチップス	5,700	3,580.00	20,406,000
O B A R A G R O U P	4,200	6,530.00	27,426,000
コーセル	10,000	1,465.00	14,650,000
イリソ電子工業	5,900	6,880.00	40,592,000
新日本無線	5,400	921.00	4,973,400
オブテックスグループ	11,700	3,240.00	37,908,000
千代田インテグレ	3,900	2,517.00	9,816,300
レーザーテック	14,600	3,555.00	51,903,000
スタンレー電気	53,900	3,905.00	210,479,500
岩崎電気	4,000	1,706.00	6,824,000
ウシオ電機	42,600	1,529.00	65,135,400
ヘリオス テクノ ホールディング	7,400	933.00	6,904,200
日本セラミック	7,500	2,894.00	21,705,000
古河電池	6,100	999.00	6,093,900
山一電機	5,600	1,908.00	10,684,800
図研	5,500	1,496.00	8,228,000
日本電子	27,000	952.00	25,704,000
カシオ計算機	57,100	1,625.00	92,787,500
ファナック	67,200	25,985.00	1,746,192,000
日本シイエムケイ	13,800	865.00	11,937,000
エンプラス	3,500	3,115.00	10,902,500
大真空	3,700	1,324.00	4,898,800
ローム	31,700	10,140.00	321,438,000
浜松ホトニクス	51,300	4,205.00	215,716,500
三井ハイテック	9,900	1,614.00	15,978,600
新光電気工業	26,500	840.00	22,260,000
京セラ	116,000	6,215.00	720,940,000
太陽誘電	32,200	1,948.00	62,725,600
村田製作所	74,100	14,150.00	1,048,515,000
ユーシン	13,400	739.00	9,902,600

双葉電子工業	11,500	2,272.00	26,128,000	
北陸電気工業	4,100	1,502.00	6,158,200	
ニチコン	22,700	1,234.00	28,011,800	
日本ケミコン	6,000	2,580.00	15,480,000	
K O A	10,000	2,233.00	22,330,000	
市光工業	11,300	1,208.00	13,650,400	
小糸製作所	42,000	7,350.00	308,700,000	
ミツバ	13,300	1,608.00	21,386,400	
S C R E E Nホールディングス	13,500	8,770.00	118,395,000	
キャノン電子	6,500	2,539.00	16,503,500	
キャノン	380,900	3,811.00	1,451,609,900	
リコー	212,600	1,093.00	232,371,800	
象印マホービン	13,300	1,472.00	19,577,600	
東京エレクトロン	47,200	21,050.00	993,560,000	
トヨタ紡織	20,700	2,457.00	50,859,900	
芦森工業	1,900	2,487.00	4,725,300	
ユニプレス	13,800	2,616.00	36,100,800	
豊田自動織機	56,700	6,510.00	369,117,000	
モリタホールディングス	11,600	2,134.00	24,754,400	
三櫻工業	11,700	804.00	9,406,800	
デンソー	156,400	5,962.00	932,456,800	
東海理化電機製作所	19,100	2,232.00	42,631,200	
三井E & Sホールディングス	26,000	1,879.00	48,854,000	
川崎重工業	54,900	3,810.00	209,169,000	
名村造船所	22,900	689.00	15,778,100	
日本車輛製造	31,000	300.00	9,300,000	
三菱ロジスネクスト	9,700	967.00	9,379,900	
日産自動車	832,600	1,155.00	961,653,000	
いすゞ自動車	205,700	1,696.00	348,867,200	
トヨタ自動車	859,900	7,169.00	6,164,623,100	代用有価証券 400,000株
日野自動車	100,800	1,394.00	140,515,200	
三菱自動車工業	261,800	808.00	211,534,400	
エフテック	5,500	1,392.00	7,656,000	
武蔵精密工業	7,700	3,890.00	29,953,000	
日産車体	28,000	1,197.00	33,516,000	
新明和工業	31,200	1,133.00	35,349,600	
極東開発工業	13,600	1,742.00	23,691,200	
日信工業	14,300	1,935.00	27,670,500	
トピー工業	6,100	3,245.00	19,794,500	
ティラド	3,200	3,970.00	12,704,000	
タチエス	12,200	2,005.00	24,461,000	
N O K	38,100	2,257.00	85,991,700	

フタバ産業	22,400	908.00	20,339,200
K Y B	7,500	5,310.00	39,825,000
大同メタル工業	10,900	1,317.00	14,355,300
プレス工業	38,400	645.00	24,768,000
ミクニ	11,700	643.00	7,523,100
太平洋工業	15,300	1,463.00	22,383,900
ケーヒン	16,000	2,201.00	35,216,000
河西工業	9,000	1,550.00	13,950,000
アイシン精機	57,700	6,010.00	346,777,000
マツダ	223,000	1,525.00	340,075,000
今仙電機製作所	8,400	1,250.00	10,500,000
本田技研工業	636,400	3,797.00	2,416,410,800
スズキ	140,300	5,843.00	819,772,900
S U B A R U	219,200	3,663.00	802,929,600
安永	3,700	2,421.00	8,957,700
ヤマハ発動機	99,300	3,530.00	350,529,000
ショーワ	18,700	1,693.00	31,659,100
T B K	14,300	549.00	7,850,700
エクセディ	8,100	3,665.00	29,686,500
豊田合成	25,800	2,622.00	67,647,600
愛三工業	13,100	1,182.00	15,484,200
ヨロズ	7,700	1,890.00	14,553,000
エフ・シー・シー	11,600	3,180.00	36,888,000
シマノ	28,500	14,590.00	415,815,000
テイ・エス テック	16,300	4,420.00	72,046,000
ジャムコ	3,900	2,490.00	9,711,000
テルモ	108,000	6,150.00	664,200,000
日機装	24,700	1,228.00	30,331,600
島津製作所	83,800	2,982.00	249,891,600
J M S	11,500	645.00	7,417,500
長野計器	6,900	1,328.00	9,163,200
ブイ・テクノロジー	1,700	29,450.00	50,065,000
東京計器	5,700	1,191.00	6,788,700
インターアクション	4,400	1,285.00	5,654,000
東京精密	12,500	4,390.00	54,875,000
マニー	8,600	4,455.00	38,313,000
ニコン	122,700	1,918.00	235,338,600
トプコン	38,400	2,196.00	84,326,400
オリンパス	104,700	4,095.00	428,746,500
理研計器	7,000	2,506.00	17,542,000
タムロン	6,400	2,253.00	14,419,200
H O Y A	142,300	5,837.00	830,605,100

シード	1,000	7,130.00	7,130,000	
ノーリツ銅機	7,400	2,763.00	20,446,200	
シチズン時計	84,700	814.00	68,945,800	
リズム時計工業	4,000	2,357.00	9,428,000	
大研医器	10,200	747.00	7,619,400	
メニコン	9,800	2,831.00	27,743,800	
松風	6,200	1,453.00	9,008,600	
セイコーホールディングス	10,700	2,857.00	30,569,900	
ニプロ	49,600	1,564.00	77,574,400	
スノーピーク	3,000	1,448.00	4,344,000	
パラマウントベッドホールディングス	7,500	5,420.00	40,650,000	
トランザクション	4,500	1,008.00	4,536,000	
ニホンフラッシュ	3,800	2,683.00	10,195,400	
前田工織	7,900	1,653.00	13,058,700	
永大産業	14,000	545.00	7,630,000	
アートネイチャー	11,000	759.00	8,349,000	
バンダイナムコホールディングス	73,000	3,675.00	268,275,000	
S H O E I	3,500	4,245.00	14,857,500	
フランスベッドホールディングス	10,700	991.00	10,603,700	
パイロットコーポレーション	12,200	5,990.00	73,078,000	
萩原工業	5,000	1,878.00	9,390,000	
トッパン・フォームズ	14,500	1,215.00	17,617,500	
フジシールインターナショナル	15,700	4,015.00	63,035,500	
タカラトミー	30,000	1,074.00	32,220,000	
アーク	41,700	126.00	5,254,200	
プロネクサス	7,900	1,456.00	11,502,400	
大建工業	5,500	2,758.00	15,169,000	
凸版印刷	195,000	917.00	178,815,000	
大日本印刷	91,300	2,336.00	213,276,800	
図書印刷	5,700	992.00	5,654,400	
共同印刷	2,500	3,375.00	8,437,500	
N I S S H A	14,600	2,698.00	39,390,800	
宝印刷	5,300	2,037.00	10,796,100	
アシックス	70,400	2,055.00	144,672,000	
ツツミ	2,900	2,059.00	5,971,100	
小松ウオール工業	3,300	2,395.00	7,903,500	
ヤマハ	47,400	5,210.00	246,954,000	
河合楽器製作所	3,300	3,620.00	11,946,000	
クリナップ	8,600	889.00	7,645,400	
ピジョン	42,600	5,040.00	214,704,000	
キングジム	8,400	1,073.00	9,013,200	
リンテック	17,000	3,155.00	53,635,000	

イトーキ	16,900	756.00	12,776,400
任天堂	43,500	45,430.00	1,976,205,000
三菱鉛筆	11,500	2,457.00	28,255,500
タカスタンダード	13,600	1,856.00	25,241,600
コクヨ	34,200	1,949.00	66,655,800
ナカバヤシ	9,900	641.00	6,345,900
グローブライド	4,100	2,972.00	12,185,200
オカムラ	24,400	1,491.00	36,380,400
美津濃	6,900	3,495.00	24,115,500
東京電力ホールディングス	559,800	492.00	275,421,600
中部電力	216,400	1,741.00	376,752,400
関西電力	288,700	1,553.00	448,351,100
中国電力	96,800	1,373.00	132,906,400
北陸電力	70,400	1,087.00	76,524,800
東北電力	165,500	1,544.00	255,532,000
四国電力	64,100	1,388.00	88,970,800
九州電力	154,100	1,355.00	208,805,500
北海道電力	71,700	732.00	52,484,400
沖縄電力	11,500	3,280.00	37,720,000
電源開発	56,500	3,000.00	169,500,000
エフオン	4,400	1,521.00	6,692,400
イーレックス	12,400	895.00	11,098,000
レノバ	4,200	1,339.00	5,623,800
東京瓦斯	151,500	2,934.00	444,501,000
大阪瓦斯	137,400	2,335.00	320,829,000
東邦瓦斯	35,200	3,500.00	123,200,000
広島ガス	18,200	382.00	6,952,400
西部瓦斯	8,500	2,867.00	24,369,500
静岡ガス	20,400	990.00	20,196,000
メタウォーター	4,400	2,977.00	13,098,800
SBSホールディングス	8,300	1,383.00	11,478,900
東武鉄道	74,000	3,420.00	253,080,000
相鉄ホールディングス	23,100	3,045.00	70,339,500
東京急行電鉄	190,200	1,822.00	346,544,400
京浜急行電鉄	97,400	1,989.00	193,728,600
小田急電鉄	104,300	2,349.00	245,000,700
京王電鉄	39,300	4,945.00	194,338,500
京成電鉄	49,100	3,540.00	173,814,000
富士急行	10,100	3,025.00	30,552,500
東日本旅客鉄道	127,000	10,370.00	1,316,990,000
西日本旅客鉄道	63,800	7,608.00	485,390,400
東海旅客鉄道	63,300	20,880.00	1,321,704,000

西武ホールディングス	90,400	1,852.00	167,420,800
鴻池運輸	10,000	1,915.00	19,150,000
西日本鉄道	20,200	3,035.00	61,307,000
ハマキョウレックス	5,200	3,800.00	19,760,000
サカイ引越センター	3,800	5,870.00	22,306,000
近鉄グループホールディングス	66,100	4,410.00	291,501,000
阪急阪神ホールディングス	88,500	4,225.00	373,912,500
南海電気鉄道	32,500	2,885.00	93,762,500
京阪ホールディングス	30,000	3,515.00	105,450,000
神戸電鉄	2,600	3,985.00	10,361,000
名古屋鉄道	52,900	2,845.00	150,500,500
山陽電気鉄道	5,200	2,795.00	14,534,000
日本通運	26,100	7,980.00	208,278,000
ヤマトホールディングス	118,000	2,896.00	341,728,000
山九	17,300	5,240.00	90,652,000
丸全昭和運輸	28,000	514.00	14,392,000
センコーグループホールディングス	40,400	838.00	33,855,200
トナミホールディングス	1,800	6,730.00	12,114,000
ニッコンホールディングス	26,000	2,904.00	75,504,000
福山通運	9,800	4,550.00	44,590,000
セイノーホールディングス	50,100	1,993.00	99,849,300
神奈川中央交通	2,400	3,765.00	9,036,000
日立物流	14,100	2,949.00	41,580,900
丸和運輸機関	3,800	3,085.00	11,723,000
C & F ロジホールディングス	8,600	1,516.00	13,037,600
九州旅客鉄道	56,500	3,460.00	195,490,000
S Gホールディングス	63,000	2,475.00	155,925,000
日本郵船	55,300	2,356.00	130,286,800
商船三井	41,900	3,430.00	143,717,000
川崎汽船	31,200	2,641.00	82,399,200
N S ユナイテッド海運	3,600	2,341.00	8,427,600
飯野海運	36,300	545.00	19,783,500
乾汽船	9,000	865.00	7,785,000
日本航空	124,400	4,309.00	536,039,600
A N A ホールディングス	130,200	4,306.00	560,641,200
トランコム	1,900	8,050.00	15,295,000
日新	6,000	2,811.00	16,866,000
三菱倉庫	23,100	2,474.00	57,149,400
三井倉庫ホールディングス	44,000	350.00	15,400,000
住友倉庫	48,000	749.00	35,952,000
澁澤倉庫	5,200	1,863.00	9,687,600
東陽倉庫	22,300	374.00	8,340,200

日本トランスシティ	22,000	506.00	11,132,000
川西倉庫	2,300	1,988.00	4,572,400
安田倉庫	8,700	1,018.00	8,856,600
東洋埠頭	3,600	1,722.00	6,199,200
上組	40,200	2,424.00	97,444,800
キューソー流通システム	2,400	2,837.00	6,808,800
近鉄エクスプレス	12,400	2,049.00	25,407,600
エーアイティー	6,300	1,201.00	7,566,300
NEC ネットエスアイ	7,500	2,892.00	21,690,000
システナ	5,800	4,070.00	23,606,000
デジタルアーツ	3,700	4,295.00	15,891,500
新日鉄住金ソリューションズ	10,000	3,010.00	30,100,000
キューブシステム	6,900	814.00	5,616,600
コア	3,800	1,464.00	5,563,200
ソリトンシステムズ	3,700	1,492.00	5,520,400
ソフトクリエイトホールディングス	5,000	1,700.00	8,500,000
T I S	23,300	4,335.00	101,005,500
電算システム	3,700	2,095.00	7,751,500
グリー	38,300	610.00	23,363,000
コーエーテクモホールディングス	11,800	2,134.00	25,181,200
三菱総合研究所	3,300	3,340.00	11,022,000
ファインデックス	8,600	713.00	6,131,800
ブレインパッド	2,000	2,697.00	5,394,000
K L a b	13,600	1,891.00	25,717,600
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	5,900	1,880.00	11,092,000
ネクソン	156,100	1,619.00	252,725,900
アイスタイル	17,800	1,443.00	25,685,400
エムアップ	3,000	1,555.00	4,665,000
エイチーム	5,300	2,291.00	12,142,300
テクノスジャパン	7,700	954.00	7,345,800
コロプラ	21,300	832.00	17,721,600
ブロードリーフ	37,600	528.00	19,852,800
ハーツユナイテッドグループ	4,600	1,744.00	8,022,400
メディアドゥホールディングス	2,900	1,862.00	5,399,800
フィックスターズ	7,200	1,405.00	10,116,000
VOYAGE GROUP	4,800	1,192.00	5,721,600
オブティム	1,700	2,549.00	4,333,300
セレス	2,700	1,864.00	5,032,800
ティーガイア	6,700	3,030.00	20,301,000
日本アジアグループ	11,000	552.00	6,072,000
豆蔵ホールディングス	6,600	1,299.00	8,573,400
テクマトリックス	4,800	1,658.00	7,958,400

ガンホー・オンライン・エンターテイメント	192,600	356.00	68,565,600
GMOペイメントゲートウェイ	5,500	10,810.00	59,455,000
インターネットイニシアティブ	11,800	2,082.00	24,567,600
さくらインターネット	9,900	790.00	7,821,000
ヴィンクス	2,200	1,740.00	3,828,000
GMOクラウド	2,300	2,407.00	5,536,100
SRAホールディングス	4,100	3,095.00	12,689,500
フリービット	6,400	1,117.00	7,148,800
コムチュア	4,400	3,645.00	16,038,000
インフォテリア	4,000	1,380.00	5,520,000
メディカル・データ・ビジョン	6,400	1,627.00	10,412,800
gumi	9,200	1,016.00	9,347,200
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	4,200	1,191.00	5,002,200
PCIホールディングス	1,700	3,040.00	5,168,000
オープンドア	3,300	2,057.00	6,788,100
アカツキ	2,000	4,900.00	9,800,000
LINE	20,600	4,015.00	82,709,000
オークネット	4,100	1,393.00	5,711,300
AOI TYO Holdings	6,600	1,562.00	10,309,200
マクロミル	8,400	2,882.00	24,208,800
フェイス	5,000	1,135.00	5,675,000
野村総合研究所	44,000	5,230.00	230,120,000
サイバネットシステム	7,900	861.00	6,801,900
インテージホールディングス	9,500	1,216.00	11,552,000
ソースネクスト	11,000	778.00	8,558,000
フォーカスシステムズ	5,600	934.00	5,230,400
クレスコ	1,800	3,755.00	6,759,000
フジ・メディア・ホールディングス	73,100	1,802.00	131,726,200
オービック	21,900	8,890.00	194,691,000
ジャストシステム	11,600	2,571.00	29,823,600
TDCソフト	4,800	1,335.00	6,408,000
ヤフー	498,600	449.00	223,871,400
トレンドマイクロ	34,000	6,450.00	219,300,000
日本オラクル	11,200	8,940.00	100,128,000
アルファシステムズ	3,300	2,300.00	7,590,000
フューチャー	11,100	1,272.00	14,119,200
CAC Holdings	7,900	1,105.00	8,729,500
ソフトバンク・テクノロジー	3,600	1,735.00	6,246,000
オービックビジネスコンサルタント	3,500	7,780.00	27,230,000
伊藤忠テクノソリューションズ	31,800	2,220.00	70,596,000
アイティフォー	11,300	879.00	9,932,700
大塚商会	41,500	5,030.00	208,745,000

サイボウズ	13,700	551.00	7,548,700
電通国際情報サービス	4,900	2,832.00	13,876,800
デジタルガレージ	12,800	3,620.00	46,336,000
E Mシステムズ	7,000	1,288.00	9,016,000
ウェザーニューズ	3,300	3,455.00	11,401,500
WOWOW	3,700	3,420.00	12,654,000
スカラ	7,700	822.00	6,329,400
イマジカ・ロボット ホールディングス	6,800	1,230.00	8,364,000
ネットワンシステムズ	28,600	1,546.00	44,215,600
アルゴグラフィックス	3,800	3,715.00	14,117,000
マーベラス	13,200	939.00	12,394,800
エイベックス	13,600	1,527.00	20,767,200
日本ユニシス	19,100	2,241.00	42,803,100
兼松エレクトロニクス	4,500	3,285.00	14,782,500
東京放送ホールディングス	38,800	2,381.00	92,382,800
日本テレビホールディングス	63,600	1,886.00	119,949,600
朝日放送グループホールディングス	9,700	878.00	8,516,600
テレビ朝日ホールディングス	19,600	2,525.00	49,490,000
スカパーJ S A Tホールディングス	52,500	495.00	25,987,500
テレビ東京ホールディングス	5,800	3,020.00	17,516,000
ビジョン	2,200	3,120.00	6,864,000
ワイヤレスゲート	4,400	1,434.00	6,309,600
コネクシオ	5,400	2,388.00	12,895,200
日本電信電話	498,000	5,192.00	2,585,616,000
K D D I	624,100	2,886.00	1,801,152,600
光通信	8,400	17,560.00	147,504,000
N T T ドコモ	498,100	2,788.50	1,388,951,850
エムティーアイ	11,400	669.00	7,626,600
G M O インターネット	25,700	1,956.00	50,269,200
カドカワ	20,300	1,178.00	23,913,400
学研ホールディングス	2,700	4,910.00	13,257,000
ゼンリン	13,100	2,204.00	28,872,400
アイネット	5,600	1,704.00	9,542,400
松竹	4,600	16,010.00	73,646,000
東宝	45,600	3,640.00	165,984,000
東映	2,600	12,260.00	31,876,000
エヌ・ティ・ティ・データ	213,400	1,167.00	249,037,800
D T S	7,300	3,880.00	28,324,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	32,300	4,590.00	148,257,000
シーイーシー	4,400	3,410.00	15,004,000
カブコン	30,500	2,105.00	64,202,500
ジャステック	5,800	1,237.00	7,174,600

SCSK	16,300	4,650.00	75,795,000
日本システムウエア	2,800	2,474.00	6,927,200
アイネス	11,300	1,163.00	13,141,900
TKC	5,900	4,335.00	25,576,500
富士ソフト	9,600	4,190.00	40,224,000
NSD	10,800	2,262.00	24,429,600
コナミホールディングス	28,500	5,310.00	151,335,000
福井コンピュータホールディングス	2,500	2,168.00	5,420,000
JBCホールディングス	8,000	1,111.00	8,888,000
ミロク情報サービス	6,400	3,105.00	19,872,000
ソフトバンクグループ	314,100	8,168.00	2,565,568,800
伊藤忠食品	1,900	6,080.00	11,552,000
エレマテック	3,800	2,410.00	9,158,000
JALUX	2,600	3,060.00	7,956,000
あらた	3,500	6,470.00	22,645,000
東京エレクトロン デバイス	3,800	2,118.00	8,048,400
フィールズ	6,700	1,193.00	7,993,100
双日	410,400	363.00	148,975,200
アルフレッサ ホールディングス	76,900	2,383.00	183,252,700
横浜冷凍	18,400	1,095.00	20,148,000
アルコニックス	8,000	2,039.00	16,312,000
神戸物産	4,500	5,180.00	23,310,000
ペッパーフードサービス	5,000	6,270.00	31,350,000
あい ホールディングス	10,700	2,928.00	31,329,600
ダイワボウホールディングス	5,900	4,995.00	29,470,500
マクニカ・富士エレホールディングス	13,000	1,883.00	24,479,000
ラクト・ジャパン	1,400	5,090.00	7,126,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	13,600	1,065.00	14,484,000
UKCホールディングス	5,400	2,326.00	12,560,400
ジュテックホールディングス	2,800	1,133.00	3,172,400
TOKAIホールディングス	37,300	1,117.00	41,664,100
三洋貿易	4,400	2,164.00	9,521,600
ウイン・パートナーズ	5,800	1,477.00	8,566,600
シップヘルスケアホールディングス	14,500	3,800.00	55,100,000
コメダホールディングス	14,100	2,189.00	30,864,900
小野建	7,200	1,934.00	13,924,800
佐島電機	7,600	1,101.00	8,367,600
伯東	5,300	1,632.00	8,649,600
コンドーテック	8,000	927.00	7,416,000
ナガイレーベン	9,400	2,910.00	27,354,000
三菱食品	6,900	3,205.00	22,114,500
松田産業	5,800	1,842.00	10,683,600

第一興商	10,700	5,630.00	60,241,000
メディバルホールディングス	69,400	2,299.00	159,550,600
萩原電気ホールディングス	2,900	3,065.00	8,888,500
アズワン	5,500	7,230.00	39,765,000
尾家産業	4,400	1,334.00	5,869,600
シモジマ	6,000	1,188.00	7,128,000
ドウシシャ	7,500	2,549.00	19,117,500
高速	6,400	1,376.00	8,806,400
丸文	8,400	983.00	8,257,200
ハピネット	5,400	1,521.00	8,213,400
日本ライフライン	20,000	3,195.00	63,900,000
エクセル	3,300	2,919.00	9,632,700
マルカキカイ	3,700	2,105.00	7,788,500
I D O M	22,100	807.00	17,834,700
日本エム・ディ・エム	6,500	1,014.00	6,591,000
進和	5,100	2,564.00	13,076,400
ダイトロン	4,100	2,126.00	8,716,600
シークス	9,000	2,231.00	20,079,000
オーハシテクニカ	5,600	1,823.00	10,208,800
伊藤忠商事	510,500	2,176.00	1,110,848,000
丸紅	573,400	822.00	471,334,800
長瀬産業	42,800	1,871.00	80,078,800
蝶理	5,400	2,110.00	11,394,000
豊田通商	76,800	3,915.00	300,672,000
三共生興	18,800	504.00	9,475,200
兼松	28,900	1,679.00	48,523,100
三井物産	591,400	1,966.00	1,162,692,400
日本紙パルプ商事	3,800	4,435.00	16,853,000
日立ハイテクノロジーズ	24,300	5,170.00	125,631,000
カメイ	9,700	1,517.00	14,714,900
スターゼン	2,900	5,520.00	16,008,000
山善	25,900	1,121.00	29,033,900
住友商事	439,500	1,951.00	857,464,500
内田洋行	3,800	3,110.00	11,818,000
三菱商事	488,400	3,017.00	1,473,502,800
第一実業	3,900	3,310.00	12,909,000
キャノンマーケティングジャパン	20,300	2,343.00	47,562,900
西華産業	5,000	2,821.00	14,105,000
佐藤商事	8,500	1,277.00	10,854,500
菱洋エレクトロ	7,300	1,824.00	13,315,200
東京産業	12,500	566.00	7,075,000
ユアサ商事	6,400	3,550.00	22,720,000

神鋼商事	2,000	3,825.00	7,650,000
阪和興業	13,300	4,690.00	62,377,000
正栄食品工業	4,100	4,160.00	17,056,000
カナデン	8,200	1,377.00	11,291,400
菱電商事	6,700	1,860.00	12,462,000
フルサト工業	5,700	1,884.00	10,738,800
岩谷産業	15,900	4,105.00	65,269,500
イワキ	14,000	404.00	5,656,000
三愛石油	18,600	1,708.00	31,768,800
稲畑産業	16,200	1,659.00	26,875,800
ワキタ	16,000	1,135.00	18,160,000
東邦ホールディングス	21,000	2,641.00	55,461,000
サンゲツ	24,000	2,250.00	54,000,000
ミツウロコグループホールディングス	12,500	885.00	11,062,500
シナネンホールディングス	4,200	2,809.00	11,797,800
伊藤忠エネクス	14,800	1,068.00	15,806,400
サンリオ	20,500	2,035.00	41,717,500
サンワテクノス	5,100	1,634.00	8,333,400
リョーサン	9,200	4,075.00	37,490,000
新光商事	8,300	1,918.00	15,919,400
トーヨー	4,100	2,623.00	10,754,300
三信電気	7,300	2,204.00	16,089,200
東陽テクニカ	11,000	988.00	10,868,000
モスフードサービス	8,900	3,315.00	29,503,500
加賀電子	6,400	2,771.00	17,734,400
ソーダニッカ	12,900	752.00	9,700,800
立花エレテック	5,500	2,111.00	11,610,500
PALTAC	9,500	5,430.00	51,585,000
三谷産業	13,600	464.00	6,310,400
太平洋興発	5,900	1,045.00	6,165,500
西本Wismettacホールディングス	2,000	4,450.00	8,900,000
ヤマタネ	5,200	1,970.00	10,244,000
日鉄住金物産	5,100	6,150.00	31,365,000
泉州電業	2,800	3,245.00	9,086,000
トラスコ中山	14,200	2,857.00	40,569,400
オートバックスセブン	28,400	2,054.00	58,333,600
モリト	7,900	1,028.00	8,121,200
加藤産業	10,400	3,990.00	41,496,000
イノテック	8,000	1,303.00	10,424,000
イエローハット	6,800	3,250.00	22,100,000
JKホールディングス	10,000	945.00	9,450,000
日伝	6,600	2,167.00	14,302,200

杉本商事	5,000	2,098.00	10,490,000
因幡電機産業	8,800	4,680.00	41,184,000
バイテックホールディングス	4,300	2,595.00	11,158,500
ミスミグループ本社	80,900	3,070.00	248,363,000
タキヒヨー	3,700	2,435.00	9,009,500
スズケン	31,600	4,605.00	145,518,000
ジェコス	6,500	1,209.00	7,858,500
ローソン	17,700	7,180.00	127,086,000
サンエー	5,100	5,770.00	29,427,000
カワチ薬品	5,500	2,743.00	15,086,500
エービーシー・マート	12,700	7,170.00	91,059,000
アスクル	6,100	3,415.00	20,831,500
ゲオホールディングス	13,200	1,823.00	24,063,600
アダストリア	11,000	1,959.00	21,549,000
くらコーポレーション	4,100	7,770.00	31,857,000
キャンドウ	5,000	1,828.00	9,140,000
パルグループホールディングス	4,000	2,947.00	11,788,000
エディオン	26,000	1,264.00	32,864,000
サーラコーポレーション	14,300	680.00	9,724,000
ハローズ	3,200	2,740.00	8,768,000
あみやき亭	1,900	5,270.00	10,013,000
ひらまつ	14,900	505.00	7,524,500
大黒天物産	2,000	5,640.00	11,280,000
ハニーズホールディングス	8,800	1,049.00	9,231,200
アルペン	5,900	2,381.00	14,047,900
クオール	8,000	2,223.00	17,784,000
ジーンズ	5,000	6,060.00	30,300,000
ビックカメラ	36,700	1,750.00	64,225,000
D C Mホールディングス	37,000	1,085.00	40,145,000
Monotaro	25,100	3,900.00	97,890,000
DDホールディングス	1,900	2,747.00	5,219,300
アーランドサービスホールディングス	6,300	2,359.00	14,861,700
J.フロント リテイリング	83,300	1,761.00	146,691,300
ドトール・日レスホールディングス	11,900	2,333.00	27,762,700
マツモトキヨシホールディングス	28,800	4,815.00	138,672,000
ブロンコビリー	3,800	4,145.00	15,751,000
スタートトゥデイ	68,700	3,085.00	211,939,500
物語コーポレーション	2,100	11,800.00	24,780,000
ココカラファイン	7,200	7,850.00	56,520,000
三越伊勢丹ホールディングス	130,400	1,200.00	156,480,000
Hamee	2,700	1,572.00	4,244,400
ウエルシアホールディングス	18,400	5,520.00	101,568,000

クリエイティブSDホールディングス	10,100	3,150.00	31,815,000
チムニー	2,700	2,902.00	7,835,400
シュッピン	4,800	1,230.00	5,904,000
ネクステージ	8,100	1,069.00	8,658,900
ジョイフル本田	10,100	3,755.00	37,925,500
鳥貴族	3,100	2,874.00	8,909,400
ホットランド	5,300	1,376.00	7,292,800
すかいらーく	44,100	1,592.00	70,207,200
綿半ホールディングス	3,000	3,935.00	11,805,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	20,200	1,427.00	28,825,400
あさひ	6,500	1,340.00	8,710,000
日本調剤	2,900	3,370.00	9,773,000
コスモス薬品	3,600	24,240.00	87,264,000
セブン&アイ・ホールディングス	291,800	4,762.00	1,389,551,600
薬王堂	3,300	3,685.00	12,160,500
クリエイティブ・レストランズ・ホールディング	18,800	1,313.00	24,684,400
ツルハホールディングス	15,100	15,450.00	233,295,000
サンマルクホールディングス	4,800	3,115.00	14,952,000
トリドールホールディングス	8,700	3,695.00	32,146,500
TOKYO BASE	6,800	1,058.00	7,194,400
パロックジャパンリミテッド	7,200	1,166.00	8,395,200
クスリのアオキホールディングス	5,500	7,260.00	39,930,000
力の源ホールディングス	1,800	2,125.00	3,825,000
スシローグローバルホールディングス	7,100	5,550.00	39,405,000
LIXILビバ	8,500	2,036.00	17,306,000
メディカルシステムネットワーク	11,000	554.00	6,094,000
総合メディカル	6,200	2,450.00	15,190,000
ノジマ	12,200	2,650.00	32,330,000
カッパ・クリエイティブ	11,000	1,344.00	14,784,000
ライトオン	8,300	1,027.00	8,524,100
良品計画	9,300	37,600.00	349,680,000
アドヴァン	9,000	992.00	8,928,000
アルビス	2,400	3,635.00	8,724,000
コナカ	14,000	595.00	8,330,000
G-7ホールディングス	2,600	2,438.00	6,338,800
コジマ	16,600	484.00	8,034,400
コーナン商事	9,900	2,904.00	28,749,600
エコス	4,600	1,872.00	8,611,200
ワタミ	10,000	1,492.00	14,920,000
ドンキホーテホールディングス	45,100	5,880.00	265,188,000
西松屋チェーン	15,500	1,327.00	20,568,500
ゼンショーホールディングス	36,700	2,531.00	92,887,700

幸楽苑ホールディングス	5,800	1,874.00	10,869,200
サイゼリヤ	10,400	2,517.00	26,176,800
V Tホールディングス	26,000	504.00	13,104,000
ユナイテッドアローズ	8,800	4,015.00	35,332,000
ハイデイ日高	9,200	2,848.00	26,201,600
京都きもの友禅	8,000	756.00	6,048,000
コロワイド	23,000	2,777.00	63,871,000
ピーシーデポコーポレーション	11,900	719.00	8,556,100
壱番屋	4,700	4,555.00	21,408,500
スギホールディングス	15,400	6,380.00	98,252,000
ヴィア・ホールディングス	12,800	691.00	8,844,800
スクロール	15,000	443.00	6,645,000
ヨンドシーホールディングス	7,300	2,723.00	19,877,900
ユニー・ファミリーマートホールディングス	22,200	10,450.00	231,990,000
木曽路	8,700	2,836.00	24,673,200
S R Sホールディングス	12,200	974.00	11,882,800
千趣会	15,300	583.00	8,919,900
ケーヨー	15,800	573.00	9,053,400
上新電機	8,200	4,455.00	36,531,000
日本瓦斯	12,800	5,380.00	68,864,000
ロイヤルホールディングス	12,300	2,963.00	36,444,900
いなげや	7,900	1,809.00	14,291,100
島忠	16,100	3,515.00	56,591,500
チヨダ	8,200	2,622.00	21,500,400
ライフコーポレーション	5,100	2,710.00	13,821,000
リンガーハット	9,000	2,641.00	23,769,000
MrMaxHD	10,500	768.00	8,064,000
AOKIホールディングス	13,600	1,668.00	22,684,800
オークワ	11,000	1,193.00	13,123,000
コメリ	11,500	2,933.00	33,729,500
青山商事	13,600	4,180.00	56,848,000
しまむら	8,100	12,700.00	102,870,000
高島屋	110,000	943.00	103,730,000
松屋	15,000	1,408.00	21,120,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	33,400	2,056.00	68,670,400
近鉄百貨店	2,800	3,900.00	10,920,000
パルコ	7,000	1,368.00	9,576,000
丸井グループ	67,000	2,234.00	149,678,000
アクシアル リテイリング	5,800	4,450.00	25,810,000
イオン	268,000	2,161.00	579,148,000
イズミ	12,700	7,120.00	90,424,000
平和堂	13,900	2,598.00	36,112,200

フジ	8,600	2,406.00	20,691,600
ヤオコー	7,700	6,010.00	46,277,000
ゼビオホールディングス	9,500	2,066.00	19,627,000
ケーズホールディングス	60,000	1,574.00	94,440,000
Olympicグループ	9,000	578.00	5,202,000
日産東京販売ホールディングス	15,700	407.00	6,389,900
Genky DrugStores	3,300	4,185.00	13,810,500
アインホールディングス	9,400	7,330.00	68,902,000
元気寿司	2,500	2,855.00	7,137,500
ヤマダ電機	233,400	566.00	132,104,400
アークランドサカモト	12,000	1,726.00	20,712,000
ニトリホールディングス	27,700	18,385.00	509,264,500
グルメ杵屋	7,000	1,173.00	8,211,000
吉野家ホールディングス	24,300	2,025.00	49,207,500
松屋フーズ	3,800	3,810.00	14,478,000
サガミチェーン	11,900	1,409.00	16,767,100
関西スーパーマーケット	6,900	1,207.00	8,328,300
王将フードサービス	5,000	5,450.00	27,250,000
プレナス	7,700	1,868.00	14,383,600
ミニストップ	5,700	2,265.00	12,910,500
アークス	12,700	2,997.00	38,061,900
パローホールディングス	16,700	3,055.00	51,018,500
ベルク	3,000	5,810.00	17,430,000
大庄	5,200	1,717.00	8,928,400
ファーストリテイリング	9,300	47,290.00	439,797,000
サンドラッグ	29,400	5,570.00	163,758,000
サックスパー ホールディングス	7,900	1,179.00	9,314,100
ベルーナ	17,400	1,272.00	22,132,800
じもとホールディングス	55,300	193.00	10,672,900
めぶきフィナンシャルグループ	359,000	425.00	152,575,000
東京ＴＹフィナンシャルグループ	9,800	2,928.00	28,694,400
九州フィナンシャルグループ	115,900	540.00	62,586,000
ゆうちょ銀行	196,100	1,513.00	296,699,300
富山第一銀行	19,300	509.00	9,823,700
コンコルディア・フィナンシャルグループ	417,800	634.00	264,885,200
西日本フィナンシャルホールディングス	45,000	1,338.00	60,210,000
関西みらいフィナンシャルグループ	29,900	870.00	26,013,000
三十三フィナンシャルグループ	5,500	2,315.00	12,732,500
新生銀行	60,700	1,716.00	104,161,200
あおぞら銀行	41,600	4,410.00	183,456,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	4,883,300	745.70	3,641,476,810
りそなホールディングス	764,100	626.60	478,785,060

三井住友トラスト・ホールディングス	136,500	4,695.00	640,867,500
三井住友フィナンシャルグループ	528,000	4,638.00	2,448,864,000
第四銀行	8,800	4,965.00	43,692,000
北越銀行	7,000	2,453.00	17,171,000
千葉銀行	246,500	888.00	218,892,000
群馬銀行	142,700	646.00	92,184,200
武蔵野銀行	11,000	3,665.00	40,315,000
千葉興業銀行	18,900	515.00	9,733,500
筑波銀行	28,500	382.00	10,887,000
七十七銀行	22,500	2,724.00	61,290,000
青森銀行	5,500	3,390.00	18,645,000
秋田銀行	4,100	3,035.00	12,443,500
山形銀行	7,800	2,416.00	18,844,800
岩手銀行	5,000	4,370.00	21,850,000
東邦銀行	58,900	427.00	25,150,300
東北銀行	4,500	1,480.00	6,660,000
みちのく銀行	5,300	1,784.00	9,455,200
ふくおかフィナンシャルグループ	285,000	593.00	169,005,000
静岡銀行	180,900	1,104.00	199,713,600
十六銀行	9,300	2,918.00	27,137,400
スルガ銀行	71,100	1,435.00	102,028,500
八十二銀行	122,600	584.00	71,598,400
山梨中央銀行	44,000	474.00	20,856,000
大垣共立銀行	11,500	2,755.00	31,682,500
福井銀行	6,600	2,514.00	16,592,400
北國銀行	8,200	4,445.00	36,449,000
清水銀行	2,900	3,130.00	9,077,000
富山銀行	1,700	4,040.00	6,868,000
滋賀銀行	67,000	559.00	37,453,000
南都銀行	8,200	3,055.00	25,051,000
百五銀行	62,200	514.00	31,970,800
京都銀行	26,600	6,490.00	172,634,000
紀陽銀行	27,000	1,796.00	48,492,000
ほくほくフィナンシャルグループ	46,900	1,619.00	75,931,100
広島銀行	103,100	838.00	86,397,800
山陰合同銀行	42,000	1,021.00	42,882,000
中国銀行	49,100	1,278.00	62,749,800
伊予銀行	99,900	868.00	86,713,200
百十四銀行	71,000	372.00	26,412,000
四国銀行	11,700	1,632.00	19,094,400
阿波銀行	54,000	724.00	39,096,000
大分銀行	4,300	4,090.00	17,587,000

宮崎銀行	5,100	3,640.00	18,564,000
佐賀銀行	4,800	2,524.00	12,115,200
十八銀行	48,000	294.00	14,112,000
沖縄銀行	6,700	4,620.00	30,954,000
琉球銀行	14,100	1,679.00	23,673,900
セブン銀行	262,500	366.00	96,075,000
みずほフィナンシャルグループ	9,475,500	199.10	1,886,572,050
山口フィナンシャルグループ	87,000	1,403.00	122,061,000
名古屋銀行	5,800	4,115.00	23,867,000
北洋銀行	105,000	373.00	39,165,000
愛知銀行	2,600	5,260.00	13,676,000
中京銀行	2,700	2,358.00	6,366,600
大光銀行	3,000	2,369.00	7,107,000
愛媛銀行	11,000	1,336.00	14,696,000
京葉銀行	59,000	504.00	29,736,000
栃木銀行	38,100	421.00	16,040,100
北日本銀行	2,500	2,881.00	7,202,500
東和銀行	13,300	1,488.00	19,790,400
大東銀行	4,200	1,333.00	5,598,600
トモニホールディングス	59,000	495.00	29,205,000
フィデアホールディングス	74,500	194.00	14,453,000
池田泉州ホールディングス	72,800	429.00	31,231,200
F P G	24,200	1,359.00	32,887,800
S B Iホールディングス	79,300	2,660.00	210,938,000
ジャフコ	10,200	5,050.00	51,510,000
大和証券グループ本社	592,000	681.00	403,152,000
野村ホールディングス	1,199,200	641.40	769,166,880
岡三証券グループ	60,000	642.00	38,520,000
丸三証券	23,000	1,052.00	24,196,000
東洋証券	28,000	295.00	8,260,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	78,200	801.00	62,638,200
水戸証券	22,000	430.00	9,460,000
いちよし証券	15,000	1,353.00	20,295,000
松井証券	35,000	1,068.00	37,380,000
マネックスグループ	73,100	670.00	48,977,000
カブドットコム証券	46,900	407.00	19,088,300
極東証券	10,000	1,625.00	16,250,000
岩井コスモホールディングス	7,000	1,515.00	10,605,000
藍澤証券	13,000	796.00	10,348,000
マネーパートナーズグループ	10,000	433.00	4,330,000
かんぽ生命保険	26,800	2,704.00	72,467,200
S O M P Oホールディングス	136,600	4,545.00	620,847,000

アニコム ホールディングス	5,000	3,625.00	18,125,000	
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	182,400	3,681.00	671,414,400	
ソニーフィナンシャルホールディングス	58,000	2,087.00	121,046,000	
第一生命ホールディングス	394,200	2,199.00	866,845,800	
東京海上ホールディングス	262,700	5,124.00	1,346,074,800	
アドバンテッジリスクマネジメント	3,600	1,366.00	4,917,600	
T & Dホールディングス	215,200	1,897.00	408,234,400	
全国保証	20,400	4,575.00	93,330,000	
アルヒ	7,600	1,519.00	11,544,400	
クレディセゾン	53,500	1,931.00	103,308,500	
芙蓉総合リース	7,900	7,330.00	57,907,000	
興銀リース	12,700	3,015.00	38,290,500	
東京センチュリー	14,000	6,790.00	95,060,000	
日本証券金融	32,000	720.00	23,040,000	
アイフル	123,500	368.00	45,448,000	
リコーリース	5,300	3,625.00	19,212,500	
イオンフィナンシャルサービス	49,600	2,546.00	126,281,600	
アコム	142,300	495.00	70,438,500	
ジャックス	9,000	2,469.00	22,221,000	
オリエントコーポレーション	142,700	171.00	24,401,700	
日立キャピタル	19,900	2,892.00	57,550,800	
オリックス	463,600	1,917.00	888,721,200	
三菱UFJリース	176,600	684.00	120,794,400	
日本取引所グループ	201,000	2,001.00	402,201,000	
イー・ギャランティ	4,800	2,174.00	10,435,200	
NECキャピタルソリューション	3,700	2,088.00	7,725,600	
いちご	100,200	473.00	47,394,600	
日本駐車場開発	92,300	182.00	16,798,600	
ヒューリック	145,000	1,168.00	169,360,000	
三栄建築設計	3,300	1,870.00	6,171,000	
スター・マイカ	3,600	2,386.00	8,589,600	
野村不動産ホールディングス	46,400	2,627.00	121,892,800	
三重交通グループホールディングス	17,500	522.00	9,135,000	
サムティ	6,800	2,055.00	13,974,000	
日本商業開発	4,700	1,791.00	8,417,700	
プレサンスコーポレーション	9,900	1,660.00	16,434,000	
ユニゾホールディングス	8,700	2,603.00	22,646,100	
日本管理センター	5,800	1,596.00	9,256,800	
フージャースホールディングス	17,900	795.00	14,230,500	
オープンハウス	11,200	6,030.00	67,536,000	
東急不動産ホールディングス	166,500	841.00	140,026,500	
飯田グループホールディングス	57,400	2,139.00	122,778,600	

ムゲンエステート	5,600	1,387.00	7,767,200
ハウスドゥ	1,200	4,160.00	4,992,000
ケアイスター不動産	2,800	2,943.00	8,240,400
パーク24	39,300	3,085.00	121,240,500
パラカ	3,400	2,437.00	8,285,800
三井不動産	347,700	2,777.00	965,562,900
三菱地所	518,800	1,930.00	1,001,284,000
平和不動産	12,500	2,417.00	30,212,500
東京建物	76,300	1,593.00	121,545,900
ダイビル	18,100	1,275.00	23,077,500
京阪神ビルディング	15,700	920.00	14,444,000
住友不動産	167,000	4,202.00	701,734,000
大京	10,700	2,360.00	25,252,000
テーオーシー	24,800	979.00	24,279,200
東京楽天地	1,900	5,430.00	10,317,000
レオパレス21	83,900	949.00	79,621,100
スターツコーポレーション	9,000	2,979.00	26,811,000
フジ住宅	12,900	940.00	12,126,000
空港施設	12,900	633.00	8,165,700
ゴールドクレスト	6,100	2,316.00	14,127,600
日本エスリード	3,700	2,019.00	7,470,300
日神不動産	10,800	810.00	8,748,000
日本エスコン	14,100	930.00	13,113,000
タカラレーベン	33,600	467.00	15,691,200
サンヨーハウジング名古屋	6,500	1,183.00	7,689,500
イオンモール	44,900	2,178.00	97,792,200
カチタス	9,000	3,485.00	31,365,000
トーセイ	10,100	1,334.00	13,473,400
エヌ・ティ・ティ都市開発	43,900	1,268.00	55,665,200
サンフロンティア不動産	9,300	1,329.00	12,359,700
エフ・ジェー・ネクスト	7,200	851.00	6,127,200
日本空港ビルデング	20,500	4,490.00	92,045,000
日本工営	4,800	3,260.00	15,648,000
LIFULL	24,300	887.00	21,554,100
ジェイエイシーリクルートメント	6,100	2,238.00	13,651,800
日本M&Aセンター	47,100	3,235.00	152,368,500
タケエイ	8,700	1,326.00	11,536,200
トラスト・テック	3,300	3,505.00	11,566,500
コシダカホールディングス	4,300	6,660.00	28,638,000
パソナグループ	6,700	1,844.00	12,354,800
リンクアンドモチベーション	13,100	1,110.00	14,541,000
GCA	9,500	973.00	9,243,500

エス・エム・エス	13,500	4,185.00	56,497,500
パーソルホールディングス	62,100	2,666.00	165,558,600
リニカル	5,400	1,757.00	9,487,800
クックパッド	23,900	624.00	14,913,600
学情	4,000	1,346.00	5,384,000
スタジオアリス	4,300	2,430.00	10,449,000
シミックホールディングス	4,700	2,494.00	11,721,800
総合警備保障	26,800	5,350.00	143,380,000
カカクコム	51,600	2,091.00	107,895,600
アイロムグループ	3,000	2,646.00	7,938,000
ルネサンス	4,600	1,904.00	8,758,400
ディップ	9,500	2,692.00	25,574,000
オプトホールディング	6,100	1,606.00	9,796,600
ツクイ	17,600	855.00	15,048,000
エムスリー	71,200	4,150.00	295,480,000
アウトソーシング	20,100	1,834.00	36,863,400
ウェルネット	7,400	1,180.00	8,732,000
ワールドホールディングス	2,400	4,005.00	9,612,000
ディー・エヌ・エー	36,900	2,128.00	78,523,200
博報堂D Yホールディングス	92,800	1,525.00	141,520,000
ぐるなび	11,500	1,503.00	17,284,500
エスアールジータカミヤ	10,700	670.00	7,169,000
ジャパンベストレスキューシステム	8,900	806.00	7,173,400
ファンコミュニケーションズ	20,200	692.00	13,978,400
ライク	3,200	1,947.00	6,230,400
WDBホールディングス	3,400	3,470.00	11,798,000
バリューコマース	7,900	1,651.00	13,042,900
インフォマート	35,100	1,011.00	35,486,100
J Pホールディングス	27,400	326.00	8,932,400
E P Sホールディングス	10,500	2,219.00	23,299,500
プレステージ・インターナショナル	15,000	1,265.00	18,975,000
アミューズ	4,800	3,175.00	15,240,000
ドリームインキュベータ	3,100	2,614.00	8,103,400
クイック	5,100	1,794.00	9,149,400
ケネディクス	91,200	623.00	56,817,600
電通	82,000	5,160.00	423,120,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	4,600	1,143.00	5,257,800
ぴあ	2,400	6,300.00	15,120,000
イオンファンタジー	2,400	5,770.00	13,848,000
シーティーエス	8,500	762.00	6,477,000
ネクシィーズグループ	3,200	1,708.00	5,465,600
みらかホールディングス	20,500	4,270.00	87,535,000

アルプス技研	6,200	2,599.00	16,113,800
日本空調サービス	10,100	775.00	7,827,500
オリエンタルランド	79,800	10,900.00	869,820,000
ダスキン	18,700	2,740.00	51,238,000
明光ネットワークジャパン	10,600	1,242.00	13,165,200
ファルコホールディングス	5,500	1,862.00	10,241,000
ラウンドワン	21,500	1,576.00	33,884,000
リゾートトラスト	29,000	2,252.00	65,308,000
ビー・エム・エル	8,800	2,760.00	24,288,000
りらいあコミュニケーションズ	10,700	1,364.00	14,594,800
リソー教育	13,600	838.00	11,396,800
ユー・エス・エス	82,800	2,277.00	188,535,600
サイバーエージェント	41,700	5,290.00	220,593,000
楽天	348,800	772.50	269,448,000
クリーク・アンド・リバー社	4,500	1,193.00	5,368,500
テー・オー・ダブリュー	8,700	957.00	8,325,900
セントラルスポーツ	3,100	3,785.00	11,733,500
フルキャストホールディングス	5,900	2,369.00	13,977,100
テクノプロ・ホールディングス	12,400	6,380.00	79,112,000
Gunosy	4,500	1,623.00	7,303,500
イー・ガーディアン	3,700	3,370.00	12,469,000
ジャパンマテリアル	18,700	1,392.00	26,030,400
ベクトル	8,500	2,018.00	17,153,000
I B J	6,600	979.00	6,461,400
アサンテ	4,100	1,955.00	8,015,500
N・フィールド	4,800	2,062.00	9,897,600
バリューHR	2,600	1,967.00	5,114,200
M&Aキャピタルパートナーズ	1,800	7,800.00	14,040,000
アビスト	1,300	4,670.00	6,071,000
シグマクシス	4,100	1,915.00	7,851,500
ウィルグループ	3,700	1,338.00	4,950,600
エスクロー・エージェント・ジャパン	11,000	429.00	4,719,000
リクルートホールディングス	521,300	2,547.00	1,327,751,100
日本郵政	383,700	1,336.00	512,623,200
ベルシステム24ホールディングス	11,600	1,713.00	19,870,800
鎌倉新書	1,400	3,695.00	5,173,000
ストライク	900	6,820.00	6,138,000
ソラスト	4,800	2,786.00	13,372,800
インソース	2,600	2,166.00	5,631,600
MS - J a p a n	800	6,610.00	5,288,000
日総工産	1,100	4,185.00	4,603,500
キュービーネットホールディングス	3,300	2,054.00	6,778,200

リログループ	37,200	2,490.00	92,628,000	
東祥	4,400	3,960.00	17,424,000	
エイチ・アイ・エス	10,400	3,980.00	41,392,000	
共立メンテナンス	12,000	5,150.00	61,800,000	
イチネンホールディングス	8,900	1,480.00	13,172,000	
建設技術研究所	7,000	1,506.00	10,542,000	
スペース	5,700	1,498.00	8,538,600	
東京テアトル	4,800	1,455.00	6,984,000	
ナガワ	1,500	4,680.00	7,020,000	
よみうりランド	2,100	4,755.00	9,985,500	
東京都競馬	5,300	4,175.00	22,127,500	
常磐興産	4,300	1,943.00	8,354,900	
カナモト	10,400	3,655.00	38,012,000	
東京ドーム	28,000	1,056.00	29,568,000	
西尾レントオール	6,200	3,270.00	20,274,000	
トランス・コスモス	7,300	3,015.00	22,009,500	
乃村工藝社	15,600	2,206.00	34,413,600	
藤田観光	3,400	3,290.00	11,186,000	
KNT-CTホールディングス	4,900	1,794.00	8,790,600	
日本管財	6,800	2,081.00	14,150,800	
トーカイ	6,600	2,412.00	15,919,200	
セコム	71,400	8,200.00	585,480,000	
セントラル警備保障	4,100	3,850.00	15,785,000	
丹青社	13,900	1,300.00	18,070,000	
メイテック	8,200	6,000.00	49,200,000	
応用地質	9,000	1,540.00	13,860,000	
船井総研ホールディングス	14,100	2,523.00	35,574,300	
オオバ	11,300	638.00	7,209,400	
ベネッセホールディングス	25,000	4,005.00	100,125,000	
イオンディライト	8,100	3,835.00	31,063,500	
ナック	7,400	937.00	6,933,800	
ニチイ学館	13,700	1,259.00	17,248,300	
ダイセキ	11,300	3,350.00	37,855,000	
合計	85,214,600		179,158,324,620	

(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

	(平成29年 4月26日現在)	(平成30年 4月26日現在)
(単位:円)		
資産の部		
流動資産		
預金	1,853,599,989	1,452,065,233
金銭信託	66,471,201	250,821,542
コール・ローン	138,302,371	38,181,025
株式	197,388,118,688	170,304,759,182
投資証券	5,147,098,719	3,800,076,025
派生商品評価勘定	83,317,769	50,433,327
未収入金	277,846,426	58,878,268
未収配当金	282,449,027	264,940,937
前払金	-	5,446,384
差入委託証拠金	1,722,543,431	2,148,510,347
流動資産合計	206,959,747,621	178,374,112,270
資産合計	206,959,747,621	178,374,112,270
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	7,796,112	56,072,971
前受金	77,937,995	-
未払金	-	72,330,014
未払解約金	610,757,602	266,432,845
未払利息	401	111
その他未払費用	5,591	29,313
流動負債合計	696,497,701	394,865,254
負債合計	696,497,701	394,865,254
純資産の部		
元本等		
元本	67,999,201,436	53,208,560,898
剰余金		
剰余金又は欠損金()	138,264,048,484	124,770,686,118
元本等合計	206,263,249,920	177,979,247,016
純資産合計	206,263,249,920	177,979,247,016
負債純資産合計	206,959,747,621	178,374,112,270

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30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29年 4月26日現在)	(平成30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	67,999,201,436口	53,208,560,898口
2. 1単位当たり純資産の額	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)	1口当たり純資産額 3.3449円 (10,000口当たりの純資産額 33,449円)

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成29年 4月27日 至 平成30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、株式、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

. 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成30年 4月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 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	3,622,372,706	-	3,700,310,701	77,937,995
	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
市場取引以外の取引	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
イスラエルシケル	1,509,120	-	1,528,500	19,380
合計	4,488,458,748	-	4,576,889,801	75,521,657

(平成30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	3,583,051,456	-	3,577,605,072	5,446,384
	SPMINI 1806	2,502,814,566	-	2,459,794,897	43,019,669
	DJ EUR 1806	651,709,944	-	678,216,069	26,506,125
	FTSE 1806	246,297,808	-	257,128,646	10,830,838

市場取引以外の取引	SPI200 1806	182,229,138	-	182,465,460	236,322
	為替予約取引				
	売建	385,357,540	-	385,550,800	193,260
	米ドル	317,065,700	-	317,231,000	165,300
	カナダドル	17,043,400	-	17,048,000	4,600
	ユーロ	13,316,000	-	13,321,000	5,000
	英ポンド	3,049,540	-	3,051,400	1,860
	スイスフラン	15,580,600	-	15,590,400	9,800
	スウェーデンクローナ	5,367,600	-	5,371,800	4,200
	ノルウェークローネ	1,373,000	-	1,374,000	1,000
	デンマーククローネ	1,787,100	-	1,788,000	900
	香港ドル	7,388,200	-	7,388,200	-
	シンガポールドル	2,472,300	-	2,472,900	600
	イスラエルシェケル	914,100	-	914,100	-
合計	3,968,408,996	-	3,963,155,872	5,639,644	

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

(2) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 平成29年 4月27日

至 平成30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
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)	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
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)	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
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>	2,752,885,982円
S M A M・バランスファンドVA25 <適格機関投資家専用>	2,669,039,616円
S M A M・バランスファンドVA37.5 <適格機関投資家専用>	2,174,701,240円
S M A M・バランスファンドVA50 <適格機関投資家専用>	9,165,841,912円
S M A M・バランスファンドVL30 <適格機関投資家限定>	25,330,001円
S M A M・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
S M A M・バランスファンドVA75 <適格機関投資家専用>	1,113,631,695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>	88,388,252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>	238,655,942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>	1,077,432,916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 >	1,860,359,937円
S M A M ・ バランスファンド V A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	2,379,275,574円
S M A M ・ バランス V A 株 4 0 T < 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・ V A S (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・ V A S (適格機関投資家専用)	1,515,857,893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 >	202,333,290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 >	109,430,512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)	1,680,619,492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

(平成30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	67,999,201,436円
同期中における追加設定元本額	6,479,607,105円
同期中における一部解約元本額	21,270,247,643円
平成30年 4月26日現在における元本の内訳	
三井住友・ D C 外国株式インデックスファンド S	12,314,303,411円
三井住友・ D C 年金バランス 3 0 (債券重点型)	265,807,738円
三井住友・ D C 年金バランス 5 0 (標準型)	1,097,241,211円
三井住友・ D C 年金バランス 7 0 (株式重点型)	768,789,110円
S M A M ・ グローバルバランスファンド (機動的資産配分型)	99,268,143円
三井住友・ D C ターゲットイヤーファンド 2 0 2 0 (4 資産タイプ)	2,657,747円
三井住友・ D C ターゲットイヤーファンド 2 0 2 5 (4 資産タイプ)	7,967,224円
三井住友・ D C ターゲットイヤーファンド 2 0 3 0 (4 資産タイプ)	21,829,082円
三井住友・ D C ターゲットイヤーファンド 2 0 3 5 (4 資産タイプ)	33,957,710円
三井住友・ D C ターゲットイヤーファンド 2 0 4 0 (4 資産タイプ)	21,980,577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)	61,426,602円
外国株式指数ファンド	478,323,794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	1,846,490,389円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	464,151,919円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	509,991,846円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	447,374,259円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	2,814,247円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	258,118円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	1,299,824円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	9,140,697円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	9,485,296円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	36,120,520円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	3,714,765円
SMAM・外国株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,861,016,759円
バランスファンドVA(安定運用型)〈適格機関投資家限定〉	11,989,163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〉	761,175,839円
SMAM・バランスファンドVA25〈適格機関投資家専用〉	2,087,096,531円
SMAM・バランスファンドVA37.5〈適格機関投資家専用〉	1,831,931,763円
SMAM・バランスファンドVA50〈適格機関投資家専用〉	7,621,846,055円
SMAM・バランスファンドVL30〈適格機関投資家限定〉	23,184,564円
SMAM・バランスファンドVL50〈適格機関投資家限定〉	123,614,027円
世界6資産バランスファンドVA〈適格機関投資家限定〉	772,703円
SMAM・バランスファンドVA75〈適格機関投資家専用〉	953,214,100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〉	69,063,912円
SMAM・インデックス・バランスVA25〈適格機関投資家専用〉	210,826,290円
SMAM・インデックス・バランスVA50〈適格機関投資家専用〉	903,886,602円
SMAM・バランスファンドVA40〈適格機関投資家専用〉	928,182,271円
SMAM・バランスファンドVA35〈適格機関投資家専用〉	1,984,404,007円
SMAM・バランスVA株40T〈適格機関投資家限定〉	45,952,710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)	880,224,993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)	1,195,139,569円
SMAM・グローバルバランス40VA〈適格機関投資家限定〉	173,816,287円
SMAM・バランスファンドVA20〈適格機関投資家専用〉	89,537,244円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,378,857,819円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A〈適格機関投資家専用〉	29,139,560円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A〈適格機関投資家専用〉	14,944,131円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A〈適格機関投資家専用〉	7,525,974円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L〈適格機関投資家専用〉	58,355,726円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L〈適格機関投資家専用〉	136,603,968円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T〈適格機関投資家専用〉	135,776,870円
SMAM・グローバルバランスファンド(標準型)VA〈適格機関投資家限定〉	1,427,941,057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〉	210,986,415円
SMAM・世界バランスファンドVA〈適格機関投資家限定〉	7,498,908,615円
SMAM・世界バランスファンドVA2〈適格機関投資家限定〉	743,105,133円
SMAM・外国株式インデックスファンドSA〈適格機関投資家限定〉	87,684,238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〉	8,596,819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〉	84,319,064円

S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド 2 0 1 6 - 0 5 < 適格機関投資家限定 >	40,344,880円
S M A M ・ マルチアセットストラテジー・オープン < 適格機関投資家限定 >	84,186,466円
S M A M ・ マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド < 適格機関投資家限定 >	14,545円
合計	53,208,560,898円

附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	24,280	66.83	1,622,632.40	
	ANDEAVOR	6,701	120.09	804,723.09	
	ANTERO RESOURCES CORP	9,233	19.21	177,365.93	
	APACHE CORPORATION	16,399	41.00	672,359.00	
	BAKER HUGHES A GE CO	16,513	35.11	579,771.43	
	CABOT OIL & GAS CORPORATION	19,632	23.17	454,873.44	
	CHENIERE ENERGY INC	8,184	57.80	473,035.20	
	CHEVRON CORPORATION	83,703	122.72	10,272,032.16	
	CIMAREX ENERGY CO	4,080	101.39	413,671.20	
	CONCHO RESOURCES INC	6,589	154.60	1,018,659.40	
	CONOCOPHILLIPS	52,158	65.06	3,393,399.48	
	CONTINENTAL RESOURCES, INC.	4,535	65.37	296,452.95	
	DEVON ENERGY CORPORATION	22,056	35.20	776,371.20	
	DIAMONDBACK ENERGY INC	3,558	125.75	447,418.50	
	EOG RESOURCES INC	25,021	115.40	2,887,423.40	
	EQT CORPORATION	11,310	46.95	531,004.50	
	EXXON MOBIL CORPORATION	186,473	79.50	14,824,603.50	
	HALLIBURTON CO	38,995	51.75	2,017,991.25	
	HELMERICH & PAYNE INC	5,249	72.13	378,610.37	
	HESS CORPORATION	12,398	59.34	735,697.32	
	HOLLYFRONTIER CORP	6,601	59.63	393,617.63	
	KINDER MORGAN INC	85,839	16.26	1,395,742.14	
	MARATHON OIL CORP	36,817	17.97	661,601.49	
	MARATHON PETROLEUM CORPORATION	21,936	80.23	1,759,925.28	
	NATIONAL-OILWELL VARCO INC.	16,848	38.28	644,941.44	
	NEWFIELD EXPLORATION CO	8,254	29.38	242,502.52	
NOBLE ENERGY INC	20,924	33.86	708,486.64		
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	34,086	77.36	2,636,892.96		
ONEOK INC	16,822	59.60	1,002,591.20		

PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	9,208	30.03	276,516.24
PHILLIPS 66	19,267	109.79	2,115,323.93
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	7,478	198.90	1,487,374.20
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	7,806	24.70	192,808.20
RANGE RESOURCES CORPORATION	12,946	13.54	175,288.84
SCHLUMBERGER LTD	60,206	69.10	4,160,234.60
TARGA RESOURCES CORP	8,672	46.75	405,416.00
TECHNIPFMC PLC	18,187	33.56	610,355.72
VALERO ENERGY CORP	19,549	108.68	2,124,585.32
WILLIAMS COS INC	37,449	25.62	959,443.38
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	9,800	165.57	1,622,586.00
ALBEMARLE CORPORATION	5,093	95.46	486,177.78
AVERY DENNISON CORP	3,941	106.67	420,386.47
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	10,777	30.74	331,284.98
BALL CORPORATION	13,670	40.22	549,807.40
CELANESE CORPORATION	5,647	109.56	618,685.32
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	10,139	39.61	401,605.79
CHEMOURS CO	8,067	50.92	410,771.64
CROWN HOLDINGS INC	5,272	50.08	264,021.76
DOWDUPONT INC	102,761	63.64	6,539,710.04
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	5,956	105.15	626,273.40
ECOLAB INC	11,670	145.17	1,694,133.90
FMC CORPORATION	5,698	80.56	459,030.88
FREEMONT-MCMORAN INC	60,238	15.37	925,858.06
INTERNATIONAL PAPER CO	17,131	53.48	916,165.88
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	3,501	140.25	491,015.25
LYONDELLBASELL INDU-CL A	14,870	105.39	1,567,149.30
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,577	196.24	505,710.48
MONSANTO CO	19,036	124.68	2,373,408.48
MOSAIC CO/THE	15,550	27.00	419,850.00
NEWMONT MINING CORP	23,519	40.52	952,989.88
NUCOR CORP	14,127	63.18	892,543.86
PACKAGING CORP OF AMERICA	4,046	117.91	477,063.86
PPG INDUSTRIES INC	11,270	107.88	1,215,807.60
PRAXAIR INC	12,573	149.75	1,882,806.75
SEALED AIR CORP	7,922	43.93	348,013.46
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	3,778	372.72	1,408,136.16
STEEL DYNAMICS, INC.	10,191	46.35	472,352.85
VULCAN MATERIALS CO	5,483	112.12	614,753.96
WESTROCK CO	11,330	65.10	737,583.00
WR GRACE & CO	3,500	68.85	240,975.00
3M COMPANY	26,156	198.84	5,200,859.04

ACUITY BRANDS INC	1,884	126.80	238,891.20
AERCAP HOLDINGS NV	6,145	52.26	321,137.70
AGCO CORP	2,297	63.57	146,020.29
ALLEGION PLC	4,545	83.03	377,371.35
AMETEK INC	10,396	71.95	747,992.20
ARCONIC INC	19,024	22.15	421,381.60
BOEING CO	24,939	342.86	8,550,585.54
CATERPILLAR INC	26,127	145.19	3,793,379.13
CUMMINS INC	6,990	162.14	1,133,358.60
DEERE & CO	11,993	138.00	1,655,034.00
DOVER CORP	6,689	94.94	635,053.66
EATON CORP PLC	18,883	76.73	1,448,892.59
EMERSON ELECTRIC CO	28,186	68.71	1,936,660.06
FASTENAL COMPANY	12,895	49.57	639,205.15
FLOWSERVE CORPORATION	6,566	46.00	302,036.00
FLUOR CORP	5,677	59.64	338,576.28
FORTIVE CORP	13,617	72.20	983,147.40
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY	6,450	56.03	361,393.50
GENERAL DYNAMICS CORP	11,029	214.53	2,366,051.37
GENERAL ELECTRIC CO	382,731	14.05	5,377,370.55
HARRIS CORP	4,981	161.16	802,737.96
HD SUPPLY HOLDINGS INC	7,787	38.21	297,541.27
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	31,994	147.06	4,705,037.64
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES	1,832	252.50	462,580.00
IDEX CORP	3,078	137.84	424,271.52
ILLINOIS TOOL WORKS	13,541	151.60	2,052,815.60
INGERSOLL-RAND PLC	11,061	85.16	941,954.76
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	4,922	58.64	288,626.08
JARDINE MATHESON HOLDINGS LIMITED	9,400	61.51	578,194.00
JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LIMITED	9,100	38.13	346,983.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	39,553	33.79	1,336,495.87
L3 TECHNOLOGIES INC	3,361	202.00	678,922.00
LENNOX INTERNATIONAL INC	1,823	194.33	354,263.59
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	11,333	329.50	3,734,223.50
MASCO CORP	14,295	37.17	531,345.15
MIDDLEBY CORP	2,764	126.23	348,899.72
NORTHROP GRUMMAN CORP	7,169	332.62	2,384,552.78
OWENS CORNING	4,859	67.46	327,788.14
PACCAR INC	15,381	64.90	998,226.90
PARKER HANNIFIN CORPORATION	5,939	168.27	999,355.53
PENTAIR PLC-REGISTERED	7,006	67.64	473,885.84
RAYTHEON COMPANY	12,577	213.69	2,687,579.13

ROCKWELL AUTOMATION INC	5,618	167.30	939,891.40
ROCKWELL COLLINS INC	7,154	133.30	953,628.20
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,481	267.82	1,200,101.42
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	8,127	51.79	420,897.33
SMITH(A.O.) CORP	6,960	61.50	428,040.00
SNAP-ON INC	2,448	146.36	358,289.28
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD CL A	5,166	78.86	407,390.76
STANLEY BLACK & DECKER INC	6,734	143.21	964,376.14
TEXTRON INC	12,033	63.46	763,614.18
TRANSDIGM GROUP INC	2,341	324.38	759,373.58
UNITED RENTALS INC	3,677	157.88	580,524.76
UNITED TECHNOLOGIES CORP	33,562	121.45	4,076,104.90
WABCO HOLDINGS INC	2,109	130.33	274,865.97
WABTEC CORP	4,279	89.38	382,457.02
MW GRAINGER INC	2,422	277.26	671,523.72
XYLEM INC	7,965	75.53	601,596.45
CINTAS CORP	4,082	171.19	698,797.58
COSTAR GROUP INC	1,621	370.16	600,029.36
EQUIFAX INC	5,368	119.84	643,301.12
IHS MARKIT LTD	18,255	48.77	890,296.35
MANPOWERGROUP	3,240	96.00	311,040.00
NIELSEN HOLDINGS PLC	15,136	34.35	519,921.60
REPUBLIC SERVICES INC	9,721	65.07	632,545.47
ROBERT HALF INTL INC	5,854	60.48	354,049.92
ROLLINS INC	4,301	49.35	212,254.35
STERICYCLE, INC.	4,280	60.80	260,224.00
TRANSUNION	6,673	65.41	436,480.93
VERISK ANALYTICS INC	7,039	106.62	750,498.18
WASTE CONNECTIONS INC	10,953	72.48	793,873.44
WASTE MANAGEMENT INC	18,677	81.25	1,517,506.25
AMERCO	390	345.55	134,764.50
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	5,676	45.25	256,839.00
C.H.ROBINSON WORLDWIDE, INC.	6,063	92.59	561,373.17
CSX CORPORATION	37,286	59.99	2,236,787.14
DELTA AIR LINES INC	7,251	54.65	396,267.15
EXPEDITORS INTL WASH INC	7,961	64.25	511,494.25
FEDEX CORP	11,187	246.90	2,762,070.30
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	3,523	117.78	414,938.94
KANSAS CITY SOUTHERN	4,649	109.05	506,973.45
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	5,115	42.12	215,443.80
MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORP	3,832	38.05	145,807.60
NORFOLK SOUTHERN CORP	12,264	145.96	1,790,053.44

OLD DOMINION FREIGHT LINE	2,639	141.81	374,236.59
SOUTHWEST AIRLINES	6,837	53.83	368,035.71
UNION PACIFIC CORP	34,434	136.06	4,685,090.04
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	3,729	68.51	255,473.79
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	30,172	108.66	3,278,489.52
APTIV PLC	11,653	85.21	992,952.13
AUTOLIV INC	4,001	145.95	583,945.95
BORGWARNER INC	8,566	52.91	453,227.06
FORD MOTOR COMPANY	160,576	11.11	1,783,999.36
GENERAL MOTORS CO	56,075	38.11	2,137,018.25
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	10,333	25.51	263,594.83
HARLEY-DAVIDSON INC	7,347	42.33	310,998.51
LEAR CORP	3,136	188.49	591,104.64
TESLA INC	5,905	280.69	1,657,474.45
D.R.HORTON INC	15,658	44.93	703,513.94
GARMIN LTD	5,834	57.83	337,380.22
HANESBRANDS INC	17,562	18.01	316,291.62
HASBRO INC	4,566	86.97	397,105.02
LEGGETT & PLATT INC	5,036	41.83	210,655.88
LENNAR CORP-CL A	13,092	53.91	705,789.72
LULULEMON ATHLETICA INC	4,279	97.85	418,700.15
MATTEL INC	14,058	13.48	189,501.84
MICHAEL KORS HOLDINGS LIMITED	7,155	66.91	478,741.05
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,863	227.12	650,244.56
NEWELL BRANDS INC	22,542	27.18	612,691.56
NIKE INC -CL B	58,105	66.67	3,873,860.35
NVR INC	143	3,101.20	443,471.60
POLARIS INDUSTRIES INC	2,467	105.14	259,380.38
PULTE GROUP INC	12,930	30.53	394,752.90
PVH CORP	3,303	158.77	524,417.31
RALPH LAUREN CORPORATION	2,646	108.79	287,858.34
TAPESTRY INC	11,987	53.44	640,585.28
TOLL BROTHERS INC	7,061	42.03	296,773.83
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	8,634	16.44	141,942.96
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	8,291	14.32	118,727.12
VF CORP	14,902	78.64	1,171,893.28
WHIRLPOOL CORP	3,391	155.48	527,232.68
ARAMARK	10,783	38.11	410,940.13
CARNIVAL CORP	15,490	66.07	1,023,424.30
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	995	339.52	337,822.40
DARDEN RESTAURANTS INC	5,372	91.12	489,496.64
DOMINO'S PIZZA INC	1,940	233.53	453,048.20

H&R BLOCK INC	7,820	28.12	219,898.40
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	12,524	81.83	1,024,838.92
LAS VEGAS SANDS CORP	17,144	72.34	1,240,196.96
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	13,716	137.24	1,882,383.84
MCDONALD'S CORPORATION	35,097	155.94	5,473,026.18
MELCO RESORTS & ENTERTAINMENET-ADR	11,150	31.00	345,650.00
MGM MIRAGE	20,106	35.33	710,344.98
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS	7,616	56.38	429,390.08
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	7,457	118.49	883,579.93
STARBUCKS CORP	62,564	57.71	3,610,568.44
VAIL RESORTS INC	1,924	230.12	442,750.88
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	4,622	117.75	544,240.50
WYNN RESORTS LTD	3,489	182.89	638,103.21
YUM! BRANDS INC	14,192	85.26	1,210,009.92
CBS CORP-CL B	15,692	50.42	791,190.64
CHARTER COMMUNICATTIONS INC-A	8,293	300.35	2,490,802.55
COMCAST CORP-CLASS A	204,835	34.26	7,017,647.10
DISCOVERY INC-A	7,075	24.10	170,507.50
DISCOVERY INC-C	11,249	22.56	253,777.44
DISH NETWORK CORP.	9,780	36.86	360,490.80
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	15,544	24.35	378,496.40
LIBERTY BROADBAND-C	4,953	81.59	404,115.27
LIBERTY GLOBAL PLC-A	8,432	32.51	274,124.32
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	23,590	31.39	740,490.10
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	8,568	30.07	257,639.76
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	7,648	41.36	316,321.28
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	4,141	41.53	171,975.73
LIVE NATION ENTERTAINMENT INC	6,065	39.47	239,385.55
NEWS CORP-CLASS A	16,662	15.88	264,592.56
OMNICOM GROUP	10,146	74.38	754,659.48
SIRIUS XM HOLDINGS INC	68,252	6.25	426,575.00
THE WALT DISNEY CO.	66,487	101.15	6,725,160.05
TIME WARNER INC	34,216	96.28	3,294,316.48
TWENTY-FIRST CE CL-A	47,150	36.58	1,724,747.00
TWENTY-FIRST CE CL-B	19,170	36.13	692,612.10
VIACOM INC-CLASS B	16,489	31.18	514,127.02
ADVANCE AUTO PARTS	3,304	107.82	356,237.28
AMAZON.COM INC	18,009	1,460.17	26,296,201.53
AUTONATION INC	2,851	46.39	132,257.89
AUTOZONE INC	1,219	610.57	744,284.83
BEST BUY COMPANY INC	11,445	74.38	851,279.10
BOOKING HOLDINGS INC	2,126	2,077.61	4,416,998.86

CARMAX INC	7,453	62.09	462,756.77
DOLLAR GENERAL CORP	11,840	97.25	1,151,440.00
DOLLAR TREE INC	10,263	96.91	994,587.33
EXPEDIA GROUP INC	5,168	108.44	560,417.92
GAP INC/THE	9,218	29.91	275,710.38
GENUINE PARTS CO	6,648	88.82	590,475.36
HOME DEPOT INC	51,078	177.39	9,060,726.42
KOHL'S CORP	7,962	60.00	477,720.00
L BRANDS INC	10,675	35.46	378,535.50
LKQ CORPORATION	13,945	37.59	524,192.55
LOWE'S COMPANIES INC	36,267	81.48	2,955,035.16
MACY'S INC	13,521	30.72	415,365.12
NETFLIX INC	19,118	305.76	5,845,519.68
NORDSTROM INC	4,756	48.73	231,759.88
O'REILLY AUTOMOTIVE INC NEW	3,687	227.67	839,419.29
QURATE RETAIL GROUP INC QVC-A	18,982	23.71	450,063.22
ROSS STORES INC	17,122	78.29	1,340,481.38
TARGET CORP	22,678	71.14	1,613,312.92
TIFFANY & CO	5,367	100.82	541,100.94
TJX COMPANIES INC	28,189	83.33	2,348,989.37
TRACTOR SUPPLY COMPANY	5,278	62.19	328,238.82
TRIPADVISOR INC-W/I	5,813	38.33	222,812.29
ULTA BEAUTY INC	2,623	236.20	619,552.60
COSTCO WHOLESALE CORP	19,190	193.97	3,722,284.30
CVS HEALTH CORPORATION	44,048	67.73	2,983,371.04
KROGER CO	38,882	25.63	996,545.66
SYSCO CORP	22,052	62.45	1,377,147.40
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	36,968	65.95	2,438,039.60
WALMART INC	65,592	87.17	5,717,654.64
ALTRIA GROUP INC	83,798	55.84	4,679,280.32
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	25,078	45.84	1,149,575.52
BROWN-FORMAN CORPORATION	11,326	54.80	620,664.80
BUNGE LIMITED	5,968	72.55	432,978.40
CAMPBELL SOUP CO	7,879	41.51	327,057.29
COCA-COLA CO/THE	178,187	42.43	7,560,474.41
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC	9,352	39.77	371,929.04
CONAGRA BRANDS INC	17,122	37.15	636,082.30
CONSTELLATION BRANDS INC-A	7,451	226.87	1,690,408.37
DR.PEPPER SNAPPLE GROUP, INC	8,175	119.69	978,465.75
GENERAL MILLS INC	25,006	44.04	1,101,264.24
HORMEL FOODS CORPORATION	12,443	36.15	449,814.45
INGREDION INC	3,320	125.52	416,726.40

JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	4,914	115.54	567,763.56
KELLOGG CO	11,216	60.95	683,615.20
KRAFT HEINZ COMPANY	26,755	56.85	1,521,021.75
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	5,606	105.19	589,695.14
MOLSON COORS BREWING COMPANY	8,674	71.91	623,747.34
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	65,326	39.68	2,592,135.68
MONSTER BEVERAGE CORPORATION	17,233	54.41	937,647.53
PEPSICO INC	62,454	101.15	6,317,222.10
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	68,209	81.81	5,580,178.29
THE HERSHEY COMPANY	6,522	93.54	610,067.88
TYSON FOODS INC-CL A	12,620	70.44	888,952.80
CHURCH & DWIGHT CO INC	11,613	45.89	532,920.57
CLOROX COMPANY	5,583	116.42	649,972.86
COLGATE-PALMOLIVE COMPANY	36,634	66.41	2,432,863.94
COTY INC-CL A	22,574	16.76	378,340.24
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	9,831	146.49	1,440,143.19
KIMBERLY-CLARK CORP	15,309	102.30	1,566,110.70
PROCTER & GAMBLE CO	111,411	72.30	8,055,015.30
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	942	94.23	88,764.66
ABBOTT LABORATORIES	76,439	58.65	4,483,147.35
AETNA INC	14,197	178.99	2,541,121.03
ALIGN TECHNOLOGY INC	3,299	245.63	810,333.37
AMERISOURCEBERGEN CORP	7,058	91.43	645,312.94
ANTHEM INC	11,378	238.84	2,717,521.52
BAXTER INTERNATIONAL INC	21,609	66.52	1,437,430.68
BECTON DICKINSON & CO	11,459	229.49	2,629,725.91
BOSTON SCIENTIFIC CORP	59,455	29.42	1,749,166.10
CARDINAL HEALTH INC	13,707	63.57	871,353.99
CENTENE CORP	7,473	109.29	816,724.17
CERNER CORP	13,575	58.34	791,965.50
CIGNA CORP	10,910	171.70	1,873,247.00
COOPER COMPANIES INC (THE)	2,055	227.59	467,697.45
DANAHER CORP	27,493	100.49	2,762,771.57
DAVITA INC	6,953	63.30	440,124.90
DENTSPLY SIRONA INC	9,944	49.16	488,847.04
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	9,150	129.52	1,185,108.00
ENVISION HEALTHCARE CORP	6,386	38.09	243,242.74
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	25,001	76.52	1,913,076.52
HCA HEALTHCARE INC	12,883	98.42	1,267,944.86
HENRY SCHEIN INC	7,253	74.49	540,275.97
HOLOGIC INC	12,110	38.85	470,473.50
HUMANA INC.	6,262	297.39	1,862,256.18

IDEXX LABORATORIES INC	3,797	194.61	738,934.17
INTUITIVE SURGICAL INC	4,847	437.96	2,122,792.12
LABORATORY CRP OF AMR HLDGS	4,405	172.71	760,787.55
MCKESSON CORP	9,111	151.71	1,382,229.81
MEDTRONIC PLC	59,851	79.46	4,755,760.46
QUEST DIAGNOSTICS	5,910	101.15	597,796.50
RESMED INC	6,572	96.45	633,869.40
STRYKER CORP	14,587	165.38	2,412,398.06
TELEFLEX INC	1,951	264.49	516,019.99
UNITEDHEALTH GROUP INC	42,557	234.90	9,996,639.30
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	3,760	122.04	458,870.40
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	4,120	125.86	518,543.20
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	5,035	69.42	349,529.70
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	8,837	110.59	977,283.83
ABBVIE INC	70,107	91.87	6,440,730.09
AGILENT TECHNOLOGIES INC	14,256	65.80	938,044.80
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	9,671	106.04	1,025,512.84
ALKERMES PLC	6,413	44.07	282,620.91
ALLERGAN PLC	14,808	157.12	2,326,632.96
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	3,908	94.33	368,641.64
AMGEN INC	29,596	174.83	5,174,268.68
BIOGEN INC	9,161	269.45	2,468,431.45
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	7,516	81.53	612,779.48
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	71,876	51.76	3,720,301.76
CELGENE CORP	34,918	89.20	3,114,685.60
ELI LILLY & CO	43,936	81.14	3,564,967.04
GILEAD SCIENCES INC	57,365	73.25	4,201,986.25
ILLUMINA INC	6,326	231.19	1,462,507.94
INCYTE CORP	7,576	62.99	477,212.24
IQVIA HOLDINGS INC	6,098	96.49	588,396.02
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,604	154.67	402,760.68
JOHNSON & JOHNSON	117,979	126.76	14,955,018.04
MERCK & CO. INC.	120,242	59.63	7,170,030.46
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,112	560.67	623,465.04
MYLAN NV	19,783	38.94	770,350.02
PERRIGO CO PLC	5,561	77.82	432,757.02
PFIZER INC	262,144	36.68	9,615,441.92
REGENERON PHARMACEUTICALS	3,392	316.17	1,072,448.64
SEATTLE GENETICS INC	4,290	48.13	206,477.70
TESARO INC	1,725	51.78	89,320.50
TEVA PHARMACEUTICAL INDUSTRIES-SP ADR	40,020	17.27	691,145.40
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	17,610	214.47	3,776,816.70

UNITED THERAPEUTICS CORP	2,169	109.77	238,091.13
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	11,149	155.15	1,729,767.35
WATERS CORP	3,459	191.66	662,951.94
ZOETIS INC	21,193	84.57	1,792,292.01
BANK OF AMERICA CORP	434,276	30.14	13,089,078.64
BB & T CORPORATION	35,023	53.79	1,883,887.17
CIT GROUP INC	5,683	52.90	300,630.70
CITIGROUP INC	116,537	69.36	8,083,006.32
CITIZENS FINANCIAL GROUP	21,812	42.52	927,446.24
COMERICA INC	7,688	96.07	738,586.16
EAST WEST BANCORP INC	6,233	66.08	411,876.64
FIFTH THIRD BANCORP	30,937	33.54	1,037,626.98
FIRST REPUBLIC BANK/CA	7,244	93.61	678,110.84
HUNTINGTON BANCSHARES INC	48,927	15.06	736,840.62
JPMORGAN CHASE & CO	152,195	109.99	16,739,928.05
KEYCORP	45,615	20.23	922,791.45
M & T BANK CORP	5,753	182.52	1,050,037.56
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	21,911	12.04	263,808.44
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	14,035	18.47	259,226.45
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	20,764	145.70	3,025,314.80
REGIONS FINANCIAL CORPORATION	51,992	19.02	988,887.84
SIGNATURE BANK	2,508	128.52	322,328.16
SUNTRUST BANKS INC	20,334	67.32	1,368,884.88
SVB FINANCIAL GROUP	2,333	257.58	600,934.14
US BANCORP	72,481	50.79	3,681,309.99
WELLS FARGO & COMPANY	205,992	53.11	10,940,235.12
ZIONS BANCORPORATION	8,874	55.26	490,377.24
AFFILIATED MANAGERS GROUP	2,602	168.99	439,711.98
ALLY FINANCIAL INC	20,762	27.92	579,675.04
AMERICAN EXPRESS COMPANY	32,558	98.78	3,216,079.24
AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,298	141.44	890,789.12
BANK OF NEW YORK MELLON CORP(THE)	44,767	55.40	2,480,091.80
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	55,936	196.80	11,008,204.80
BLACKROCK INC	5,231	512.22	2,679,422.82
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	21,619	92.76	2,005,378.44
CBOE GLOBAL MARKETS INC	4,473	106.27	475,345.71
CME GROUP INC.	14,728	161.08	2,372,386.24
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	16,122	71.86	1,158,526.92
E*TRADE FINANCIAL CORPORATION	11,942	59.56	711,265.52
EATON VANCE CORP	5,530	54.98	304,039.40
FRANKLIN RESOURCES INC	15,511	33.58	520,859.38
GOLDMAN SACHS GROUP INC	15,767	239.23	3,771,939.41

INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	25,499	73.21	1,866,781.79
INVESCO LIMITED	18,328	30.74	563,402.72
LEUCADIA NATIONAL CORPORATION	15,290	24.46	373,993.40
MOODY'S CORP	7,529	162.54	1,223,763.66
MORGAN STANLEY	59,685	52.04	3,106,007.40
MSCI INC-A	3,805	149.21	567,744.05
NASDAQ INC	5,343	87.79	469,061.97
NORTHERN TRUST CORP	9,731	106.83	1,039,562.73
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	5,490	86.82	476,641.80
S&P GLOBAL INC	11,370	189.58	2,155,524.60
SCHWAB (CHARLES) CORP	53,607	54.60	2,926,942.20
SEI INVESTMENTS COMPANY	5,862	68.46	401,312.52
STATE STREET CORP	16,204	100.89	1,634,821.56
SYNCHRONY FINANCIAL	34,462	33.29	1,147,239.98
T ROWE PRICE GROUP INC	10,711	111.00	1,188,921.00
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	13,040	57.29	747,061.60
VOYA FINANCIAL INC	7,528	52.75	397,102.00
AFLAC INC	34,250	45.41	1,555,292.50
ALLEGHANY CORPORATION	735	585.06	430,019.10
ALLSTATE CORP	15,658	97.49	1,526,498.42
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	3,539	114.14	403,941.46
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	40,024	55.40	2,217,329.60
AON PLC	11,059	141.97	1,570,046.23
ARCH CAPITAL GROUP LTD.	5,941	80.62	478,963.42
ARTHUR J GALLAGHER & CO	7,587	69.38	526,386.06
ASSURANT INC	2,198	93.39	205,271.22
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	4,807	49.20	236,504.40
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	3,961	56.81	225,024.41
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	4,258	51.38	218,776.04
CHUBB LTD	20,167	137.26	2,768,122.42
CINCINNATI FINANCIAL CORP	6,311	74.82	472,189.02
EVEREST RE GROUP LTD	1,650	240.44	396,726.00
FNF GROUP	10,851	37.23	403,982.73
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	15,215	51.83	788,593.45
LINCOLN NATIONAL CORP	9,193	71.90	660,976.70
LOEWS CORPORATION	12,803	51.54	659,866.62
MARKEL CORP	629	1,137.49	715,481.21
MARSH & MCLENNAN COS	22,208	82.61	1,834,602.88
METLIFE INC	39,146	47.83	1,872,353.18
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	12,796	61.08	781,579.68
PROGRESSIVE CORP	25,621	60.30	1,544,946.30
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	18,252	106.77	1,948,766.04

REINSURANCE GROUP OF AMERICA	2,972	156.77	465,920.44
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	1,504	136.76	205,687.04
TORCHMARK CORPORATION	4,615	86.47	399,059.05
TRAVELERS COS INC(THE)	12,182	132.22	1,610,704.04
UNUM GROUP	9,769	48.46	473,405.74
W.R.BERKLEY CORPORATION	3,873	76.13	294,851.49
WILLIS TOWERS WATSON PLC	5,339	149.35	797,379.65
XL GROUP LTD	11,562	55.40	640,534.80
CBRE GROUP INC-A	13,193	45.39	598,830.27
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	17,990	105.20	1,892,548.00
EQUINIX INC	3,436	410.21	1,409,481.56
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	52,300	7.10	371,330.00
JONES LANG LASALLE INC	2,007	169.05	339,283.35
SBA COMMUNICATIONS CORP	5,325	164.49	875,909.25
ACCENTURE PLC-CL A	26,777	150.09	4,018,959.93
ACTIVISION BLIZZARD INC	31,544	64.82	2,044,682.08
ADOBE SYSTEMS INC	21,580	217.32	4,689,765.60
AKAMAI TECHNOLOGIES	8,040	70.78	569,071.20
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2,222	204.10	453,510.20
ALPHABET INC-CL A	13,099	1,022.99	13,400,146.01
ALPHABET INC-CL C	13,813	1,021.18	14,105,559.34
ANSYS INC	3,662	159.86	585,407.32
AUTODESK INC	8,636	123.97	1,070,604.92
AUTOMATIC DATA PROCESSING	19,255	116.70	2,247,058.50
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	5,375	107.36	577,060.00
CA INC	12,753	34.50	439,978.50
CADENCE DESIGN SYS INC	13,205	39.56	522,389.80
CDK GLOBAL INC	5,003	64.07	320,542.21
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	5,747	96.33	553,608.51
CITRIX SYSTEMS INC	7,019	96.58	677,895.02
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATION	25,894	80.91	2,095,083.54
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	8,755	71.78	628,433.90
DXC TECHNOLOGY CO	12,719	101.82	1,295,048.58
EBAY INC	44,058	40.97	1,805,056.26
ELECTRONIC ARTS INC	13,523	116.68	1,577,863.64
FACEBOOK INC-A	104,729	159.69	16,724,174.01
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	14,635	94.11	1,377,299.85
FIRST DATA CORP-CLASS A	20,984	14.99	314,550.16
FISERV INC	18,478	70.16	1,296,416.48
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,824	201.29	769,732.96
FORTINET INC	6,882	54.80	377,133.60
GARTNER INC	4,011	117.38	470,811.18

GLOBAL PAYMENTS INC	7,016	109.53	768,462.48
IAC/INTERACTIVECORP	3,231	157.43	508,656.33
INTL BUSINESS MACHINES CORP	38,623	145.94	5,636,640.62
INTUIT INC	10,765	176.37	1,898,623.05
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	3,649	119.25	435,143.25
LEIDOS HOLDINGS INC	6,074	65.52	397,968.48
MASTERCARD INC-CL A	41,154	172.47	7,097,830.38
MERCADOLIBRE INC	1,842	336.13	619,151.46
MICROSOFT CORP	321,848	92.31	29,709,788.88
ORACLE CORPORATION	137,460	45.75	6,288,795.00
PAYCHEX INC	14,156	60.00	849,360.00
PAYPAL HOLDINGS INC	50,143	74.00	3,710,582.00
RED HAT INC	7,729	158.14	1,222,264.06
SABRE CORP	9,850	20.22	199,167.00
SALESFORCE.COM, INC.	30,134	117.32	3,535,320.88
SERVICENOW INC	7,584	158.00	1,198,272.00
SPLUNK INC	6,247	97.64	609,957.08
SQUARE INC-A	11,069	44.75	495,337.75
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	8,124	49.16	399,375.84
SYMANTEC CORPORATION	27,227	28.48	775,424.96
SYNOPSYS INC	6,139	83.74	514,079.86
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	4,808	96.22	462,625.76
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	7,179	84.49	606,553.71
TWITTER INC	27,825	29.75	827,793.75
VERISIGN INC	3,837	118.61	455,106.57
VISA INC	79,638	121.21	9,652,921.98
VMWARE INC	3,055	131.62	402,099.10
WESTERN UNION COMPANY	21,476	19.15	411,265.40
WORKDAY INC-CLASS A	6,016	122.58	737,441.28
WORLDPAY INC-CL A	13,361	79.10	1,056,855.10
ZILLOW GROUP INC-C	5,320	47.50	252,700.00
AMPHENOL CORPORATION -CL A	13,389	82.88	1,109,680.32
APPLE INC	225,474	163.65	36,898,820.10
ARISTA NETWORKS INC	1,990	253.02	503,509.80
ARROW ELECTRONICS INC	4,130	75.96	313,714.80
AVNET INC	4,559	40.35	183,955.65
CDW CORP/DE	6,951	71.13	494,424.63
CISCO SYSTEMS INC	217,100	43.71	9,489,441.00
COGNEX CORP	8,160	47.24	385,478.40
COMMSCOPE HOLDING CO INC	8,803	40.62	357,577.86
CORNING INC	38,165	27.06	1,032,744.90
F5 NETWORKS INC	2,620	157.07	411,523.40

FLEX LTD	23,204	16.59	384,954.36
FLIR SYSTEMS INC	5,286	52.18	275,823.48
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE C	70,980	17.31	1,228,663.80
HP INC	71,437	21.31	1,522,322.47
IPG PHOTONICS CORP	1,776	214.09	380,223.84
JUNIPER NETWORKS INC	16,739	24.29	406,590.31
MOTOROLA SOLUTIONS INC	7,367	109.42	806,097.14
NETAPP INC	11,136	67.25	748,896.00
PALO ALTO NETWORKS INC	3,917	190.55	746,384.35
SEAGATE TECHNOLOGY	12,422	58.30	724,202.60
TE CONNECTIVITY LTD	15,442	94.38	1,457,415.96
TRIMBLE INC	11,778	34.83	410,227.74
WESTERN DIGITAL CORP	12,990	85.92	1,116,100.80
XEROX CORP	9,697	30.64	297,116.08
AT&T INC	269,898	35.20	9,500,409.60
CENTURYLINK INC	42,717	18.50	790,264.50
SPRINT CORP	36,740	6.02	221,174.80
T-MOBILE US INC	12,603	63.93	805,709.79
VERIZON COMMUNICATIONS INC	179,149	50.10	8,975,364.90
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	7,915	37.26	294,912.90
AES CORPORATION	27,194	12.03	327,143.82
ALLIANT ENERGY CORP	9,162	42.23	386,911.26
AMEREN CORPORATION	10,336	57.21	591,322.56
AMERICAN ELECTRIC POWER	21,673	69.09	1,497,387.57
AMERICAN WATER WORKS CO INC	8,207	84.75	695,543.25
ATMOS ENERGY CORP	4,697	85.31	400,701.07
CENTERPOINT ENERGY INC	17,622	24.92	439,140.24
CMS ENERGY CORPORATION	11,464	45.86	525,739.04
CONSOLIDATED EDISON INC	13,546	78.39	1,061,870.94
DOMINION ENERGY INC	28,261	64.80	1,831,312.80
DTE ENERGY COMPANY	7,944	104.01	826,255.44
DUKE ENERGY CORP	30,740	78.89	2,425,078.60
EDISON INTERNATIONAL	14,473	64.84	938,429.32
ENERGY CORP	8,107	79.42	643,857.94
EVERSOURCE ENERGY	13,730	59.37	815,150.10
EXELON CORP	42,162	39.16	1,651,063.92
FIRSTENERGY CORP	18,217	34.16	622,292.72
NEXTERA ENERGY INC	20,658	160.33	3,312,097.14
NISOURCE INC	15,794	23.91	377,634.54
OGE ENERGY CORP	9,056	32.80	297,036.80
P G & E CORPORATION	22,921	46.34	1,062,159.14
PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	5,120	79.92	409,190.40

	PPL CORPORATION	30,510	28.64	873,806.40
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	22,788	50.34	1,147,147.92
	SCANA CORP	6,498	36.55	237,501.90
	SEMPRA ENERGY	10,435	109.31	1,140,649.85
	SOUTHERN CO	44,075	46.03	2,028,772.25
	UGI CORPORATION	7,497	47.29	354,533.13
	VISTRA ENERGY CORP	11,939	22.48	268,388.72
	WEC ENERGY GROUP INC	13,142	62.80	825,317.60
	WESTAR ENERGY INC	6,480	53.05	343,764.00
	XCEL ENERGY INC	22,653	45.77	1,036,827.81
	ADVANCED MICRO DEVICES	36,014	9.71	349,695.94
	ANALOG DEVICES INC	16,189	87.77	1,420,908.53
	APPLIED MATERIALS INC	46,835	49.14	2,301,471.90
	BROADCOM INC	17,916	229.00	4,102,764.00
	INTEL CORP	204,835	51.38	10,524,422.30
	KLA-TENCOR CORPORATION	6,485	98.65	639,745.25
	LAM RESEARCH CORP	7,275	186.67	1,358,024.25
	MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	18,948	20.38	386,160.24
	MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	12,942	54.40	704,044.80
	MICROCHIP TECHNOLOGY INC	10,117	82.98	839,508.66
	MICRON TECHNOLOGY INC	50,579	47.60	2,407,560.40
	NVIDIA CORP	26,613	216.66	5,765,972.58
	NXP SEMICONDUCTORS NV	14,992	101.19	1,517,040.48
	QORVO INC	5,998	67.66	405,824.68
	QUALCOMM INC	64,738	49.75	3,220,715.50
	SKYWORKS SOLUTIONS INC	7,938	87.81	697,035.78
	TEXAS INSTRUMENTS INC	42,899	103.00	4,418,597.00
	XILINX INC	11,021	63.64	701,376.44
	米ドル 小計	13,443,282		1,017,124,548.28 (111,303,939,318)
カナダドル	ALTAGAS LTD	6,948	24.72	171,754.56
	ARC RESOURCES LTD	17,074	14.75	251,841.50
	CAMECO CORP	16,384	13.09	214,466.56
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	48,502	46.58	2,259,223.16
	CENOVUS ENERGY INC	41,433	12.80	530,342.40
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	22,509	11.62	261,554.58
	ENBRIDGE INC	73,593	37.59	2,766,360.87
	ENCANA CORP	41,829	16.31	682,230.99
	HUSKY ENERGY INC	14,553	19.09	277,816.77
	IMPERIAL OIL LTD	12,999	38.38	498,901.62
	INTER PIPELINE LTD	18,081	23.19	419,298.39
	KEYERA CORP	8,467	34.62	293,127.54

PEMBINA PIPELINE CORP	21,701	40.38	876,286.38
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	9,038	28.89	261,107.82
SEVEN GENERATIONS ENERGY-A	14,441	18.29	264,125.89
SUNCOR ENERGY INC	70,959	49.20	3,491,182.80
TOURMALINE OIL CORP	12,887	24.53	316,118.11
TRANSCANADA CORP	38,551	54.74	2,110,281.74
VERMILION ENERGY INC	5,586	45.53	254,330.58
AGNICO EAGLE MINES LIMITED	9,697	55.56	538,765.32
BARRICK GOLD CORP	50,240	17.32	870,156.80
CCL INDUSTRIES INC-CL B	5,358	62.48	334,767.84
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	31,672	17.02	539,057.44
FRANCO-NEVADA CORPORATION	8,072	90.37	729,466.64
GOLDCORP INC	40,330	18.11	730,376.30
KINROSS GOLD CORP	57,099	5.00	285,495.00
LUNDIN MINING CORP	28,209	8.08	227,928.72
METHANEX CORPORATION	4,361	83.88	365,800.68
NUTRIEN LTD	28,662	59.54	1,706,535.48
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	23,969	31.85	763,412.65
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	45,107	3.93	177,270.51
WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,873	94.00	270,062.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	19,578	27.01	528,801.78
BOMBARDIER INC 'B'	75,852	3.99	302,649.48
CAE INC	13,932	24.40	339,940.80
FINNING INTERNATIONAL INC	6,115	31.95	195,374.25
SNC-LAVALIN GROUP INC	8,250	55.78	460,185.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	32,541	98.46	3,203,986.86
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	6,397	231.92	1,483,592.24
LINAMAR CORP	2,200	72.36	159,192.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	14,641	75.76	1,109,202.16
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,066	37.13	336,620.58
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	9,162	70.47	645,646.14
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	19,379	26.78	518,969.62
CANADIAN TIRE CORP -CL A	3,029	172.29	521,866.41
DOLLARAMA INC	4,808	147.22	707,833.76
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B	18,360	53.90	989,604.00
EMPIRE CO LTD A	7,235	24.47	177,040.45
JEAN COUTU GROUP INC A	2,801	24.68	69,128.68
LOBLAW COMPANIES LTD	9,974	65.13	649,606.62
METRO INC	9,866	41.23	406,775.18
WESTON (GEORGE) LTD	1,960	104.39	204,604.40
SAPUTO INC	9,854	41.38	407,758.52
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	14,555	22.56	328,360.80

	BANK OF MONTREAL	27,699	97.12	2,690,126.88	
	BANK OF NOVA SCOTIA	53,195	77.66	4,131,123.70	
	CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	19,150	110.83	2,122,394.50	
	NATIONAL BANK OF CANADA	14,715	59.99	882,752.85	
	ROYAL BANK OF CANADA	64,430	96.61	6,224,582.30	
	TORONTO-DOMINION BANK	81,666	71.29	5,821,969.14	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	37,852	49.11	1,858,911.72	
	CI FINANCIAL CORP	11,041	27.24	300,756.84	
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	19,611	4.82	94,525.02	
	IGM FINANCIAL INC	3,023	38.15	115,327.45	
	ONEX CORPORATION	4,217	92.02	388,048.34	
	THOMSON REUTERS CORP	12,371	50.93	630,055.03	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,153	682.04	786,392.12	
	GREAT-WEST LIFECO INC	14,200	33.87	480,954.00	
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANC	4,851	53.24	258,267.24	
	INTACT FINANCIAL CORPORATION	6,264	97.77	612,431.28	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	87,588	24.33	2,131,016.04	
	POWER CORP OF CANADA	14,595	30.10	439,309.50	
	POWER FINANCIAL CORP	11,076	32.95	364,954.20	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	25,824	52.46	1,354,727.04	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	6,546	20.09	131,509.14	
	BLACKBERRY LIMITED	23,701	13.30	315,223.30	
	CGI GROUP INC - CL A	11,705	73.97	865,818.85	
	CONSTELLATION SOFTWARE	848	899.50	762,776.00	
	OPEN TEXT CORPORATION	11,689	45.01	526,121.89	
	SHOPIFY INC-CLASS A	3,397	154.04	523,273.88	
	BCE INC	6,928	54.13	375,012.64	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	15,965	60.67	968,596.55	
	TELUS CORPORATION	7,611	45.42	345,691.62	
	ATCO LTD-CLASS I	3,030	40.91	123,957.30	
	CANADIAN UTILITIES LIMITED	6,417	34.33	220,295.61	
	EMERA INC	2,409	40.22	96,889.98	
	FORTIS INC	17,933	42.29	758,386.57	
	HYDRO ONE LTD	15,052	20.43	307,512.36	
	カナダドル 小計	1,778,491		75,495,878.25 (6,436,778,579)	
ユーロ	ENAGAS	10,471	23.51	246,173.21	
	ENI SPA	108,967	15.85	1,727,126.95	
	GALP ENERGIA SGPS S.A	20,924	15.78	330,180.72	
	NESTE OYJ	5,632	53.84	303,226.88	
	OMV AG	6,314	50.56	319,235.84	
	REPSOL SA	53,823	15.70	845,021.10	

SNAM SPA	99,978	3.89	388,914.42
TENARIS S.A.	23,321	15.28	356,344.88
TOTAL SA	106,057	51.15	5,424,815.55
VOPAK	3,130	40.06	125,387.80
AIR LIQUIDE SA	18,345	105.00	1,926,225.00
AKZO NOBEL	11,379	75.50	859,114.50
ARCELORMITTAL	29,490	27.81	820,264.35
ARKEMA	3,250	108.55	352,787.50
BASF SE	40,335	84.42	3,405,080.70
COVESTRO AG	6,687	77.76	519,981.12
CRH PLC	37,164	29.20	1,085,188.80
EVONIK INDUSTRIES AG	6,449	29.29	188,891.21
FUCHS PETROLUB SE-PREF	3,370	43.18	145,516.60
HEIDELBERGCEMENT AG	6,574	80.56	529,601.44
IMERYS SA	1,384	79.40	109,889.60
K+S AG	9,644	23.27	224,415.88
KONINKLIJKE DSM NV	7,986	85.70	684,400.20
LANXESS	4,159	60.96	253,532.64
LINDE AG - TENDER	7,910	179.40	1,419,054.00
SOLVAY SA	3,317	114.65	380,294.05
STORA ENSO OYJ-R SHS	24,709	16.45	406,586.59
SYMRISE AG	6,010	65.88	395,938.80
THYSSENKRUPP AG	19,367	22.18	429,560.06
UMICORE	9,568	42.47	406,352.96
UPM-KYMMENE OYJ	23,383	30.15	704,997.45
VOESTALPINE AG	5,079	44.22	224,593.38
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	11,265	34.20	385,263.00
AIRBUS SE	25,783	94.97	2,448,611.51
ALSTOM RGPT	6,452	37.54	242,208.08
ANDRITZ AG	3,606	44.72	161,260.32
BOSKALIS WESTMINSTER NV	3,784	24.24	91,724.16
BOUYGUES SA	10,290	41.73	429,401.70
BRENTAG AG	6,629	47.30	313,551.70
CNH INDUSTRIAL NV	43,160	9.80	422,968.00
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	21,266	43.42	923,476.05
DASSAULT AVIATION SA	89	1,670.00	148,630.00
EIFFAGE SA	3,580	97.52	349,121.60
FERROVIAL SA	22,033	17.80	392,187.40
GEA GROUP AG	8,178	32.20	263,331.60
HOCHTIEF AG	825	149.70	123,502.50
KION GROUP AG	3,179	74.84	237,916.36
KONE OYJ-B	14,652	40.77	597,362.04

LEGRAND SA	11,992	63.84	765,569.28
LEONARDO SPA	18,310	9.65	176,764.74
MAN SE	1,403	96.20	134,968.60
METSO OYJ	5,502	28.90	159,007.80
MTU AERO ENGINES AG	2,451	138.60	339,708.60
OSRAM LICHT AG	4,588	48.00	220,224.00
PRYSMIAN SPA	9,379	24.11	226,127.69
REXEL SA	12,854	13.70	176,164.07
SAFRAN SA	14,456	90.52	1,308,557.12
SCHNEIDER ELECTRIC SE	24,254	73.94	1,793,340.76
SIEMENS AG-REG	33,836	104.82	3,546,689.52
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY	8,238	13.45	110,801.10
THALES SA	4,530	102.20	462,966.00
VINCI S.A.	22,403	82.50	1,848,247.50
WARTSILA OYJ-B SHARES	18,903	17.43	329,479.29
BIC	1,337	83.70	111,906.90
BUREAU VERITAS SA	12,626	21.20	267,671.20
ELENRED	9,497	27.95	265,441.15
RANDSTAD NV	4,694	52.20	245,026.80
RELX NV	43,033	17.67	760,393.11
TELEPERFORMANCE	2,489	127.10	316,351.90
WOLTERS KLUWER-CVA	13,701	43.70	598,733.70
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	31,359	18.29	573,556.11
AENA SME SA	2,881	168.80	486,312.80
AEROPORTS DE PARIS (ADP)	1,346	182.20	245,241.20
ATLANTIA SPA	20,462	26.94	551,246.28
BOLLORE	39,433	4.09	161,517.56
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	9,260	25.61	237,148.60
DEUTSCHE POST AG-REG	41,384	35.97	1,488,582.48
FRAPORT AG	1,856	80.40	149,222.40
GETLINK	23,484	11.60	272,414.40
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP	23,274	7.12	165,710.88
RYANAIR HOLDINGS PLC	1,614	15.39	24,839.46
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	14,056	89.27	1,254,779.12
BAYERISCHE MOTOREN WERKE(BMW)AG-PFD	2,508	77.85	195,247.80
CONTINENTAL AG	4,655	221.90	1,032,944.50
DAIMLER AG	42,431	65.01	2,758,439.31
FAURECIA	3,127	67.78	211,948.06
FERRARI NV	5,395	100.80	543,816.00
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	47,196	19.14	903,520.22
MICHELIN (CGDE)-B	7,634	115.55	882,108.70
NOKIAN RENKAAT OYJ	5,507	33.13	182,446.91

PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PEF	6,624	70.64	467,919.36
PSA PEUGEOT CITROEN	26,121	20.18	527,121.78
RENAULT SA	8,755	92.76	812,113.80
SCHAEFFLER AG	9,576	12.40	118,742.40
VALEO SA	9,959	54.80	545,753.20
VOLKSWAGEN AG	1,256	165.70	208,119.20
VOLKSWAGEN AG PFD	8,314	167.00	1,388,438.00
ADIDAS AG	8,339	202.30	1,686,979.70
HERMES INTERNATIONAL	1,312	520.20	682,502.40
HUGO BOSS AG	3,149	76.36	240,457.64
KERING	3,379	458.40	1,548,933.60
LUXOTTICA GROUP SPA	7,229	51.00	368,679.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	12,354	280.65	3,467,150.10
SEB SA	1,032	156.40	161,404.80
ACCOR SA	7,551	45.37	342,588.87
PADDY POWER BETFAIR PLC	3,448	79.30	273,426.40
SODEXO	3,900	79.94	311,766.00
ALTICE NV -A W/I	22,625	8.26	186,882.50
AXEL SPRINGER SE	1,698	65.55	111,303.90
EUTELSAT COMMUNICATIONS	8,726	17.91	156,282.66
JC DECAUX SA	2,828	29.00	82,012.00
LAGARDERE S.C.A.	6,108	23.32	142,438.56
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE-REG	10,851	29.55	320,647.05
PUBLICIS GROUPE	9,116	59.02	538,026.32
RTL GROUP	1,615	68.65	110,869.75
SES	17,656	11.73	207,193.16
TELENET GROUP HOLDINGS NV	2,181	53.70	117,119.70
VIVENDI SA	45,432	21.18	962,249.76
INDITEX	48,190	25.33	1,220,652.70
ZALANDO SE	5,372	42.49	228,256.28
CARREFOUR SA	26,320	16.56	435,859.20
CASINO GUICHARD PERRACHON	1,833	42.03	77,040.99
COLRUYT NV	2,173	46.15	100,283.95
JERONIMO MARTINS SGPS S.A.	12,270	14.33	175,890.45
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	54,058	19.95	1,078,457.10
METRO AG	8,344	11.93	99,543.92
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	33,462	84.91	2,841,258.42
DANONE	26,156	66.21	1,731,788.76
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	22,958	6.18	141,995.23
HEINEKEN HOLDING NV	5,292	83.15	440,029.80
HEINEKEN NV	11,685	85.96	1,004,442.60
KERRY GROUP PLC-A	7,289	84.70	617,378.30

PERNOD-RICARD SA	9,357	135.90	1,271,616.30
REMY COINTREAU	1,273	111.90	142,448.70
BEIERSDORF AG	4,089	92.34	377,578.26
HENKEL AG & CO KGAA	4,681	95.70	447,971.70
HENKEL AG & CO KGAA	7,824	102.70	803,524.80
L'OREAL	11,214	190.30	2,134,024.20
UNILEVER NV-CVA	71,537	45.85	3,279,971.45
BIOMERIEUX	1,779	63.80	113,500.20
ESSILOR INTERNATIONAL	8,802	113.40	998,146.80
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	9,181	81.06	744,211.86
FRESENIUS SE & CO KGAA	18,310	63.22	1,157,558.20
KONINKLIJKE PHILIPS NV	40,770	34.68	1,413,903.60
SIEMENS HEALTHINEERS AG	6,584	31.50	207,396.00
BAYER AG	36,504	97.47	3,558,044.88
EUROFINS SCIENTIFIC	484	422.20	204,344.80
GRIFOLS S.A.	13,951	22.75	317,385.25
IPSEN	1,807	125.70	227,139.90
MERCK KGAA	5,705	80.90	461,534.50
ORION OYJ	4,259	22.80	97,105.20
QIAGEN N.V.	10,011	26.39	264,190.29
RECORDATI SPA	4,578	29.34	134,318.52
SANOFI	50,032	65.87	3,295,607.84
UCB SA	5,753	65.08	374,405.24
ABN AMRO GROUP NV-CVA	18,916	25.55	483,303.80
AIB GROUP PLC	36,918	5.03	185,697.54
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	292,821	6.55	1,918,856.01
BANCO DE SABADELL SA	235,029	1.63	383,684.84
BANCO ESPIRITO SANTO,S.A(BES)	187,906	0.01	1,879.06
BANCO SANTANDER SA	708,624	5.37	3,809,562.62
BANK OF IRELAND GROUP PLC	43,692	7.45	325,723.86
BANKIA SA	48,396	3.63	175,677.48
BANKINTER,S.A.	26,969	8.64	233,120.03
BNP PARIBAS	49,754	63.50	3,159,379.00
CAIXABANK	166,584	3.99	665,669.66
COMMERZBANK AG	46,644	10.78	503,008.89
CREDIT AGRICOLE SA	49,578	13.62	675,252.36
ERSTE GROUP BANK AG	13,095	40.35	528,383.25
ING GROEP NV-CVA	171,125	13.95	2,388,220.50
INTESA SANPAOLO	584,126	3.15	1,842,041.34
INTESA SANPAOLO-RSP	32,509	3.29	107,247.19
KBC GROUPE SA	10,878	72.94	793,441.32
MEDIOBANCA SPA	26,782	10.24	274,247.68

RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	6,677	28.85	192,631.45
SOCIETE GENERALE	32,955	45.74	1,507,526.47
UNICREDIT SPA	89,256	18.06	1,611,963.36
AMUNDI SA	2,379	66.44	158,060.76
DEUTSCHE BANK AG -REG	87,576	11.99	1,050,036.24
DEUTSCHE BOERSE AG	8,227	110.00	904,970.00
EURAZEO	2,022	72.55	146,696.10
EXOR NV	4,683	61.40	287,536.20
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	3,375	94.14	317,722.50
NATIXIS	45,362	6.65	302,020.19
WENDEL	1,082	122.70	132,761.40
AEGON NV	74,580	6.05	451,507.32
AGEAS	8,915	44.03	392,527.45
ALLIANZ SE-REG	19,730	193.28	3,813,414.40
ASSICURAZIONI GENERALI	56,608	16.70	945,636.64
AXA SA	83,032	23.41	1,944,194.28
CNP ASSURANCES	8,978	21.10	189,435.80
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	3,033	115.80	351,221.40
MAPFRE SA	46,367	2.86	133,026.92
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	6,847	197.60	1,352,967.20
NN GROUP NV	14,071	39.09	550,035.39
POSTE ITALIANE SPA	26,562	7.91	210,158.54
SAMPO OYJ-A SHS	19,358	44.35	858,527.30
SCOR SE	8,353	35.32	295,027.96
UNIPOLSAI SPA	49,963	2.18	109,269.08
DEUTSCHE WOHNEN SE	15,822	37.60	594,907.20
VONOVIA SE	21,002	39.82	836,299.64
AMADEUS IT GROUP SA	19,271	59.18	1,140,457.78
ATOS SE	4,258	111.25	473,702.50
CAPGEMINI SA	6,963	104.60	728,329.80
DASSAULT SYSTEMES SA	5,529	104.60	578,333.40
SAP SE	43,413	89.14	3,869,834.82
UBISOFT ENTERTAINMENT SA	2,839	77.44	219,852.16
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,981	52.46	313,763.26
WIRECARD AG	5,168	107.45	555,301.60
INGENICO S.A.	2,691	70.18	188,854.38
NOKIA OYJ	260,197	4.94	1,286,413.96
1&1 DRILLISCH AG	2,188	58.85	128,763.80
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	145,054	14.09	2,043,810.86
ELISA OYJ	5,909	35.93	212,310.37
ILIAD SA	1,016	162.85	165,455.60
KONINKLIJKE KPN NV	141,551	2.49	352,461.99

	ORANGE S.A.	87,968	14.77	1,299,287.36
	PROXIMUS SA	6,313	25.09	158,393.17
	TELECOM ITALIA SPA	494,065	0.82	408,196.50
	TELECOM ITALIA-RNC	251,378	0.72	181,193.26
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	40,394	3.83	154,830.20
	TELEFONICA S.A.	204,731	8.33	1,707,251.80
	E.ON SE	97,365	8.79	855,838.35
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	101,010	3.21	324,242.10
	ELECTRICITE DE FRANCE(EDF)	23,877	11.45	273,391.65
	ENDESA S.A.	15,037	19.03	286,154.11
	ENEL SPA	354,797	5.19	1,843,525.21
	ENGIE	77,173	14.18	1,094,313.14
	FORTUM OYJ	19,563	18.34	358,883.23
	GAS NATURAL SDG SA	16,170	20.71	334,880.70
	IBERDROLA SA	253,332	6.31	1,599,538.24
	INNOGY SE	5,851	35.80	209,465.80
	RED ELECTRICA CORPORATION SA	18,384	16.49	303,244.08
	RWE AG	22,852	21.12	482,634.24
	SUEZ	17,725	11.70	207,471.12
	TERNA SPA	66,384	4.87	323,754.76
	UNIPER SE	8,953	23.90	213,976.70
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	21,587	19.18	414,038.66
	ASML HOLDING NV	16,826	158.60	2,668,603.60
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	48,425	21.23	1,028,062.75
	STMICROELECTRONICS NV	28,042	18.17	509,663.35
	ユーロ 小計	8,810,697		175,453,279.60 (23,372,131,375)
英ポンド	BP PLC	873,772	5.24	4,578,565.28
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	199,974	25.28	5,056,342.59
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	162,293	25.88	4,200,142.84
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	32,660	5.47	178,715.52
	ANGLO AMERICAN PLC	58,674	16.75	982,789.50
	ANTOFAGASTA PLC	19,439	9.60	186,614.40
	BHP BILLITON PLC	89,998	15.33	1,380,389.32
	CRODA INTERNATIONAL PLC	6,223	44.38	276,176.74
	FRESNILLO PLC	8,512	12.77	108,698.24
	GLENCORE PLC	541,600	3.77	2,042,915.20
	JOHNSON MATTHEY PLC	9,426	31.99	301,537.74
	MONDI PLC	17,158	20.24	347,277.92
	RANDGOLD RESOURCES LTD	3,897	57.44	223,843.68
	RIO TINTO PLC	52,904	39.24	2,075,952.96
	ASHTREAD GROUP PLC	23,067	20.10	463,646.70

BAE SYSTEMS PLC	141,730	6.13	869,655.28
BUNZL PLC	13,431	20.70	278,021.70
COBHAM PLC	108,087	1.15	124,732.39
DCC PLC	3,732	66.90	249,670.80
FERGUSON PLC	11,452	55.62	636,960.24
IMI PLC	12,034	10.78	129,726.52
MEGGITT PLC	36,960	4.60	170,126.88
MELROSE INDUSTRIES PLC	212,580	2.16	459,172.80
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	71,679	8.42	603,967.25
SMITHS GROUP PLC	18,742	15.86	297,248.12
TRAVIS PERKINS PLC	9,272	12.92	119,794.24
WEIR GROUP PLC/THE	9,222	21.88	201,777.36
BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	11,442	7.21	82,519.70
CAPITA PLC	30,870	1.84	56,924.28
EXPERIAN PLC	41,178	16.21	667,701.27
G4S PLC	74,291	2.54	188,847.72
INTERTEK GROUP PLC	6,794	47.60	323,394.40
RELX PLC	45,547	15.48	705,295.29
EASYJET PLC	7,630	15.80	120,554.00
ROYAL MAIL PLC	36,064	5.81	209,603.96
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	39,736	5.51	219,104.30
BURBERRY GROUP PLC	20,414	17.60	359,388.47
PERSIMMON PLC	13,916	26.94	374,897.04
TAYLOR WIMPEY PLC	129,687	1.92	250,101.37
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	5,336	39.99	213,386.64
CARNIVAL PLC	8,091	46.92	379,629.72
COMPASS GROUP PLC	70,275	14.95	1,050,962.62
GVC HOLDINGS PLC	23,842	8.92	212,789.85
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	7,601	44.09	335,128.09
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	32,557	3.42	111,344.94
TUI AG-DI	17,636	16.17	285,174.12
WHITBREAD PLC	7,771	41.77	324,594.67
ITV PLC	151,064	1.44	218,816.20
PEARSON PLC	38,689	7.96	308,119.19
SKY PLC	46,118	13.59	626,743.62
WPP PLC	54,571	11.16	609,285.21
KINGFISHER PLC	100,357	3.01	302,074.57
MARKS & SPENCER GROUP PLC	71,350	2.83	202,348.60
NEXT PLC	6,971	51.86	361,516.06
SAINSBURY (J) PLC	64,136	2.66	171,114.84
TESCO PLC	426,993	2.39	1,022,221.24
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	100,809	2.34	235,993.86

ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	16,771	26.34	441,748.14
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	101,110	38.50	3,892,735.00
COCA-COLA HBC AG-CDI	8,704	24.42	212,551.68
DIAGEO PLC	108,215	24.67	2,669,664.05
IMPERIAL BRANDS PLC	42,416	24.72	1,048,523.52
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	28,609	54.94	1,571,778.46
UNILEVER PLC	54,125	39.30	2,127,112.50
CONVATEC GROUP PLC	61,239	2.13	130,439.07
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	19,832	6.62	131,446.49
SMITH & NEPHEW PLC	39,633	13.65	540,990.45
ASTRAZENECA PLC	55,594	49.91	2,774,696.54
GLAXOSMITHKLINE PLC	217,148	14.12	3,066,564.05
SHIRE PLC	38,624	38.20	1,475,436.80
BARCLAYS PLC	759,705	2.13	1,618,171.65
HSBC HOLDINGS PLC	878,070	7.11	6,250,102.26
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,194,667	0.65	2,076,533.55
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	152,437	2.73	416,610.32
STANDARD CHARTERED PLC	145,314	7.52	1,093,487.85
3I GROUP PLC	44,300	9.16	405,788.00
HARGREAVES LANSDOWN PLC	11,038	17.29	190,902.21
INVESTEC PLC	33,008	5.61	185,240.89
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	12,977	42.73	554,507.21
SCHRODERS PLC	6,213	32.44	201,549.72
ST JAMES' S PLACE PLC	21,830	11.17	243,841.10
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	117,114	3.64	427,114.75
ADMIRAL GROUP PLC	7,842	20.02	156,996.84
AVIVA PLC	180,213	5.22	942,153.56
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	63,289	3.74	237,143.88
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	249,238	2.78	693,878.59
OLD MUTUAL PLC	225,291	2.48	559,172.26
PRUDENTIAL PLC	111,192	18.54	2,061,499.68
RSA INSURANCE GROUP PLC	40,508	6.49	263,058.95
AUTO TRADER GROUP PLC	42,053	3.41	143,737.15
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	18,215	12.76	232,423.40
SAGE GROUP PLC/THE	49,630	6.27	311,477.88
BT GROUP PLC	365,274	2.39	873,187.49
VODAFONE GROUP PLC	1,179,668	2.09	2,466,095.95
CENTRICA PLC	254,915	1.47	375,234.88
NATIONAL GRID PLC	145,154	8.05	1,169,796.08
SEVERN TRENT PLC	9,868	18.69	184,482.26
SSE PLC	44,560	13.37	595,990.00
UNITED UTILITIES GROUP PLC	33,192	7.14	237,256.41

	英ポンド 小計	13,629,049		82,325,159.57 (12,561,996,098)
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	10,101	23.23	234,646.23
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	321	602.50	193,402.50
	GIVAUDAN-REG	409	2,188.00	894,892.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	19,169	54.24	1,039,726.56
	SIKA AG	99	7,180.00	710,820.00
	ABB LTD	81,802	22.95	1,877,355.90
	GEBERIT AG-REG	1,593	423.50	674,635.50
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,025	194.60	199,465.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	1,977	202.60	400,540.20
	ADECCO GROUP AG-REG	7,019	64.90	455,533.10
	SGS SA	219	2,367.00	518,373.00
	KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	2,362	153.45	362,448.90
	CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-REGD A	23,163	92.88	2,151,379.44
	THE SWATCH GROUP AG-B	1,330	463.80	616,854.00
	THE SWATCH GROUP AG-REG	2,516	86.90	218,640.40
	DUFREY AG-REG	1,650	137.20	226,380.00
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	109	1,796.00	195,764.00
	LINDT & SPRUENGLI AG	45	6,225.00	280,125.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	4	74,500.00	298,000.00
	NESTLE SA-REGISTERED	136,671	75.24	10,283,126.04
	SONOVA HOLDING AG	2,643	161.15	425,919.45
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	435	621.50	270,352.50
	LONZA GROUP AG-REG	3,160	239.00	755,240.00
	NOVARTIS AG-REG SHS	97,442	75.24	7,331,536.08
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	30,853	217.75	6,718,240.75
	VIFOR PHARMA AG	2,258	152.70	344,796.60
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	107,601	16.77	1,805,006.77
	JULIUS BAER GROUP LTD	9,558	57.98	554,172.84
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,867	91.35	170,550.45
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	818	707.50	578,735.00
	UBS GROUP AG	162,424	16.46	2,673,499.04
	BALOISE HOLDING AG	1,987	155.70	309,375.90
SWISS LIFE HOLDING AG	1,472	357.10	525,651.20	
SWISS RE AG	13,294	93.80	1,246,977.20	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	6,458	312.90	2,020,708.20	
SWISS PRIME SITE-REG	3,061	91.20	279,163.20	
SWISSCOM AG-REG	1,163	464.80	540,562.40	
	スイスフラン 小計	738,078		48,382,595.35 (5,387,885,818)
	LUNDIN PETROLEUM AB	8,864	239.60	2,123,814.40

スウェーデンク ローナ	BOLIDEN AB	12,103	312.40	3,780,977.20	
	ALFA LAVAL AB	12,041	215.40	2,593,631.40	
	ASSA ABLOY AB-B	43,430	179.70	7,804,371.00	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	30,249	335.60	10,151,564.40	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	16,107	305.10	4,914,245.70	
	SANDVIK AB	50,953	152.90	7,790,713.70	
	SKANSKA AB-B SHS	15,711	166.70	2,619,023.70	
	SKF AB-B SHARES	16,642	172.70	2,874,073.40	
	VOLVO AB-B SHS	69,797	151.75	10,591,694.75	
	SECURITAS AB-B SHS	12,234	136.85	1,674,222.90	
	ELECTROLUX AB-SER B	11,046	260.50	2,877,483.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	18,593	83.44	1,551,399.92	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	40,173	144.42	5,801,784.66	
	ICA GRUPPEN AB	3,550	302.80	1,074,940.00	
	SWEDISH MATCH AB	7,555	379.40	2,866,367.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	26,240	215.90	5,665,216.00	
	GETINGE AB-B SHS	9,989	95.96	958,544.44	
	NORDEA BANK AB	131,614	87.72	11,545,180.08	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A	66,708	84.88	5,662,175.04	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	69,942	95.78	6,699,044.76	
	SWEDBANK AB - A SHARES	39,030	188.65	7,363,009.50	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	6,266	184.60	1,156,703.60	
	INVESTOR AB-B SHS	19,895	376.00	7,480,520.00	
	KINNEVIK AB-B SHS	11,257	308.30	3,470,533.10	
LUNDBERGS AB-B SHS	1,567	586.00	918,262.00		
ERICSSON LM-B SHS	136,331	66.82	9,109,637.42		
HEXAGON AB-B SHS	11,065	504.40	5,581,186.00		
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	2,694	583.00	1,570,602.00		
TELE2 AB-B SHS	18,224	111.65	2,034,709.60		
TELIA CO AB	126,963	42.71	5,422,589.73		
スウェーデンクローナ 小計		1,046,833		145,728,220.40	(1,863,863,938)
ノルウェーク ローネ	STATOIL ASA	49,847	198.50	9,894,629.50	
	NORSK HYDRO ASA	60,434	51.16	3,091,803.44	
	YARA INTERNATIONAL ASA	7,492	324.60	2,431,903.20	
	SCIBSTED ASA-B SHS	3,724	212.00	789,488.00	
	MARINE HARVEST ASA	18,939	174.80	3,310,537.20	
	ORKLA ASA	33,915	75.06	2,545,659.90	
	DNB ASA	43,520	138.90	6,044,928.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	9,988	127.60	1,274,468.80	
	TELENOR ASA	33,605	176.85	5,943,044.25	
		261,464		35,326,462.29	

	ノルウェークローネ 小計			(485,738,856)
デンマーククローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	4,096	553.40	2,266,726.40
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	10,279	297.60	3,059,030.40
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	9,608	406.90	3,909,495.20
	ISS A/S	6,409	216.60	1,388,189.40
	A P MOLLER-MAERSK A/S-A	168	8,895.00	1,494,360.00
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	295	9,410.00	2,775,950.00
	DSV A/S	8,324	492.10	4,096,240.40
	PANDORA A/S	4,763	695.80	3,314,095.40
	CARLSBERG AS-B	4,678	686.40	3,210,979.20
	COLOPLAST-B	4,991	518.40	2,587,334.40
	WILLIAM DEMANT HOLDING	4,455	233.40	1,039,797.00
	GENMAB A/S	2,773	1,221.50	3,387,219.50
	H LUNDBECK A/S	3,618	348.50	1,260,873.00
	NOVO NORDISK A/S-B	81,148	285.30	23,151,524.40
	DANSKE BANK A/S	32,840	218.80	7,185,392.00
	TRYG A/S	5,005	144.00	720,720.00
ORSTED A/S	8,516	390.00	3,321,240.00	
	デンマーククローネ 小計	191,966		68,169,166.70 (1,218,864,700)
オーストラリアドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	12,579	30.97	389,571.63
	OIL SEARCH LTD	60,868	7.81	475,379.08
	ORIGIN ENERGY LIMITED	74,587	9.26	690,675.62
	SANTOS LTD	80,415	6.13	492,943.95
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	41,107	31.79	1,306,791.53
	ALUMINA LTD	106,977	2.62	280,279.74
	AMCOR LIMITED	50,321	14.01	704,997.21
	BHP BILLITON LTD	141,042	31.27	4,410,383.34
	BLUESCOPE STEEL LTD	23,089	16.91	390,434.99
	BORAL LIMITED	55,663	6.88	382,961.44
	FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	72,860	4.57	332,970.20
	INCITEC PIVOT LTD	85,406	3.77	321,980.62
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	18,691	23.40	437,369.40
	NEWCREST MINING LIMITED	31,386	20.77	651,887.22
	ORICA LIMITED	17,981	19.07	342,897.67
	RIO TINTO LIMITED	17,862	79.52	1,420,386.24
	SOUTH32 LTD	223,474	3.58	800,036.92
	CIMIC GROUP LTD	4,062	44.76	181,815.12
	BRAMBLES LIMITED	72,482	9.74	705,974.68
	SEEK LIMITED	16,538	19.33	319,679.54
AURIZON HOLDINGS LTD	86,884	4.48	389,240.32	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	23,822	26.47	630,568.34	

	CROWN RESORTS LTD	16,521	12.78	211,138.38	
	DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LIMITED	2,137	39.79	85,031.23	
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	2,650	55.94	148,241.00	
	TABCORP HOLDINGS LIMITED	88,199	4.40	388,075.60	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	20,543	3.57	73,338.51	
	WESFARMERS LIMITED	49,585	42.86	2,125,213.10	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	55,613	27.02	1,502,663.26	
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	26,828	9.03	242,256.84	
	TREASURY WINE ESTATES LTD	31,984	17.99	575,392.16	
	COCHLEAR LIMITED	2,344	185.67	435,210.48	
	HEALTHSCOPE LTD	76,014	2.03	154,308.42	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	6,175	63.34	391,124.50	
	SONIC HEALTHCARE LTD	17,837	23.31	415,780.47	
	CSL LIMITED	20,122	161.75	3,254,733.50	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	130,470	27.15	3,542,260.50	
	BANK OF QUEENSLAND LIMITED	17,851	10.52	187,792.52	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	19,841	10.59	210,116.19	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	77,456	73.46	5,689,917.76	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	114,924	29.08	3,341,989.92	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	146,383	29.18	4,271,455.94	
	AMP LIMITED	129,763	4.06	526,837.78	
	ASX LTD	9,287	56.74	526,944.38	
	CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	23,022	10.86	250,018.92	
	MACQUARIE GROUP LTD	14,151	105.88	1,498,307.88	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	112,664	7.78	876,525.92	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	128,724	2.86	368,150.64	
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	58,227	10.11	588,674.97	
	SUNCORP GROUP LTD	59,211	13.76	814,743.36	
	COMPUTERSHARE LIMITED	19,458	16.86	328,061.88	
	REA GROUP LTD	2,727	79.43	216,605.61	
	TELSTRA CORPORATION LIMITED	169,731	3.10	526,166.10	
	TPG TELECOM LTD	17,758	5.24	93,051.92	
	AGL ENERGY LIMITED	29,039	20.50	595,299.50	
	AUSNET SERVICES	85,220	1.66	141,465.20	
	オーストラリアドル 小計	3,100,555		50,656,119.14 (4,200,405,399)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	33,434	6.28	209,965.52	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	46,513	6.20	288,380.60	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C	21,979	12.20	268,143.80	
	RYMAN HEALTHCARE LIMITED	19,820	10.60	210,092.00	
	SPARK NEW ZEALAND LIMITED	79,808	3.35	267,356.80	
	MERCURY NZ LTD	34,827	3.13	109,008.51	

	MERIDIAN ENERGY LTD	41,571	2.85	118,477.35
	ニュージーランドドル 小計	277,952		1,471,424.58 (113,917,690)
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	119,924	93.00	11,152,932.00
	NWS HOLDINGS LTD	69,500	14.62	1,016,090.00
	MTR CORPORATION	67,000	43.65	2,924,550.00
	MINIH GROUP LTD	32,000	38.55	1,233,600.00
	LI & FUNG LTD	237,200	3.88	920,336.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	56,000	42.40	2,374,400.00
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	27,000	22.90	618,300.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	106,000	69.35	7,351,100.00
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	44,000	21.85	961,400.00
	SANDS CHINA LTD	107,200	43.00	4,609,600.00
	SHANGRI-LA ASIA LTD.	64,000	14.84	949,760.00
	SJM HOLDINGS LIMITED	80,000	7.48	598,400.00
	WYNN MACAU LTD	70,800	29.75	2,106,300.00
	WH GROUP LIMITED	397,500	7.80	3,100,500.00
	BANK OF EAST ASIA	52,820	33.85	1,787,957.00
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	170,000	39.35	6,689,500.00
	HANG SENG BANK LTD	33,100	192.50	6,371,750.00
	FIRST PACIFIC COMPANY	86,000	4.00	344,000.00
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	51,700	259.00	13,390,300.00
	KINGSTON FINANCIAL GROUP LIMITED	162,000	3.75	607,500.00
	AIA GROUP LTD	529,000	68.85	36,421,650.00
	CK ASSET HOLDINGS LTD	113,924	67.15	7,649,996.60
	HANG LUNG GROUP LTD	42,000	24.20	1,016,400.00
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	98,000	18.38	1,801,240.00
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	56,020	49.30	2,761,786.00
	HYSAN DEVELOPMENT CO	29,000	44.20	1,281,800.00
	KERRY PROPERTIES LTD	27,500	36.85	1,013,375.00
	NEW WORLD DEVELOPMENT	261,333	11.18	2,921,702.94
	SINO LAND CO	124,200	13.00	1,614,600.00
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	64,000	121.60	7,782,400.00
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	24,500	75.95	1,860,775.00
	SWIRE PROPERTIES LIMITED	53,000	27.30	1,446,900.00
	WHARF HOLDINGS LTD	59,000	25.35	1,495,650.00
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	48,000	55.25	2,652,000.00
	WHEELLOCK&COMPANY LTD	33,000	55.30	1,824,900.00
	PCCW LIMITED	194,000	4.75	921,500.00
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	30,000	62.00	1,860,000.00
	CLP HOLDINGS LTD	70,100	81.35	5,702,635.00
	HK ELECTRIC INVESTMENTS-SS	111,000	7.30	810,300.00

	HONG KONG & CHINA GAS	379,079	16.20	6,141,079.80	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	60,000	57.90	3,474,000.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	12,300	107.90	1,327,170.00	
	香港ドル 小計	4,452,700		162,890,135.34 (2,272,317,387)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	58,600	8.08	473,488.00	
	SEMCORP INDUSTRIES LTD	43,720	3.13	136,843.60	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG	68,300	3.46	236,318.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	90,000	1.17	105,300.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	107,000	2.23	238,610.00	
	SATS LTD	26,800	5.39	144,452.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	25,066	10.75	269,459.50	
	GENTING SINGAPORE PLC	280,700	1.17	328,419.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	56,350	2.74	154,399.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	4,700	34.00	159,800.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	353,600	0.35	123,760.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	69,900	3.23	225,777.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	76,900	29.79	2,290,851.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	139,100	13.69	1,904,279.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	59,500	29.85	1,776,075.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	35,600	7.74	275,544.00	
	CAPITALAND LTD	104,500	3.75	391,875.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	16,100	12.52	201,572.00	
	UOL GROUP LIMITED	21,700	8.70	188,790.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	355,515	3.40	1,208,751.00	
STARHUB LIMITED	42,500	2.25	95,625.00		
	シンガポールドル 小計	2,036,151		10,929,988.10 (901,286,818)	
イスラエルシュケル	FRUTAROM INDUSTRIES LTD	1,842	336.10	619,096.20	
	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	21,574	16.00	345,184.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,198	433.90	519,812.20	
	BANK HAPUALIM BM	44,062	24.84	1,094,500.08	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	65,574	21.31	1,397,381.94	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	5,442	67.60	367,879.20	
	AZRIELI GROUP	2,140	166.10	355,454.00	
	NICE LTD	2,768	334.60	926,172.80	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	100,118	4.64	464,847.87	
	イスラエルシュケル 小計	244,718		6,090,328.29 (185,633,206)	
	合 計	50,011,936		170,304,759,182 (170,304,759,182)	

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

通貨	銘柄数	組入株式時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	株式 603銘柄	62.5%	65.4%
カナダドル	株式 88銘柄	3.6%	3.8%
ユーロ	株式 241銘柄	13.1%	13.7%
英ポンド	株式 99銘柄	7.1%	7.4%
スイスフラン	株式 37銘柄	3.0%	3.2%
スウェーデンクローナ	株式 31銘柄	1.0%	1.1%
ノルウェークローネ	株式 9銘柄	0.3%	0.3%
デンマーククローネ	株式 17銘柄	0.7%	0.7%
オーストラリアドル	株式 56銘柄	2.4%	2.5%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	0.1%	0.1%
香港ドル	株式 42銘柄	1.3%	1.3%
シンガポールドル	株式 21銘柄	0.5%	0.5%
イスラエルシェケル	株式 9銘柄	0.1%	0.1%

(b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	AGNC INVESTMENT CORPORATION	15,080	285,615.20	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	4,326	527,166.36	
		AMERICAN TOWER CORP	18,886	2,563,396.78	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	46,842	483,409.44	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,026	974,946.54	
		BOSTON PROPERTIES INC	7,005	828,831.60	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	12,150	169,857.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,242	357,812.70	
		COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	24,561	147,857.22	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	8,934	906,532.98	
		DUKE REALTY CORP	16,657	432,415.72	
		EQUITY RESIDENTIAL	16,005	965,261.55	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,713	642,031.45	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	5,405	466,343.40	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	3,224	361,603.84	
		GGP INC	25,302	490,605.78	
		HCP, INC.	22,100	493,714.00	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	32,068	629,174.16	
		HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	283,000	91,975.00	
		INVITATION HOMES INC	14,734	338,439.98	
IRON MOUNTAIN INC	12,165	410,933.70			
KIMCO REALTY CORPORATION	20,926	277,060.24			

	LIBERTY PROPERTY TRUST	6,876	275,177.52
	MACERICH COMPANY/THE	5,229	288,902.25
	MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	4,759	426,977.48
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES	6,416	240,022.56
	PROLOGIS INC	23,366	1,510,378.24
	PUBLIC STORAGE	6,879	1,332,531.09
	REALTY INCOME CORPORATION	11,714	581,131.54
	REGENCY CENTERS CORP	6,080	340,480.00
	SIMON PROPERTY GROUP INC	13,651	2,003,147.74
	SL GREEN REALTY CORP	3,945	380,258.55
	UDR INC	10,651	375,341.24
	VENTAS INC	14,830	702,348.80
	VEREIT INC	44,740	297,968.40
	VORNADO REALTY TRUST	7,603	494,271.03
	WELLTOWER INC	16,264	821,657.28
	WEYERHAEUSER CO	33,634	1,216,878.12
	米ドル 小計	818,988	24,132,456.48 (2,640,814,712)
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,257	148,187.94
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	7,441	171,515.05
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	3,585	101,312.10
	カナダドル 小計	18,283	421,015.09 (35,895,746)
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	1,550	138,957.50
	GECINA SA	2,152	296,330.40
	ICADE	1,265	100,694.00
	KLEPIERRE	9,305	323,348.75
	UNIBAIL-RODAMCO SE	4,523	874,069.75
	ユーロ 小計	18,795	1,733,400.40 (230,906,267)
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	42,136	278,434.68
	HAMMERSON PLC	34,414	185,560.28
	LAND SECURITIES GROUP PLC	32,703	315,845.57
	SEGRO PLC	40,873	257,009.42
	英ポンド 小計	150,126	1,036,849.95 (158,212,933)
オーストラリアドル	APA GROUP	48,387	388,063.74
	DEXUS	47,512	441,386.48
	GOODMAN GROUP	84,182	747,536.16
	GPT GROUP	69,713	324,862.58

	LENLEASE GROUP	25,262	450,168.84
	MIRVAC GROUP	140,993	305,954.81
	SCENTRE GROUP	234,290	925,445.50
	STOCKLAND	103,417	408,497.15
	SYDNEY AIRPORT	49,760	337,372.80
	TRANSURBAN GROUP	93,469	1,067,415.98
	VICINITY CENTRES	146,656	350,507.84
	WESTFIELD CORP	87,803	779,690.64
	オーストラリアドル 小計	1,131,444	6,526,902.52 (541,210,756)
香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	182,000	1,870,960.00
	LINK REIT	92,500	6,192,875.00
	香港ドル 小計	274,500	8,063,835.00 (112,490,498)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	118,300	317,044.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	130,000	231,400.00
	CAPITALAND MALL TRUST	102,800	213,824.00
	SUNTEC REIT	112,900	214,510.00
	シンガポールドル 小計	464,000	976,778.00 (80,545,113)
	合計		3,800,076,025 (3,800,076,025)

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

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	投資証券 38銘柄	1.5%	69.5%
カナダドル	投資証券 3銘柄	0.0%	0.9%
ユーロ	投資証券 5銘柄	0.1%	6.1%
英ポンド	投資証券 4銘柄	0.1%	4.2%
オーストラリアドル	投資証券 12銘柄	0.3%	14.2%
香港ドル	投資証券 2銘柄	0.1%	3.0%
シンガポールドル	投資証券 4銘柄	0.0%	2.1%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

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

	(平成29年 4月26日現在)	(平成30年 4月26日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	10,183,907	21,659,687
金銭信託	76,318,953	1,361,774,157
コール・ローン	158,791,958	207,294,528
株式	-	1,856,620,729
国債証券	332,535,056	-
投資信託受益証券	-	286,282,698
投資証券	-	13,237,602
派生商品評価勘定	392,938,251	136,587,696
現先取引勘定	6,202,108,000	-
未収入金	442,800,000	-
未収配当金	-	1,350,655
前払金	-	99,958,286
差入委託証拠金	1,470,610,559	366,739,274
流動資産合計	9,086,286,684	4,351,505,312
資産合計	9,086,286,684	4,351,505,312
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	8,141,532	252,998,103
前受金	338,756,037	-
未払解約金	-	35,631,000
未払利息	460	607
その他未払費用	2,793	78,063
流動負債合計	346,900,822	288,707,773
負債合計	346,900,822	288,707,773
純資産の部		
元本等		
元本	7,131,406,613	2,878,626,011
剰余金		
剰余金又は欠損金()	1,607,979,249	1,184,171,528
元本等合計	8,739,385,862	4,062,797,539
純資産合計	8,739,385,862	4,062,797,539
負債純資産合計	9,086,286,684	4,351,505,312

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30年 4月26日
----	------------------------------

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

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成29年 4月26日現在)	(平成30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	7,131,406,613口	2,878,626,011口
2. 1単位当たり純資産の額	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)	1口当たり純資産額 1.4114円 (10,000口当たりの純資産額 14,114円)

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成29年 4月27日 至 平成30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、株式、国債証券、投資信託受益証券、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っております。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

. 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成30年 4月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、投資信託受益証券、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

(平成30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				

市場取引以外の取引	買建	1,967,600,096	-	1,867,641,810	99,958,286
	MSCIE 1806	1,967,600,096	-	1,867,641,810	99,958,286
	為替予約取引				
	買建	5,079,000,000	-	5,215,587,696	136,587,696
	米ドル	5,079,000,000	-	5,215,587,696	136,587,696
	売建	3,582,000,000	-	3,735,039,817	153,039,817
	米ドル	3,582,000,000	-	3,735,039,817	153,039,817
	合計	10,628,600,096	-	10,818,269,323	116,410,407

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

(2) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 平成29年 4月27日 至 平成30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

(平成30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	7,131,406,613円
同期中における追加設定元本額	3,558,112,555円
同期中における一部解約元本額	7,810,893,157円
平成30年 4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	603,108,556円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	1,049,645,455円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	68,332,612円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	560,106,759円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	503,211,661円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	3,275,102円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	191,901円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	651,822円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	6,082,672円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	8,535,337円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	46,394,792円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	4,320,560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>	24,768,782円
合計	2,878,626,011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	CIA DE MINAS BUENAVENTURA S.A-ADR	700	16.17	11,319.00	

	SOUTHERN COPPER CORPORATION	300	53.02	15,906.00	
	NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR	500	88.47	44,235.00	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	1,200	35.43	42,516.00	
	YUM CHINA HOLDINGS INC	1,400	39.46	55,244.00	
	CTRIP.COM INTERNATIONAL-ADR	1,400	41.29	57,806.00	
	JD.COM INC-ADR	2,400	35.88	86,112.00	
	VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR	1,500	15.26	22,890.00	
	CREDICORP LTD	200	231.89	46,378.00	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	3,400	1.42	4,848.40	
	58.COM INC-ADR	300	80.52	24,156.00	
	ALIBABA GROUP HOLDING LTD-ADR	4,200	170.22	714,924.00	
	AUTOHOME INC-ADR	200	93.08	18,616.00	
	BAIDU INC - SPON ADR	1,000	231.41	231,410.00	
	MOMO INC-SPON ADR	400	34.30	13,720.00	
	NETEASE.COM INC -ADR	300	249.07	74,721.00	
	SINA CORP	200	91.62	18,324.00	
	WEIBO CORP-SPON ADR	200	108.88	21,776.00	
	YY INC-ADR	200	91.89	18,378.00	
	米ドル 小計	20,000		1,523,279.40 (166,692,464)	
メキシコペソ	CEMEX SAB-CPO	53,400	12.47	665,898.00	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV	14,000	63.56	889,840.00	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	510	393.85	200,863.50	
	MEXICHEM SAB DE CV	3,800	58.55	222,490.00	
	ALFA S.A.B. -A	11,100	23.36	259,296.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	1,700	63.79	108,443.00	
	GROUP AEROPORT DEL SURESTE-B	760	332.14	252,426.40	
	GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B	1,300	195.24	253,812.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INFRAESTRUCTURA	835	190.12	158,750.20	
	GRUPO TELEVISA SAB-SER CPO	9,000	65.59	590,310.00	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	700	128.99	90,293.00	
	WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV	19,200	50.23	964,416.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	1,600	128.66	205,856.00	
	COCA-COLA FEMSA S.A. DE C.V	1,800	120.78	217,404.00	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	7,100	172.57	1,225,247.00	
	GRUMA S.A.B. -B	795	225.90	179,590.50	
	GRUPO BIMBO SAB-SERIES A	6,000	43.27	259,620.00	
	GRUPO LALA SAB DE CV	2,300	24.02	55,246.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	5,600	33.71	188,776.00	
	BANCO SANTANDER MEXICO-B	6,695	27.71	185,518.45	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE S.A.B. DE C.V.	9,100	115.55	1,051,505.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	8,500	30.69	260,865.00	

	GENEREA SAB DE CV	3,600	14.85	53,460.00
	AMERICA MOVIL SAB DE C.V.	123,300	17.50	2,157,750.00
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA NOVA	2,000	82.33	164,660.00
	メキシコペソ 小計	294,695		10,862,336.05 (63,110,172)
ブラジルリアル	COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	600	39.35	23,610.00
	PETROLEO BRASILEIRO SA-PETROBRAS	10,900	23.50	256,150.00
	PETROLEO BRASILEIRO SA-PETROBRAS-PR	14,400	21.73	312,912.00
	ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	1,300	61.02	79,326.00
	BRASKEM SA-PREF A	600	45.23	27,138.00
	COMPANHIA SIDERURGICA NACIONAL S.A.-CSN	2,300	9.14	21,022.00
	FIBRIA CELULOSE SA	900	67.37	60,633.00
	GERDAU S.A.-PREF	3,800	16.77	63,726.00
	SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	1,600	39.20	62,720.00
	VALE SA	11,600	47.95	556,220.00
	EMPRESA BRASILEIRA DE AERONAUTICA S.A.	2,400	23.10	55,440.00
	WEG SA	2,100	17.10	35,910.00
	WEG SA-NEW	630	17.10	10,773.00
	COMPANHIA DE CONCESSOES RODOVIARIAS	4,400	11.64	51,216.00
	LOCALIZA RENT A CAR SA	1,800	29.70	53,460.00
	RUMO SA	4,000	13.76	55,040.00
	KROTON EDUCACIONAL SA	5,100	14.01	71,451.00
	LOJAS AMERICANAS SA	2,700	19.45	52,515.00
	LOJAS RENNER S.A.	2,600	32.03	83,278.00
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERCIO	1,500	15.25	22,875.00
	COMPANHIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICAO GRU	600	74.25	44,550.00
	RAIA DROGASIL SA	800	68.42	54,736.00
	AMBEV SA	17,300	23.17	400,841.00
	BRF-BRASIL FOODS SA	1,600	25.82	41,312.00
	JBS SA	3,000	8.97	26,910.00
	M DIAS BRANCO SA	400	43.80	17,520.00
	NATURA COSMETICOS SA	600	32.52	19,512.00
	ODONTOPREV S.A.	1,000	15.25	15,250.00
	QUALICORP SA	800	24.49	19,592.00
	HYPERMARCAS SA	1,300	32.79	42,627.00
	BANCO BRADESCO S.A.-PREF	12,320	34.73	427,873.60
	BANCO BRADESCO SA	3,740	32.39	121,138.60
	BANCO DO BRASIL S.A.	3,100	37.06	114,886.00
	ITAU UNIVANCO HOLDING SA	11,800	50.43	595,074.00
	ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	14,800	13.24	195,952.00
	BM&F BOVESPA SA	7,500	25.06	187,950.00
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	2,600	27.52	71,552.00

	PORTO SEGURO SA	400	44.88	17,952.00	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	3,000	10.94	32,820.00	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS IMOBILIARIOS	300	64.75	19,425.00	
	CIELO SA	4,500	19.20	86,400.00	
	TELEFONICA BRASIL SA	1,600	48.99	78,384.00	
	TIM PARTICIPACOES SA	3,100	15.48	47,988.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA-ELECTR	800	18.05	14,440.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA-PR B	800	22.03	17,624.00	
	CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	3,200	8.17	26,144.00	
	COMPANHIA DE SANEAMENTO BASICO DO ESTADO	1,300	35.15	45,695.00	
	EDP-ENERGIAS DO BRASIL SA	1,100	13.27	14,597.00	
	ENGIE BRASIL ENERGIA SA	600	36.60	21,960.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	700	68.92	48,244.00	
	ブラジルリアル 小計	179,890		4,824,364.20 (151,388,548)	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	1,428	10,001.00	14,281,428.00	
	EMPRESAS CMPC SA	4,579	2,413.70	11,052,332.30	
	SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA	353	33,214.00	11,724,542.00	
	LATAM AIRLINES GROUP	1,111	9,268.70	10,297,525.70	
	S.A.C.I. FALABELLA	2,668	5,960.10	15,901,546.80	
	CENCOSUD SA	5,244	1,813.20	9,508,420.80	
	CIA CERVECERIAS UNIDAS SA	541	8,421.90	4,556,247.90	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	954	3,042.90	2,902,926.60	
	BANCO DE CHILE	91,067	101.67	9,258,781.89	
	BANCO DE CREDITO E INVERSIONES	160	45,915.00	7,346,400.00	
	BANCO SANTANDER CHILE	241,600	50.28	12,147,648.00	
	ITAU CORPBANCA	563,090	6.11	3,442,732.26	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	553	7,197.80	3,980,383.40	
	AES GENER SA	10,770	167.55	1,804,513.50	
	AGUAS ANDINAS SA-A	9,579	401.99	3,850,662.21	
	COLBUN SA	28,906	150.47	4,349,485.82	
	ENEL AMERICAS SA	105,226	138.93	14,619,048.18	
	ENEL CHILE SA	71,932	76.36	5,492,727.52	
	チリペソ 小計	1,139,761		146,517,352.88 (26,519,640)	
コロンビアペソ	ECOPETRO SA	18,073	3,045.00	55,032,285.00	
	CEMENTOS ARGOS SA	1,687	9,970.00	16,819,390.00	
	GRUPO ARGOS SA	1,064	19,940.00	21,216,160.00	
	BANCOLOMBIA SA	840	33,160.00	27,854,400.00	
	BANCOLOMBIA SA-PREF	1,656	33,060.00	54,747,360.00	
	GRUPO AVAL ACCIONES SA-PF	12,922	1,240.00	16,023,280.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	859	38,680.00	33,226,120.00	

	GRUPO DE INV SURAMERICANA-PF	414	36,480.00	15,102,720.00
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	1,420	14,900.00	21,158,000.00
	コロンビアペソ 小計	38,935		261,179,715.00 (10,159,890)
ユーロ	TITAN CEMENT CO. S.A.	169	21.55	3,641.95
	OPAP SA	818	9.77	7,991.86
	FOLLI FOLLIE GROUP	123	16.40	2,017.20
	JUMBO S.A.	374	14.98	5,602.52
	ALPHA BANK AE	5,089	2.04	10,381.56
	EUROBANK ERGASIAS SA	6,806	0.92	6,295.55
	NATIONAL BANK OF GREECE	20,104	0.30	6,111.61
	PIRAEUS BANK S.A.	1,040	3.04	3,167.84
	HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	898	11.59	10,407.82
	ユーロ 小計	35,421		55,617.91 (7,408,861)
トルコリラ	TUPRAS TURKIYE PETROL RAFINE	459	104.40	47,919.60
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	5,128	11.03	56,561.84
	PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS	2,473	7.33	18,127.09
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	733	25.38	18,603.54
	KOC HOLDING AS	2,787	13.88	38,683.56
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	2,885	4.83	13,934.55
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	599	24.22	14,507.78
	TURK HAVA YOLLARI ANONIM ORTAKLIGI	2,022	17.25	34,879.50
	FORD OTOMOTIV SANAYI AS	257	55.50	14,263.50
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKASI AS	458	25.08	11,486.64
	ARCELIK AS	866	16.68	14,444.88
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	778	72.70	56,560.60
	ANADOLU EFES BIRACILIK VE	759	25.88	19,642.92
	COCA-COLA ICECEK AS	280	36.16	10,124.80
	ULKER BISKUVI SANAYI AS	564	21.30	12,013.20
	AKBANK T.A.S.	8,059	8.96	72,208.64
	TURKIYE GARANTI BANKASI	8,462	9.27	78,442.74
	TURKIYE HALK BANKASI A.S.	2,289	8.68	19,868.52
	TURKIYE IS BANKASI-C	5,769	6.16	35,537.04
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	2,747	6.27	17,223.69
	YAPI VE KREDI BANKASI	3,185	4.15	13,217.75
	HACI OMER SABANCI HOLDING	3,363	10.04	33,764.52
	TURK TELEKOMUNIKASYON AS	1,923	6.35	12,211.05
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	4,029	14.18	57,131.22
	トルコリラ 小計	60,874		721,359.17 (19,332,425)
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	278	916.00	254,648.00

	MONETA MONEY BANK AS	1,778	84.95	151,041.10
	O2 CZECH REPUBLIC AS	227	290.50	65,943.50
	CEZ AS	591	536.00	316,776.00
	チェココルナ 小計	2,874		788,408.60 (4,123,376)
ハンガリーフォ リント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS NYRT	1,351	2,946.00	3,980,046.00
	RICHTER GEDEON NYRT	512	5,235.00	2,680,320.00
	OTP BANK PLC	872	11,370.00	9,914,640.00
	ハンガリーフォリント 小計	2,735		16,575,006.00 (7,046,035)
ポーランドズロ チ	GRUPA LOTOS SA	339	55.34	18,760.26
	POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	1,097	86.70	95,109.90
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	6,350	6.02	38,227.00
	GRUPA AZOTY SA	164	54.40	8,921.60
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	194	82.60	16,024.40
	KGHM POLSKA MIEDZ SA	513	91.00	46,683.00
	CCC SA	106	264.40	28,026.40
	LPP SA	5	9,120.00	45,600.00
	CYFROWY POLSAT SA	820	25.52	20,926.40
	DINO POLSKA SA	180	91.00	16,380.00
	ALIOR BANK SA	331	70.90	23,467.90
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	120	80.00	9,600.00
	BANK MILLENNIUM SA	2,222	8.55	18,998.10
	BANK PEKAO SA	577	117.15	67,595.55
	BANK ZACHODNI WBK SA	127	365.40	46,405.80
	MBANK SA	54	441.00	23,814.00
	PKO BANK POLSKI SA	3,434	40.89	140,416.26
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	2,214	42.80	94,759.20
	CD PROJEKT SA	246	115.70	28,462.20
	ORANGE POLSKA SA	2,404	5.38	12,933.52
PLAY COMMUNICATIONS SA	418	31.98	13,367.64	
PGE SA	3,082	10.09	31,097.38	
TAURON POLSKA ENERGIA SA	3,852	2.31	8,898.12	
	ポーランドズロチ 小計	28,849		854,474.63 (26,924,495)
香港ドル	CHINA OILFIELD SERVICES-H	6,000	8.18	49,080.00
	CHINA PETROLEUM&CHEMICAL-H	94,000	7.48	703,120.00
	CHINA SHENHUA ENERGY COMPANY LIMITED -H	12,500	20.15	251,875.00
	CNOOC LTD	65,000	12.90	838,500.00
	KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	12,000	6.42	77,040.00
	PETROCHINA CO LTD	78,000	5.76	449,280.00
	YANZHOU COAL MINING CO-H	6,000	11.32	67,920.00

ALUMINUM CORP OF CHINA LTD	14,000	4.42	61,880.00
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H	4,500	46.05	207,225.00
CHINA MOLYBDENUM CO LTD	15,000	5.63	84,450.00
CHINA NATIONAL BUILDING MATERIAL CO LTD	10,000	8.70	87,000.00
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	5,000	11.22	56,100.00
LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LIMITED	6,000	8.86	53,160.00
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	6,000	11.94	71,640.00
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEMICAL COMPANY L	12,000	5.17	62,040.00
ZIJIN MINING GROUP CO LTD-H	22,000	3.61	79,420.00
AVICHINA INDUSTRY & TECH CO	8,000	4.98	39,840.00
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LIMITED	2,000	38.95	77,900.00
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	16,000	8.81	140,960.00
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS LIMITED	6,000	23.20	139,200.00
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	15,000	5.98	89,700.00
CHINA RAILWAYS CONSTRUCTION CORP-H	7,000	8.84	61,880.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INTL HLDGS LTD	8,000	9.77	78,160.00
CITIC LIMITED	21,000	11.52	241,920.00
CRRG CORP LTD-H	15,000	6.53	97,950.00
FOSUN INTERNATIONAL	9,500	16.82	159,790.00
HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	2,000	21.30	42,600.00
SHANGHAI ELECTRIC GROUP COMPANY LIMITED	10,000	2.70	27,000.00
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	2,000	20.20	40,400.00
WEICHAJ POWER CO	7,000	9.66	67,620.00
ZHUZHOU CRRG TIMES ELECTRIC CO LTD	2,000	39.15	78,300.00
CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL LIMITED	9,000	10.60	95,400.00
AIR CHINA/HONG KONG	6,000	10.14	60,840.00
BEIJING CAPITAL INTL AIRPORT-H	6,000	10.86	65,160.00
CHINA MERCHANTS PORT HLDGS COMPANY LTD	4,000	17.24	68,960.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H	6,000	8.02	48,120.00
COSCO SHIPPING PORTS LIMITED	6,000	6.49	38,940.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	4,000	10.86	43,440.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	6,000	7.93	47,580.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	12,000	13.74	164,880.00
BYD CO LTD-H	2,500	58.35	145,875.00
DONGFENG MOTOR CORPORATION	10,000	8.46	84,600.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H	2,000	29.55	59,100.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LIMITED	18,000	21.20	381,600.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY LIMITED	11,500	7.84	90,160.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD-H	8,000	14.22	113,760.00
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LIMITED	3,000	12.28	36,840.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LIMITED	4,000	43.30	173,200.00
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	5,000	27.20	136,000.00

SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	3,000	83.65	250,950.00
ALIBABA PICTURES GROUP LIMITED	50,000	0.92	46,000.00
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	39,000	0.83	32,370.00
SUN ART RETAIL GROUP LTD	8,500	9.29	78,965.00
CHINA MENGNIU DAIRY COMPANY LIMITED	10,000	28.55	285,500.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDINGS CO LTD	6,000	33.35	200,100.00
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	8,000	16.06	128,480.00
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	2,000	41.30	82,600.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LIMITED	18,000	7.25	130,500.00
HENGAN INTERNATIONAL GROUP CO LTD	2,500	68.50	171,250.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY LI	12,000	3.98	47,760.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	8,000	4.90	39,200.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	3,200	20.50	65,600.00
SINOPHARM MEDICINE HOLDING CO-H	4,400	33.35	146,740.00
3SBIO INC	3,500	17.34	60,690.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LIMITED	5,000	19.70	98,500.00
CHINA PHARMACEUTICAL GROUP LTD	18,000	20.80	374,400.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL	7,000	10.58	74,060.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL CO LTD-H	2,000	44.40	88,800.00
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	14,000	1.96	27,440.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	16,000	16.78	268,480.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA	96,000	4.32	414,720.00
BANK OF CHINA LTD	291,000	4.17	1,213,470.00
BANK OF COMMUNICATIONS LTD-H	32,000	6.35	203,200.00
CHINA CITIC BANK	33,000	5.49	181,170.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	308,000	8.10	2,494,800.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	9,000	3.92	35,280.00
CHINA MERCHANTS BANK- H	14,500	32.75	474,875.00
CHINA MINSHENG BANKING-H	20,500	7.30	149,650.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD-H	9,000	6.12	55,080.00
INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK OF CHINA	270,000	6.79	1,833,300.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEMENT-H	32,000	2.77	88,640.00
CHINA EVERBRIGHT LIMITED	4,000	16.90	67,600.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO	12,000	4.96	59,520.00
CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT	37,000	2.67	98,790.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	8,500	18.36	156,060.00
FAR EAST HORIZON LTD	7,000	7.71	53,970.00
GF SECURITIES CO LTD-H	5,000	13.74	68,700.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	12,000	10.50	126,000.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	6,000	15.30	91,800.00
CHINA LIFE INSURANCE CO.	27,000	21.80	588,600.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	9,600	34.60	332,160.00

CHINA TAIPING INSURANCE HLDS COMPANY LTD	6,000	25.65	153,900.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE COMPANY LIMITED	3,000	35.80	107,400.00
PEOPLE'S INSURANCE COMPANY OF CHINA LTD	26,000	3.55	92,300.00
PICC PROPERTY & CASUALTY - H	16,000	13.32	213,120.00
PING AN INSURANCE (GROUP) CO OF CHINA LT	19,000	81.65	1,551,350.00
AGILE PROPRETY HOLDINGS LIMITED	6,000	16.30	97,800.00
CHINA EVERGRANDE GROUP	12,000	26.10	313,200.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LIMITED	20,000	4.52	90,400.00
CHINA OVERSEAS LAND&INVEST	14,000	26.20	366,800.00
CHINA RESOURCES LAND LTD	10,000	28.80	288,000.00
CHINA VANKE CO LTD -H	4,300	32.80	141,040.00
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	12,000	6.33	75,960.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS COMPANY	20,000	16.38	327,600.00
FULLSHARE HOLDING LTD	25,000	3.84	96,000.00
GUANGSHOU R&F PROPERTIES - H	3,600	18.82	67,752.00
LONGFOR PROPERTIES	5,500	24.00	132,000.00
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LIMITED	4,500	20.80	93,600.00
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD.	11,000	5.46	60,060.00
SOHO CHINA LTD	7,500	3.98	29,850.00
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	9,000	34.50	310,500.00
KINGSOFT CORPORATION LTD.	3,000	23.85	71,550.00
TENCENT HOLDINGS LIMITED	20,900	386.80	8,084,120.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	3,000	22.50	67,500.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	2,500	117.40	293,500.00
BYD ELECTRONIC INTL CO LTD	2,500	11.58	28,950.00
KINGBOARD CHEMICALS HOLDINGS	2,500	32.10	80,250.00
LENOVO GROUP LTD	26,000	3.72	96,720.00
MEITU INC	4,500	8.23	37,035.00
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	2,600	130.50	339,300.00
ZTE CORPORATION	2,600	25.60	66,560.00
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H	8,000	4.76	38,080.00
CHINA MOBILE LTD	22,500	72.70	1,635,750.00
CHINA TELECOM CORP LTD	50,000	3.63	181,500.00
CHINA UNICOM HONG KONG LTD	22,000	10.62	233,640.00
BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LIMITED	20,000	4.50	90,000.00
CGN POWER CO LTD-H	39,000	2.12	82,680.00
CHINA GAS HOLDINGS LIMITED	6,400	27.90	178,560.00
CHINA LONGYUAN POWER GROUP	12,000	6.79	81,480.00
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	4,000	28.40	113,600.00
CHINA RESOURCES POWER HOLDINGS CO LTD	8,000	14.62	116,960.00
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	3,000	70.10	210,300.00
GUANGDONG INVESTMENT	10,000	12.36	123,600.00

	HUANENG POWER INTL INC-H	16,000	4.93	78,880.00	
	HUANENG RENEWABLES CORP-H	18,000	3.05	54,900.00	
	GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	48,000	0.98	47,040.00	
	SEMICONDUCTOR MANUFACTURING INTERNATIONAL	11,000	9.97	109,670.00	
	香港ドル 小計	2,707,100		35,073,932.00	(489,281,351)
マレーシアリン ギット	DIALOG GROUP BHD	11,400	3.00	34,200.00	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	900	27.00	24,300.00	
	SAPURAKENCANA PETROLEUM BHD	14,300	0.66	9,509.50	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	8,800	8.39	73,832.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS	4,800	4.74	22,752.00	
	GAMUDA BHD	6,300	5.08	32,004.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	2,300	9.71	22,333.00	
	IJM CORP BHD	10,600	2.57	27,242.00	
	SIME DARBY BERHAD	8,700	2.57	22,359.00	
	AIRASIA GROUP BERHAD	5,500	3.69	20,295.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	3,000	8.90	26,700.00	
	MISC BHD	4,900	7.08	34,692.00	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	3,700	3.33	12,321.00	
	UMW HOLDINGS BHD	1,700	6.08	10,336.00	
	GENTING BHD	8,500	8.75	74,375.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	10,900	4.88	53,192.00	
	ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	5,700	1.79	10,203.00	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO MALAYSIA BERHAD	500	24.70	12,350.00	
	FELDA GLOBAL VENTURES	5,300	1.70	9,010.00	
	GENTING PLANTATIONS BERHAD	900	9.78	8,802.00	
	IOI CORPORATION BERHAD	8,100	4.75	38,475.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG BERHAD	1,800	25.48	45,864.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	200	139.10	27,820.00	
	PPB GROUP BERHAD	1,700	19.18	32,606.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	8,700	5.50	47,850.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	4,800	5.69	27,312.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	7,500	6.05	45,375.00	
	ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	3,700	4.19	15,503.00	
	AMMB HOLDINGS BERHAD	6,100	3.78	23,058.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	16,900	7.17	121,173.00	
	HONG LEONG BANK BERHAD	2,400	18.84	45,216.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	800	19.30	15,440.00	
MALAYAN BANKING BERHAD	15,800	10.58	167,164.00		
PUBLIC BANK BERHAD	10,700	23.84	255,088.00		
RHB BANK BHD	2,900	5.27	15,283.00		
IOI PROPERTIES GROUP BHD	6,100	1.52	9,272.00		

	SIME DARBY PROPERTY BHD	8,700	1.39	12,093.00	
	SP SETIA BHD	5,500	2.99	16,445.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	9,900	5.30	52,470.00	
	DIGI.COM BHD	11,400	4.49	51,186.00	
	MAXIS BERHAD	7,200	5.82	41,904.00	
	TELEKOM MALAYSIA BHD	4,100	5.23	21,443.00	
	PETRONAS GAS BHD	2,500	17.94	44,850.00	
	TENAGA NASIONAL BHD	12,500	15.84	198,000.00	
	YTL CORP BHD	16,000	1.39	22,240.00	
	YTL POWER INTERNATIONAL BHD	7,500	0.92	6,937.50	
	マレーシアリングット 小計	302,200		1,940,875.00	(54,189,230)
タイバーツ	BANPU PUBLIC COMPANY LIMITED-NVDR	7,600	19.10	145,160.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	4,100	33.75	138,375.00	
	IRPC PCL-NVDR	36,700	7.00	256,900.00	
	PTT EXPLORATION & PRODUCTION PCL-NVDR	5,100	134.00	683,400.00	
	PTT PUBLIC COMPANY LIMITED- NVDR	39,000	57.50	2,242,500.00	
	THAI OIL PUBLIC CO LTD-NVDR	4,100	90.50	371,050.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	5,800	60.50	350,900.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PLC-NVDR	8,300	97.50	809,250.00	
	SIAM CEMENT PUBLIC CO LTD (THE) -NVDR	400	474.00	189,600.00	
	SIAM CEMENT PUBLIC CO LTD (THE)-FOREIGN	1,100	474.00	521,400.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL -NVDR	15,700	70.75	1,110,775.00	
	BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO- NVDR	27,400	7.60	208,240.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	21,400	8.65	185,110.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	8,300	40.00	332,000.00	
	HOME PRODUCT CENTER PUBLIC CO LTD-NVDR	14,500	14.80	214,600.00	
	ROBINSON DEPARTMENT STORE PLC-NVDR	1,800	64.00	115,200.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO LTD NVDR	4,400	58.50	257,400.00	
	CP ALL PCL-NVDR	18,100	87.00	1,574,700.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS PCL-NVDR	11,000	24.30	267,300.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	7,000	18.10	126,700.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVICE -NVDR	14,200	23.70	336,540.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PUBLIC CO LTD - NVDR	1,300	220.00	286,000.00	
	BANGKOK BANK PUBLIC CO LTD-FOREIGN REG	900	191.50	172,350.00	
	KASIKORNBANK PUBLIC CAMPANY LTD- FOREIGN	4,300	190.00	817,000.00	
	KASIKORNBANK PUBLIC CAMPANY LTD- NVDR	2,500	190.00	475,000.00	
	KRUNG THAI BANK PCL-NVDR	12,800	18.00	230,400.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK PUBLIC CO LTD-NVDR	6,700	130.50	874,350.00	
	TMB BANK PUBLIC CO LTD-NVDR	40,100	2.36	94,636.00	
	CENTRAL PATTANA PUBLIC CO LTD- NVDR	4,900	80.25	393,225.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	1,800	73.50	132,300.00	

	KCE ELECTRONICS - NVDR	1,000	73.25	73,250.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	3,800	207.00	786,600.00	
	TRUE CORPORATION PCL-NVDR	36,700	7.45	273,415.00	
	ELECTRICITY GENERATING PCL -NVDR	500	227.00	113,500.00	
	GLOW ENERGY PLC- NVDR	1,900	87.00	165,300.00	
	タイパーツ 小計	375,200		15,324,426.00	(53,175,758)
フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	7,220	67.40	486,628.00	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP, INC.	15,000	13.00	195,000.00	
	DMCI HOLDINGS INC	14,600	12.08	176,368.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	10,500	59.00	619,500.00	
	SM INVESTMENTS CORP	880	882.50	776,600.00	
	INTL CONTAINER TERM SVCS INC	1,860	85.40	158,844.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	1,590	281.60	447,744.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	3,230	133.70	431,851.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	2,880	105.00	302,400.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS NEW	407	105.00	42,735.00	
	BDO UNIBANK INC	7,200	130.00	936,000.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	2,330	83.75	195,137.50	
	SECURITY BANK CORP	830	216.00	179,280.00	
	AYALA CORPORATION	910	908.50	826,735.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	315	1,000.00	315,000.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	51,900	4.44	230,436.00	
	AYALA LAND INC	27,000	39.80	1,074,600.00	
	MEGAWORLD CORP	41,000	4.25	174,250.00	
	ROBINSONS LAND CO	7,600	17.50	133,000.00	
	SM PRIME HOLDINGS INC	31,700	32.90	1,042,930.00	
GLOBE TELECOM INC	120	1,480.00	177,600.00		
PLDT INC	315	1,415.00	445,725.00		
ABOITIZ POWER CORP	5,400	38.45	207,630.00		
MANILA ELECTRIC COMPANY	830	307.00	254,810.00		
	フィリピンペソ 小計	235,617		9,830,803.50	(20,546,379)
インドネシアルピア	ADARO ENERGY TBK PT	52,700	2,120.00	111,724,000.00	
	PT UNITED TRACTORS TBK DISTRIBUTES	6,100	36,800.00	224,480,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	6,700	18,100.00	121,270,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	10,900	9,675.00	105,457,500.00	
	AKR CORPORINDO TBK PT	6,600	5,400.00	35,640,000.00	
	WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	17,400	2,390.00	41,586,000.00	
	JASA MARGA(PERSERO)TBK PT	8,000	4,340.00	34,720,000.00	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	74,100	7,150.00	529,815,000.00	
	PT SURYA CITRA MEDIA TBK	21,400	2,630.00	56,282,000.00	

	PT MATAHARI DEPARTMENT STORE TBK	9,100	10,450.00	95,095,000.00	
	CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT	27,000	3,650.00	98,550,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT	8,500	8,200.00	69,700,000.00	
	PT GUDANG GARAM TBK	1,800	70,800.00	127,440,000.00	
	PT HANJAYA MANDALA SAMPOERNA TBK	34,100	3,860.00	131,626,000.00	
	PT INDOFOOD SUKSES MAKMUR TBK	16,100	6,875.00	110,687,500.00	
	PT UNILEVER INDONESIA TBK	5,600	46,000.00	257,600,000.00	
	KALBE FARMA PT	77,300	1,480.00	114,404,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	27,300	8,225.00	224,542,500.00	
	BANK TABUNGAN NEGARA PERSERO	15,500	3,560.00	55,180,000.00	
	PT BANK CENTRAL ASIA TBK	36,100	21,750.00	785,175,000.00	
	PT BANK DANAMON INDONESIA TBK	12,300	6,425.00	79,027,500.00	
	PT BANK MANDIRI	68,400	7,150.00	489,060,000.00	
	PT BANK RAKYAT	203,300	3,310.00	672,923,000.00	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	28,200	1,810.00	51,042,000.00	
	PAKUWON JATI TBK PT	79,400	590.00	46,846,000.00	
	TELEKOMUNIKASI TBK PT	184,600	3,780.00	697,788,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	7,500	5,525.00	41,437,500.00	
	XL AXIATA TBK PT	11,700	2,370.00	27,729,000.00	
	PT PERUSAHAAN GAS NEGARA	40,000	2,220.00	88,800,000.00	
	インドネシアルピア 小計	1,097,700		5,525,627,500.00 (43,652,457)	
韓国ウォン	GS HOLDINGS	187	60,200.00	11,257,400.00	
	S-OIL CORPORATION	165	110,000.00	18,150,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	237	193,500.00	45,859,500.00	
	HANWHA CHEMICAL CORP	392	28,400.00	11,132,800.00	
	HYOSUNG CORPORATION	77	125,000.00	9,625,000.00	
	HYUNDAI STEEL COMPANY	293	54,500.00	15,968,500.00	
	KOREA ZINC CO., LTD.	31	427,000.00	13,237,000.00	
	KUMHO PETROCHEMICAL CO LTD	67	91,900.00	6,157,300.00	
	LG CHEM LTD	168	352,500.00	59,220,000.00	
	LG CHEM LTD	28	203,000.00	5,684,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	56	403,000.00	22,568,000.00	
	OCI COMPANY LTD	61	158,000.00	9,638,000.00	
	POSCO	271	359,000.00	97,289,000.00	
	CJ CORP	53	159,500.00	8,453,500.00	
	DAELIM INDUSTRIAL CO., LTD	102	83,900.00	8,557,800.00	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	609	6,090.00	3,708,810.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	129	31,300.00	4,037,700.00	
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES AND CONSTRUCTION	195	16,850.00	3,285,750.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	184	37,000.00	6,808,000.00	
	HANWHA CORPORATION	165	40,300.00	6,649,500.00	

HANWHA TECHWIN CO LTD	135	25,050.00	3,381,750.00
HYUNDAI DEVELOPMENT CO-ENGIN	221	46,250.00	10,221,250.00
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO	286	49,950.00	14,285,700.00
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES CO LTD	134	112,500.00	15,075,000.00
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS	36	402,500.00	14,490,000.00
KCC CORP	21	385,000.00	8,085,000.00
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES LTD	250	44,300.00	11,075,000.00
LG CORP	348	82,100.00	28,570,800.00
LOTTE CORPORATION	108	64,900.00	7,009,200.00
POSCO DAEWOO CORP	136	22,650.00	3,080,400.00
SAMSUNG C&T CORPORATION	278	135,000.00	37,530,000.00
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO.,LTD.	929	7,420.00	6,893,180.00
SK HOLDINGS CO LTD	116	293,500.00	34,046,000.00
SK NETWORKS CO LTD	500	5,480.00	2,740,000.00
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINE	82	48,750.00	3,997,500.00
S1 CORPORATION	63	98,600.00	6,211,800.00
CJ LOGISTICS CORPORATION	29	152,000.00	4,408,000.00
GLOVIS CO LTD	69	176,500.00	12,178,500.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	174	34,450.00	5,994,300.00
PAN OCEAN CO LTD	783	5,250.00	4,110,750.00
HANKOOK TIRE CO LTD	272	47,650.00	12,960,800.00
HANON SYSTEMS	684	11,050.00	7,558,200.00
HYUNDAI MOBIS	250	244,000.00	61,000,000.00
HYUNDAI MOTOR CO	565	164,000.00	92,660,000.00
HYUNDAI MOTOR COMPANY	138	112,000.00	15,456,000.00
HYUNDAI MOTOR COMPANY	87	100,500.00	8,743,500.00
HYUNDAI WIA CORP	60	53,000.00	3,180,000.00
KIA MOTORS CORPORATION	965	31,350.00	30,252,750.00
COWAY CO LTD	192	90,200.00	17,318,400.00
HANSSEM CO LTD	39	122,500.00	4,777,500.00
LG ELECTRONICS INC	390	100,000.00	39,000,000.00
KANGWON LAND INC	431	29,450.00	12,692,950.00
CHEIL COMMUNICATIONS INC	253	19,200.00	4,857,600.00
CJ E&M CORP	70	92,200.00	6,454,000.00
HOTEL SHILLA CO LTD	115	106,000.00	12,190,000.00
HYUNDAI DEPARTMENT STORE CO LTD	51	97,200.00	4,957,200.00
LOTTE SHOPPING CO LTD	41	256,500.00	10,516,500.00
SHINSEGAE CO LTD	27	396,500.00	10,705,500.00
BGF RETAIL CO LTD	32	185,500.00	5,936,000.00
DONGSUH COMPANIES INC	128	27,200.00	3,481,600.00
E-MART INC	77	269,000.00	20,713,000.00
GS RETAIL CO LTD	99	34,550.00	3,420,450.00

CJ CHEILJEDANG CORP	30	340,000.00	10,200,000.00
KT&G CORPORATION	427	97,700.00	41,717,900.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	80	125,000.00	10,000,000.00
OTTOGI CORPORATION	4	772,000.00	3,088,000.00
AMOREPACIFIC CORP	118	334,500.00	39,471,000.00
AMOREPACIFIC CORP-PREF	33	170,000.00	5,610,000.00
AMOREPACIFIC GROUP	106	142,000.00	15,052,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD	34	1,223,000.00	41,582,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE-PREF	8	729,000.00	5,832,000.00
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	128	86,000.00	11,008,000.00
CELLTRION INC	298	251,000.00	74,798,000.00
HANMI PHARM CO LTD	23	455,500.00	10,476,500.00
HANMI SCIENCE CO LTD	47	78,400.00	3,684,800.00
MEDY-TOC INC	16	695,600.00	11,129,600.00
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	61	478,500.00	29,188,500.00
SILLAJEN INC	199	82,800.00	16,477,200.00
YUHAN CORPORATION	31	229,500.00	7,114,500.00
BS FINANCIAL GROUP INC	955	10,350.00	9,884,250.00
DGB FINANCIAL GROUP INC	620	12,050.00	7,471,000.00
HANA FINANCIAL GROUP INC.	1,084	46,750.00	50,677,000.00
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	923	16,600.00	15,321,800.00
KB FINANCIAL GROUP INC	1,455	60,500.00	88,027,500.00
SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD	1,563	46,500.00	72,679,500.00
WOORI BANK	1,733	15,950.00	27,641,350.00
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	143	86,600.00	12,383,800.00
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	1,342	9,440.00	12,668,480.00
SAMSUNG CARD CO LTD	106	36,750.00	3,895,500.00
SAMSUNG SECURITIES CO,LTD.	245	36,050.00	8,832,250.00
WOORI INVESTMENT & SECURITIES CO.,LTD	515	15,050.00	7,750,750.00
DB INSURANCE CO LTD	182	63,100.00	11,484,200.00
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	954	6,220.00	5,933,880.00
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	229	38,300.00	8,770,700.00
ING LIFE INSURANCE KOREA LTD	120	42,350.00	5,082,000.00
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	113	271,500.00	30,679,500.00
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO.,LTD.	256	117,000.00	29,952,000.00
KAKAO CORP	167	115,500.00	19,288,500.00
NCSOFT CORP	64	354,000.00	22,656,000.00
NETMARBLE CORPORATION	93	131,000.00	12,183,000.00
NHN CORP	103	743,000.00	76,529,000.00
SAMSUNG SDS CO LTD	128	243,000.00	31,104,000.00
LG DISPLAY CO LTD	852	24,700.00	21,044,400.00
LG INNOTEK CO LTD	52	117,500.00	6,110,000.00

	SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD	205	117,500.00	24,087,500.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	355	2,520,000.00	894,600,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	64	2,049,000.00	131,136,000.00	
	SAMSUNG SDI CO LTD	202	176,000.00	35,552,000.00	
	SK TELECOM CO LTD	74	226,500.00	16,761,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER CORPORATION	941	36,250.00	34,111,250.00	
	KOREA GAS CORPORATION	101	54,300.00	5,484,300.00	
	HYNIX SEMICONDUCTOR INC	2,133	82,400.00	175,759,200.00	
	韓国ウォン 小計	32,849		3,241,475,250.00 (329,333,885)	
新台幣ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	5,000	120.50	602,500.00	
	ASIA CEMENT CORPORATION	9,000	30.70	276,300.00	
	CHINA STEEL CORP	46,000	23.40	1,076,400.00	
	FORMOSA CHEMICALS & FIBRE CORPORATION	11,000	107.50	1,182,500.00	
	FORMOSA PLASTICS CORPORATION	15,000	103.00	1,545,000.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	17,000	80.90	1,375,300.00	
	TAIWAN CEMENT CORPORATION	13,000	40.20	522,600.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	12,000	27.20	326,400.00	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	1,000	432.50	432,500.00	
	TECO ELECTRIC & MACHINERY CO LTD	7,000	24.15	169,050.00	
	CHINA AIRLINES LTD	10,000	10.40	104,000.00	
	EVA AIRWAYS CORP	7,000	15.20	106,400.00	
	EVERGREEN MARINE CORPORATION	7,000	14.30	100,100.00	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	6,000	22.60	135,600.00	
	CHENG SHIN RUBBER INDUSTRY CO.,LTD	7,000	47.40	331,800.00	
	ECLAT TEXTILE CO LTD	1,000	360.00	360,000.00	
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	1,000	132.00	132,000.00	
	FORMOSA TAFFETA CO LTD	3,000	32.70	98,100.00	
	GIANT MANUFACTURING CO LTD	1,000	153.50	153,500.00	
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	1,000	280.00	280,000.00	
	POU CHEN	8,000	36.50	292,000.00	
	RUENTEX INDUSTRIES LIMITED	2,000	57.80	115,600.00	
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	1,000	292.00	292,000.00	
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	2,000	295.00	590,000.00	
	STANDARD FOODS CORPORATION	2,000	66.40	132,800.00	
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	18,000	69.60	1,252,800.00	
	TAIMED BIOLOGICS INC	1,000	298.00	298,000.00	
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	17,000	17.05	289,850.00	
	CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL HOLDING	49,000	10.95	536,550.00	
	CHINATRUST FINANCIAL HOLDING	64,000	21.40	1,369,600.00	
	E.SUN FINANCIAL HOLDING CO	34,000	20.25	688,500.00	
	FIRST FINANCIAL HOLDING CO	34,000	20.50	697,000.00	

HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS CO LTD	26,000	17.80	462,800.00
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD	40,000	26.00	1,040,000.00
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS CO.,LTD.	38,000	10.55	400,900.00
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS	35,000	14.25	498,750.00
TAIWAN BUSINESS BANK	14,000	8.89	124,460.00
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL HOLDING CO	29,000	17.10	495,900.00
CHAILEASE HOLDING CO LTD	4,000	104.50	418,000.00
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	24,000	50.30	1,207,200.00
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD	37,000	13.85	512,450.00
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	30,000	52.20	1,566,000.00
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	9,000	32.00	288,000.00
SHIN KONG FINANCIAL HOLDING CO LTD	30,000	12.05	361,500.00
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	3,000	45.20	135,600.00
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	3,000	35.85	107,550.00
ACER INC	11,000	23.00	253,000.00
ADVANTECH CO LTD	1,000	203.00	203,000.00
ASUSTEK COMPUTER INC	3,000	281.00	843,000.00
AU OPTRONICS CORP	32,000	12.15	388,800.00
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	2,000	326.50	653,000.00
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	2,000	73.10	146,200.00
COMPAL ELECTRONICS	15,000	19.65	294,750.00
DELTA ELECTRONICS INC	7,000	111.50	780,500.00
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	3,000	74.90	224,700.00
GENERAL INTERFACE SOLUTION HOLDINGS	1,000	184.50	184,500.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	57,000	80.40	4,582,800.00
HTC CORPORATION	2,000	60.70	121,400.00
INNOLUX DISPLAY CORPORATION	33,000	11.30	372,900.00
INVENTEC CORPORATION	9,000	22.40	201,600.00
LARGAN PRECISION CO LTD	380	3,250.00	1,235,000.00
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	8,000	40.00	320,000.00
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	2,000	88.90	177,800.00
PEGATRON CORP	7,000	68.60	480,200.00
QUANTA COMPUTER INC	10,000	54.20	542,000.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	5,000	43.50	217,500.00
WISTRON CORPORATION	10,000	23.50	235,000.00
WPG HOLDINGS CO LTD	6,000	38.80	232,800.00
YAGEO CORPORATION	1,000	584.00	584,000.00
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD	2,000	63.20	126,400.00
ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	8,000	8.94	71,520.00
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	14,000	110.50	1,547,000.00
FAR EASTONE TELECOMMUNICATIONS CO LTD	6,000	77.40	464,400.00
TAIWAN MOBILE CO LTD	6,000	108.50	651,000.00

	ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGR	26,000	44.50	1,157,000.00	
	GLOBALWAFERS CO LTD	1,000	475.50	475,500.00	
	MACRONIX INTERNATIONAL CO LTD	7,000	46.20	323,400.00	
	MEDIATEK INCORPORATION	6,000	337.00	2,022,000.00	
	NANYA TECHNOLOGY CORP	4,000	90.80	363,200.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS CORP LTD	2,000	125.50	251,000.00	
	PHISON ELECTRONICS CORP	1,000	274.00	274,000.00	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	3,000	88.90	266,700.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	2,000	113.50	227,000.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	90,000	225.00	20,250,000.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORPORATION	44,000	15.50	682,000.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR COR	3,000	60.90	182,700.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	1,000	231.00	231,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORP	11,000	18.15	199,650.00	
	新台湾ドル 小計	1,198,380		66,523,780.00	(244,807,510)
エジプトbond	EASTERN TOBACCO	147	599.04	88,058.88	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK EGYPT SAE	3,830	92.39	353,853.70	
	GLOBAL TELECOM HOLDING	7,782	5.48	42,645.36	
	エジプトbond 小計	11,759		484,557.94	(2,994,568)
南アフリカランド	EXXARO RESOURCES LIMITED	920	110.00	101,200.00	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	198	341.49	67,615.02	
	ANGLOGOLD ASHANTI LIMITED	1,502	111.86	168,013.72	
	GOLD FIELDS LIMITED	3,009	46.62	140,279.58	
	KUMBA IRON ORE LTD	236	274.62	64,810.32	
	MONDI LTD	433	349.40	151,290.20	
	SAPPI LIMITED	2,041	80.00	163,280.00	
	SASOL LTD.	2,033	428.30	870,733.90	
	SIBANYE GOLD LTD	6,609	10.89	71,972.01	
	BIDVEST GROUP LTD	1,232	238.00	293,216.00	
	STEINHOFF INTERNATIONAL H NV	11,051	2.21	24,422.71	
	NASPERS LIMITED-N SHS	1,607	2,951.60	4,743,221.20	
	IMPERIAL HOLDINGS LTD	553	230.80	127,632.40	
	MR PRICE GROUP LTD	892	262.08	233,775.36	
	THE FOSCHINI GROUP	824	205.64	169,447.36	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	1,619	98.70	159,795.30	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LIMITED	3,647	62.68	228,593.96	
	BID CORP LTD	1,229	277.97	341,625.13	
	PICK N PAY STORES LTD	1,342	78.67	105,575.14	
	SHOPRITE HOLDINGS LIMITED	1,625	245.25	398,531.25	
	SPAR GROUP LIMITED	706	209.30	147,765.80	

PIONEER FOODS GROUP LTD	470	118.05	55,483.50
TIGER BRANDS LTD	598	387.00	231,426.00
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDINGS LTD	4,865	29.00	141,085.00
NETCARE LTD	3,751	29.28	109,829.28
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD	1,421	264.55	375,925.55
BARCLAYS AFRICA GROUP LIMITED	2,640	170.55	450,252.00
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	148	846.00	125,208.00
NEDBANK GROUP LTD	821	285.24	234,182.04
STANDARD BANK GROUP LIMITED	4,743	210.75	999,587.25
BRAIT SE	1,348	41.41	55,820.68
CORONATION FUND MANAGERS LTD	833	77.19	64,299.27
FIRSTRAND LIMITED	12,329	64.30	792,754.70
INVESTEC LTD	1,024	96.46	98,775.04
PSG GROUP LTD	551	217.50	119,842.50
REMGRO LTD	1,939	221.58	429,643.62
RMB HOLDINGS LTD	2,586	75.61	195,527.46
DISCOVERY LTD	1,303	167.38	218,096.14
LIBERTY HOLDINGS LTD	472	128.05	60,439.60
MMI HOLDINGS LTD	3,464	22.30	77,247.20
RAND MERCHANT INVESTMENT HOLDINGS LIMITE	2,502	41.43	103,657.86
SANLAM LTD	5,158	77.20	398,197.60
NEPI ROCKCASTLE PLC	1,376	134.80	185,484.80
MTN GROUP LIMITED	6,212	122.08	758,360.96
TELKOM SA SOC LTD	965	56.58	54,599.70
VODACOM GROUP LIMITED	2,207	153.37	338,487.59
南アフリカランド 小計	107,034		15,447,009.70 (135,933,685)
合 計	7,871,873		1,856,620,729 (1,856,620,729)

(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 19銘柄	4.1%	9.0%
メキシコペソ	株式 25銘柄	1.6%	3.4%
ブラジルレアル	株式 50銘柄	3.7%	8.2%
チリペソ	株式 18銘柄	0.7%	1.4%
コロンビアペソ	株式 9銘柄	0.3%	0.5%
ユーロ	株式 9銘柄	0.2%	0.4%
トルコリラ	株式 24銘柄	0.5%	1.0%
チェココルナ	株式 4銘柄	0.1%	0.2%
ハンガリーフォリント	株式 3銘柄	0.2%	0.4%
ポーランドズロチ	株式 23銘柄	0.7%	1.5%

香港ドル	株式	137銘柄	12.0%	26.4%
マレーシアリングット	株式	46銘柄	1.3%	2.9%
タイバーツ	株式	35銘柄	1.3%	2.9%
フィリピンペソ	株式	24銘柄	0.5%	1.1%
インドネシアルピア	株式	29銘柄	1.1%	2.4%
韓国ウォン	株式	112銘柄	8.1%	17.7%
新台湾ドル	株式	88銘柄	6.0%	13.2%
エジプトポンド	株式	3銘柄	0.1%	0.2%
南アフリカランド	株式	46銘柄	3.3%	7.3%

(b)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	GLOBAL X MSCI PAKISTAN ETF	1,272	16,536.00	
		ISHARES MSCI INDIA ETF	49,559	1,694,917.80	
		ISHARES MSCI QATAR ETF	6,875	117,631.25	
		ISHARES MSCI RUSSIA ETF	20,101	663,131.99	
		ISHARES MSCI UAE ETF	7,644	123,909.24	
	米ドル 小計		85,451	2,616,126.28	(286,282,698)
投資信託受益証券合計				286,282,698	(286,282,698)
投資証券	メキシコペソ	DEUTSCHE BANK MEX(FIBRA UNO ADMINISTR)	11,700	362,232.00	
		メキシコペソ 小計		11,700	362,232.00
	ブラジルリアル	BANCO SANTANDER BRASIL-UNIT	1,500	57,105.00	
		KLABIN SA-UNIT	2,200	44,440.00	
		SUL AMERICA SA-UNITS	700	15,274.00	
		TRANSMISSORA ALIANCA DE-UNIT	800	16,928.00	
	ブラジルリアル 小計		5,200	133,747.00	(4,196,980)
	トルコリラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATIRIM	6,960	16,843.20	
		トルコリラ 小計		6,960	16,843.20
	南アフリカランド	FORTRESS REIT LTD-A	3,905	65,447.80	
		FORTRESS REIT LTD-B	2,984	47,952.88	
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	8,061	229,577.28	
		HYPROP INVESTMENTS LTD	910	102,957.40	
REDEFINE PROPERTIES LTD		18,627	220,543.68		
RESILIENT REIT LTD		1,090	70,414.00		
			35,577	736,893.04	

	南アフリカランド 小計		(6,484,658)	
投資証券合計			13,237,602	
			(13,237,602)	
	合計		299,520,300	
			(299,520,300)	

（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	組入投資証券 時価比率	合計金額に対する 比率
米ドル	投資信託受益証券 5銘柄	7.0%	-	95.6%
メキシコペソ	投資証券 1銘柄	-	0.1%	0.7%
ブラジルレアル	投資証券 4銘柄	-	0.1%	1.4%
トルコリラ	投資証券 1銘柄	-	0.0%	0.2%
南アフリカランド	投資証券 6銘柄	-	0.2%	2.2%

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

（単位：円）

	（平成29年 4月26日現在）	（平成30年 4月26日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	18,979,745	108,875,237
コール・ローン	39,489,941	16,573,410
投資証券	12,957,860,700	9,855,017,840
未収入金	3,000,000	131,337,696
未収配当金	123,849,688	102,876,162
流動資産合計	13,143,180,074	10,214,680,345
資産合計	13,143,180,074	10,214,680,345
負債の部		
流動負債		
未払解約金	33,000,000	112,115,901
未払利息	114	48
その他未払費用	1,504	10,761
流動負債合計	33,001,618	112,126,710
負債合計	33,001,618	112,126,710
純資産の部		
元本等		
元本	6,864,702,791	5,131,265,092
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	6,245,475,665	4,971,288,543
元本等合計	13,110,178,456	10,102,553,635
純資産合計	13,110,178,456	10,102,553,635
負債純資産合計	13,143,180,074	10,214,680,345

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30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29年 4月26日現在）	（平成30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	6,864,702,791口	5,131,265,092口
2. 1単位当たり純資産の額	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)	1口当たり純資産額 1.9688円 (10,000口当たりの純資産額 19,688円)

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成29年 4月27日 至 平成30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	(1) 金融商品の内容

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30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）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

自 平成29年 4月27日 至 平成30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
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>	877,450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 >	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 2 0 1 6 - 0 5 < 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

（平成30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	6,864,702,791円
同期中における追加設定元本額	2,340,084,364円
同期中における一部解約元本額	4,073,522,063円
平成30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）	278,763,514円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	431,657,987円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	382,042,477円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	253,215,357円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド 2 0 5 0	1,719,012円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	142,638円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	476,408円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	2,932,871円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	3,087,211円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	7,895,831円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	1,546,422円
世界6資産バランスファンドVA < 適格機関投資家限定 >	850,204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）	2,042,384,122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）	1,177,011,982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 >	21,532,121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 >	209,987,752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 >	100,670,910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 >	215,348,273円
合計	5,131,265,092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	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	407	195,360,000	
	MCUBS MidCity投資法人	1,367	112,504,100	
	森ヒルズリート投資法人	1,312	182,761,600	
	産業ファンド投資法人	1,421	171,941,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	1,134	315,592,200	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	623	99,555,400	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	554	269,244,000	
	GLP投資法人	2,540	297,180,000	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	466	116,453,400	
	日本プロロジスリート投資法人	1,631	377,413,400	
	星野リゾート・リート投資法人	187	100,793,000	
	星野リゾート・リート投資法人	2	1,078,000	
	Oneリート投資法人	134	33,245,400	
	イオンリート投資法人	1,162	131,887,000	
	ヒューリックリート投資法人	832	140,025,600	
	日本リート投資法人	330	108,075,000	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	5,207	71,492,110	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	881	12,096,130	
	日本ヘルスケア投資法人	57	10,089,000	
	積水ハウス・リート投資法人	1,513	106,363,900	
	トーセイ・リート投資法人	197	22,083,700	
	ケネディクス商業リート投資法人	446	103,026,000	
	ヘルスケア&メディカル投資法人	151	16,006,000	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	216	20,520,000	
	野村不動産マスターファンド投資法人	3,620	549,516,000	
	いちごホテルリート投資法人	193	25,746,200	
	ラサールロジポート投資法人	924	103,210,800	
	スターアジア不動産投資法人	286	30,001,400	
	マリモ地方創生リート投資法人	97	11,164,700	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	231	81,196,500	
	大江戸温泉リート投資法人	205	18,409,000	
	さくら総合リート投資法人	295	27,641,500	
	投資法人みらい	156	28,657,200	
森トラスト・ホテルリート投資法人	263	37,740,500		
三菱地所物流リート投資法人	114	30,050,400		
CREロジスティクスファンド投資法人	120	13,548,000		
ザイマックス・リート投資法人	115	12,995,000		
日本ビルファンド投資法人	1,186	732,948,000		
ジャパンリアルエステイト投資法人	1,218	695,478,000		

日本リートファンド投資法人	2,311	473,755,000	
オリックス不動産投資法人	2,430	402,894,000	
日本プライムリアルティ投資法人	773	305,335,000	
プレミア投資法人	1,105	118,345,500	
東急リアル・エステート投資法人	820	120,950,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	785	85,094,000	
ユナイテッド・アーバン投資法人	2,702	455,287,000	
森トラスト総合リート投資法人	875	142,712,500	
インヴィンシブル投資法人	3,355	163,388,500	
フロンティア不動産投資法人	417	185,565,000	
平和不動産リート投資法人	762	78,562,200	
日本ロジスティクスファンド投資法人	816	182,294,400	
福岡リート投資法人	631	105,124,600	
ケネディクス・オフィス投資法人	358	235,922,000	
積水ハウス・レジデンシャル投資法人	939	104,886,300	
いちごオフィスリート投資法人	948	76,882,800	
大和証券オフィス投資法人	264	169,224,000	
阪急リート投資法人	534	74,172,600	
スターツプロシード投資法人	192	30,892,800	
大和ハウスリート投資法人	1,426	372,043,400	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	3,532	286,798,400	
日本賃貸住宅投資法人	1,376	116,134,400	
ジャパンエクセレント投資法人	1,097	155,664,300	
合計	60,241	9,855,017,840	

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29年 4月26日現在)	(平成30年 4月26日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	88,657,333	37,943,931
金銭信託	1,599,132	3,434,490
コール・ローン	3,327,211	522,811
投資証券	4,853,273,623	4,013,265,189
派生商品評価勘定	15,120	-
未収入金	587,391,197	126,519
未収配当金	9,999,763	5,070,631
流動資産合計	5,544,263,379	4,060,363,571
資産合計	5,544,263,379	4,060,363,571
負債の部		

（平成29年 4月26日現在）

（平成30年 4月26日現在）

流動負債		
派生商品評価勘定	7,771,680	-
未払解約金	610,153,068	3,421,000
未払利息	9	1
その他未払費用	306	1,243
流動負債合計	617,925,063	3,422,244
負債合計	617,925,063	3,422,244
純資産の部		
元本等		
元本	2,517,086,687	2,192,135,055
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	2,409,251,629	1,864,806,272
元本等合計	4,926,338,316	4,056,941,327
純資産合計	4,926,338,316	4,056,941,327
負債純資産合計	5,544,263,379	4,060,363,571

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30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29年 4月26日現在)	(平成30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	2,517,086,687口	2,192,135,055口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.9572円 (10,000口当たりの純資産額 19,572円)	1口当たり純資産額 1.8507円 (10,000口当たりの純資産額 18,507円)

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成29年 4月27日 至 平成30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、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成30年 4月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）

（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

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	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	32,683,464	-	33,145,840	462,376
	オーストラリアドル	52,684,680	-	53,165,670	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。

（平成30年 4月26日現在）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

自 平成29年 4月27日

至 平成30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

(平成30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	2,517,086,687円
同期中における追加設定元本額	1,335,510,241円
同期中における一部解約元本額	1,660,461,873円
平成30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）	158,048,622円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	101,106,811円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	72,762,326円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	673,507,529円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	708,755円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	225,428円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	669,752円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	3,946,220円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	3,958,310円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	10,585,400円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	5,035,354円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	897,738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）	1,152,168,202円

S M A M ・ 年 金 W リ ス ク コ ン ト ロ ー ル フ ァ ン ド < 適 格 機 関 投 資 家 限 定 >	8,514,608円
合計	2,192,135,055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	3,108	69,992.16	
		AGREE REALTY CORP	1,153	55,101.87	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	2,414	54,194.30	
		ALEXANDER'S INC	136	52,768.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	3,545	431,993.70	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	900	29,493.00	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES INC	5,109	192,915.84	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	9,035	179,164.05	
		AMERICOLD REALTY TRUST	2,500	50,500.00	
		APARTMENT INVESTMENT & MANEGEMENT CO-A	5,813	228,741.55	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	7,200	129,312.00	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	600	7,914.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	6,012	41,963.76	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	4,686	758,147.94	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	600	5,166.00	
		BOSTON PROPERTIES INC	5,332	630,882.24	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC NEW	602	6,339.06	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	6,525	102,899.25	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	8,502	118,857.96	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	3,468	292,525.80	
		CARETRUST REIT INC	1,749	22,579.59	
		CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	7,201	28,011.89	
		CEDAR REALTY TRUST INC	2,130	7,795.80	
		CHATHAM LODGING TRUST	800	15,304.00	
		CHESAPEAKE LODGING TRUST	2,300	67,321.00	
		CITY OFFICE REIT INC	600	6,732.00	
CLIPPER REALTY INC	800	6,176.00			

COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	22,060	132,801.20	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	4,500	93,195.00	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	300	7,413.00	
CORECIVIC INC	5,301	107,663.31	
CORESITE REALTY CORPORATION	900	94,680.00	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	4,364	117,566.16	
COUSINS PROPERTIES INC	17,983	152,316.01	
CUBESMART	6,662	184,604.02	
CYRUSONE INC	2,695	138,765.55	
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	3,461	198,661.40	
DDR CORPORATION	11,595	79,193.85	
DIAMONDROCK HOSPITALITY COMPANY	10,056	111,621.60	
DIGITAL REALTY TRUST INC	7,020	712,319.40	
DOUGLAS EMMETT INC	4,637	169,714.20	
DUKE REALTY CORP	12,615	327,485.40	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES	900	18,243.00	
EASTGROUP PROPERTIES INC	1,102	94,595.68	
EDUCATION REALTY TRUST INC	3,556	113,543.08	
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	5,000	85,600.00	
EPR PROPERTIES	1,767	95,824.41	
EQUITY COMMONWEALTH REIT	4,408	135,413.76	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	3,223	283,076.09	
EQUITY RESIDENTIAL	12,967	782,039.77	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,272	537,668.80	
EXTRA SPACE STORAGE INC	4,414	380,839.92	
FARMLAND PARTNERS INC	300	2,328.00	
FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	2,652	297,448.32	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC	4,094	121,387.10	
FOREST CITY REALTY TRUST-A	7,800	155,454.00	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	1,339	30,087.33	
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORPORATION	3,700	27,935.00	
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	6,380	215,388.80	
GEO GROUP INC	5,536	121,293.76	
GETTY REALTY CORPORATION	1,428	35,428.68	
GGP INC	20,043	388,633.77	
GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	1,440	24,840.00	
GLADSTONE LAND CORP	600	7,356.00	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	1,000	7,820.00	
GLOBAL NET LEASE INC	1,433	25,908.64	
	2,700	33,912.00	

GOVERNMENT PROPERTIES INCOME TRUST		
GRAMERCY PROPERTY TRUST	5,529	125,176.56
HCP, INC.	16,618	371,246.12
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	5,372	143,271.24
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	5,915	143,852.80
HERSHA HOSPITALITY TRUST	1,018	19,331.82
HIGHWOODS PROPERTIES INC	2,857	123,593.82
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	4,534	113,848.74
HOST HOTELS AND RESORTS INC	25,537	501,035.94
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	4,405	139,814.70
INDEPENDENCE REALTY TRUST	641	5,954.89
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES	1,300	26,780.00
INFREIT INC	2,200	46,794.00
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	3,233	16,940.92
INVITATION HOMES INC	10,564	242,655.08
IRON MOUNTAIN INC	8,700	293,886.00
ISTAR INC	3,000	29,880.00
JBG SMITH PROPERTIES	2,364	85,056.72
KILROY REALTY CORP	3,754	262,517.22
KIMCO REALTY CORPORATION	12,555	166,228.20
KITE REALTY GROUP TRUST	3,261	46,240.98
LASALLE HOTEL PROPERTIES	4,051	122,056.63
LEXINGTON REALTY TRUST	7,127	55,733.14
LIBERTY PROPERTY TRUST	5,295	211,905.90
LIFE STORAGE INC	1,258	108,175.42
LTC PROPERTIES INC	1,576	54,923.60
MACERICH COMPANY/THE	3,237	178,844.25
MACK-CALI REALTY CORPORATION	2,599	42,987.46
MANULIFE US REAL ESTATE INV	63,400	58,962.00
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	1,500	14,940.00
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	10,278	126,933.30
MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	4,008	359,597.76
MONMOUTH REAL ESTATE INVESTMENT CORP	3,536	53,570.40
NATIONAL HEALTH INVESTORS INC	1,704	113,043.36
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	6,051	226,367.91
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	1,400	35,602.00
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	2,800	23,520.00
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST	500	12,785.00
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	2,216	31,666.64
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC	5,746	146,752.84
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1,000	23,630.00

PARAMOUNT GROUP INC	7,500	105,000.00	
PARK HOTELS AND RESORTS INC	6,700	193,094.00	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	1,584	55,519.20	
PENNSYLVANIA REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	2,331	20,909.07	
PHYSICIANS REALTY TRUST	8,144	118,169.44	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	5,400	94,446.00	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	100	1,397.00	
PROLOGIS INC	18,158	1,173,733.12	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	604	68,789.56	
PUBLIC STORAGE	5,205	1,008,260.55	
QTS REALTY TRUST INC-CL A	1,000	34,040.00	
QUALITY CARE PROPERTIES	3,883	88,144.10	
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	2,740	31,455.20	
REALTY INCOME CORPORATION	10,227	507,361.47	
REGENCY CENTERS CORP	4,548	254,688.00	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	4,100	66,871.00	
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA	10,074	110,713.26	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	3,040	88,494.40	
RLJ LODGING TRUST	7,377	151,671.12	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	1,374	108,820.80	
SABRA HEALTH CARE REIT	4,981	86,719.21	
SAUL CENTERS INC	703	34,278.28	
SELECT INCOME REIT	1,900	36,195.00	
SENIOR HOUSING PROPERTIES TRUST	6,396	96,963.36	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	500	17,790.00	
SIMON PROPERTY GROUP INC	10,634	1,560,433.16	
SL GREEN REALTY CORP	3,206	309,026.34	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	15,800	124,820.00	
STAG INDUSTRIAL INC	3,500	83,020.00	
STORE CAPITAL CORP	4,500	111,420.00	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	4,300	62,694.00	
SUN COMMUNITIES INC	2,388	219,552.72	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	9,659	151,646.30	
TANGER FACTORY OUTLET CENTERS, INC	3,736	79,875.68	
TAUBMAN CENTERS INC	1,620	86,394.60	
TERRENO REALTY CORP	2,200	77,484.00	
TIER REIT INC	1,800	33,714.00	
UDR INC	8,312	292,914.88	
UMH PROPERTIES INC	800	10,344.00	

	UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	215	12,749.50
	URBAN EDGE PROPERTIES	3,834	76,449.96
	URSTADT BIDDLE PROPERTIES - CL A	442	8,552.70
	VENTAS INC	12,709	601,898.24
	VEREIT INC	37,310	248,484.60
	VORNADO REALTY TRUST	6,297	409,367.97
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	6,130	36,534.80
	WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,670	46,559.60
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	3,081	79,458.99
	WELLTOWER INC	13,183	666,005.16
	WHEELER REAL ESTATE INVESTMENT	125	428.75
	WHITESTONE REIT	200	2,110.00
	WP CAREY INC	3,200	199,520.00
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	4,000	81,960.00
	米ドル 小計	843,082	25,375,905.22 (2,776,885,308)
カナダドル	AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTA	500	5,530.00
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	2,300	93,633.00
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	2,000	26,700.00
	BOARDWALK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	735	32,678.10
	CAN APARTMENT PROP	2,507	92,533.37
	CANADIAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,210	60,838.80
	CHOICE PROPERTIES REIT	300	3,414.00
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR	3,192	39,548.88
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,500	18,255.00
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	200	2,562.00
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	1,814	24,416.44
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	100	985.00
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	1,476	34,686.00
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	1,000	49,570.00
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	6,012	122,765.04
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	1,000	10,020.00
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	1,000	13,930.00
	MORGUARD NORTH AMERICAN RE	100	1,389.00
	MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	1,503	19,839.60
	NORTHVIEW APARTMENT REIT	1,052	26,100.12

	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	1,500	16,635.00
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	4,127	95,127.35
	SLATE OFFICE REIT	1,000	7,540.00
	SLATE RETAIL REIT	500	6,190.00
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	3,207	90,629.82
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	1,500	12,420.00
	カナダドル 小計	41,335	907,936.52 (77,410,667)
ユーロ	AEDIFICA	968	72,987.20
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	6,469	82,026.92
	ALTAREA	70	14,875.00
	AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA	1,530	26,683.20
	BEFIMMO SCA	744	39,580.80
	BENI STABILU SPA	30,000	22,770.00
	COFINIMMO	655	70,478.00
	EUROCOMMERCIAL	1,064	36,324.96
	FONCIERE DES REGIONS	2,027	181,720.55
	GECINA SA	1,474	202,969.80
	GREEN REIT PLC	27,000	40,392.00
	HAMBORNER REIT AG	2,840	26,980.00
	HIBERNIA REIT PLC	25,270	37,349.06
	HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI	3,600	63,684.00
	ICADE	1,262	100,455.20
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	3,408	26,582.40
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI	11,310	105,974.70
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	300	7,080.00
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	10,100	13,796.60
	KLEPIERRE	6,331	220,002.25
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	2,620	24,497.00
	MERCIALYS	2,280	36,594.00
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	9,500	119,225.00
	NSI NV	727	25,554.05
	RETAIL ESTATES	200	14,160.00
	RETAIL ESTATES-RTS	200	155.80
	UNIBAIL-RODAMCO SE	3,510	678,307.50
	VASTNED RETAIL	925	38,202.50
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	333	34,232.40
	WERELDHAVE NV	1,995	64,179.15
	ユーロ 小計	158,712	2,427,820.04 (323,409,907)
英ポンド	AEW UK LONG LEASE REIT PLC	5,000	4,765.00

	ASSURA PLC	116,800	69,963.20
	BIG YELLOW GROUP PLC	6,736	62,004.88
	BRITISH LAND CO PLC	30,600	202,204.80
	CAPITAL & REGIONAL PLC	20,000	10,500.00
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	10,000	10,300.00
	DERWENT LONDON PLC	3,147	96,644.37
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	20,000	16,980.00
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	9,745	66,002.88
	HAMMERSON PLC	23,400	126,172.80
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	11,700	15,186.60
	INTU PROPERTIES PLC	20,800	41,184.00
	LAND SECURITIES GROUP PLC	26,563	256,545.45
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	37,101	68,970.75
	LXI REIT PLC	4,000	4,060.00
	NEWRIVER REIT PLC	17,642	51,867.48
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	17,148	19,205.76
	RDI REIT PLC	40,100	14,796.90
	REGIONAL REIT LTD	5,000	5,010.00
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	6,200	33,449.00
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,000	9,060.00
	SEGRO PLC	30,393	191,111.18
	SHAFTESBURY PLC	10,700	105,127.50
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	46,900	69,412.00
	UNITE GROUP PLC	7,294	58,424.94
	WORKSPACE GROUP PLC	6,465	67,882.50
	英債券 小計	548,434	1,676,831.99 (255,867,793)
オーストラリアドル	ABACUS PROPERTY GROUP	20,971	74,027.63
	ARENA REIT	3,100	6,758.00
	BWP TRUST	29,090	88,724.50
	CHARTER HALL GROUP	22,550	128,535.00
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	5,000	19,950.00
	CHARTER HALL RETAIL REIT	11,701	44,814.83
	CROMWELL PROPERTY GROUP	37,000	39,405.00
	DEXUS	30,837	286,475.73
	FOLKESTONE EDUCATION TRUST	7,100	19,951.00
	GDI PROPERTY GROUP	18,000	22,410.00
	GOODMAN GROUP	50,256	446,273.28
	GPT GROUP	69,000	321,540.00
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	4,000	13,400.00
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	100	316.00
	INDUSTRIA REIT	1,000	2,500.00

	INGENIA COMMUNITIES GROUP	8,166	22,048.20
	INVESTA OFFICE FUND	26,578	113,488.06
	MIRVAC GROUP	115,322	250,248.74
	NATIONAL STORAGE REIT	11,000	17,380.00
	PROPERTYLINK GROUP	28,000	28,700.00
	RURAL FUNDS GROUP	10,000	21,500.00
	SCENTRE GROUP	190,409	752,115.55
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA PROPERTY GR	42,042	97,537.44
	STOCKLAND	73,730	291,233.50
	VICINITY CENTRES	93,829	224,251.31
	VIVA ENERGY REIT	18,000	35,730.00
	WESTFIELD CORP	60,369	536,076.72
	オーストラリアドル 小計	987,150	3,905,390.49 (323,834,979)
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	30,000	30,150.00
	GOODMAN PROPERTY TRUST	56,925	76,848.75
	INVESTORE PROPERTY LTD	2,250	3,172.50
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	44,907	59,726.31
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	24,000	30,360.00
	STRIDE STAPLED GROUP	4,000	6,880.00
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	19,000	38,950.00
	ニュージーランドドル 小計	181,082	246,087.56 (19,052,098)
香港ドル	CHAMPION REAL ESTATE INVESTMENT	114,000	624,720.00
	FORTUNE REIT	34,000	316,880.00
	LINK REIT	72,600	4,860,570.00
	PROSPERITY REIT	60,000	193,200.00
	SPRING REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	28,000	92,120.00
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	37,000	195,730.00
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	38,000	197,980.00
	香港ドル 小計	383,600	6,481,200.00 (90,412,740)
シンガポールドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT	23,500	32,665.00
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	25,000	20,000.00
	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	78,100	209,308.00
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	40,000	45,200.00
	CACHE LOGISTICS TRUST	27,000	22,410.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	71,000	126,380.00
	CAPITALAND MALL TRUST	74,500	154,960.00

	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	20,000	30,600.00
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	17,350	30,015.50
	ESR REIT	57,552	30,502.56
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	46,000	31,280.00
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	28,000	38,360.00
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	15,000	33,150.00
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	44,800	64,512.00
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRIAL TRUST	40,000	42,400.00
	KEPPEL DC REIT	25,000	35,500.00
	KEPPEL REIT	91,000	111,020.00
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL T	33,000	10,560.00
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	69,000	109,710.00
	MAPLETREE GREATER CHINA COMM	83,000	93,790.00
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	33,800	67,600.00
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	55,250	68,510.00
	OUE HOSPITALITY TRUST	36,000	29,160.00
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	10,000	27,700.00
	SABANA SHARIAH COMPLIANT INDUSTRIAL REIT	31,000	13,175.00
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	26,000	17,030.00
	SPH REIT	16,000	15,920.00
	STARHILL GLOBAL REIT	54,000	38,610.00
	SUNTEC REIT	96,000	182,400.00
	シンガポールドル 小計	1,266,852	1,732,428.06 (142,856,017)
イスラエルシュケル	REIT 1 LTD	8,000	116,000.00
	イスラエルシュケル 小計	8,000	116,000.00 (3,535,680)
	合計		4,013,265,189 (4,013,265,189)

(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	68.4%	69.2%
カナダドル	投資証券 26銘柄	1.9%	1.9%
ユーロ	投資証券 30銘柄	8.0%	8.1%
英ポンド	投資証券 26銘柄	6.3%	6.4%
オーストラリアドル	投資証券 27銘柄	8.0%	8.1%
ニュージーランドドル	投資証券 7銘柄	0.5%	0.5%
香港ドル	投資証券 7銘柄	2.2%	2.3%

シンガポールドル	投資証券	29銘柄	3.5%	3.6%
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

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

貸借対照表

	（単位：円）	
	（平成29年 4月26日現在）	（平成30年 4月26日現在）
資産の部		
流動資産		
金銭信託	147,622,892	451,970,386
コール・ローン	307,149,496	68,800,680
国債証券	161,177,348,860	153,647,469,680
地方債証券	17,616,234,832	18,938,548,460
特殊債券	27,334,302,311	25,316,074,638
社債券	9,808,138,000	7,921,212,000
未収入金	802,732,100	-
未収利息	527,827,717	463,619,144
前払費用	9,828,201	11,696,740
流動資産合計	217,731,184,409	206,819,391,728
資産合計	217,731,184,409	206,819,391,728
負債の部		
流動負債		
未払解約金	498,393,710	93,744,181
未払利息	890	201
その他未払費用	19,314	117,955
流動負債合計	498,413,914	93,862,337
負債合計	498,413,914	93,862,337
純資産の部		
元本等		
元本	173,031,066,223	163,997,039,244
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	44,201,704,272	42,728,490,147
元本等合計	217,232,770,495	206,725,529,391
純資産合計	217,232,770,495	206,725,529,391
負債純資産合計	217,731,184,409	206,819,391,728

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30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29年 4月26日現在)	(平成30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	173,031,066,223口	163,997,039,244口
2. 1単位当たり純資産の額	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)	1口当たり純資産額 1.2605円 (10,000口当たりの純資産額 12,605円)

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成29年 4月27日 至 平成30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、地方債証券、特殊債券、社債券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいておりません。デリバティブ取引は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成30年 4月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29年 4月27日 至 平成30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・DC年金バランス30（債券重点型）	2,954,754,744円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	5,143,936,169円
三井住友・DC年金バランス70（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
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＞	5,926,425,523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＞	25,474,682,363円
S M A M ・ バランスファンドV A 3 7 . 5 ＜適格機関投資家専用＞	8,748,753,150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＞	21,454,588,776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＞	371,792,432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＞	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
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-05<適格機関投資家限定>	645,366,680円
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>	852,098,361円
合計	173,031,066,223円

(平成30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	173,031,066,223円
同期中における追加設定元本額	25,013,687,838円
同期中における一部解約元本額	34,047,714,817円
平成30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)	3,786,799,916円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	6,727,420,925円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,487,606,561円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	493,395,990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)	51,108,394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)	150,628,625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)	255,771,925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)	181,344,355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)	68,013,382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)	156,784,732円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	66,241,688円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	4,525,451,502円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	592,212,196円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	532,706,643円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	4,729,808円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	108,862円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	246,143円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	1,061,669円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	917,272円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	3,067,349円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	7,319,664円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	5,893,054,891円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	22,108,583,158円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	8,267,510,005円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	20,010,677,598円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	366,643,600円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	645,629,164円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	4,683,310円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	307,803,288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>	119,038,837円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	2,193,018,238円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,348,304,498円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	3,694,303,869円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	12,265,266,018円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	121,841,796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)	6,689,017,072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)	19,037,044,247円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	603,732,535円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	958,092,973円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	16,533,976,390円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	1,020,107,706円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	201,449,705円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	46,453,205円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	2,326,561,573円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	2,838,136,250円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	2,605,901,989円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	1,101,467,242円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	250,182,596円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	23,291,757円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	389,089,332円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	7,056,525,713円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	318,754,686円

S M A M ・ 年 金 W リ ス ク コ ン ト ロ ー ル フ ァ ン ド < 適 格 機 関 投 資 家 限 定 >	197,159,728円
S M A M ・ マ ル チ ア セ ャ ッ ト ス ト ラ テ ィ ー フ ァ ン ド 2 0 1 6 - 0 4 < 適 格 機 関 投 資 家 限 定 >	1,734,019,761円
S M A M ・ マ ル チ ア セ ャ ッ ト ス ト ラ テ ィ ー フ ァ ン ド 2 0 1 6 - 0 5 < 適 格 機 関 投 資 家 限 定 >	830,924,791円
S M A M ・ マ ル チ ア セ ャ ッ ト ス ト ラ テ ィ ー ・ オ ー プ ン < 適 格 機 関 投 資 家 限 定 >	1,795,302,217円
S M A M ・ マ ル チ ア セ ャ ッ ト ・ ダ イ ナ ミ ッ ク ア ロ ケ ー シ ョ ン ・ ス ト ラ テ ィ ー ・ フ ァ ン ド < 適 格 機 関 投 資 家 限 定 >	551,905円
合 計	163,997,039,244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 3 8 6 回 利 付 国 債 (2 年)	3,000,000,000	3,013,200,000	
	第 1 2 3 回 利 付 国 債 (5 年)	10,000,000	10,041,500	
	第 1 2 5 回 利 付 国 債 (5 年)	1,060,000,000	1,065,459,000	
	第 1 2 6 回 利 付 国 債 (5 年)	910,000,000	915,296,200	
	第 1 2 7 回 利 付 国 債 (5 年)	920,000,000	925,722,400	
	第 1 2 8 回 利 付 国 債 (5 年)	1,215,000,000	1,223,407,800	
	第 1 2 9 回 利 付 国 債 (5 年)	1,610,000,000	1,622,042,800	
	第 1 3 0 回 利 付 国 債 (5 年)	1,000,000,000	1,007,850,000	
	第 1 3 1 回 利 付 国 債 (5 年)	2,270,000,000	2,288,591,300	
	第 1 3 2 回 利 付 国 債 (5 年)	655,000,000	660,574,050	
	第 1 3 3 回 利 付 国 債 (5 年)	600,000,000	605,286,000	
	第 1 3 4 回 利 付 国 債 (5 年)	1,150,000,000	1,160,706,500	
	第 1 3 5 回 利 付 国 債 (5 年)	250,000,000	252,452,500	
	第 1 回 利 付 国 債 (4 0 年)	40,000,000	57,588,800	
	第 2 回 利 付 国 債 (4 0 年)	287,000,000	399,877,100	
	第 3 回 利 付 国 債 (4 0 年)	255,000,000	357,030,600	
	第 4 回 利 付 国 債 (4 0 年)	387,000,000	544,358,070	
	第 5 回 利 付 国 債 (4 0 年)	390,000,000	528,134,100	
	第 6 回 利 付 国 債 (4 0 年)	405,000,000	537,495,750	
	第 7 回 利 付 国 債 (4 0 年)	400,000,000	507,444,000	
第 8 回 利 付 国 債 (4 0 年)	460,000,000	540,141,200		
第 9 回 利 付 国 債 (4 0 年)	731,000,000	622,461,120		

第10回利付国債(40年)	775,000,000	781,750,250
第310回利付国債(10年)	1,480,000,000	1,519,530,800
第312回利付国債(10年)	2,145,000,000	2,219,624,550
第313回利付国債(10年)	2,105,000,000	2,191,199,750
第315回利付国債(10年)	1,800,000,000	1,875,096,000
第317回利付国債(10年)	1,005,000,000	1,046,717,550
第318回利付国債(10年)	895,000,000	929,108,450
第319回利付国債(10年)	980,000,000	1,023,502,200
第320回利付国債(10年)	960,000,000	999,100,800
第321回利付国債(10年)	960,000,000	1,001,568,000
第322回利付国債(10年)	1,065,000,000	1,106,961,000
第323回利付国債(10年)	510,000,000	531,292,500
第324回利付国債(10年)	790,000,000	819,704,000
第325回利付国債(10年)	1,365,000,000	1,419,149,550
第326回利付国債(10年)	527,000,000	546,641,290
第327回利付国債(10年)	375,000,000	390,723,750
第328回利付国債(10年)	380,000,000	392,958,000
第329回利付国債(10年)	2,530,000,000	2,646,202,900
第330回利付国債(10年)	1,335,000,000	1,398,572,700
第332回利付国債(10年)	793,000,000	823,070,560
第333回利付国債(10年)	815,000,000	847,013,200
第334回利付国債(10年)	1,265,000,000	1,316,017,450
第335回利付国債(10年)	1,250,000,000	1,293,650,000
第336回利付国債(10年)	920,000,000	953,064,800
第337回利付国債(10年)	120,000,000	122,715,600
第338回利付国債(10年)	1,105,000,000	1,138,172,100
第339回利付国債(10年)	1,655,000,000	1,705,891,250
第340回利付国債(10年)	2,030,000,000	2,093,072,100
第341回利付国債(10年)	1,187,000,000	1,216,057,760
第342回利付国債(10年)	1,520,000,000	1,533,193,600
第343回利付国債(10年)	1,620,000,000	1,633,170,600
第344回利付国債(10年)	2,201,000,000	2,217,595,540
第345回利付国債(10年)	1,528,000,000	1,538,527,920
第346回利付国債(10年)	2,040,000,000	2,053,545,600
第347回利付国債(10年)	1,520,000,000	1,529,682,400
第348回利付国債(10年)	635,000,000	638,860,800
第349回利付国債(10年)	2,020,000,000	2,030,645,400
第350回利付国債(10年)	450,000,000	451,989,000
第2回利付国債(30年)	510,000,000	644,634,900
第4回利付国債(30年)	300,000,000	401,178,000
第5回利付国債(30年)	290,000,000	364,701,100
第7回利付国債(30年)	474,000,000	607,558,980

第9回利付国債(30年)	100,000,000	116,075,000
第10回利付国債(30年)	585,000,000	654,012,450
第11回利付国債(30年)	430,000,000	518,666,000
第12回利付国債(30年)	590,000,000	747,317,600
第14回利付国債(30年)	742,000,000	978,252,800
第16回利付国債(30年)	465,000,000	622,369,950
第18回利付国債(30年)	500,000,000	655,440,000
第19回利付国債(30年)	490,000,000	643,433,700
第21回利付国債(30年)	345,000,000	454,120,050
第22回利付国債(30年)	335,000,000	452,796,050
第23回利付国債(30年)	329,000,000	445,452,840
第24回利付国債(30年)	310,000,000	420,428,200
第25回利付国債(30年)	300,000,000	396,801,000
第26回利付国債(30年)	383,000,000	514,334,530
第27回利付国債(30年)	440,000,000	600,318,400
第28回利付国債(30年)	386,000,000	528,013,260
第29回利付国債(30年)	177,000,000	239,666,850
第30回利付国債(30年)	572,000,000	765,970,920
第31回利付国債(30年)	425,000,000	562,428,000
第32回利付国債(30年)	735,000,000	990,118,500
第33回利付国債(30年)	483,000,000	622,606,320
第34回利付国債(30年)	682,000,000	910,729,160
第35回利付国債(30年)	735,000,000	952,890,750
第36回利付国債(30年)	280,000,000	363,792,800
第37回利付国債(30年)	790,000,000	1,011,729,300
第38回利付国債(30年)	445,000,000	561,229,550
第39回利付国債(30年)	395,000,000	507,713,250
第40回利付国債(30年)	455,000,000	574,665,000
第41回利付国債(30年)	475,000,000	589,133,000
第42回利付国債(30年)	445,000,000	552,196,050
第43回利付国債(30年)	485,000,000	602,132,350
第44回利付国債(30年)	520,000,000	646,625,200
第45回利付国債(30年)	285,000,000	340,780,200
第46回利付国債(30年)	600,000,000	717,534,000
第47回利付国債(30年)	600,000,000	732,330,000
第48回利付国債(30年)	415,000,000	486,234,750
第49回利付国債(30年)	575,000,000	673,670,000
第50回利付国債(30年)	565,000,000	576,831,100
第51回利付国債(30年)	520,000,000	464,552,400
第52回利付国債(30年)	633,000,000	596,653,140
第53回利付国債(30年)	477,000,000	461,216,070
第54回利付国債(30年)	580,000,000	590,387,800
第55回利付国債(30年)	595,000,000	605,001,950

第56回利付国債(30年)	320,000,000	325,024,000	
第57回利付国債(30年)	930,000,000	943,559,400	
第58回利付国債(30年)	180,000,000	182,419,200	
第46回利付国債(20年)	775,000,000	813,703,500	
第48回利付国債(20年)	955,000,000	1,021,286,550	
第50回利付国債(20年)	918,000,000	971,776,440	
第52回利付国債(20年)	720,000,000	774,432,000	
第54回利付国債(20年)	965,000,000	1,046,426,700	
第56回利付国債(20年)	818,000,000	889,354,140	
第59回利付国債(20年)	1,455,000,000	1,576,667,100	
第61回利付国債(20年)	1,215,000,000	1,280,281,950	
第64回利付国債(20年)	1,025,000,000	1,134,531,500	
第65回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,133,740,200	
第69回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,150,111,200	
第70回利付国債(20年)	780,000,000	897,631,800	
第72回利付国債(20年)	753,000,000	856,492,320	
第74回利付国債(20年)	664,000,000	758,573,520	
第75回利付国債(20年)	490,000,000	562,196,600	
第78回利付国債(20年)	590,000,000	671,201,700	
第82回利付国債(20年)	620,000,000	717,259,400	
第84回利付国債(20年)	850,000,000	980,968,000	
第85回利付国債(20年)	645,000,000	752,392,500	
第88回利付国債(20年)	742,000,000	880,865,300	
第89回利付国債(20年)	20,000,000	23,580,200	
第90回利付国債(20年)	580,000,000	686,464,800	
第92回利付国債(20年)	734,000,000	865,275,900	
第93回利付国債(20年)	632,000,000	742,321,920	
第95回利付国債(20年)	305,000,000	367,918,450	
第97回利付国債(20年)	677,000,000	813,781,080	
第99回利付国債(20年)	693,000,000	829,666,530	
第100回利付国債(20年)	207,000,000	250,652,160	
第101回利付国債(20年)	355,000,000	436,841,700	
第102回利付国債(20年)	457,000,000	564,458,980	
第105回利付国債(20年)	390,000,000	471,412,500	
第106回利付国債(20年)	370,000,000	451,052,200	
第107回利付国債(20年)	378,000,000	458,302,320	
第108回利付国債(20年)	390,000,000	464,626,500	
第109回利付国債(20年)	410,000,000	489,728,600	
第111回利付国債(20年)	456,000,000	561,162,720	
第113回利付国債(20年)	327,000,000	399,966,780	
第114回利付国債(20年)	508,000,000	623,092,480	
第116回利付国債(20年)	830,000,000	1,030,478,200	

第118回利付国債(20年)	460,000,000	561,770,400
第119回利付国債(20年)	425,000,000	508,584,750
第120回利付国債(20年)	280,000,000	328,392,400
第121回利付国債(20年)	255,000,000	308,899,350
第122回利付国債(20年)	535,000,000	641,588,050
第123回利付国債(20年)	380,000,000	471,029,000
第124回利付国債(20年)	365,000,000	447,639,650
第125回利付国債(20年)	455,000,000	570,738,350
第126回利付国債(20年)	280,000,000	344,173,200
第127回利付国債(20年)	335,000,000	407,557,650
第128回利付国債(20年)	445,000,000	542,530,650
第129回利付国債(20年)	440,000,000	530,794,000
第130回利付国債(20年)	485,000,000	586,185,550
第131回利付国債(20年)	460,000,000	549,971,400
第132回利付国債(20年)	970,000,000	1,160,857,200
第133回利付国債(20年)	60,000,000	72,648,600
第134回利付国債(20年)	50,000,000	60,643,500
第135回利付国債(20年)	275,000,000	329,835,000
第136回利付国債(20年)	320,000,000	379,497,600
第137回利付国債(20年)	415,000,000	498,522,900
第138回利付国債(20年)	25,000,000	29,347,000
第139回利付国債(20年)	280,000,000	332,519,600
第140回利付国債(20年)	850,000,000	1,022,601,000
第141回利付国債(20年)	445,000,000	535,739,950
第142回利付国債(20年)	380,000,000	463,174,400
第143回利付国債(20年)	360,000,000	428,821,200
第144回利付国債(20年)	150,000,000	176,527,500
第145回利付国債(20年)	485,000,000	585,433,800
第146回利付国債(20年)	460,000,000	555,546,600
第147回利付国債(20年)	960,000,000	1,145,558,400
第148回利付国債(20年)	474,000,000	558,547,380
第149回利付国債(20年)	1,040,000,000	1,226,420,000
第150回利付国債(20年)	901,000,000	1,049,259,550
第151回利付国債(20年)	980,000,000	1,110,095,000
第152回利付国債(20年)	525,000,000	594,247,500
第153回利付国債(20年)	627,000,000	719,225,430
第154回利付国債(20年)	1,060,000,000	1,197,863,600
第155回利付国債(20年)	820,000,000	898,834,800
第156回利付国債(20年)	770,000,000	764,255,800
第157回利付国債(20年)	555,000,000	530,396,850
第158回利付国債(20年)	725,000,000	729,292,000
第159回利付国債(20年)	798,000,000	815,077,200
第160回利付国債(20年)	1,025,000,000	1,063,119,750

	第161回利付国債(20年)	550,000,000	559,603,000	
	第162回利付国債(20年)	830,000,000	842,433,400	
	第163回利付国債(20年)	1,160,000,000	1,175,486,000	
	第164回利付国債(20年)	100,000,000	99,281,000	
国債証券合計		139,103,000,000	153,647,469,680	
地方債証券	第1回東京都公募公債(20年)	100,000,000	107,710,000	
	第1回東京都公募公債(30年)	100,000,000	125,587,000	
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	113,090,000	
	第7回東京都公募公債(20年)	100,000,000	115,132,000	
	第8回東京都公募公債(20年)	100,000,000	117,566,000	
	第8回東京都公募公債(30年)	400,000,000	513,284,000	
	第13回東京都公募公債(30年)	500,000,000	620,205,000	
	第668回東京都公募公債	200,000,000	202,712,000	
	第674回東京都公募公債	100,100,000	101,994,893	
	第684回東京都公募公債	100,000,000	102,628,000	
	第685回東京都公募公債	100,000,000	102,349,000	
	第688回東京都公募公債	193,500,000	197,697,015	
	第689回東京都公募公債	200,000,000	205,008,000	
	第703回東京都公募公債	100,000,000	103,504,000	
	第705回東京都公募公債	100,000,000	104,003,000	
	第710回東京都公募公債	100,000,000	103,233,000	
	平成21年度第14回北海道公募公債	100,000,000	102,737,000	
	平成24年度第1回北海道公募公債	100,000,000	103,774,000	
	平成24年度第14回北海道公募公債	100,000,000	103,599,000	
	平成25年度第15回北海道公募公債	100,000,000	103,401,000	
	平成26年度第15回北海道公募公債	100,000,000	102,165,000	
	平成29年度第6回北海道公募公債(5年)	300,000,000	299,490,000	
	第1回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	115,118,000	
	第3回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	114,230,000	
	第7回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	117,965,000	
	第157回神奈川県公募公債	115,600,000	116,775,652	
	第167回神奈川県公募公債	100,000,000	102,089,000	
	第326回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	203,542,000	
	第332回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,462,000	
	第342回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	205,652,000	
	第361回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	207,288,000	
	第373回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,349,000	
	第377回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,590,000	
	平成22年度第5回京都府公募公債	110,000,000	113,573,900	
	平成26年度第13回京都府公募公債	100,000,000	102,594,000	
	平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	103,141,000	
	平成29年度第12回京都府公募公債	300,000,000	299,925,000	

第5回兵庫県公募公債(15年)	300,000,000	332,088,000	
平成21年度第3回兵庫県公募公債	390,000,000	396,637,800	
平成21年度第11回兵庫県公募公債	200,000,000	203,740,000	
平成22年度第1回兵庫県公募公債	100,000,000	102,815,000	
平成25年度第15回兵庫県公募公債(5年)	100,000,000	100,128,000	
第7回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	126,064,000	
平成20年度第1回静岡県公募公債	200,000,000	230,218,000	
平成21年度第5回静岡県公募公債	300,000,000	305,856,000	
平成21年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,596,000	
平成21年度第7回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	204,026,000	
平成21年度第8回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,944,000	
平成21年度第10回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,040,000	
平成22年度第12回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,725,000	
平成23年度第18回愛知県公募公債(7年)	100,000,000	100,436,000	
平成21年度第1回広島県公募公債	100,000,000	101,674,000	
平成20年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	101,214,000	
平成21年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	101,487,000	
平成21年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	101,670,000	
平成21年度第4回埼玉県公募公債	200,000,000	203,594,000	
平成29年度第7回埼玉県公募公債(5年)	400,000,000	399,640,000	
平成20年度第10回福岡県公募公債	100,000,000	101,231,000	
平成21年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	102,031,000	
平成21年度第8回福岡県公募公債	100,000,000	102,181,000	
平成25年度第11回福岡県公募公債	100,000,000	103,598,000	
平成25年度第12回福岡県公募公債	100,000,000	100,118,000	
平成26年度第4回福岡県公募公債	100,000,000	100,148,000	
平成26年度第10回福岡県公募公債	100,000,000	102,362,000	
平成20年度第8回千葉県公募公債	100,000,000	101,210,000	
平成21年度第2回千葉県公募公債	345,000,000	350,716,650	
平成21年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	101,953,000	
第9回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	103,481,000	
平成21年度第1回岐阜県公募公債(10年)	200,000,000	203,976,000	
第73回共同発行市場公募地方債	400,000,000	406,220,000	
第74回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,657,000	
第75回共同発行市場公募地方債	900,000,000	916,857,000	
第76回共同発行市場公募地方債	300,000,000	305,118,000	
第77回共同発行市場公募地方債	300,000,000	306,003,000	
第79回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,924,000	
第81回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,147,000	
第82回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,428,000	
第91回共同発行市場公募地方債	300,000,000	306,465,000	

第110回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,482,000	
第111回共同発行市場公募地方債	300,000,000	310,659,000	
第112回共同発行市場公募地方債	150,000,000	155,119,500	
第114回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,432,000	
第115回共同発行市場公募地方債	600,000,000	620,472,000	
第118回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,768,000	
第137回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,922,000	
第172回共同発行市場公募地方債	500,000,000	501,815,000	
平成21年度第4回大阪市公募公債	300,000,000	306,282,000	
平成26年度第2回大阪市公募公債(5年)	200,000,000	200,398,000	
第1回名古屋市公募公債(20年)	200,000,000	221,618,000	
第3回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	113,662,000	
第467回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	101,828,000	
第1回京都市公募公債(7年)	300,000,000	301,653,000	
第1回京都市公募公債(30年)	100,000,000	134,239,000	
第7回京都市公募公債(20年)	100,000,000	121,911,000	
平成26年度第1回京都市公募公債	100,000,000	100,170,000	
平成29年度第5回京都市公募公債	100,000,000	99,975,000	
平成26年度第17回神戸市公募公債	100,000,000	101,173,000	
第4回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	113,218,000	
第9回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	117,803,000	
第14回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	120,561,000	
第47回横浜市公募公債(5年)	100,000,000	99,976,000	
平成25年度第11回札幌市公募公債(5年)	100,000,000	100,152,000	
平成26年度第4回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	102,783,000	
第2回川崎市15年公募公債	100,000,000	103,435,000	
第4回川崎市15年公募公債	100,000,000	107,590,000	
平成24年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	103,145,000	
平成23年度第9回福岡市公募公債	147,000,000	152,608,050	
平成21年度第1回千葉市公募公債	200,000,000	203,118,000	
地方債証券合計	18,051,200,000	18,938,548,460	
特殊債券	第3回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	223,462,000
	第5回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,386,000
	第9回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,448,000
	第15回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	107,434,000
	第20回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	109,374,000
	第27回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	100,378,000
	第34回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	300,000,000	300,261,000
	第36回日本政策投資銀行債券	100,000,000	118,118,000
	第2回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	314,634,000
	第7回道路債券	100,000,000	110,953,000

第 8 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	117,764,000	
第 9 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,616,000	
第 9 回道路債券	100,000,000	133,380,000	
第 1 8 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	148,612,000	
第 2 2 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	431,715,000	
第 4 2 回道路債券	100,000,000	114,139,000	
第 4 2 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,036,000	
第 4 7 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	245,262,000	
第 8 1 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	241,118,000	
第 8 8 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	131,433,000	
第 8 9 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1,251,000,000	1,274,794,020	
第 9 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	362,820,000	
第 9 5 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,056,000	
第 9 8 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	159,000,000	162,738,090	
第 9 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	122,360,000	
第 1 0 3 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1,500,000,000	1,537,830,000	
第 1 0 4 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	308,616,000	
第 1 0 7 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	312,996,000	
第 1 2 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,325,000	
第 1 2 0 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,600,000	
第 1 3 7 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1,000,000,000	1,039,120,000	
第 2 2 7 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,398,000	
第 2 3 1 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	308,772,000	
第 3 4 0 回政府保証道路債券	100,000,000	103,466,000	
第 1 回政府保証地方公共団体金融機構債券	300,000,000	305,205,000	
第 1 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,890,000	
第 2 回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	203,462,000	
第 2 回地方公営企業等金融機構債券(20年)	100,000,000	121,390,000	
第 3 回公営企業債券(20年)	100,000,000	104,717,000	
第 3 回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	306,198,000	
第 4 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,840,000	
第 5 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,820,000	
第 5 回公営企業債券(20年)	100,000,000	110,831,000	

第6回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	101,176,000	
第6回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	204,718,000	
第7回政府保証地方公営企業等金融機構債券	500,000,000	506,930,000	
第8回政府保証地方公共団体金融機構債券	129,000,000	131,979,900	
第8回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,174,000	
第11回公営企業債券(20年)	100,000,000	113,481,000	
第11回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,850,000	
第14回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)	200,000,000	200,958,000	
第15回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,360,000	
第16回政府保証地方公共団体金融機構債券	201,000,000	205,920,480	
第16回公営企業債券(20年)	100,000,000	114,703,000	
第17回公営企業債券(20年)	100,000,000	117,418,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券	500,000,000	511,855,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券(6年)	800,000,000	800,680,000	
第18回公営企業債券(20年)	100,000,000	119,368,000	
第22回公営企業債券(20年)	100,000,000	119,039,000	
第24回公営企業債券(20年)	200,000,000	240,028,000	
第27回政府保証地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,800,000	
第42回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,345,000	
第44回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	310,251,000	
第45回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	206,960,000	
第61回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,460,000	
第63回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,803,000	
第65回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,546,000	
第67回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,750,000	
F74回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,559,000	
第15回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	100,384,000	
第11回阪神高速道路株式会社社債	200,000,000	200,362,000	
第7回本州四国連絡橋債券	100,000,000	114,968,000	
第332回東京交通債券	100,000,000	104,175,000	
第342回東京交通債券	100,000,000	109,558,000	
第13回関西国際空港株式会社社債	100,000,000	100,680,000	
第16回関西国際空港株式会社社債	100,000,000	101,176,000	
第51回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	109,201,000	
第203回政府保証預金保険機構債	600,000,000	601,344,000	
第208回政府保証預金保険機構債	600,000,000	601,842,000	
第209回政府保証預金保険機構債	600,000,000	601,968,000	
第3回貸付債権担保住宅金融公庫債券	9,894,000	9,958,607	
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	14,712,000	15,295,772	
第4回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,378,000	10,444,315	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	18,209,000	19,288,429	

第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	15,117,000	15,692,353
第6回貸付債権担保住宅金融公庫債券	23,504,000	23,994,528
第7回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	19,402,000	20,601,819
第8回貸付債権担保住宅金融公庫債券	11,729,000	11,932,146
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	33,340,000	35,278,721
第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	19,549,000	20,813,038
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	51,345,000	54,356,384
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	19,140,000	20,170,689
第11回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	20,421,000	21,698,537
第12回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,219,000	13,581,597
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	20,543,000	21,125,804
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	46,808,000	48,460,322
第19回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	25,861,000	27,688,855
第21回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,755,000
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,628,000	58,093,067
第25回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	202,124,000
第26回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,948,000	88,277,663
第27回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	29,202,000	31,372,000
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	32,499,000	34,856,152
第29回貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,211,000	16,823,451
第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	35,244,000	37,790,731
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,737,000	37,200,895
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	18,513,000	19,222,233
第32回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,602,000	73,070,048
第35回貸付債権担保住宅金融公庫債券	19,035,000	19,878,440
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,952,000	40,335,006
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,643,000	40,951,146
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	17,342,000	18,087,879
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	18,833,000	19,865,425
第43回貸付債権担保住宅金融公庫債券	35,652,000	37,867,058
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	49,800,000	52,720,272
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,099,000	44,875,850
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,196,000	84,514,011
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,959,000	41,349,524
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	16,828,000	17,770,536
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,438,000	90,438,686
第52回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	119,596,000
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	18,234,000	19,277,531
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	108,470,000	114,199,385
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,663,000	54,431,620

第58回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,722,000	57,585,055
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	106,142,000	111,884,282
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	166,092,000	174,295,283
第61回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,495,000	55,960,584
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	59,661,000	62,029,541
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	121,938,000	128,037,338
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	109,192,000	114,282,531
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,234,000	64,429,190
第95回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	103,982,000
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,307,000	85,950,331
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,543,000	98,112,651
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,844,000	98,099,372
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,123,000	98,369,288
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,773,000	98,863,871
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,038,000	99,285,595
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,347,000	99,874,532
第130回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	236,910,000
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	34,524,000	36,283,343
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	37,040,000	39,176,096
第3回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	18,019,000	19,139,241
第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	17,996,000	18,973,362
第5回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	37,112,000	39,215,137
い第768号農林債	100,000,000	100,281,000
い第810号農林債	300,000,000	299,862,000
第291回信金中金債(5年)	100,000,000	100,193,000
第293回信金中金債(5年)	100,000,000	100,209,000
第297回信金中金債(5年)	200,000,000	200,426,000
第301回信金中金債(5年)	300,000,000	300,924,000
第197号商工債(3年)	200,000,000	199,822,000
第12回国際協力機構債券	100,000,000	103,524,000
第15回政府保証東日本高速道路債券	100,000,000	101,111,000
第28回東日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,335,000
第35回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,318,000
第5回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,737,000
第6回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,105,000
第25回政府保証中日本高速道路債券	200,000,000	203,470,000
第45回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	103,546,000
第19回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	101,390,000
第20回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	103,319,000
第22回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	103,441,000
第23回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,660,000
特殊債券合計	24,093,041,000	25,316,074,638

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	200,168,000	
	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	200,460,000	
	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	200,114,000	
	第13回大和ハウス工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,969,000	
	第10回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,061,000	
	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	102,013,000	
	第30回東レ株式会社無担保社債	100,000,000	99,600,000	
	第7回株式会社クラレ無担保社債	100,000,000	99,725,000	
	第56回住友化学株式会社無担保社債	200,000,000	199,668,000	
	第24回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	100,066,000	
	第3回新日鐵住金株式会社無担保社債	100,000,000	99,910,000	
	第8回株式会社ジェイテクト無担保社債	100,000,000	99,764,000	
	第16回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	103,098,000	
	第36回富士通株式会社無担保社債	100,000,000	101,185,000	
	第12回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	201,066,000	
	第13回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	203,116,000	
	第1回日本生命2012基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,211,000	
	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	100,207,000	
	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	100,377,000	
	第1回ユニー・ファミリーマートホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,056,000	
	第63回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	117,455,000	
	第47回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,071,000	
	第8回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	120,235,000	
	第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	300,000,000	308,676,000	
	第110回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	102,128,000	
	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	102,095,000	
	第4回株式会社りそな銀行無担保社債	100,000,000	103,005,000	
	第9回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	104,356,000	
	第8回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	117,629,000	
	第1回株式会社みずほフィナンシャルグループ無担保社債	100,000,000	102,684,000	
	第20回株式会社三井住友銀行無担保社債	200,000,000	205,190,000	
	第24回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	104,244,000	
	第9回株式会社みずほ銀行無担保社債	100,000,000	117,924,000	

第17回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	104,180,000	
第53回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,022,000	
第54回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,787,000	
第83回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	99,900,000	
第70回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	99,954,000	
第48回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	99,850,000	
第21回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	103,272,000	
第58回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	99,928,000	
第58回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	131,018,000	
第38回京王電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,830,000	
第15回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	106,080,000	
第34回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	114,574,000	
第110回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	120,136,000	
第41回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	119,765,000	
第42回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	243,218,000	
第528回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,981,000	
第537回東京電力株式会社社債	100,000,000	102,974,000	
第544回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,313,000	
第547回東京電力株式会社社債	100,000,000	103,788,000	
第507回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,115,000	
第518回中部電力株式会社社債	100,000,000	99,976,000	
第467回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,667,000	
第512回関西電力株式会社社債	100,000,000	99,872,000	
第308回北陸電力株式会社社債	100,000,000	103,114,000	
第471回東北電力株式会社社債	100,000,000	104,981,000	
第472回東北電力株式会社社債	100,000,000	103,806,000	
第476回東北電力株式会社社債	100,000,000	101,651,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	104,058,000	
第328回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,798,000	
第11回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	111,748,000	
第18回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	212,588,000	
第27回東邦瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	104,742,000	
社債券合計	7,600,000,000	7,921,212,000	
合計		205,823,304,778	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

	(単位：円)	
	(平成29年 4月26日現在)	(平成30年 4月26日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	909,198,394	530,333,373
金銭信託	89,862,543	185,518,848
コール・ローン	186,971,239	28,240,396
国債証券	207,417,666,531	179,501,148,876
派生商品評価勘定	7,088	-
未収入金	600,120,347	-
未収利息	1,583,663,555	1,525,595,859
前払費用	146,186,993	38,534,730
流動資産合計	210,933,676,690	181,809,372,082
資産合計	210,933,676,690	181,809,372,082
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	8,764,406	28,461
未払解約金	800,627,417	79,143,754
未払利息	542	82
その他未払費用	14,649	35,662
流動負債合計	809,407,014	79,207,959
負債合計	809,407,014	79,207,959
純資産の部		
元本等		
元本	125,322,708,862	104,217,368,782
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	84,801,560,814	77,512,795,341
元本等合計	210,124,269,676	181,730,164,123
純資産合計	210,124,269,676	181,730,164,123
負債純資産合計	210,933,676,690	181,809,372,082

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30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29年 4月26日現在)	(平成30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	125,322,708,862口	104,217,368,782口
2. 1単位当たり純資産の額	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)	1口当たり純資産額 1.7438円 (10,000口当たりの純資産額 17,438円)

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成29年 4月27日 至 平成30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	(1) 金融商品の内容

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成30年 4月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 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

(平成30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	72,760,539	-	72,789,000	28,461
	米ドル	32,816,163	-	32,826,000	9,837
	ユーロ	39,944,376	-	39,963,000	18,624
合計		72,760,539	-	72,789,000	28,461

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 平成29年 4月27日

至 平成30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29年 4月26日現在)

(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・DC外国債券インデックスファンドS	8,554,397,919円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	411,070,090円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,116,063,124円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	561,304,415円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	41,542,505円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	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
SMAM・FGグローバルバランス25VA<適格機関投資家限定>	235,574円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	402,977円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04<適格機関投資家限定>	302,296,032円
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>	144,824,274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>	191,206,529円

合計	125,322,708,862円
----	------------------

(平成30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	125,322,708,862円
同期中における追加設定元本額	5,722,372,000円
同期中における一部解約元本額	26,827,712,080円
平成30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	9,668,652,987円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	496,733,438円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,398,272,783円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	720,332,583円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	22,179,954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)	8,683,996円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	30,529,246円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	80,071,471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)	75,807,533円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	38,010,912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)	99,079,120円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	12,943,803円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	76,402,108円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	232,152,798円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	367,591,210円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	2,169,319円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	878,468円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	2,866,926円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	11,715,853円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	7,614,875円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	8,761,245円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	7,106,192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>	1,814,319,430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>	645,912,821円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	14,077,424,363円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	6,528,378,446円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	14,558,454,265円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	43,495,798円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	117,273,174円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	953,417円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	909,331,302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>	130,176,295円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,413,798,037円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,712,577,611円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,691,135,759円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	7,657,103,435円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	88,717,938円

SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	12,533,173,156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）	1,107,396,539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）	2,276,903,513円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	220,662,348円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	702,294,439円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	2,660,961,718円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	170,058,697円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	43,471,582円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	14,667,943円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	171,087,626円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	629,568,293円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	192,369,373円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	185,753,722円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	55,155,762円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	7,151,827円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,566,334,259円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	24,063,953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>	4,486,876,371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>	2,052,684,983円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	6,986,825,036円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	1,678,789,460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>	29,026,520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>	265,457,486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>	127,190,307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>	271,815,747円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	19,211円
合計	104,217,368,782円

附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B 0.75	2,000,000.00	1,962,031.26	
		US TREASURY N/B 0.75	3,000,000.00	2,937,890.64	
		US TREASURY N/B 0.875	4,000,000.00	3,946,875.00	
		US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	2,955,234.39	

US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	2,951,484.39
US TREASURY N/B 0.875	2,000,000.00	1,962,968.76
US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	2,938,125.00
US TREASURY N/B 1	4,000,000.00	3,955,937.52
US TREASURY N/B 1	3,000,000.00	2,954,062.50
US TREASURY N/B 1	2,300,000.00	2,258,312.50
US TREASURY N/B 1	2,000,000.00	1,960,937.50
US TREASURY N/B 1	2,000,000.00	1,959,531.26
US TREASURY N/B 1	2,000,000.00	1,956,875.00
US TREASURY N/B 1	3,000,000.00	2,932,968.75
US TREASURY N/B 1.125	2,000,000.00	1,974,531.26
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,935,781.25
US TREASURY N/B 1.125	2,800,000.00	2,728,687.50
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,918,671.89
US TREASURY N/B 1.125	3,800,000.00	3,642,953.14
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,857,968.75
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,852,812.50
US TREASURY N/B 1.125	4,000,000.00	3,797,812.52
US TREASURY N/B 1.125	3,500,000.00	3,318,164.08
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,971,406.25
US TREASURY N/B 1.25	2,000,000.00	1,979,218.76
US TREASURY N/B 1.25	2,000,000.00	1,976,875.00
US TREASURY N/B 1.25	2,000,000.00	1,965,781.26
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,937,187.50
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,933,906.25
US TREASURY N/B 1.25	3,600,000.00	3,458,812.50
US TREASURY N/B 1.25	3,500,000.00	3,328,007.83
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,763,750.00
US TREASURY N/B 1.375	900,000.00	893,460.94
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,949,843.75
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,946,093.75
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,926,250.00
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,942,343.75
US TREASURY N/B 1.375	5,000,000.00	4,901,171.90
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,916,875.00
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,911,562.52
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,929,687.50
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,891,250.00
US TREASURY N/B 1.375	1,900,000.00	1,848,046.87
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,915,156.25
US TREASURY N/B 1.375	3,700,000.00	3,590,445.33
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,900,390.64

US TREASURY N/B 1.375	2,400,000.00	2,310,937.51
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,845,937.52
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,786,250.00
US TREASURY N/B 1.375	2,500,000.00	2,314,648.45
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,772,890.64
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,974,453.14
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,958,984.39
US TREASURY N/B 1.5	5,000,000.00	4,927,734.40
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,937,421.89
US TREASURY N/B 1.5	1,000,000.00	978,671.88
US TREASURY N/B 1.5	2,000,000.00	1,955,312.50
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,865,937.50
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,819,296.89
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,815,312.50
US TREASURY N/B 1.5	5,800,000.00	5,157,015.65
US TREASURY N/B 1.625	5,000,000.00	4,968,750.00
US TREASURY N/B 1.625	4,000,000.00	3,973,125.00
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,974,687.50
US TREASURY N/B 1.625	2,000,000.00	1,981,250.00
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,970,000.00
US TREASURY N/B 1.625	4,000,000.00	3,947,187.52
US TREASURY N/B 1.625	2,000,000.00	1,968,593.76
US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,432,734.37
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,938,828.14
US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,413,593.75
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,858,671.89
US TREASURY N/B 1.625	4,000,000.00	3,809,062.52
US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,322,812.50
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,828,906.25
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,825,625.00
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,808,046.89
US TREASURY N/B 1.625	6,000,000.00	5,428,125.00
US TREASURY N/B 1.625	6,300,000.00	5,677,875.00
US TREASURY N/B 1.75	4,000,000.00	3,963,437.52
US TREASURY N/B 1.75	2,300,000.00	2,252,562.50
US TREASURY N/B 1.75	2,000,000.00	1,955,312.50
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,899,218.75
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,891,015.64
US TREASURY N/B 1.75	3,500,000.00	3,369,023.45
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,883,984.39
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,883,515.64
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,880,937.50
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,878,359.39

US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,868,046.89
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,856,328.14
US TREASURY N/B 1.75	5,700,000.00	5,405,203.12
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,958,515.64
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,913,750.00
US TREASURY N/B 1.875	3,600,000.00	3,487,500.00
US TREASURY N/B 1.875	4,000,000.00	3,871,562.52
US TREASURY N/B 1.875	2,000,000.00	1,933,906.26
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,897,578.14
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,896,640.64
US TREASURY N/B 1.875	700,000.00	674,242.19
US TREASURY N/B 1.875	4,000,000.00	3,849,375.00
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	2,881,875.00
US TREASURY N/B 1.875	1,800,000.00	1,689,609.38
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,963,437.50
US TREASURY N/B 2	2,300,000.00	2,268,734.37
US TREASURY N/B 2	1,600,000.00	1,575,875.00
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,951,484.39
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,947,734.39
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,940,703.14
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,932,265.64
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,926,875.00
US TREASURY N/B 2	4,300,000.00	4,196,195.33
US TREASURY N/B 2	3,500,000.00	3,409,218.75
US TREASURY N/B 2	3,100,000.00	3,016,929.70
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,905,078.14
US TREASURY N/B 2	500,000.00	482,812.50
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,895,234.39
US TREASURY N/B 2	5,500,000.00	5,295,039.09
US TREASURY N/B 2	2,000,000.00	1,897,812.50
US TREASURY N/B 2	5,000,000.00	4,739,453.15
US TREASURY N/B 2	2,500,000.00	2,367,578.12
US TREASURY N/B 2	5,600,000.00	5,264,437.52
US TREASURY N/B 2	4,300,000.00	4,022,515.62
US TREASURY N/B 2	6,200,000.00	5,722,890.65
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	2,969,765.64
US TREASURY N/B 2.125	2,700,000.00	2,663,929.70
US TREASURY N/B 2.125	1,700,000.00	1,671,046.87
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	3,926,875.00
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	2,941,640.64
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	2,935,781.25
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	2,922,421.89

US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	3,877,500.00
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	3,840,937.52
US TREASURY N/B 2.125	2,000,000.00	1,914,843.76
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	3,826,875.00
US TREASURY N/B 2.125	3,500,000.00	3,336,484.37
US TREASURY N/B 2.125	5,400,000.00	5,138,437.50
US TREASURY N/B 2.125	1,800,000.00	1,709,859.38
US TREASURY N/B 2.125	6,000,000.00	5,674,687.50
US TREASURY N/B 2.25	4,000,000.00	3,959,375.00
US TREASURY N/B 2.25	3,000,000.00	2,966,484.39
US TREASURY N/B 2.25	2,000,000.00	1,976,406.26
US TREASURY N/B 2.25	2,800,000.00	2,761,062.50
US TREASURY N/B 2.25	3,000,000.00	2,897,812.50
US TREASURY N/B 2.25	2,000,000.00	1,930,000.00
US TREASURY N/B 2.25	1,500,000.00	1,437,304.69
US TREASURY N/B 2.25	6,300,000.00	6,034,710.96
US TREASURY N/B 2.25	3,100,000.00	2,965,585.95
US TREASURY N/B 2.25	6,500,000.00	6,171,445.34
US TREASURY N/B 2.25	7,000,000.00	6,583,281.25
US TREASURY N/B 2.25	6,600,000.00	6,186,468.75
US TREASURY N/B 2.25	6,200,000.00	5,801,359.40
US TREASURY N/B 2.25	4,200,000.00	3,452,531.25
US TREASURY N/B 2.375	2,000,000.00	1,987,500.00
US TREASURY N/B 2.375	3,000,000.00	2,978,437.50
US TREASURY N/B 2.375	8,000,000.00	7,737,500.00
US TREASURY N/B 2.375	6,000,000.00	5,693,906.28
US TREASURY N/B 2.5	5,000,000.00	4,908,984.40
US TREASURY N/B 2.5	5,700,000.00	5,563,289.09
US TREASURY N/B 2.5	4,600,000.00	4,468,109.39
US TREASURY N/B 2.5	5,100,000.00	4,453,734.37
US TREASURY N/B 2.5	4,900,000.00	4,262,617.21
US TREASURY N/B 2.5	4,900,000.00	4,258,023.46
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,006,250.00
US TREASURY N/B 2.625	5,500,000.00	5,503,007.84
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	3,962,812.52
US TREASURY N/B 2.75	6,200,000.00	6,153,984.40
US TREASURY N/B 2.75	5,100,000.00	5,054,976.58
US TREASURY N/B 2.75	4,300,000.00	4,199,554.70
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	1,852,187.50
US TREASURY N/B 2.75	5,000,000.00	4,624,218.75
US TREASURY N/B 2.75	2,400,000.00	2,190,562.51
US TREASURY N/B 2.75	1,500,000.00	1,368,281.25
US TREASURY N/B 2.875	3,000,000.00	2,836,406.25

US TREASURY N/B 2.875	4,000,000.00	3,758,750.00	
US TREASURY N/B 2.875	3,600,000.00	3,373,031.26	
US TREASURY N/B 3	1,800,000.00	1,744,875.00	
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	3,854,687.52	
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	3,854,062.52	
US TREASURY N/B 3	4,900,000.00	4,716,250.00	
US TREASURY N/B 3	2,500,000.00	2,401,953.12	
US TREASURY N/B 3	2,200,000.00	2,112,515.63	
US TREASURY N/B 3	900,000.00	864,070.31	
US TREASURY N/B 3.125	2,000,000.00	2,016,875.00	
US TREASURY N/B 3.125	3,000,000.00	3,040,546.89	
US TREASURY N/B 3.125	2,000,000.00	1,982,656.26	
US TREASURY N/B 3.125	2,000,000.00	1,982,500.00	
US TREASURY N/B 3.125	1,400,000.00	1,383,703.13	
US TREASURY N/B 3.125	5,400,000.00	5,324,906.25	
US TREASURY N/B 3.375	5,000,000.00	5,069,140.65	
US TREASURY N/B 3.375	4,000,000.00	4,121,875.00	
US TREASURY N/B 3.5	4,500,000.00	4,587,539.08	
US TREASURY N/B 3.5	1,500,000.00	1,585,312.50	
US TREASURY N/B 3.625	5,000,000.00	5,079,687.50	
US TREASURY N/B 3.625	6,000,000.00	6,122,343.78	
US TREASURY N/B 3.625	5,000,000.00	5,135,156.25	
US TREASURY N/B 3.625	5,300,000.00	5,697,085.96	
US TREASURY N/B 3.625	5,000,000.00	5,371,093.75	
US TREASURY N/B 3.75	1,500,000.00	1,642,265.62	
US TREASURY N/B 3.75	4,000,000.00	4,382,812.52	
US TREASURY N/B 3.875	1,500,000.00	1,671,328.12	
US TREASURY N/B 4.25	1,000,000.00	1,171,875.00	
US TREASURY N/B 4.25	2,000,000.00	2,349,843.76	
US TREASURY N/B 4.375	500,000.00	593,085.94	
US TREASURY N/B 4.375	1,500,000.00	1,789,101.57	
US TREASURY N/B 4.375	1,400,000.00	1,671,359.38	
US TREASURY N/B 4.375	1,800,000.00	2,154,937.50	
US TREASURY N/B 4.5	1,200,000.00	1,431,750.00	
US TREASURY N/B 4.5	1,000,000.00	1,206,484.38	
US TREASURY N/B 4.5	1,000,000.00	1,211,875.00	
US TREASURY N/B 4.625	2,100,000.00	2,588,250.00	
US TREASURY N/B 4.75	1,500,000.00	1,885,429.69	
US TREASURY N/B 5	500,000.00	636,367.19	
US TREASURY N/B 5.25	500,000.00	599,453.12	
US TREASURY N/B 5.375	1,320,000.00	1,644,121.88	
US TREASURY N/B 5.5	500,000.00	608,671.87	

	US TREASURY N/B 6	1,000,000.00	1,210,312.50
	US TREASURY N/B 6.125	1,000,000.00	1,257,578.13
	US TREASURY N/B 6.25	800,000.00	934,000.00
	US TREASURY N/B 6.25	500,000.00	660,781.25
	US TREASURY N/B 6.5	500,000.00	631,914.06
	US TREASURY N/B 8	1,300,000.00	1,531,664.06
	US TREASURY N/B 8.75	1,000,000.00	1,137,890.63
	米ドル 小計	708,920,000.00	692,073,654.74 (75,733,620,038)
カナダドル	CANADA-GOV'T 0.5	600,000.00	597,012.00
	CANADA-GOV'T 0.5	2,000,000.00	1,983,200.00
	CANADA-GOV'T 0.5	2,000,000.00	1,879,920.00
	CANADA-GOV'T 0.75	2,000,000.00	1,981,280.00
	CANADA-GOV'T 0.75	1,300,000.00	1,263,990.00
	CANADA-GOV'T 0.75	2,000,000.00	1,930,100.00
	CANADA-GOV'T 0.75	2,000,000.00	1,914,000.00
	CANADA-GOV'T 1	1,000,000.00	888,300.00
	CANADA-GOV'T 1.25	1,500,000.00	1,484,505.00
	CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	1,985,060.00
	CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	1,931,560.00
	CANADA-GOV'T 1.5	1,600,000.00	1,500,960.00
	CANADA-GOV'T 1.75	1,000,000.00	1,000,950.00
	CANADA-GOV'T 1.75	1,000,000.00	999,080.00
	CANADA-GOV'T 1.75	800,000.00	784,160.00
	CANADA-GOV'T 2	400,000.00	386,200.00
	CANADA-GOV'T 2.25	1,100,000.00	1,094,588.00
	CANADA-GOV'T 2.5	2,300,000.00	2,330,245.00
	CANADA-GOV'T 2.75	1,000,000.00	1,024,000.00
	CANADA-GOV'T 2.75	1,800,000.00	1,907,100.00
	CANADA-GOV'T 2.75	500,000.00	543,055.00
	CANADA-GOV'T 3.25	1,000,000.00	1,035,430.00
	CANADA-GOV'T 3.5	2,000,000.00	2,063,380.00
	CANADA-GOV'T 3.5	1,500,000.00	1,804,875.00
	CANADA-GOV'T 3.75	2,500,000.00	2,554,750.00
	CANADA-GOV'T 4	1,500,000.00	1,897,920.00
	CANADA-GOV'T 5	1,300,000.00	1,800,318.00
	CANADA-GOV'T 5.75	800,000.00	1,059,192.00
	CANADA-GOV'T 5.75	1,200,000.00	1,700,448.00
	CANADA-GOV'T 8	500,000.00	729,235.00
	カナダドル 小計	42,200,000.00	44,054,813.00 (3,756,113,356)
メキシコペソ	MEXICAN BONOS 10	40,000,000.00	45,369,600.00
	MEXICAN BONOS 5.75	20,000,000.00	17,924,200.00

	MEXICAN BONOS 6.5	35,000,000.00	33,870,200.00
	MEXICAN BONOS 8	50,000,000.00	50,669,500.00
	MEXICAN BONOS 8	20,000,000.00	20,529,800.00
	MEXICAN BONOS 8.5	37,000,000.00	39,403,520.00
	MEXICAN BONOS 8.5	40,000,000.00	43,000,000.00
	メキシコペソ 小計	242,000,000.00	250,766,820.00 (1,456,955,224)
ユーロ	BELGIAN 0326 4	1,000,000.00	1,378,040.00
	BELGIAN 0.8	1,300,000.00	1,330,589.00
	BELGIAN 0.8	700,000.00	702,793.00
	BELGIAN 0291 5.5	2,000,000.00	2,906,160.00
	BELGIAN 0304 5	2,000,000.00	3,154,100.00
	BELGIAN 0308 4	1,500,000.00	1,745,640.00
	BELGIAN 0318 3.75	2,000,000.00	2,202,580.00
	BELGIAN 0320 4.25	1,700,000.00	2,628,523.00
	BELGIAN 0321 4.25	1,700,000.00	1,962,633.00
	BELGIAN 0324 4.5	1,000,000.00	1,309,730.00
	BELGIAN 0325 4.25	2,000,000.00	2,381,600.00
	BELGIAN 0327 3	1,000,000.00	1,049,940.00
	BELGIAN 0328 2.25	1,500,000.00	1,665,885.00
	BELGIAN 0332 2.6	2,000,000.00	2,280,480.00
	BELGIAN 0333 3	500,000.00	627,635.00
	BELGIAN 0338 0.5	1,000,000.00	1,007,480.00
	BELGIAN 0338 2.25	500,000.00	561,325.00
	BELGIAN 1	1,400,000.00	1,443,372.00
	BELGIAN 1	1,400,000.00	1,384,628.00
	BELGIAN 1.25	400,000.00	401,116.00
	BELGIAN 1.6	500,000.00	495,930.00
	BELGIAN 1.9	700,000.00	758,415.00
	BELGIAN 2.15	500,000.00	540,775.00
	BELGIAN 3.75	900,000.00	1,333,413.00
	BTPS 0.05	1,000,000.00	1,005,430.00
	BTPS 0.2	2,000,000.00	2,014,200.00
	BTPS 0.35	500,000.00	505,625.00
	BTPS 0.35	1,500,000.00	1,508,895.00
	BTPS 0.45	2,000,000.00	2,024,360.00
	BTPS 0.65	1,600,000.00	1,630,000.00
	BTPS 0.65	2,000,000.00	1,985,960.00
	BTPS 0.7	2,000,000.00	2,036,400.00
	BTPS 0.9	800,000.00	814,984.00
	BTPS 0.95	2,000,000.00	2,030,700.00
	BTPS 1.05	2,000,000.00	2,043,240.00
	BTPS 1.2	1,000,000.00	1,032,940.00

BTPS 1.25	2,000,000.00	1,955,720.00	
BTPS 1.35	2,000,000.00	2,076,640.00	
BTPS 1.45	2,000,000.00	2,082,260.00	
BTPS 1.5	2,000,000.00	2,047,140.00	
BTPS 1.5	1,600,000.00	1,627,696.00	
BTPS 1.6	2,000,000.00	2,020,000.00	
BTPS 1.65	2,000,000.00	1,887,100.00	
BTPS 1.85	1,000,000.00	1,050,840.00	
BTPS 2	2,000,000.00	2,091,620.00	
BTPS 2	2,000,000.00	2,041,840.00	
BTPS 2.05	1,000,000.00	1,031,620.00	
BTPS 2.15	2,000,000.00	2,138,120.00	
BTPS 2.2	1,000,000.00	1,046,730.00	
BTPS 2.25	1,200,000.00	1,174,284.00	
BTPS 2.45	1,000,000.00	1,023,820.00	
BTPS 2.5	1,000,000.00	1,029,010.00	
BTPS 2.5	600,000.00	652,656.00	
BTPS 2.7	1,900,000.00	1,886,529.00	
BTPS 2.8	900,000.00	854,820.00	
BTPS 2.95	1,000,000.00	1,063,150.00	
BTPS 3.25	1,500,000.00	1,651,110.00	
BTPS 3.45	800,000.00	900,360.00	
BTPS 3.5	2,300,000.00	2,654,522.00	
BTPS 3.75	2,500,000.00	2,767,600.00	
BTPS 3.75	2,000,000.00	2,221,960.00	
BTPS 3.75	3,200,000.00	3,578,304.00	
BTPS 3.75	2,000,000.00	2,330,780.00	
BTPS 4	2,500,000.00	2,743,150.00	
BTPS 4	3,000,000.00	3,712,560.00	
BTPS 4.25	3,500,000.00	3,717,735.00	
BTPS 4.25	2,300,000.00	2,492,119.00	
BTPS 4.5	2,700,000.00	2,928,042.00	
BTPS 4.5	2,300,000.00	2,734,263.00	
BTPS 4.5	3,000,000.00	3,610,290.00	
BTPS 4.5	1,700,000.00	2,093,618.00	
BTPS 4.75	2,600,000.00	2,998,580.00	
BTPS 4.75	2,500,000.00	3,021,700.00	
BTPS 4.75	2,100,000.00	2,676,072.00	
BTPS 4.75	1,600,000.00	2,192,320.00	
BTPS 5	2,000,000.00	2,357,600.00	
BTPS 5	1,000,000.00	1,252,200.00	
BTPS 5	2,670,000.00	3,636,086.10	

BTPS 5	2,000,000.00	2,783,000.00
BTPS 5	1,900,000.00	2,640,487.00
BTPS 5.25	2,700,000.00	3,619,296.00
BTPS 5.5	2,000,000.00	2,434,340.00
BTPS 5.5	2,000,000.00	2,442,620.00
BTPS 5.75	2,200,000.00	3,168,110.00
BTPS 6	3,100,000.00	4,473,858.00
BTPS 6.5	3,360,000.00	4,787,428.80
BTPS 7.25	1,000,000.00	1,459,230.00
BTPS 9	1,000,000.00	1,441,850.00
BUNDESÖBL-170 0.25	1,000,000.00	1,012,670.00
BUNDESÖBL-171 0	2,000,000.00	2,021,640.00
BUNDESÖBL-172 0.25	2,000,000.00	2,036,300.00
BUNDESÖBL-173 0	2,500,000.00	2,529,350.00
BUNDESÖBL-174 0	3,000,000.00	3,031,170.00
DEUTSCHLAND REP 0	3,000,000.00	2,890,860.00
DEUTSCHLAND REP 0.25	3,000,000.00	2,935,530.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	500,000.00	508,245.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	2,800,000.00	2,825,788.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	1,000,000.00	993,940.00
DEUTSCHLAND REP 0.5	2,000,000.00	1,975,080.00
DEUTSCHLAND REP 1	2,000,000.00	2,101,420.00
DEUTSCHLAND REP 1	2,200,000.00	2,309,362.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,500,000.00	2,679,075.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,500,000.00	2,687,400.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,000,000.00	2,151,900.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,000,000.00	2,161,680.00
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,500,000.00	2,702,500.00
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,000,000.00	2,188,220.00
DEUTSCHLAND REP 2	2,000,000.00	2,167,080.00
DEUTSCHLAND REP 2	1,500,000.00	1,655,625.00
DEUTSCHLAND REP 2.25	1,500,000.00	1,597,860.00
DEUTSCHLAND REP 2.25	2,000,000.00	2,173,120.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	1,500,000.00	1,619,925.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,200,000.00	2,827,924.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,100,000.00	2,724,540.00
DEUTSCHLAND REP 3	3,000,000.00	3,232,470.00
DEUTSCHLAND REP 3.25	3,000,000.00	3,197,670.00
DEUTSCHLAND REP 3.25	2,000,000.00	2,231,100.00
DEUTSCHLAND REP 3.25	1,500,000.00	2,158,785.00
DEUTSCHLAND REP 3.5	3,000,000.00	3,148,830.00
DEUTSCHLAND REP 4	2,700,000.00	4,058,775.00
DEUTSCHLAND REP 4.25	1,500,000.00	2,394,690.00

DEUTSCHLAND REP 4.75	800,000.00	1,126,640.00	
DEUTSCHLAND REP 4.75	2,100,000.00	3,296,874.00	
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,700,000.00	2,918,764.00	
DEUTSCHLAND REP 5.5	1,800,000.00	2,828,772.00	
DEUTSCHLAND REP 5.625	1,580,000.00	2,333,707.40	
DEUTSCHLAND REP 6.25	1,200,000.00	1,618,668.00	
DEUTSCHLAND REP 6.25	1,000,000.00	1,623,990.00	
DEUTSCHLAND REP 6.5	1,000,000.00	1,537,870.00	
FINNISH GOV'T 0.75	500,000.00	483,705.00	
FINNISH GOV'T 1.125	200,000.00	198,796.00	
FINNISH GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,069,940.00	
FINNISH GOV'T 1.625	1,000,000.00	1,073,380.00	
FINNISH GOV'T 2	1,000,000.00	1,103,610.00	
FINNISH GOV'T 2.625	500,000.00	643,165.00	
FINNISH GOV'T 2.75	600,000.00	715,968.00	
FINNISH GOV'T 3.375	700,000.00	753,459.00	
FINNISH GOV'T 3.5	1,000,000.00	1,113,480.00	
FINNISH GOV'T 4	1,000,000.00	1,252,980.00	
FINNISH GOV'T 4.375	1,000,000.00	1,059,150.00	
FRANCE O.A.T. 0	3,000,000.00	3,028,230.00	
FRANCE O.A.T. 0	2,000,000.00	2,017,300.00	
FRANCE O.A.T. 0	1,000,000.00	1,003,050.00	
FRANCE O.A.T. 0.25	2,300,000.00	2,337,674.00	
FRANCE O.A.T. 0.25	3,000,000.00	2,902,530.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	3,000,000.00	3,049,290.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	2,500,000.00	2,514,075.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	3,000,000.00	2,984,580.00	
FRANCE O.A.T. 1	2,000,000.00	2,033,800.00	
FRANCE O.A.T. 1	2,000,000.00	2,075,280.00	
FRANCE O.A.T. 1	2,000,000.00	2,049,220.00	
FRANCE O.A.T. 1.25	2,000,000.00	1,971,920.00	
FRANCE O.A.T. 1.5	4,400,000.00	4,622,816.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	4,000,000.00	4,334,720.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	5,400,000.00	5,892,966.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	1,400,000.00	1,479,744.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	1,000,000.00	974,620.00	
FRANCE O.A.T. 2	1,000,000.00	1,077,190.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	3,200,000.00	3,526,496.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	5,100,000.00	5,709,654.00	
FRANCE O.A.T. 2.5	3,500,000.00	3,755,220.00	
FRANCE O.A.T. 2.5	3,200,000.00	3,746,112.00	
FRANCE O.A.T. 2.75	4,500,000.00	5,329,935.00	

FRANCE O.A.T. 3	5,000,000.00	5,625,600.00
FRANCE O.A.T. 3.25	3,400,000.00	3,812,964.00
FRANCE O.A.T. 3.25	2,700,000.00	3,686,364.00
FRANCE O.A.T. 3.5	4,000,000.00	4,318,920.00
FRANCE O.A.T. 3.5	4,000,000.00	4,938,640.00
FRANCE O.A.T. 3.75	5,000,000.00	5,322,050.00
FRANCE O.A.T. 3.75	3,900,000.00	4,377,750.00
FRANCE O.A.T. 4	2,300,000.00	3,383,875.00
FRANCE O.A.T. 4	1,170,000.00	1,890,895.50
FRANCE O.A.T. 4	1,500,000.00	2,486,865.00
FRANCE O.A.T. 4.25	1,900,000.00	1,991,523.00
FRANCE O.A.T. 4.25	4,500,000.00	5,511,105.00
FRANCE O.A.T. 4.5	3,500,000.00	5,591,845.00
FRANCE O.A.T. 4.75	2,900,000.00	4,474,381.00
FRANCE O.A.T. 5.5	3,000,000.00	4,452,480.00
FRANCE O.A.T. 5.75	3,100,000.00	5,035,795.00
FRANCE O.A.T. 6	3,000,000.00	4,238,580.00
FRANCE O.A.T. 8.5	850,000.00	966,067.50
FRANCE O.A.T. 8.5	600,000.00	852,576.00
IRISH GOVT 0	400,000.00	398,008.00
IRISH GOVT 0.8	700,000.00	723,030.00
IRISH GOVT 1	1,000,000.00	1,021,350.00
IRISH GOVT 1.7	300,000.00	306,963.00
IRISH GOVT 2	1,000,000.00	1,058,900.00
IRISH GOVT 2.4	1,000,000.00	1,138,180.00
IRISH GOVT 3.4	1,000,000.00	1,177,980.00
IRISH GOVT 3.9	500,000.00	591,310.00
IRISH GOVT 4.4	1,000,000.00	1,056,120.00
IRISH GOVT 4.5	990,000.00	1,087,020.00
IRISH GOVT 5	1,000,000.00	1,133,590.00
IRISH GOVT 5.4	1,200,000.00	1,595,088.00
IRISH GOVT 5.9	800,000.00	875,624.00
NETHERLANDS GOVT 0	2,000,000.00	2,013,580.00
NETHERLANDS GOVT 0.25	2,000,000.00	2,029,140.00
NETHERLANDS GOVT 0.25	1,700,000.00	1,680,688.00
NETHERLANDS GOVT 0.5	1,500,000.00	1,496,145.00
NETHERLANDS GOVT 0.75	1,400,000.00	1,411,718.00
NETHERLANDS GOVT 1.75	1,600,000.00	1,739,312.00
NETHERLANDS GOVT 2	1,000,000.00	1,107,920.00
NETHERLANDS GOVT 2.25	1,500,000.00	1,650,150.00
NETHERLANDS GOVT 2.5	2,400,000.00	2,895,360.00
NETHERLANDS GOVT 2.75	1,300,000.00	1,760,694.00
NETHERLANDS GOVT 3.25	800,000.00	892,504.00

NETHERLANDS GOVT 3.5	1,500,000.00	1,634,565.00	
NETHERLANDS GOVT 3.75	1,000,000.00	1,178,200.00	
NETHERLANDS GOVT 3.75	1,500,000.00	2,298,450.00	
NETHERLANDS GOVT 4	1,500,000.00	1,585,155.00	
NETHERLANDS GOVT 4	1,400,000.00	2,094,904.00	
NETHERLANDS GOVT 5.5	700,000.00	1,019,235.00	
REP OF AUSTRIA 0.25	1,000,000.00	1,011,590.00	
REP OF AUSTRIA 0.5	2,400,000.00	2,356,056.00	
REP OF AUSTRIA 0.75	1,400,000.00	1,413,118.00	
REP OF AUSTRIA 1.2	900,000.00	946,989.00	
REP OF AUSTRIA 1.5	200,000.00	174,622.00	
REP OF AUSTRIA 1.5	500,000.00	498,440.00	
REP OF AUSTRIA 1.65	1,000,000.00	1,084,050.00	
REP OF AUSTRIA 1.75	1,000,000.00	1,086,880.00	
REP OF AUSTRIA 1.95	1,000,000.00	1,028,600.00	
REP OF AUSTRIA 2.4	800,000.00	942,896.00	
REP OF AUSTRIA 3.15	500,000.00	690,270.00	
REP OF AUSTRIA 3.4	1,000,000.00	1,156,430.00	
REP OF AUSTRIA 3.5	2,000,000.00	2,254,080.00	
REP OF AUSTRIA 3.65	1,000,000.00	1,149,940.00	
REP OF AUSTRIA 3.8	500,000.00	834,520.00	
REP OF AUSTRIA 3.9	1,500,000.00	1,644,810.00	
REP OF AUSTRIA 4.15	1,300,000.00	1,938,911.00	
REP OF AUSTRIA 4.85	1,000,000.00	1,337,320.00	
REP OF AUSTRIA 6.25	1,000,000.00	1,499,380.00	
SPANISH GOV'T 0.4	2,000,000.00	2,025,180.00	
SPANISH GOV'T 0.75	2,000,000.00	2,054,620.00	
SPANISH GOV'T 1.15	2,000,000.00	2,063,820.00	
SPANISH GOV'T 1.3	2,000,000.00	2,036,000.00	
SPANISH GOV'T 1.4	2,000,000.00	2,061,560.00	
SPANISH GOV'T 1.45	1,000,000.00	1,020,420.00	
SPANISH GOV'T 1.5	1,500,000.00	1,543,740.00	
SPANISH GOV'T 1.6	1,200,000.00	1,266,720.00	
SPANISH GOV'T 1.95	2,200,000.00	2,360,116.00	
SPANISH GOV'T 1.95	2,000,000.00	2,090,360.00	
SPANISH GOV'T 2.15	2,000,000.00	2,180,180.00	
SPANISH GOV'T 2.35	1,000,000.00	1,072,610.00	
SPANISH GOV'T 2.75	3,000,000.00	3,096,990.00	
SPANISH GOV'T 2.75	3,300,000.00	3,737,283.00	
SPANISH GOV'T 2.9	2,100,000.00	2,370,480.00	
SPANISH GOV'T 3.45	1,100,000.00	1,351,757.00	
SPANISH GOV'T 3.8	2,400,000.00	2,855,400.00	

	SPANISH GOV'T 4	2,500,000.00	2,715,550.00
	SPANISH GOV'T 4.2	2,050,000.00	2,782,198.50
	SPANISH GOV'T 4.3	2,000,000.00	2,142,480.00
	SPANISH GOV'T 4.4	2,000,000.00	2,430,960.00
	SPANISH GOV'T 4.6	2,500,000.00	2,658,875.00
	SPANISH GOV'T 4.65	3,100,000.00	3,934,985.00
	SPANISH GOV'T 4.7	1,500,000.00	2,212,005.00
	SPANISH GOV'T 4.8	2,000,000.00	2,487,900.00
	SPANISH GOV'T 4.85	2,000,000.00	2,254,540.00
	SPANISH GOV'T 4.9	2,000,000.00	2,999,220.00
	SPANISH GOV'T 5.15	1,100,000.00	1,511,334.00
	SPANISH GOV'T 5.15	1,200,000.00	1,904,568.00
	SPANISH GOV'T 5.4	2,500,000.00	3,106,850.00
	SPANISH GOV'T 5.5	2,700,000.00	3,157,002.00
	SPANISH GOV'T 5.75	2,200,000.00	3,350,908.00
	SPANISH GOV'T 5.85	2,500,000.00	3,048,075.00
	SPANISH GOV'T 5.9	2,500,000.00	3,465,150.00
	SPANISH GOV'T 6	2,500,000.00	3,667,625.00
	ユーロ 小計	486,670,000.00	565,963,688.80 (75,392,022,985)
英bond	UK TSY GILT 0.5	1,200,000.00	1,170,060.00
	UK TSY GILT 1.25	900,000.00	875,160.00
	UK TSY GILT 1.5	2,900,000.00	2,944,718.00
	UK TSY GILT 1.5	2,500,000.00	2,508,125.00
	UK TSY GILT 1.5	1,500,000.00	1,358,940.00
	UK TSY GILT 1.75	2,100,000.00	2,125,074.00
	UK TSY GILT 1.75	3,000,000.00	3,082,140.00
	UK TSY GILT 1.75	600,000.00	584,550.00
	UK TSY GILT 2	2,500,000.00	2,561,825.00
	UK TSY GILT 2	2,200,000.00	2,300,012.00
	UK TSY GILT 2.25	2,700,000.00	2,844,558.00
	UK TSY GILT 2.5	1,600,000.00	2,004,336.00
	UK TSY GILT 2.75	1,700,000.00	1,850,331.00
	UK TSY GILT 3.25	2,500,000.00	3,160,025.00
	UK TSY GILT 3.5	2,300,000.00	3,042,624.00
	UK TSY GILT 3.5	2,000,000.00	3,197,660.00
	UK TSY GILT 3.75	2,000,000.00	2,080,760.00
	UK TSY GILT 3.75	2,000,000.00	2,135,940.00
	UK TSY GILT 3.75	1,400,000.00	1,528,800.00
	UK TSY GILT 3.75	1,900,000.00	2,820,075.00
	UK TSY GILT 4	1,500,000.00	1,669,965.00
	UK TSY GILT 4	1,700,000.00	2,838,031.00
	UK TSY GILT 4.25	1,600,000.00	1,986,320.00

	UK TSY GILT 4.25	1,200,000.00	1,568,508.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,900,000.00	2,588,541.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,000,000.00	1,411,030.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,600,000.00	2,284,336.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,700,000.00	2,563,175.00	
	UK TSY GILT 4.25	1,700,000.00	2,653,275.00	
	UK TSY GILT 4.25	2,100,000.00	3,514,035.00	
	UK TSY GILT 4.5	1,900,000.00	2,613,051.00	
	UK TSY GILT 4.5	1,800,000.00	2,705,202.00	
	UK TSY GILT 4.75	1,700,000.00	1,823,403.00	
	UK TSY GILT 4.75	1,300,000.00	1,744,028.00	
	UK TSY GILT 4.75	1,500,000.00	2,233,050.00	
	UK TSY GILT 5	1,600,000.00	1,984,512.00	
	UK TSY GILT 6	1,100,000.00	1,570,283.00	
	UK TSY GILT 8	1,620,000.00	1,971,297.00	
	英債券 小計	68,020,000.00	83,897,755.00 (12,801,958,435)	
スイスフラン	SWISS (GOVT) 2.25	900,000.00	961,110.00	
	SWISS (GOVT) 3	300,000.00	311,730.00	
	SWISS (GOVT) 4	400,000.00	485,640.00	
	SWISS (GOVT) 4	700,000.00	967,750.00	
	スイスフラン 小計	2,300,000.00	2,726,230.00 (303,592,972)	
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVRNMNT 1	8,000,000.00	8,262,880.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 1.5	7,000,000.00	7,515,340.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 2.5	5,000,000.00	5,727,600.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	11,000,000.00	12,638,340.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	6,000,000.00	8,225,820.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 5	10,600,000.00	12,124,280.00	
	スウェーデンクローナ 小計	47,600,000.00	54,494,260.00 (696,981,585)	
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOV'T 1.5	5,000,000.00	4,877,500.00	
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	5,000,000.00	5,000,500.00	
	NORWEGIAN GOV'T 2	10,000,000.00	10,229,000.00	
	NORWEGIAN GOV'T 3	4,000,000.00	4,303,200.00	
	NORWEGIAN GOV'T 3.75	8,500,000.00	9,156,200.00	
	NORWEGIAN GOV'T 4.5	6,000,000.00	6,236,400.00	
	ノルウェークローネ 小計	38,500,000.00	39,802,800.00 (547,288,500)	
デンマーククローネ	DENMARK - BULLET 0.25	4,000,000.00	4,018,800.00	
	DENMARK - BULLET 1.5	5,000,000.00	5,386,500.00	
	DENMARK - BULLET 1.75	11,000,000.00	12,128,600.00	

	DENMARK - BULLET 3	7,000,000.00	7,811,300.00
	DENMARK - BULLET 4	8,000,000.00	8,570,400.00
	DENMARK - BULLET 4.5	13,500,000.00	22,253,400.00
	デンマーククローネ 小計	48,500,000.00	60,169,000.00 (1,075,821,720)
ポーランドズロチ	POLAND GOVT BOND 1.5	5,500,000.00	5,486,800.00
	POLAND GOVT BOND 1.75	3,000,000.00	2,986,800.00
	POLAND GOVT BOND 2	2,000,000.00	2,007,200.00
	POLAND GOVT BOND 2.5	4,000,000.00	3,855,200.00
	POLAND GOVT BOND 2.5	1,000,000.00	954,000.00
	POLAND GOVT BOND 3.25	5,000,000.00	5,105,000.00
	POLAND GOVT BOND 4	2,000,000.00	2,160,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.25	2,000,000.00	2,174,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.5	3,700,000.00	3,925,330.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	4,000,000.00	4,496,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	4,200,000.00	4,807,572.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	1,000,000.00	1,243,460.00
		ポーランドズロチ 小計	37,400,000.00
オーストラリアドル	AUSTRALIAN GOVT. 1.75	3,000,000.00	2,966,550.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2	1,000,000.00	988,400.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	400,000.00	396,220.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	2,100,000.00	1,987,230.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,600,000.00	1,615,920.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2,500,000.00	2,520,775.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	2,000,000.00	1,981,800.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,500,000.00	1,486,369.50
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	500,000.00	490,850.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,000,000.00	944,700.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3	1,000,000.00	927,610.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	2,800,000.00	2,894,640.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	2,100,000.00	2,170,140.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	1,000,000.00	992,700.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.75	1,200,000.00	1,293,000.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25	3,300,000.00	3,644,520.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	3,000,000.00	3,137,448.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	1,600,000.00	1,874,080.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.75	3,000,000.00	3,457,500.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	2,500,000.00	2,849,000.00
AUSTRALIAN GOVT. 5.75	3,000,000.00	3,307,050.00	
AUSTRALIAN GOVT. 5.75	3,000,000.00	3,401,550.00	
	オーストラリアドル 小計	43,100,000.00	45,328,052.50 (3,758,602,113)

シンガポールドル	SINGAPORE GOV'T 2.25	800,000.00	803,920.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	1,000,000.00	1,022,000.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	400,000.00	391,200.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	500,000.00	489,497.50	
	SINGAPORE GOV'T 2.875	400,000.00	407,400.00	
	SINGAPORE GOV'T 3	300,000.00	310,350.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.125	1,000,000.00	1,041,300.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.25	2,100,000.00	2,161,530.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.375	500,000.00	539,230.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.5	1,400,000.00	1,507,604.00	
シンガポールドル 小計		8,400,000.00	8,674,031.50	(715,260,637)
マレーシアリングット	MALAYSIA GOVT 3.418	8,000,000.00	7,819,592.00	
	MALAYSIA GOVT 3.502	9,000,000.00	8,380,980.00	
	MALAYSIA GOVT 4.378	8,000,000.00	8,094,128.00	
	MALAYSIA GOVT 4.498	4,000,000.00	3,994,620.00	
	MALAYSIA GOVT 4.736	3,000,000.00	2,916,591.00	
マレーシアリングット 小計		32,000,000.00	31,205,911.00	(871,269,035)
南アフリカランド	REP SOUTH AFRICA 6.5	65,000,000.00	48,594,000.00	
	REP SOUTH AFRICA 6.75	25,000,000.00	24,562,500.00	
	REP SOUTH AFRICA 7	63,000,000.00	54,450,900.00	
	REP SOUTH AFRICA 8	4,000,000.00	3,804,800.00	
南アフリカランド 小計		157,000,000.00	131,412,200.00	(1,156,427,360)
合計			179,501,148,876	(179,501,148,876)

(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 223銘柄	41.7%	42.2%
カナダドル	国債証券 30銘柄	2.1%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 7銘柄	0.8%	0.8%
ユーロ	国債証券 266銘柄	41.5%	42.0%
英ポンド	国債証券 38銘柄	7.0%	7.1%
スイスフラン	国債証券 4銘柄	0.2%	0.2%
スウェーデンクローナ	国債証券 6銘柄	0.4%	0.4%
ノルウェークローネ	国債証券 6銘柄	0.3%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 6銘柄	0.6%	0.6%
ポーランドズロチ	国債証券 12銘柄	0.7%	0.7%
オーストラリアドル	国債証券 22銘柄	2.1%	2.1%
シンガポールドル	国債証券 10銘柄	0.4%	0.4%

マレーシアリングット	国債証券	5銘柄	0.5%	0.5%
南アフリカランド	国債証券	4銘柄	0.6%	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。

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 4月26日現在)	(平成30年 4月26日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	245,360,510	259,230,603
金銭信託	172,896,804	289,835,875
コール・ローン	359,735,308	44,119,938
国債証券	59,784,087,499	51,785,032,676
派生商品評価勘定	38,872,372	7,988,825
未収入金	571,922,601	42,108,460
未収利息	350,679,362	405,046,658
前払費用	150,042,070	42,818,395
流動資産合計	61,673,596,526	52,876,181,430
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	752,112,173	1,197,670,271
未払金	2,098,112	21,022,205
未払解約金	606,948,000	228,352,000
未払利息	1,043	129
その他未払費用	22,274	28,777
流動負債合計	1,361,181,602	1,447,073,382
負債合計		
1,361,181,602		
純資産の部		
元本等		
元本	43,677,470,657	37,484,650,129
剰余金		
剰余金又は欠損金()	16,634,944,267	13,944,457,919
元本等合計	60,312,414,924	51,429,108,048
純資産合計		
60,312,414,924		
負債純資産合計		
61,673,596,526		

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30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29年 4月26日現在)	(平成30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	43,677,470,657口	37,484,650,129口
2. 1単位当たり純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.3809円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 13,809円)</p>	<p>1口当たり純資産額 1.3720円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 13,720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29年 4月27日 至 平成30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	(1) 金融商品の内容

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成30年 4月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 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

（平成30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	51,737,759,554	-	52,927,441,000	1,189,681,446
	米ドル	21,648,332,645	-	22,321,135,000	672,802,355
	カナダドル	1,069,728,530	-	1,107,600,000	37,871,470
	メキシコペソ	436,047,691	-	435,234,000	813,691
	ユーロ	21,840,931,906	-	22,194,447,000	353,515,094
	英ポンド	3,706,427,997	-	3,797,997,000	91,569,003
	スイスフラン	100,183,221	-	100,242,000	58,779
	スウェーデンク ローナ	204,721,482	-	205,919,000	1,197,518
	ノルウェークロー ネ	159,931,772	-	162,014,000	2,082,228
	デンマーククロー ネ	312,419,014	-	318,264,000	5,844,986
	ポーランドズロチ	363,128,688	-	368,316,000	5,187,312
	オーストラリアド ル	1,082,357,724	-	1,101,506,000	19,148,276
	シンガポールドル	461,229,750	-	469,623,000	8,393,250
	南アフリカランド	352,319,134	-	345,144,000	7,175,134
	合計	51,737,759,554	-	52,927,441,000	1,189,681,446

（注）1．時価の算定方法

(1)為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

自 平成29年 4月27日 至 平成30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

(平成30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	43,677,470,657円
同期中における追加設定元本額	11,173,000,491円
同期中における一部解約元本額	17,365,821,019円
平成30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)	11,612,319,177円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	5,981,900,100円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	2,690,389,470円
イオン・バランス戦略ファンド	766,448,537円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	6,850,648円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	9,701,314円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	26,352,404円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	9,648,237円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	5,366,728円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	2,171,544円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	5,344,760,836円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	111,614,838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)	5,043,404,425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>	3,597,379,498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>	92,798,295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>	866,441,504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>	415,238,172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>	901,864,402円
合計	37,484,650,129円

附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B 0.75	1,000,000.00	981,015.63	
		US TREASURY N/B 0.75	500,000.00	489,648.44	

US TREASURY N/B 0.875	500,000.00	493,359.37	
US TREASURY N/B 0.875	1,000,000.00	985,078.13	
US TREASURY N/B 0.875	1,000,000.00	983,828.13	
US TREASURY N/B 0.875	300,000.00	294,445.31	
US TREASURY N/B 0.875	1,000,000.00	979,375.00	
US TREASURY N/B 1	500,000.00	492,343.75	
US TREASURY N/B 1	1,200,000.00	1,178,250.00	
US TREASURY N/B 1	1,500,000.00	1,470,703.12	
US TREASURY N/B 1	1,000,000.00	979,765.63	
US TREASURY N/B 1	1,000,000.00	978,437.50	
US TREASURY N/B 1	700,000.00	684,359.37	
US TREASURY N/B 1.125	300,000.00	296,179.68	
US TREASURY N/B 1.125	700,000.00	685,015.62	
US TREASURY N/B 1.125	1,000,000.00	974,531.25	
US TREASURY N/B 1.125	1,000,000.00	972,890.63	
US TREASURY N/B 1.125	1,000,000.00	958,671.88	
US TREASURY N/B 1.125	1,000,000.00	952,656.25	
US TREASURY N/B 1.125	1,000,000.00	950,937.50	
US TREASURY N/B 1.125	1,000,000.00	949,453.13	
US TREASURY N/B 1.125	2,000,000.00	1,896,093.76	
US TREASURY N/B 1.25	900,000.00	890,648.44	
US TREASURY N/B 1.25	1,000,000.00	982,890.63	
US TREASURY N/B 1.25	1,000,000.00	979,062.50	
US TREASURY N/B 1.25	800,000.00	782,375.00	
US TREASURY N/B 1.25	500,000.00	480,390.62	
US TREASURY N/B 1.25	1,000,000.00	950,859.38	
US TREASURY N/B 1.25	700,000.00	644,875.00	
US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	983,281.25	
US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	982,031.25	
US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	981,562.50	
US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	980,781.25	
US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	980,234.38	
US TREASURY N/B 1.375	2,300,000.00	2,252,203.12	
US TREASURY N/B 1.375	1,200,000.00	1,173,468.75	
US TREASURY N/B 1.375	900,000.00	878,906.25	

US TREASURY N/B 1.375	1,500,000.00	1,459,218.75	
US TREASURY N/B 1.375	1,100,000.00	1,068,890.62	
US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	970,390.63	
US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	966,796.88	
US TREASURY N/B 1.375	400,000.00	385,156.25	
US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	961,484.38	
US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	928,750.00	
US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	925,859.38	
US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	924,296.88	
US TREASURY N/B 1.5	1,800,000.00	1,784,671.88	
US TREASURY N/B 1.5	1,000,000.00	986,328.13	
US TREASURY N/B 1.5	1,000,000.00	985,546.88	
US TREASURY N/B 1.5	1,000,000.00	980,859.38	
US TREASURY N/B 1.5	1,700,000.00	1,664,539.07	
US TREASURY N/B 1.5	600,000.00	573,187.50	
US TREASURY N/B 1.5	2,300,000.00	2,161,460.94	
US TREASURY N/B 1.5	500,000.00	469,218.75	
US TREASURY N/B 1.5	2,200,000.00	1,956,109.38	
US TREASURY N/B 1.625	100,000.00	99,375.00	
US TREASURY N/B 1.625	1,000,000.00	993,281.25	
US TREASURY N/B 1.625	800,000.00	793,250.00	
US TREASURY N/B 1.625	1,500,000.00	1,485,937.50	
US TREASURY N/B 1.625	800,000.00	792,000.00	
US TREASURY N/B 1.625	1,000,000.00	986,796.88	
US TREASURY N/B 1.625	1,000,000.00	984,296.88	
US TREASURY N/B 1.625	800,000.00	784,625.00	
US TREASURY N/B 1.625	1,500,000.00	1,469,414.07	
US TREASURY N/B 1.625	1,200,000.00	1,170,375.00	
US TREASURY N/B 1.625	800,000.00	762,312.50	
US TREASURY N/B 1.625	1,600,000.00	1,519,000.00	
US TREASURY N/B 1.625	1,000,000.00	942,968.75	
US TREASURY N/B 1.625	1,000,000.00	941,875.00	
US TREASURY N/B 1.625	1,000,000.00	936,015.63	
US TREASURY N/B 1.625	1,800,000.00	1,628,437.50	
US TREASURY N/B 1.625	1,800,000.00	1,622,250.00	

US TREASURY N/B 1.75	1,000,000.00	990,859.38	
US TREASURY N/B 1.75	700,000.00	685,562.50	
US TREASURY N/B 1.75	700,000.00	676,484.37	
US TREASURY N/B 1.75	200,000.00	192,734.37	
US TREASURY N/B 1.75	900,000.00	866,320.31	
US TREASURY N/B 1.75	1,500,000.00	1,441,992.19	
US TREASURY N/B 1.75	600,000.00	576,703.12	
US TREASURY N/B 1.75	1,200,000.00	1,152,375.00	
US TREASURY N/B 1.75	1,000,000.00	956,015.63	
US TREASURY N/B 1.75	1,100,000.00	1,043,109.37	
US TREASURY N/B 1.875	500,000.00	493,085.94	
US TREASURY N/B 1.875	600,000.00	582,750.00	
US TREASURY N/B 1.875	1,000,000.00	968,750.00	
US TREASURY N/B 1.875	1,000,000.00	967,890.63	
US TREASURY N/B 1.875	1,000,000.00	966,953.13	
US TREASURY N/B 1.875	1,000,000.00	965,859.38	
US TREASURY N/B 1.875	1,600,000.00	1,544,875.00	
US TREASURY N/B 1.875	1,000,000.00	962,343.75	
US TREASURY N/B 1.875	1,500,000.00	1,440,937.50	
US TREASURY N/B 1.875	300,000.00	281,601.56	
US TREASURY N/B 2	500,000.00	493,906.25	
US TREASURY N/B 2	500,000.00	493,203.12	
US TREASURY N/B 2	400,000.00	393,968.75	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	2,951,484.39	
US TREASURY N/B 2	2,300,000.00	2,259,929.69	
US TREASURY N/B 2	1,000,000.00	980,234.38	
US TREASURY N/B 2	800,000.00	781,937.50	
US TREASURY N/B 2	1,200,000.00	1,170,750.00	
US TREASURY N/B 2	1,000,000.00	975,859.38	
US TREASURY N/B 2	1,000,000.00	974,062.50	
US TREASURY N/B 2	600,000.00	583,921.87	
US TREASURY N/B 2	700,000.00	677,851.56	
US TREASURY N/B 2	1,300,000.00	1,255,312.50	
US TREASURY N/B 2	2,300,000.00	2,219,679.69	
US TREASURY N/B 2	1,200,000.00	1,155,281.25	

US TREASURY N/B 2	1,000,000.00	948,906.25	
US TREASURY N/B 2	800,000.00	758,312.50	
US TREASURY N/B 2	600,000.00	568,218.75	
US TREASURY N/B 2	2,200,000.00	2,068,171.87	
US TREASURY N/B 2	2,400,000.00	2,245,125.00	
US TREASURY N/B 2	1,900,000.00	1,753,789.07	
US TREASURY N/B 2.125	500,000.00	494,960.94	
US TREASURY N/B 2.125	500,000.00	493,320.31	
US TREASURY N/B 2.125	800,000.00	786,375.00	
US TREASURY N/B 2.125	1,500,000.00	1,472,578.12	
US TREASURY N/B 2.125	400,000.00	392,218.75	
US TREASURY N/B 2.125	1,000,000.00	978,593.75	
US TREASURY N/B 2.125	700,000.00	681,898.44	
US TREASURY N/B 2.125	1,000,000.00	969,375.00	
US TREASURY N/B 2.125	1,000,000.00	960,234.38	
US TREASURY N/B 2.125	1,000,000.00	957,421.88	
US TREASURY N/B 2.125	500,000.00	478,359.37	
US TREASURY N/B 2.125	1,100,000.00	1,048,609.37	
US TREASURY N/B 2.125	1,000,000.00	951,562.50	
US TREASURY N/B 2.125	1,200,000.00	1,134,937.50	
US TREASURY N/B 2.25	400,000.00	395,937.50	
US TREASURY N/B 2.25	600,000.00	593,296.87	
US TREASURY N/B 2.25	500,000.00	494,101.56	
US TREASURY N/B 2.25	1,000,000.00	986,093.75	
US TREASURY N/B 2.25	1,000,000.00	965,937.50	
US TREASURY N/B 2.25	1,000,000.00	965,000.00	
US TREASURY N/B 2.25	800,000.00	766,562.50	
US TREASURY N/B 2.25	900,000.00	862,101.56	
US TREASURY N/B 2.25	500,000.00	478,320.31	
US TREASURY N/B 2.25	1,900,000.00	1,803,960.94	
US TREASURY N/B 2.25	2,200,000.00	2,069,031.25	
US TREASURY N/B 2.25	1,700,000.00	1,593,484.37	
US TREASURY N/B 2.25	1,200,000.00	1,122,843.75	
US TREASURY N/B 2.25	1,300,000.00	1,068,640.62	
US TREASURY N/B 2.375	500,000.00	496,875.00	

US TREASURY N/B 2.375	2,000,000.00	1,934,375.00	
US TREASURY N/B 2.375	1,600,000.00	1,518,375.00	
US TREASURY N/B 2.5	1,300,000.00	1,276,335.94	
US TREASURY N/B 2.5	1,000,000.00	976,015.63	
US TREASURY N/B 2.5	1,000,000.00	971,328.13	
US TREASURY N/B 2.5	1,000,000.00	873,281.25	
US TREASURY N/B 2.5	1,400,000.00	1,217,890.63	
US TREASURY N/B 2.5	900,000.00	782,085.94	
US TREASURY N/B 2.625	1,400,000.00	1,402,187.50	
US TREASURY N/B 2.625	1,800,000.00	1,800,984.38	
US TREASURY N/B 2.75	1,500,000.00	1,488,867.19	
US TREASURY N/B 2.75	1,500,000.00	1,486,757.82	
US TREASURY N/B 2.75	2,200,000.00	2,170,265.63	
US TREASURY N/B 2.75	200,000.00	195,328.12	
US TREASURY N/B 2.75	600,000.00	555,656.25	
US TREASURY N/B 2.75	400,000.00	369,937.50	
US TREASURY N/B 2.75	400,000.00	365,093.75	
US TREASURY N/B 2.75	1,600,000.00	1,459,500.00	
US TREASURY N/B 2.875	1,000,000.00	945,468.75	
US TREASURY N/B 2.875	1,300,000.00	1,221,593.75	
US TREASURY N/B 2.875	1,300,000.00	1,218,039.06	
US TREASURY N/B 3	400,000.00	387,750.00	
US TREASURY N/B 3	1,200,000.00	1,156,406.25	
US TREASURY N/B 3	1,300,000.00	1,252,570.31	
US TREASURY N/B 3	1,300,000.00	1,251,250.00	
US TREASURY N/B 3	700,000.00	672,546.87	
US TREASURY N/B 3	800,000.00	768,187.50	
US TREASURY N/B 3	1,000,000.00	960,078.12	
US TREASURY N/B 3.125	800,000.00	806,750.00	
US TREASURY N/B 3.125	800,000.00	810,812.50	
US TREASURY N/B 3.125	300,000.00	297,398.43	
US TREASURY N/B 3.125	800,000.00	793,000.00	
US TREASURY N/B 3.125	400,000.00	395,343.74	
US TREASURY N/B 3.125	1,300,000.00	1,281,921.87	
US TREASURY N/B 3.375	1,500,000.00	1,520,742.19	

	US TREASURY N/B 3.375	1,000,000.00	1,030,468.75	
	US TREASURY N/B 3.5	800,000.00	815,562.50	
	US TREASURY N/B 3.5	300,000.00	317,062.50	
	US TREASURY N/B 3.625	800,000.00	812,750.00	
	US TREASURY N/B 3.625	2,000,000.00	2,040,781.26	
	US TREASURY N/B 3.625	1,200,000.00	1,232,437.50	
	US TREASURY N/B 3.625	1,200,000.00	1,289,906.25	
	US TREASURY N/B 3.625	1,500,000.00	1,611,328.12	
	US TREASURY N/B 3.75	500,000.00	547,421.87	
	US TREASURY N/B 3.75	1,200,000.00	1,314,843.75	
	US TREASURY N/B 3.875	700,000.00	779,953.12	
	US TREASURY N/B 4.25	200,000.00	234,375.00	
	US TREASURY N/B 4.25	400,000.00	469,968.75	
	US TREASURY N/B 4.375	200,000.00	237,234.37	
	US TREASURY N/B 4.375	300,000.00	357,820.31	
	US TREASURY N/B 4.375	400,000.00	477,531.25	
	US TREASURY N/B 4.375	300,000.00	359,156.25	
	US TREASURY N/B 4.5	400,000.00	477,250.00	
	US TREASURY N/B 4.5	200,000.00	241,296.87	
	US TREASURY N/B 4.5	300,000.00	363,562.50	
	US TREASURY N/B 4.625	800,000.00	986,000.00	
	US TREASURY N/B 4.75	600,000.00	754,171.87	
	US TREASURY N/B 5	200,000.00	254,546.87	
	US TREASURY N/B 5.25	200,000.00	239,781.25	
	US TREASURY N/B 5.25	500,000.00	601,523.44	
	US TREASURY N/B 5.375	200,000.00	249,109.37	
	US TREASURY N/B 6	200,000.00	242,062.50	
	US TREASURY N/B 6.125	500,000.00	628,789.05	
	US TREASURY N/B 6.25	500,000.00	583,750.00	
	US TREASURY N/B 6.25	200,000.00	264,312.50	
	US TREASURY N/B 6.5	300,000.00	379,148.43	
	US TREASURY N/B 8	300,000.00	353,460.93	
	米ドル 小計	204,500,000.00	199,676,820.36 (21,850,634,451)	
カナダドル	CANADA-GOV'T 0.5	200,000.00	199,004.00	

	CANADA-GOV'T 0.5	500,000.00	495,800.00
	CANADA-GOV'T 0.5	600,000.00	563,976.00
	CANADA-GOV'T 0.75	700,000.00	693,448.00
	CANADA-GOV'T 0.75	400,000.00	388,920.00
	CANADA-GOV'T 0.75	600,000.00	579,030.00
	CANADA-GOV'T 0.75	300,000.00	287,100.00
	CANADA-GOV'T 1	400,000.00	355,320.00
	CANADA-GOV'T 1.5	1,100,000.00	1,091,783.00
	CANADA-GOV'T 1.5	500,000.00	482,890.00
	CANADA-GOV'T 1.5	500,000.00	469,050.00
	CANADA-GOV'T 1.75	300,000.00	300,285.00
	CANADA-GOV'T 1.75	300,000.00	299,724.00
	CANADA-GOV'T 2.25	300,000.00	298,524.00
	CANADA-GOV'T 2.5	500,000.00	506,575.00
	CANADA-GOV'T 2.75	800,000.00	819,200.00
	CANADA-GOV'T 2.75	500,000.00	529,750.00
	CANADA-GOV'T 3.25	300,000.00	310,629.00
	CANADA-GOV'T 3.5	300,000.00	309,507.00
	CANADA-GOV'T 3.5	500,000.00	601,625.00
	CANADA-GOV'T 3.75	700,000.00	715,330.00
	CANADA-GOV'T 4	600,000.00	759,168.00
	CANADA-GOV'T 5	300,000.00	415,458.00
	CANADA-GOV'T 5.75	600,000.00	794,394.00
	CANADA-GOV'T 5.75	300,000.00	425,112.00
	カナダドル 小計	12,100,000.00	12,691,602.00 (1,082,085,986)
メキシコペソ	MEXICAN BONOS 10	7,000,000.00	7,939,680.00
	MEXICAN BONOS 5	6,000,000.00	5,786,820.00
	MEXICAN BONOS 5.75	7,000,000.00	6,273,470.00
	MEXICAN BONOS 6.5	7,000,000.00	6,827,800.00
	MEXICAN BONOS 6.5	4,000,000.00	3,870,880.00
	MEXICAN BONOS 7.75	4,000,000.00	4,019,680.00
	MEXICAN BONOS 7.75	4,000,000.00	4,008,240.00
	MEXICAN BONOS 7.75	8,000,000.00	7,978,080.00
	MEXICAN BONOS 8	7,000,000.00	7,093,730.00
	MEXICAN BONOS 8	10,000,000.00	10,264,900.00

	MEXICAN BONOS 8.5	2,000,000.00	2,011,200.00	
	MEXICAN BONOS 8.5	2,000,000.00	2,129,920.00	
	MEXICAN BONOS 8.5	4,000,000.00	4,300,000.00	
	メキシコペソ 小計	72,000,000.00	72,504,400.00	(421,250,564)
ユーロ	BELGIAN 0326 4	200,000.00	275,608.00	
	BELGIAN 0.8	400,000.00	409,412.00	
	BELGIAN 0.8	300,000.00	301,197.00	
	BELGIAN 0291 5.5	500,000.00	726,540.00	
	BELGIAN 0304 5	700,000.00	1,103,935.00	
	BELGIAN 0308 4	500,000.00	581,880.00	
	BELGIAN 0318 3.75	700,000.00	770,903.00	
	BELGIAN 0320 4.25	600,000.00	927,714.00	
	BELGIAN 0321 4.25	200,000.00	230,898.00	
	BELGIAN 0324 4.5	400,000.00	523,892.00	
	BELGIAN 0325 4.25	500,000.00	595,400.00	
	BELGIAN 0327 3	500,000.00	524,970.00	
	BELGIAN 0328 2.25	500,000.00	555,295.00	
	BELGIAN 0332 2.6	400,000.00	456,096.00	
	BELGIAN 0333 3	100,000.00	125,527.00	
	BELGIAN 0338 0.5	300,000.00	302,244.00	
	BELGIAN 1	400,000.00	412,392.00	
	BELGIAN 1	300,000.00	296,706.00	
	BELGIAN 1.6	300,000.00	297,558.00	
	BELGIAN 1.9	300,000.00	325,035.00	
	BELGIAN 2.15	200,000.00	216,310.00	
	BELGIAN 3.75	200,000.00	296,314.00	
	BTPS 0.05	300,000.00	301,629.00	
	BTPS 0.35	400,000.00	402,372.00	
	BTPS 0.45	500,000.00	506,090.00	
	BTPS 0.65	200,000.00	203,750.00	
	BTPS 0.65	300,000.00	297,894.00	
	BTPS 0.7	1,900,000.00	1,934,580.00	
	BTPS 0.95	600,000.00	609,210.00	
	BTPS 1.05	600,000.00	612,972.00	

BTPS 1.2	500,000.00	516,470.00
BTPS 1.25	600,000.00	586,716.00
BTPS 1.35	600,000.00	622,992.00
BTPS 1.45	600,000.00	624,678.00
BTPS 1.45	1,500,000.00	1,532,220.00
BTPS 1.5	400,000.00	409,428.00
BTPS 1.5	400,000.00	406,924.00
BTPS 1.6	600,000.00	606,000.00
BTPS 1.65	600,000.00	566,130.00
BTPS 1.85	300,000.00	315,252.00
BTPS 2	900,000.00	941,229.00
BTPS 2.05	600,000.00	618,972.00
BTPS 2.15	300,000.00	320,718.00
BTPS 2.2	300,000.00	314,019.00
BTPS 2.25	400,000.00	391,428.00
BTPS 2.45	300,000.00	307,146.00
BTPS 2.5	600,000.00	617,406.00
BTPS 2.5	600,000.00	652,656.00
BTPS 2.7	200,000.00	198,582.00
BTPS 2.8	200,000.00	189,960.00
BTPS 2.95	400,000.00	425,260.00
BTPS 3.25	400,000.00	440,296.00
BTPS 3.45	200,000.00	225,090.00
BTPS 3.5	800,000.00	923,312.00
BTPS 3.75	700,000.00	774,928.00
BTPS 3.75	400,000.00	444,392.00
BTPS 3.75	800,000.00	894,576.00
BTPS 3.75	600,000.00	699,234.00
BTPS 4	700,000.00	768,082.00
BTPS 4	900,000.00	1,113,768.00
BTPS 4.25	700,000.00	743,547.00
BTPS 4.25	700,000.00	758,471.00
BTPS 4.5	1,100,000.00	1,192,906.00
BTPS 4.5	600,000.00	713,286.00
BTPS 4.5	400,000.00	492,616.00

BTPS 4.75	300,000.00	345,990.00	
BTPS 4.75	700,000.00	846,076.00	
BTPS 4.75	400,000.00	509,728.00	
BTPS 4.75	400,000.00	548,080.00	
BTPS 5	700,000.00	825,160.00	
BTPS 5	700,000.00	876,540.00	
BTPS 5	600,000.00	817,098.00	
BTPS 5	600,000.00	834,900.00	
BTPS 5	700,000.00	972,811.00	
BTPS 5.25	1,000,000.00	1,340,480.00	
BTPS 5.5	900,000.00	1,095,453.00	
BTPS 5.5	600,000.00	732,786.00	
BTPS 5.75	500,000.00	720,025.00	
BTPS 6	900,000.00	1,298,862.00	
BTPS 6.5	800,000.00	1,139,864.00	
BTPS 7.25	400,000.00	583,692.00	
BTPS 9	300,000.00	432,555.00	
BUNDESOBL-170 0.25	600,000.00	607,602.00	
BUNDESOBL-171 0	700,000.00	707,574.00	
BUNDESOBL-172 0.25	600,000.00	610,890.00	
BUNDESOBL-174 0	500,000.00	505,195.00	
BUNDESOBL-175 0	500,000.00	504,030.00	
DEUTSCHLAND REP 0	600,000.00	578,172.00	
DEUTSCHLAND REP 0.25	1,300,000.00	1,272,063.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	500,000.00	508,245.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	1,100,000.00	1,110,131.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	200,000.00	198,788.00	
DEUTSCHLAND REP 1	300,000.00	315,213.00	
DEUTSCHLAND REP 1	600,000.00	629,826.00	
DEUTSCHLAND REP 1.25	100,000.00	99,032.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	700,000.00	750,141.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	600,000.00	644,976.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	1,000,000.00	1,075,950.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	600,000.00	648,504.00	
DEUTSCHLAND REP 1.75	800,000.00	864,800.00	

DEUTSCHLAND REP 1.75	700,000.00	765,877.00	
DEUTSCHLAND REP 2	600,000.00	650,124.00	
DEUTSCHLAND REP 2	400,000.00	441,500.00	
DEUTSCHLAND REP 2.25	400,000.00	426,096.00	
DEUTSCHLAND REP 2.25	500,000.00	543,280.00	
DEUTSCHLAND REP 2.5	500,000.00	539,975.00	
DEUTSCHLAND REP 2.5	500,000.00	642,710.00	
DEUTSCHLAND REP 2.5	700,000.00	908,180.00	
DEUTSCHLAND REP 3	800,000.00	861,992.00	
DEUTSCHLAND REP 3.25	500,000.00	532,945.00	
DEUTSCHLAND REP 3.25	600,000.00	669,330.00	
DEUTSCHLAND REP 3.25	400,000.00	575,676.00	
DEUTSCHLAND REP 3.5	800,000.00	839,688.00	
DEUTSCHLAND REP 4	600,000.00	901,950.00	
DEUTSCHLAND REP 4.25	400,000.00	638,584.00	
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,000,000.00	1,408,300.00	
DEUTSCHLAND REP 4.75	600,000.00	941,964.00	
DEUTSCHLAND REP 4.75	400,000.00	686,768.00	
DEUTSCHLAND REP 5.5	500,000.00	785,770.00	
DEUTSCHLAND REP 5.625	410,000.00	605,582.30	
DEUTSCHLAND REP 6.25	200,000.00	269,778.00	
DEUTSCHLAND REP 6.25	100,000.00	162,399.00	
DEUTSCHLAND REP 6.5	500,000.00	768,935.00	
FINNISH GOV'T 0.75	300,000.00	290,223.00	
FINNISH GOV'T 0.875	300,000.00	308,889.00	
FINNISH GOV'T 1.5	300,000.00	320,982.00	
FINNISH GOV'T 1.625	300,000.00	322,014.00	
FINNISH GOV'T 2	200,000.00	220,722.00	
FINNISH GOV'T 2.625	100,000.00	128,633.00	
FINNISH GOV'T 2.75	100,000.00	119,328.00	
FINNISH GOV'T 3.375	200,000.00	215,274.00	
FINNISH GOV'T 3.5	200,000.00	222,696.00	
FINNISH GOV'T 4.375	200,000.00	211,830.00	
FRANCE O.A.T. 0	300,000.00	302,694.00	
FRANCE O.A.T. 0	800,000.00	807,528.00	

FRANCE O.A.T. 0	1,300,000.00	1,311,752.00	
FRANCE O.A.T. 0	700,000.00	706,055.00	
FRANCE O.A.T. 0	200,000.00	200,610.00	
FRANCE O.A.T. 0.25	500,000.00	508,190.00	
FRANCE O.A.T. 0.25	900,000.00	870,759.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	1,200,000.00	1,219,716.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	1,000,000.00	1,005,630.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	800,000.00	795,888.00	
FRANCE O.A.T. 1	1,100,000.00	1,118,590.00	
FRANCE O.A.T. 1	700,000.00	726,348.00	
FRANCE O.A.T. 1	1,100,000.00	1,127,071.00	
FRANCE O.A.T. 1.25	800,000.00	788,768.00	
FRANCE O.A.T. 1.5	1,400,000.00	1,470,896.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	1,100,000.00	1,192,048.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	1,000,000.00	1,091,290.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	300,000.00	317,088.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	200,000.00	194,924.00	
FRANCE O.A.T. 2	700,000.00	754,033.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	900,000.00	991,827.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	800,000.00	895,632.00	
FRANCE O.A.T. 2.5	500,000.00	536,460.00	
FRANCE O.A.T. 2.5	800,000.00	936,528.00	
FRANCE O.A.T. 2.75	1,200,000.00	1,421,316.00	
FRANCE O.A.T. 3	1,700,000.00	1,912,704.00	
FRANCE O.A.T. 3.25	1,100,000.00	1,233,606.00	
FRANCE O.A.T. 3.25	700,000.00	955,724.00	
FRANCE O.A.T. 3.5	1,100,000.00	1,187,703.00	
FRANCE O.A.T. 3.5	700,000.00	864,262.00	
FRANCE O.A.T. 3.75	1,600,000.00	1,796,000.00	
FRANCE O.A.T. 4	800,000.00	1,177,000.00	
FRANCE O.A.T. 4	200,000.00	323,230.00	
FRANCE O.A.T. 4	400,000.00	663,164.00	
FRANCE O.A.T. 4.25	1,400,000.00	1,714,566.00	
FRANCE O.A.T. 4.5	800,000.00	1,278,136.00	
FRANCE O.A.T. 4.75	900,000.00	1,388,601.00	

FRANCE O.A.T. 5.5	800,000.00	1,187,328.00	
FRANCE O.A.T. 5.75	1,000,000.00	1,624,450.00	
FRANCE O.A.T. 6	900,000.00	1,271,574.00	
FRANCE O.A.T. 8.5	1,400,000.00	1,591,170.00	
FRANCE O.A.T. 8.5	200,000.00	284,192.00	
IRISH GOVT 0.8	300,000.00	309,870.00	
IRISH GOVT 1	200,000.00	204,270.00	
IRISH GOVT 1.7	100,000.00	102,321.00	
IRISH GOVT 2	300,000.00	317,670.00	
IRISH GOVT 2.4	300,000.00	341,454.00	
IRISH GOVT 3.4	200,000.00	235,596.00	
IRISH GOVT 3.9	200,000.00	236,524.00	
IRISH GOVT 4.4	200,000.00	211,224.00	
IRISH GOVT 4.5	500,000.00	549,000.00	
IRISH GOVT 5	200,000.00	226,718.00	
IRISH GOVT 5.4	300,000.00	398,772.00	
IRISH GOVT 5.9	200,000.00	218,906.00	
NETHERLANDS GOVT 0	300,000.00	302,037.00	
NETHERLANDS GOVT 0.25	400,000.00	405,828.00	
NETHERLANDS GOVT 0.25	400,000.00	395,456.00	
NETHERLANDS GOVT 0.5	300,000.00	299,229.00	
NETHERLANDS GOVT 0.75	300,000.00	302,511.00	
NETHERLANDS GOVT 1.75	500,000.00	543,535.00	
NETHERLANDS GOVT 2	400,000.00	443,168.00	
NETHERLANDS GOVT 2.25	500,000.00	550,050.00	
NETHERLANDS GOVT 2.5	200,000.00	241,280.00	
NETHERLANDS GOVT 2.75	500,000.00	677,190.00	
NETHERLANDS GOVT 3.25	600,000.00	669,378.00	
NETHERLANDS GOVT 3.5	800,000.00	871,768.00	
NETHERLANDS GOVT 3.75	300,000.00	353,460.00	
NETHERLANDS GOVT 3.75	300,000.00	459,690.00	
NETHERLANDS GOVT 4	500,000.00	528,385.00	
NETHERLANDS GOVT 4	700,000.00	1,047,452.00	
NETHERLANDS GOVT 5.5	400,000.00	582,420.00	
REP OF AUSTRIA 0.25	200,000.00	202,318.00	

REP OF AUSTRIA 0.5	100,000.00	98,169.00	
REP OF AUSTRIA 0.75	500,000.00	504,685.00	
REP OF AUSTRIA 0.75	200,000.00	198,908.00	
REP OF AUSTRIA 1.2	100,000.00	105,221.00	
REP OF AUSTRIA 1.5	300,000.00	299,064.00	
REP OF AUSTRIA 1.65	300,000.00	325,215.00	
REP OF AUSTRIA 1.75	500,000.00	543,440.00	
REP OF AUSTRIA 1.95	200,000.00	205,720.00	
REP OF AUSTRIA 2.4	200,000.00	235,724.00	
REP OF AUSTRIA 3.15	300,000.00	414,162.00	
REP OF AUSTRIA 3.4	700,000.00	809,501.00	
REP OF AUSTRIA 3.5	200,000.00	225,408.00	
REP OF AUSTRIA 3.65	400,000.00	459,976.00	
REP OF AUSTRIA 3.8	100,000.00	166,904.00	
REP OF AUSTRIA 3.9	300,000.00	328,962.00	
REP OF AUSTRIA 4.15	300,000.00	447,441.00	
REP OF AUSTRIA 4.85	400,000.00	534,928.00	
REP OF AUSTRIA 6.25	200,000.00	299,876.00	
SPANISH GOV'T 0.4	300,000.00	303,777.00	
SPANISH GOV'T 0.45	700,000.00	707,161.00	
SPANISH GOV'T 0.75	500,000.00	513,655.00	
SPANISH GOV'T 1.15	700,000.00	722,337.00	
SPANISH GOV'T 1.3	600,000.00	610,800.00	
SPANISH GOV'T 1.4	700,000.00	721,546.00	
SPANISH GOV'T 1.45	600,000.00	612,252.00	
SPANISH GOV'T 1.5	500,000.00	514,580.00	
SPANISH GOV'T 1.6	100,000.00	105,560.00	
SPANISH GOV'T 1.95	600,000.00	643,668.00	
SPANISH GOV'T 2.15	500,000.00	545,045.00	
SPANISH GOV'T 2.35	400,000.00	429,044.00	
SPANISH GOV'T 2.7	300,000.00	322,053.00	
SPANISH GOV'T 2.75	1,000,000.00	1,132,510.00	
SPANISH GOV'T 2.9	700,000.00	790,160.00	
SPANISH GOV'T 3.45	200,000.00	245,774.00	
SPANISH GOV'T 3.8	200,000.00	237,950.00	

	SPANISH GOV'T 4	700,000.00	760,354.00	
	SPANISH GOV'T 4.2	670,000.00	909,303.90	
	SPANISH GOV'T 4.3	700,000.00	749,868.00	
	SPANISH GOV'T 4.4	800,000.00	972,384.00	
	SPANISH GOV'T 4.6	500,000.00	531,775.00	
	SPANISH GOV'T 4.65	1,000,000.00	1,269,350.00	
	SPANISH GOV'T 4.7	700,000.00	1,032,269.00	
	SPANISH GOV'T 4.8	500,000.00	621,975.00	
	SPANISH GOV'T 4.85	500,000.00	563,635.00	
	SPANISH GOV'T 4.9	400,000.00	599,844.00	
	SPANISH GOV'T 5.15	400,000.00	549,576.00	
	SPANISH GOV'T 5.15	200,000.00	317,428.00	
	SPANISH GOV'T 5.4	200,000.00	248,548.00	
	SPANISH GOV'T 5.5	700,000.00	818,482.00	
	SPANISH GOV'T 5.75	800,000.00	1,218,512.00	
	SPANISH GOV'T 5.85	600,000.00	731,538.00	
	SPANISH GOV'T 5.9	700,000.00	970,242.00	
	SPANISH GOV'T 6	700,000.00	1,026,935.00	
	ユーロ 小計	140,580,000.00	163,177,965.20 (21,736,936,744)	
英bond	UK TSY GILT 0.5	500,000.00	487,525.00	
	UK TSY GILT 0.75	200,000.00	195,082.00	
	UK TSY GILT 1.25	300,000.00	291,720.00	
	UK TSY GILT 1.5	800,000.00	812,336.00	
	UK TSY GILT 1.5	800,000.00	802,600.00	
	UK TSY GILT 1.5	900,000.00	815,364.00	
	UK TSY GILT 1.75	200,000.00	202,388.00	
	UK TSY GILT 1.75	700,000.00	719,166.00	
	UK TSY GILT 1.75	300,000.00	292,275.00	
	UK TSY GILT 1.75	300,000.00	298,875.00	
	UK TSY GILT 2	900,000.00	922,257.00	
	UK TSY GILT 2	600,000.00	627,276.00	
	UK TSY GILT 2.25	500,000.00	526,770.00	
	UK TSY GILT 2.5	500,000.00	626,355.00	
	UK TSY GILT 2.75	500,000.00	544,215.00	

	UK TSY GILT 3.25	800,000.00	1,011,208.00	
	UK TSY GILT 3.5	900,000.00	1,190,592.00	
	UK TSY GILT 3.5	400,000.00	639,532.00	
	UK TSY GILT 3.75	700,000.00	728,266.00	
	UK TSY GILT 3.75	500,000.00	533,985.00	
	UK TSY GILT 3.75	400,000.00	436,800.00	
	UK TSY GILT 3.75	600,000.00	890,550.00	
	UK TSY GILT 4	500,000.00	556,655.00	
	UK TSY GILT 4	400,000.00	667,772.00	
	UK TSY GILT 4.25	400,000.00	496,580.00	
	UK TSY GILT 4.25	700,000.00	914,963.00	
	UK TSY GILT 4.25	600,000.00	817,434.00	
	UK TSY GILT 4.25	400,000.00	564,412.00	
	UK TSY GILT 4.25	500,000.00	713,855.00	
	UK TSY GILT 4.25	500,000.00	753,875.00	
	UK TSY GILT 4.25	300,000.00	468,225.00	
	UK TSY GILT 4.25	300,000.00	502,005.00	
	UK TSY GILT 4.5	300,000.00	412,587.00	
	UK TSY GILT 4.5	300,000.00	450,867.00	
	UK TSY GILT 4.75	600,000.00	643,554.00	
	UK TSY GILT 4.75	300,000.00	402,468.00	
	UK TSY GILT 4.75	400,000.00	595,480.00	
	UK TSY GILT 5	800,000.00	992,256.00	
	UK TSY GILT 6	200,000.00	285,506.00	
	UK TSY GILT 8	300,000.00	365,055.00	
	英bond 小計	20,100,000.00	24,198,686.00 (3,692,477,496)	
スイスフラン	SWISS (GOVT) 2	400,000.00	431,640.00	
	SWISS (GOVT) 3	200,000.00	207,820.00	
	SWISS (GOVT) 4	100,000.00	121,410.00	
	SWISS (GOVT) 4	100,000.00	138,250.00	
	スイスフラン 小計	800,000.00	899,120.00 (100,126,003)	
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVRNMNT 0.75	1,100,000.00	1,095,765.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 1	2,600,000.00	2,685,436.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 1.5	2,500,000.00	2,684,050.00	

	SWEDISH GOVRNMNT 2.5	1,000,000.00	1,145,520.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	2,300,000.00	2,642,562.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	1,400,000.00	1,919,358.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 4.25	200,000.00	208,870.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 5	3,000,000.00	3,431,400.00	
スウェーデンクローナ 小計		14,100,000.00	15,812,961.00	(202,247,771)
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOV'T 1.5	1,500,000.00	1,463,250.00	
	NORWEGIAN GOV'T 1.75	1,000,000.00	1,000,100.00	
	NORWEGIAN GOV'T 2	2,400,000.00	2,454,960.00	
	NORWEGIAN GOV'T 3	2,000,000.00	2,151,600.00	
	NORWEGIAN GOV'T 3.75	2,200,000.00	2,369,840.00	
	NORWEGIAN GOV'T 4.5	2,000,000.00	2,078,800.00	
ノルウェークローネ 小計		11,100,000.00	11,518,550.00	(158,380,062)
デンマーククローネ	DENMARK - BULLET 0.5	1,800,000.00	1,776,420.00	
	DENMARK - BULLET 1.5	1,000,000.00	1,077,300.00	
	DENMARK - BULLET 1.75	2,500,000.00	2,756,500.00	
	DENMARK - BULLET 3	1,900,000.00	2,120,210.00	
	DENMARK - BULLET 4	2,700,000.00	2,892,510.00	
	DENMARK - BULLET 4.5	3,400,000.00	5,604,560.00	
	DENMARK - BULLET 7	820,000.00	1,182,932.00	
デンマーククローネ 小計		14,120,000.00	17,410,432.00	(311,298,524)
ポーランドズロチ	POLAND GOVT BOND 1.5	2,000,000.00	1,995,200.00	
	POLAND GOVT BOND 1.75	1,000,000.00	995,600.00	
	POLAND GOVT BOND 2	1,400,000.00	1,405,040.00	
	POLAND GOVT BOND 2.5	1,300,000.00	1,252,940.00	
	POLAND GOVT BOND 2.5	1,200,000.00	1,144,800.00	
	POLAND GOVT BOND 3.25	200,000.00	204,200.00	
	POLAND GOVT BOND 4	500,000.00	540,000.00	
	POLAND GOVT BOND 5.5	900,000.00	954,810.00	
	POLAND GOVT BOND 5.75	1,100,000.00	1,236,400.00	
	POLAND GOVT BOND 5.75	900,000.00	1,030,194.00	
	POLAND GOVT BOND 5.75	400,000.00	497,384.00	

ポーランドズロチ 小計		10,900,000.00	11,256,568.00 (354,694,457)
オーストラリアドル	AUSTRALIAN GOVT. 1.75	1,200,000.00	1,186,620.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2	500,000.00	494,200.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.25	700,000.00	662,410.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	200,000.00	201,990.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	800,000.00	806,648.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	800,000.00	792,720.00
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	500,000.00	495,456.50
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	400,000.00	377,880.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3	200,000.00	185,522.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	1,000,000.00	1,033,800.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	900,000.00	930,060.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	200,000.00	198,540.00
	AUSTRALIAN GOVT. 3.75	300,000.00	323,250.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25	900,000.00	993,960.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	700,000.00	732,071.20
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	400,000.00	468,520.00
	AUSTRALIAN GOVT. 4.75	500,000.00	576,250.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	600,000.00	683,760.00
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	800,000.00	881,880.00
AUSTRALIAN GOVT. 5.75	900,000.00	1,020,465.00	
オーストラリアドル 小計		12,500,000.00	13,046,002.70 (1,081,774,543)
シンガポールドル	SINGAPORE GOV'T 1.25	400,000.00	388,760.00
	SINGAPORE GOV'T 1.625	500,000.00	498,550.00
	SINGAPORE GOV'T 2	600,000.00	600,981.00
	SINGAPORE GOV'T 2.125	500,000.00	487,100.00
	SINGAPORE GOV'T 2.25	300,000.00	301,470.00
	SINGAPORE GOV'T 2.5	100,000.00	100,780.00
	SINGAPORE GOV'T 2.75	300,000.00	306,600.00
	SINGAPORE GOV'T 2.75	200,000.00	195,600.00
	SINGAPORE GOV'T 2.75	200,000.00	195,799.00
	SINGAPORE GOV'T 2.875	300,000.00	306,300.00
	SINGAPORE GOV'T 2.875	300,000.00	305,550.00

	SINGAPORE GOV'T 3	600,000.00	620,700.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.125	200,000.00	208,260.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.25	200,000.00	205,860.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.375	300,000.00	323,538.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.5	500,000.00	538,430.00	
	シンガポールドル 小計	5,500,000.00	5,584,278.00	(460,479,563)
南アフリカランド	REP SOUTH AFRICA 6.5	20,000,000.00	14,952,000.00	
	REP SOUTH AFRICA 7	16,000,000.00	13,828,800.00	
	REP SOUTH AFRICA 7.75	7,000,000.00	7,007,000.00	
	REP SOUTH AFRICA 8	2,000,000.00	2,012,940.00	
	南アフリカランド 小計	45,000,000.00	37,800,740.00	(332,646,512)
	合計		51,785,032,676	(51,785,032,676)

（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 209銘柄	42.5%	42.2%
カナダドル	国債証券 25銘柄	2.1%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 13銘柄	0.8%	0.8%
ユーロ	国債証券 258銘柄	42.3%	42.0%
英ポンド	国債証券 40銘柄	7.2%	7.1%
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 8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 7銘柄	0.6%	0.6%
ポーランドズロチ	国債証券 11銘柄	0.7%	0.7%
オーストラリアドル	国債証券 20銘柄	2.1%	2.1%
シンガポールドル	国債証券 16銘柄	0.9%	0.9%
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	2017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	1,002,231

（1口当たり情報）

（2017年10月31日現在）	
1口当たり純資産額	
（一般投資家クラス） 80.73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	2017年10月31日現在
	金額（千米ドル）
債券	11,695,996
短期金融資産	37,553
投資総額	11,733,549
その他資産及び負債	194,660
純資産額	11,928,209

（1口当たり情報）

（2017年10月31日現在）	
1口当たり純資産額	
（一般投資家クラス） 115.92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	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

【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4期中間計算期間(平成30年 4月27日から平成30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4期中間計算期間
（平成30年10月26日現在）

資産の部	
流動資産	
預金	14,981,729
金銭信託	488,016,137
コール・ローン	53,714,067
投資信託受益証券	3,277,854,151
親投資信託受益証券	20,339,603,937
派生商品評価勘定	137,718
未収入金	836,581,455
流動資産合計	25,010,889,194
資産合計	
25,010,889,194	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	7,290,529
未払金	653,000,000
未払解約金	106,095,812
未払受託者報酬	4,437,729
未払委託者報酬	133,131,574
未払利息	155
その他未払費用	915,962
流動負債合計	904,871,761
負債合計	
904,871,761	
純資産の部	
元本等	
元本	24,906,261,207
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	800,243,774
元本等合計	24,106,017,433
純資産合計	
24,106,017,433	
負債純資産合計	
25,010,889,194	

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期中間計算期間 自 平成30年 4月27日 至 平成30年10月26日
営業収益	
受取配当金	98,619,401
受取利息	7,505
有価証券売買等損益	253,594,950
為替差損益	45,178,714
営業収益合計	200,146,758
営業費用	
支払利息	170,869
受託者報酬	4,437,729
委託者報酬	133,131,574
その他費用	1,378,596
営業費用合計	139,118,768
営業利益又は営業損失（ ）	339,265,526
経常利益又は経常損失（ ）	339,265,526
中間純利益又は中間純損失（ ）	339,265,526
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（ ）	106,619
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	579,777,793
剰余金増加額又は欠損金減少額	122,880,185
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	122,880,185
中間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	4,187,259
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	4,187,259
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	800,243,774

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第4期中間計算期間	
	自 平成30年 4月27日	至 平成30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4期中間計算期間	
	(平成30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		24,906,261,207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	800,243,774円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	0.9679円
	(10,000口当たりの純資産額)	9,679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4期中間計算期間 (平成30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4期中間計算期間（平成30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	56,778,102	-	56,915,820	137,718
	米ドル	56,778,102	-	56,915,820	137,718
	売建	3,657,220,394	-	3,664,510,923	7,290,529
	米ドル	3,657,220,394	-	3,664,510,923	7,290,529
	合計	3,713,998,496	-	3,721,426,743	7,152,811

（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4期中間計算期間 (平成30年10月26日現在)
期首元本額	31,323,831,015円
期中追加設定元本額	223,334,550円
期中一部解約元本額	6,640,904,358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4期中間計算期間
（平成30年10月26日現在）

資産の部	
流動資産	
預金	15,852,907
金銭信託	522,908,505
コール・ローン	57,554,536
投資信託受益証券	3,705,732,663
親投資信託受益証券	12,039,481,497
派生商品評価勘定	63,126
未収入金	351,000,000
流動資産合計	16,692,593,234
資産合計	
16,692,593,234	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	7,830,425
未払金	461,000,000
未払解約金	75,563,649
未払受託者報酬	2,911,126
未払委託者報酬	87,333,816
未払利息	166
その他未払費用	602,304
流動負債合計	635,241,486
負債合計	
635,241,486	
純資産の部	
元本等	
元本	16,391,418,388
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	334,066,640
元本等合計	16,057,351,748
純資産合計	
16,057,351,748	
負債純資産合計	
16,692,593,234	

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期中間計算期間 自 平成30年 4月27日 至 平成30年10月26日
営業収益	
受取配当金	103,102,544
受取利息	7,777
有価証券売買等損益	330,591,192
為替差損益	48,028,974
営業収益合計	275,509,845
営業費用	
支払利息	117,981
受託者報酬	2,911,126
委託者報酬	87,333,816
その他費用	1,071,076
営業費用合計	91,433,999
営業利益又は営業損失（ ）	366,943,844
経常利益又は経常損失（ ）	366,943,844
中間純利益又は中間純損失（ ）	366,943,844
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（ ）	252,133
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	40,066,728
剰余金増加額又は欠損金減少額	957,023
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	957,023
剰余金減少額又は欠損金増加額	7,894,414
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	7,894,414
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（ ）	334,066,640

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第4期中間計算期間	
	自 平成30年 4月27日	至 平成30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4期中間計算期間	
	(平成30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		16,391,418,388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	334,066,640円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	0.9796円
	(10,000口当たりの純資産額)	9,796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4期中間計算期間 (平成30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4期中間計算期間（平成30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	35,972,334	-	36,035,460	63,126
	米ドル	35,972,334	-	36,035,460	63,126
	売建	3,773,198,635	-	3,781,029,060	7,830,425
	米ドル	3,773,198,635	-	3,781,029,060	7,830,425
	合計	3,809,170,969	-	3,817,064,520	7,767,299

（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4期中間計算期間 (平成30年10月26日現在)
期首元本額	19,984,561,437円
期中追加設定元本額	332,870,408円
期中一部解約元本額	3,926,013,457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4期中間計算期間
（平成30年10月26日現在）

資産の部	
流動資産	
預金	14,689,659
金銭信託	357,086,145
コール・ローン	39,303,104
投資信託受益証券	3,473,277,907
親投資信託受益証券	8,092,649,305
派生商品評価勘定	74,094
未収入金	312,000,000
流動資産合計	12,289,080,214
資産合計	
12,289,080,214	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	7,311,924
未払金	390,000,000
未払解約金	39,469,828
未払受託者報酬	2,137,250
未払委託者報酬	64,117,366
未払利息	113
その他未払費用	443,612
流動負債合計	503,480,093
負債合計	
503,480,093	
純資産の部	
元本等	
元本	11,971,701,923
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	186,101,802
元本等合計	11,785,600,121
純資産合計	
11,785,600,121	
負債純資産合計	
12,289,080,214	

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期中間計算期間 自 平成30年 4月27日 至 平成30年10月26日
営業収益	
受取配当金	94,693,088
受取利息	6,898
有価証券売買等損益	305,299,284
為替差損益	44,459,800
営業収益合計	255,059,098
営業費用	
支払利息	89,081
受託者報酬	2,137,250
委託者報酬	64,117,366
その他費用	879,280
営業費用合計	67,222,977
営業利益又は営業損失（ ）	322,282,075
経常利益又は経常損失（ ）	322,282,075
中間純利益又は中間純損失（ ）	322,282,075
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（ ）	2,552,165
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	161,695,371
剰余金増加額又は欠損金減少額	6,876,318
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	6,876,318
剰余金減少額又は欠損金増加額	34,943,581
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	34,943,581
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（ ）	186,101,802

(3) 【中間注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第4期中間計算期間	
	自 平成30年 4月27日	至 平成30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4期中間計算期間	
	(平成30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		11,971,701,923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	186,101,802円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	0.9845円
	(10,000口当たりの純資産額)	9,845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4期中間計算期間 (平成30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4期中間計算期間（平成30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	17,775,246	-	17,849,340	74,094
	米ドル	17,775,246	-	17,849,340	74,094
	売建	3,522,816,036	-	3,530,127,960	7,311,924
	米ドル	3,522,816,036	-	3,530,127,960	7,311,924
	合計	3,540,591,282	-	3,547,977,300	7,237,830

（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4期中間計算期間 (平成30年10月26日現在)
期首元本額	14,615,040,087円
期中追加設定元本額	507,595,020円
期中一部解約元本額	3,150,933,184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30年10月26日現在)

資産の部

流動資産

金銭信託	2,792,559,876
コール・ローン	307,366,367
株式	158,419,293,720
未収入金	755,000,000
未収配当金	1,488,583,039
前払金	416,800,000
流動資産合計	164,179,603,002

資産合計

164,179,603,002

負債の部

流動負債

派生商品評価勘定	417,092,680
未払金	9,405,000
未払解約金	34,302,673
未払利息	887
その他未払費用	113,328

(平成30年10月26日現在)

流動負債合計	460,914,568
負債合計	460,914,568
純資産の部	
元本等	
元本	65,971,793,827
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	97,746,894,607
元本等合計	163,718,688,434
純資産合計	163,718,688,434
負債純資産合計	164,179,603,002

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成30年4月27日 至平成30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30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 2,613,600,000円</p>
2. 当計算期間の末日における受益権の総数	65,971,793,827口
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.4816円

(10,000口当たりの純資産額

24,816円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成30年10月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30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	6,066,857,680	-	5,649,765,000	417,092,680
	東証株価指数先物	6,066,857,680	-	5,649,765,000	417,092,680
	合計	6,066,857,680	-	5,649,765,000	417,092,680

(注) 1.時価の算定方法

(1)株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2.ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(平成30年10月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	67,579,087,442円
同期中における追加設定元本額	6,078,475,075円
同期中における一部解約元本額	7,685,768,690円
平成30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	10,146,581,235円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	719,494,559円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	3,488,419,828円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	2,580,233,865円
SMAM・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	153,755,203円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	7,031,846円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	23,004,523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)	58,055,769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)	81,028,717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)	48,072,187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)	120,369,648円
国内株式指数ファンド(TOPIX)	1,953,352,654円
三井住友・DCつみたてNISA・日本株インデックスファンド	7,055,069,747円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	452,137,875円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	644,075,428円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	630,555,066円
イオン・バランス戦略ファンド	40,109,452円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	7,487,934円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	6,841,263円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	8,460,511円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	31,280,305円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	23,863,217円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	56,844,305円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	4,762,370円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	5,956,749,701円
バランスファンドVA(安定運用型)<適格機関投資家限定>	24,267,833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>	604,776,391円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	3,480,120,194円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	2,449,698,399円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	9,016,678,236円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	55,931,035円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	217,589,384円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	779,654円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	994,243,351円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	53,997,026円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	369,425,008円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,088,999,956円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	928,739,841円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	3,098,232,570円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,443,205円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,207,656,106円

S M A M ・ グローバルバランス40VA < 適格機関投資家限定 >	64,109,227円
S M A M ・ バランスファンドVA20 < 適格機関投資家専用 >	87,969,891円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS (適格機関投資家専用)	1,640,032,255円
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 >	102,035,835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 >	46,106,949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 >	21,461,043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 >	200,324,710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 >	367,669,962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 >	159,692,005円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20A2 < 適格機関投資家専用 >	113,598,859円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA35A2 < 適格機関投資家専用 >	57,774,586円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA50A2 < 適格機関投資家専用 >	10,719,389円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA30L2 < 適格機関投資家専用 >	73,824,243円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA25L2 < 適格機関投資家専用 >	939,088,588円
S M A M ・ 国内株式インデックスファンド・VA (適格機関投資家専用)	201,409,377円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20T2 < 適格機関投資家専用 >	19,535,802円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(標準型)VA < 適格機関投資家限定 >	1,677,781,097円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(債券重視型)VA < 適格機関投資家限定 >	232,095,874円
S M A M ・ 世界バランスファンドVA < 適格機関投資家限定 >	1,575,906,619円
S M A M ・ 世界バランスファンドVA2 < 適格機関投資家限定 >	133,573,058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 >	12,539,689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 >	129,425,667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 >	62,221,820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 >	152,667,380円
S M A M ・ マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド < 適格機関投資家限定 >	14,505円
合計	65,971,793,827円

外国株式インデックス・マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

(平成30年10月26日現在)

資産の部

流動資産

預金	3,170,271,570
金銭信託	158,961,977
コール・ローン	17,496,336
株式	160,134,268,129
投資証券	3,789,160,546
派生商品評価勘定	2,072,231
未収入金	145,740,573
未収配当金	171,262,444
前払金	251,813,590
差入委託証拠金	1,698,770,599
流動資産合計	169,539,817,995

資産合計

169,539,817,995

負債の部

流動負債

派生商品評価勘定	253,389,908
未払解約金	63,432,500

(平成30年10月26日現在)

未払利息	50
その他未払費用	36,170
流動負債合計	316,858,628
負債合計	316,858,628
純資産の部	
元本等	
元本	49,996,936,142
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	119,226,023,225
元本等合計	169,222,959,367
純資産合計	169,222,959,367
負債純資産合計	169,539,817,995

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成30年4月27日 至平成30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</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	（平成30年10月26日現在）	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		49,996,936,142口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	3.3847円
	(10,000口当たりの純資産額)	33,847円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成30年10月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30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	株価指数先物取引				
	買建	5,681,966,263	-	5,430,152,673	251,813,590
	SPMINI 1812	4,093,791,875	-	3,900,209,916	193,581,959
	DJ EUR 1812	977,017,473	-	944,029,663	32,987,810
	FTSE 1812	370,289,459	-	362,059,394	8,230,065
	SPI200 1812	240,867,456	-	223,853,700	17,013,756
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	290,741,787	-	291,241,100	499,313
	米ドル	196,315,710	-	196,752,500	436,790
	カナダドル	4,295,862	-	4,296,500	638

ユーロ	42,158,676	-	42,183,900	25,224
英ポンド	21,632,136	-	21,628,500	3,636
スイスフラン	7,863,624	-	7,868,000	4,376
スウェーデンクローナ	1,356,023	-	1,357,400	1,377
ノルウェークローネ	673,069	-	673,000	69
デンマーククローネ	1,198,838	-	1,199,100	262
オーストラリアドル	10,313,407	-	10,338,900	25,493
香港ドル	3,006,292	-	3,011,400	5,108
シンガポールドル	1,624,350	-	1,628,000	3,650
イスラエルシケル	303,800	-	303,900	100
売建	871,600	-	875,000	3,400
スウェーデンクローナ	737,400	-	740,400	3,000
ノルウェークローネ	134,200	-	134,600	400
合計	5,973,579,650	-	5,722,268,773	251,317,677

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

(2) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(平成30年10月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	53,208,560,898円
同期中における追加設定元本額	5,766,922,281円

(平成30年10月26日現在)	
同期中における一部解約元本額	8,978,547,037円
平成30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	13,551,775,492円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	268,208,830円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,119,165,440円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	774,118,176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)	74,510,583円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	2,617,655円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	7,745,122円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	21,829,082円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	39,058,958円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	26,541,230円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	68,351,037円
外国株式指数ファンド	505,657,086円
三井住友・DCつみたてN I S A・全海外株インデックスファンド	2,420,808,053円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	315,400,400円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	371,839,498円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	330,101,605円
イオン・バランス戦略ファンド	16,681,672円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	4,773,908円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	5,064,854円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	6,263,771円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	23,160,774円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	17,989,418円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	42,548,598円
三井住友・DCつみたてN I S A・世界分散ファンド	7,213,471円
S M A M・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	2,149,550,939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>	8,922,970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>	208,489,562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>	1,755,823,811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>	1,622,654,012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>	6,828,627,561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>	21,070,583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>	109,197,074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>	448,417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>	856,491,675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>	61,708,673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>	188,955,118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>	825,048,969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>	700,715,521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>	1,758,084,467円
S M A M・バランスV A株4 0 T <適格機関投資家限定>	1,098,601円
三井住友・外国株式インデックスファンド・V A S(適格機関投資家専用)	673,398,483円

（平成30年10月26日現在）	
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）	913,949,581円
S M A M・グローバルバランス40 V A <適格機関投資家限定>	144,875,919円
S M A M・バランスファンドV A 20 <適格機関投資家専用>	66,809,451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）	1,238,982,181円
S M A M・アセットバランスファンドV A 20 A <適格機関投資家専用>	25,787,340円
S M A M・アセットバランスファンドV A 35 A <適格機関投資家専用>	14,190,765円
S M A M・アセットバランスファンドV A 50 A <適格機関投資家専用>	6,986,832円
S M A M・アセットバランスファンドV A 20 L <適格機関投資家専用>	50,091,943円
S M A M・アセットバランスファンドV A 25 L <適格機関投資家専用>	117,258,620円
S M A M・アセットバランスファンドV A 20 T <適格機関投資家専用>	120,634,183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>	1,290,643,460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>	176,401,107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>	6,487,462,055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>	331,629,889円
S M A M・外国株式インデックスファンドS A <適格機関投資家限定>	881,546,599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>	11,092,554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>	123,072,598円
S M A M・マルチアセットストラテジーファンド2016-05<適格機関投資家限定>	58,805,401円
S M A M・マルチアセットストラテジー・オープン<適格機関投資家限定>	144,985,517円
S M A M・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	18,998円
合計	49,996,936,142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30年10月26日現在）

資産の部

流動資産

預金	22,075,874
金銭信託	1,463,935,781
コール・ローン	161,129,803
株式	1,796,952,916
投資信託受益証券	124,170,118
投資証券	10,909,524
派生商品評価勘定	28,192,832
未収入金	48,018,488
未収配当金	1,355,001
前払金	142,960,055
差入委託証拠金	365,723,647
流動資産合計	4,165,424,039

資産合計

4,165,424,039

負債の部

流動負債

派生商品評価勘定	145,882,107
----------	-------------

(平成30年10月26日現在)

未払解約金	6,755,649
未払利息	465
その他未払費用	78,387
流動負債合計	152,716,608
負債合計	152,716,608
純資産の部	
元本等	
元本	3,273,135,790
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	739,571,641
元本等合計	4,012,707,431
純資産合計	4,012,707,431
負債純資産合計	4,165,424,039

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成30年4月27日 至平成30年10月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資信託受益証券、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	（平成30年10月26日現在）	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		3,273,135,790口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.2260円
	(10,000口当たりの純資産額)	12,260円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成30年10月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、投資信託受益証券、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30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	株価指数先物取引				
	買建	2,224,073,443	-	2,081,113,388	142,960,055
	MSCIE 1812	2,224,073,443	-	2,081,113,388	142,960,055
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	1,952,869,540	-	1,978,402,517	25,532,977
	米ドル	1,952,869,540	-	1,978,402,517	25,532,977
	売建	284,000,000	-	284,262,197	262,197
	米ドル	284,000,000	-	284,262,197	262,197
	合計	4,460,942,983	-	4,343,778,102	117,689,275

（注）1. 時価の算定方法

(1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

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

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

(2) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(平成30年10月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	2,878,626,011円
同期中における追加設定元本額	1,029,897,319円
同期中における一部解約元本額	635,387,540円
平成30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	864,955,525円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	1,215,604,003円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	83,167,154円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	506,367,397円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	454,934,555円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	6,619,586円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	4,563,435円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	3,623,795円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	17,990,577円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	19,211,062円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	64,799,944円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	9,982,245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>	21,316,512円
合計	3,273,135,790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30年10月26日現在)

資産の部	
流動資産	
金銭信託	118,592,388
コール・ローン	13,053,010
投資証券	8,826,194,065
未収入金	526,630,924
未収配当金	77,771,873
流動資産合計	9,562,242,260
資産合計	9,562,242,260
負債の部	
流動負債	
未払解約金	576,000,000
未払利息	37
その他未払費用	5,007
流動負債合計	576,005,044
負債合計	576,005,044
純資産の部	
元本等	
元本	4,410,651,648
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	4,575,585,568
元本等合計	8,986,237,216
純資産合計	8,986,237,216
負債純資産合計	9,562,242,260

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成30年4月27日 至平成30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	受取配当金の計上基準

項 目	自 平成30年 4月27日 至 平成30年10月26日
	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。

(貸借対照表に関する注記)

項 目	(平成30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		4,410,651,648口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	2.0374円
	(10,000口当たりの純資産額	20,374円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項 目	(平成30年10月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30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	5,131,265,092円
同期中における追加設定元本額	1,012,237,259円

（平成30年10月26日現在）	
同期中における一部解約元本額	1,732,850,703円
平成30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）	165,904,091円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	300,863,107円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	268,813,095円
イオン・バランス戦略ファンド	64,919,445円
三井住友・DC日本リートインデックスファンド	373,110,968円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	3,082,145円
三井住友・資産最適化ファンド（1安定重視型）	2,779,736円
三井住友・資産最適化ファンド（2やや安定型）	2,208,565円
三井住友・資産最適化ファンド（3バランス型）	7,295,920円
三井住友・資産最適化ファンド（4やや成長型）	5,844,271円
三井住友・資産最適化ファンド（5成長重視型）	9,279,120円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	2,971,503円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	517,403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）	1,617,339,702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）	1,100,890,445円
SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定>	35,296,191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>	20,235,830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>	161,551,440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>	77,567,143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>	190,181,528円
合計	4,410,651,648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30年10月26日現在）

資産の部	
流動資産	
預金	24,288,812
金銭信託	6,324,765
コール・ローン	696,143
投資証券	4,612,622,548
派生商品評価勘定	24,700
未収入金	562,049,914
未収配当金	4,334,085
流動資産合計	5,210,340,967
資産合計	5,210,340,967
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,940,040
未払解約金	530,163,598

(平成30年10月26日現在)

未払利息	2
その他未払費用	461
流動負債合計	532,104,101
負債合計	532,104,101
純資産の部	
元本等	
元本	2,325,579,290
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	2,352,657,576
元本等合計	4,678,236,866
純資産合計	4,678,236,866
負債純資産合計	5,210,340,967

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成30年4月27日 至平成30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30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		2,325,579,290口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	2.0116円
	(10,000口当たりの純資産額)	20,116円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成30年10月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30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				
	売建	523,453,760	-	525,369,100	1,915,340
	米ドル	380,698,000	-	382,296,000	1,598,000
	カナダドル	8,592,000	-	8,593,000	1,000
	ユーロ	38,316,000	-	38,349,000	33,000
	英ポンド	27,420,800	-	27,396,100	24,700
	オーストラリアドル	35,613,000	-	35,788,500	175,500
	ニュージーランドドル	3,650,000	-	3,663,500	13,500
	香港ドル	12,138,000	-	12,189,000	51,000
シンガポールドル	17,025,960	-	17,094,000	68,040	
合計		523,453,760	-	525,369,100	1,915,340

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(平成30年10月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	2,192,135,055円
同期中における追加設定元本額	1,027,249,734円
同期中における一部解約元本額	893,805,499円
平成30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)	51,803,019円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	33,892,645円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	25,849,065円
イオン・バランス戦略ファンド	33,903,109円
三井住友・DC外国リートインデックスファンド	997,038,406円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	1,218,150円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	4,287,782円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	3,015,622円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	9,383,590円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	7,211,873円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	11,916,949円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	9,451,040円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	517,156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)	1,098,769,528円
SMA・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>	18,778,911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>	18,542,445円
合計	2,325,579,290円

国内債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(平成30年10月26日現在)

資産の部	
流動資産	
金銭信託	548,743,106
コール・ローン	60,398,051
国債証券	142,438,489,100
地方債証券	18,218,926,957
特殊債券	24,701,011,112
社債券	7,693,045,000
未収入金	955,602,650
未収利息	438,930,141
前払費用	4,566,527
流動資産合計	195,059,712,644
資産合計	195,059,712,644
負債の部	
流動負債	
未払解約金	518,224,907
未払利息	174
その他未払費用	37,230
流動負債合計	518,262,311
負債合計	518,262,311
純資産の部	
元本等	
元本	154,897,357,348
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	39,644,092,985
元本等合計	194,541,450,333
純資産合計	194,541,450,333
負債純資産合計	195,059,712,644

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成30年4月27日 至平成30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30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		154,897,357,348口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.2559円
	(10,000口当たりの純資産額)	12,559円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成30年10月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30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	163,997,039,244円
同期中における追加設定元本額	8,197,662,866円
同期中における一部解約元本額	17,297,344,762円
平成30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）	4,285,186,154円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	7,668,141,822円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	1,721,542,806円

(平成30年10月26日現在)	
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)	438,513,055円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	54,411,998円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	162,158,001円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	281,197,360円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	233,312,742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)	89,734,817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)	196,367,006円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	74,345,192円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	3,752,218,928円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	603,103,623円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	521,208,843円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	8,744,073円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	11,656,818円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	4,946,642円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	2,992,810円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	1,909,721円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	3,788,666円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	15,083,724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>	5,825,296,562円
S M A M ・ バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	20,330,459,535円
S M A M ・ バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	7,934,618,681円
S M A M ・ バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	19,520,558,634円
S M A M ・ バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	362,463,120円
S M A M ・ バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	620,377,480円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	2,980,578円
S M A M ・ バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	307,475,345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>	117,668,774円
S M A M ・ インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	2,164,026,925円
S M A M ・ インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,406,281,476円
S M A M ・ バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	3,040,260,520円
S M A M ・ バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	11,777,530,666円
S M A M ・ バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	3,271,137円
三井住友・国内債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	5,228,546,078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)	15,738,253,023円
S M A M ・ グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	559,888,941円
S M A M ・ バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	765,215,802円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	16,282,649,088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>	962,346,293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>	200,653,206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>	46,392,297円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	2,146,375,185円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	2,650,917,358円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	2,564,065,591円

（平成30年10月26日現在）	
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2＜適格機関投資家専用＞	1,086,360,351円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2＜適格機関投資家専用＞	256,779,768円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2＜適格機関投資家専用＞	23,316,375円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2＜適格機関投資家専用＞	375,367,079円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2＜適格機関投資家専用＞	6,825,390,057円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2＜適格機関投資家専用＞	310,068,743円
SMAM・年金Wリスクコントロールファンド＜適格機関投資家限定＞	159,584,601円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-04＜適格機関投資家限定＞	1,568,399,842円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-05＜適格機関投資家限定＞	751,930,159円
SMAM・マルチアセットストラテジー・オープン＜適格機関投資家限定＞	1,850,600,039円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド＜適格機関投資家限定＞	423,238円
合計	154,897,357,348円

外国債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

（平成30年10月26日現在）

資産の部	
流動資産	
預金	379,198,198
金銭信託	179,323,634
コール・ローン	19,737,465
国債証券	169,209,931,297
派生商品評価勘定	2,773,149
未収入金	596,822,679
未収利息	1,396,022,360
前払費用	31,768,648
流動資産合計	171,815,577,430
資産合計	171,815,577,430
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	81,576
未払解約金	286,084,544
未払利息	56
その他未払費用	12,518
流動負債合計	286,178,694
負債合計	286,178,694
純資産の部	
元本等	
元本	99,774,790,755
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	71,754,607,981
元本等合計	171,529,398,736
純資産合計	171,529,398,736
負債純資産合計	171,815,577,430

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成30年 4月27日 至 平成30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30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	99,774,790,755口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.7192円
	(10,000口当たりの純資産額 17,192円)

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成30年10月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。

項目	(平成30年10月26日現在)
2.時価の算定方法	(1) 有価証券（国債証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成30年10月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	603,793,447	-	601,101,874	2,691,573
	米ドル	273,624,278	-	273,704,268	79,990
	カナダドル	16,193,572	-	16,195,130	1,558
	メキシコペソ	13,077,198	-	12,950,214	126,984
	ユーロ	251,520,007	-	249,367,591	2,152,416
	英ポンド	40,098,735	-	39,622,688	476,047
	オーストラリアドル	9,279,657	-	9,261,983	17,674
合計		603,793,447	-	601,101,874	2,691,573

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(平成30年10月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	104,217,368,782円
同期中における追加設定元本額	3,451,988,211円
同期中における一部解約元本額	7,894,566,238円
平成30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	10,361,781,683円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	556,863,835円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,561,272,201円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	819,404,047円
S M A M ・ グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	58,306,447円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2020(4資産タイプ)	9,082,382円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2025(4資産タイプ)	31,884,240円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2030(4資産タイプ)	84,952,423円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2035(4資産タイプ)	96,890,014円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2040(4資産タイプ)	50,102,697円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2045(4資産タイプ)	122,264,542円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	14,374,866円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	63,685,311円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	188,895,191円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	294,089,382円
三井住友・DCターゲットイヤーファンド2050	3,931,190円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	18,609,122円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	14,355,401円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	30,961,166円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	15,325,532円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	11,024,532円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	14,550,441円
S M A M ・ 年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	2,136,261,479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>	199,982,245円
S M A M ・ バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	12,922,776,733円
S M A M ・ バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	6,243,206,694円
S M A M ・ バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	14,167,193,583円
S M A M ・ バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	44,184,531円
S M A M ・ バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	114,146,360円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	600,777円
S M A M ・ バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	876,013,308円
S M A M ・ バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	127,886,244円
S M A M ・ インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,371,137,002円
S M A M ・ インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,727,753,184円
S M A M ・ バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,204,815,776円
S M A M ・ バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	7,336,808,329円
S M A M ・ バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	2,321,047円

（平成30年10月26日現在）	
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	11,850,653,479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）	923,050,368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）	1,910,511,864円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	204,077,995円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	556,976,107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）	2,616,306,852円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	161,737,182円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	43,915,013円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	14,415,303円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	159,186,031円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	585,582,506円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	191,277,593円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	180,812,020円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	55,444,546円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	7,191,746円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,472,575,064円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	23,188,295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>	4,274,597,792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>	1,898,212,800円
SMAM・世界バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	6,702,871,278円
SMAM・世界バランスファンドVA2<適格機関投資家限定>	796,234,747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>	47,899,506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>	451,265,371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>	216,234,292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>	532,852,010円
SMAM・マルチアセット・ダイナミックアロケーション・ストラテジー・ファンド<適格機関投資家限定>	27,058円
合計	99,774,790,755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30年10月26日現在）

資産の部	
流動資産	
預金	216,237,476
金銭信託	85,620,890
コール・ローン	9,423,963
国債証券	43,257,317,452
派生商品評価勘定	1,003,571,442
未収入金	166,008,077
未収利息	357,008,054
前払費用	10,243,059

(平成30年10月26日現在)

流動資産合計	45,105,430,413
資産合計	45,105,430,413
負債の部	
流動負債	
未払金	62,824
未払解約金	83,000,000
未払利息	27
その他未払費用	14,393
流動負債合計	83,077,244
負債合計	83,077,244
純資産の部	
元本等	
元本	33,136,137,208
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	11,886,215,961
元本等合計	45,022,353,169
純資産合計	45,022,353,169
負債純資産合計	45,105,430,413

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成30年4月27日 至平成30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30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		33,136,137,208口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.3587円
	(10,000口当たりの純資産額)	13,587円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成30年10月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30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				
	売建	44,747,432,442	-	43,743,861,000	1,003,571,442
	米ドル	20,038,770,415	-	19,831,540,000	207,230,415
	カナダドル	919,358,960	-	893,256,000	26,102,960
	メキシコペソ	399,641,855	-	380,075,000	19,566,855
	ユーロ	17,987,338,026	-	17,397,663,000	589,675,026
	英ポンド	2,935,683,036	-	2,854,170,000	81,513,036
	スウェーデンクローナ	172,885,725	-	166,590,000	6,295,725
	ノルウェークローネ	110,347,437	-	106,334,000	4,013,437

デンマーククローネ	281,879,811	-	272,367,000	9,512,811
ポーランドズロチ	280,747,285	-	269,542,000	11,205,285
オーストラリアドル	951,512,040	-	922,084,000	29,428,040
シンガポールドル	407,202,740	-	398,664,000	8,538,740
南アフリカランド	262,065,112	-	251,576,000	10,489,112
合計	44,747,432,442	-	43,743,861,000	1,003,571,442

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

(その他の注記)

(平成30年10月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	37,484,650,129円
同期中における追加設定元本額	1,646,931,165円
同期中における一部解約元本額	5,995,444,086円
平成30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)	9,408,964,775円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	5,003,627,695円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	2,276,408,891円
イオン・バランス戦略ファンド	710,188,209円
三井住友・資産最適化ファンド(1安定重視型)	137,872,025円
三井住友・資産最適化ファンド(2やや安定型)	45,696,884円
三井住友・資産最適化ファンド(3バランス型)	70,415,190円
三井住友・資産最適化ファンド(4やや成長型)	19,513,266円
三井住友・資産最適化ファンド(5成長重視型)	7,049,126円
三井住友・DCつみたてNISA・世界分散ファンド	4,607,059円

SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	5,323,704,828円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	2,998,719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)	4,987,196,406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>	3,409,925,029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>	73,638,777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>	622,073,818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>	297,774,178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>	734,482,333円
合計	33,136,137,208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	2017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	1,002,231

(1口当たり情報)

(2017年10月31日現在)
1口当たり純資産額 (一般投資家クラス) 80.73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	2017年10月31日現在
	金額(千米ドル)
債券	11,695,996
短期金融資産	37,553
投資総額	11,733,549
その他資産及び負債	194,660

純資産額	11,928,209
------	------------

(1口当たり情報)

(2017年10月31日現在)
1口当たり純資産額 (一般投資家クラス) 115.92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	2018年6月30日現在
	金額 (千米ドル)
債券	9,357,411
短期金融資産等	648,015
投資総額	10,005,426
その他資産及び負債	498,900
純資産額	9,506,526

(1口当たり情報)

(2018年6月30日)
1口当たり純資産額 (一般投資家クラス) 35.60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）

2018年11月30日現在

資産総額	23,772,561,175円
負債総額	174,504,281円
純資産総額（ - ）	23,598,056,894円
発行済口数	24,258,445,764口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9728円
（1万口当たり純資産額）	（9,728円）

アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）

2018年11月30日現在

資産総額	15,687,465,299円
負債総額	111,364,147円
純資産総額（ - ）	15,576,101,152円
発行済口数	15,746,342,712口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9892円
（1万口当たり純資産額）	（9,892円）

アセットアロケーション・ファンド（成長型）

2018年11月30日現在

資産総額	11,666,423,030円
負債総額	87,426,268円
純資産総額（ - ）	11,578,996,762円
発行済口数	11,629,151,721口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9957円
（1万口当たり純資産額）	（9,957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

	2018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	60,000,000株
発行済株式総数	17,640,000株

ロ 最近5年間における資本金の額の増減 該当ありません。

ハ 会社の機構

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

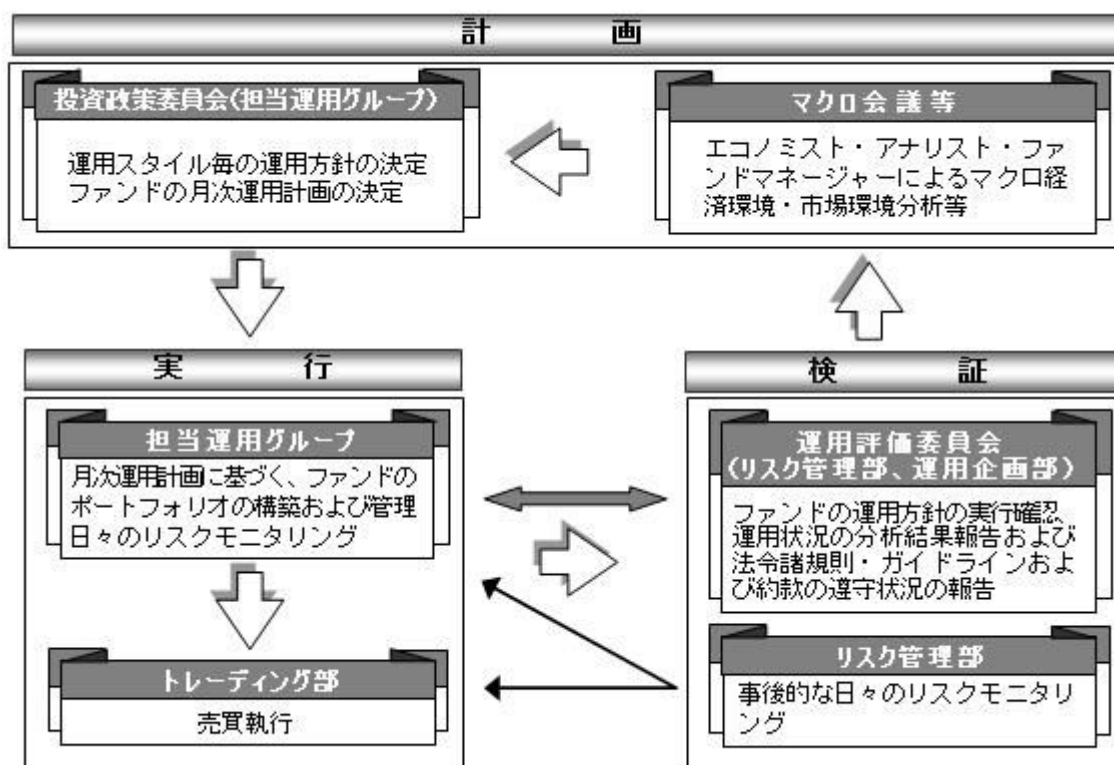
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役若干名を選定します。

また、取締役会の決議によって、取締役社長を1名選定します。

二 投資信託の運用の流れ



2【事業の内容及び営業の概況】

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

2018年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。

	本数(本)	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	461	5,871,209
単位型株式投資信託	91	389,325
追加型公社債投資信託	1	29,051
単位型公社債投資信託	112	301,391
合計	665	6,590,976

3【委託会社等の経理状況】

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

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

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

（1）【貸借対照表】

	(単位：千円)	
	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	13,279,384	20,873,870
顧客分別金信託	20,008	20,010
前払費用	351,526	402,249
未収入金	40,544	39,030
未収委託者報酬	5,511,715	6,332,203
未収運用受託報酬	1,297,104	1,725,215
未収投資助言報酬	343,523	316,407

未収収益		20,789	50,321
繰延税金資産		482,535	715,988
その他の流動資産		5,560	10,891
流動資産合計		21,352,691	30,486,188
固定資産			
有形固定資産	1		
建物		198,767	185,371
器具備品		261,096	300,694
有形固定資産合計		459,864	486,065
無形固定資産			
ソフトウェア		493,806	409,765
ソフトウェア仮勘定		141,025	5,755
電話加入権		68	56
商標権		3	-
無形固定資産合計		634,903	415,576
投資その他の資産			
投資有価証券		12,098,372	10,616,594
関係会社株式		10,412,523	10,412,523
長期差入保証金		677,681	658,505
長期前払費用		61,282	69,423
会員権		7,819	7,819
繰延税金資産		871,577	678,459
投資その他の資産合計		24,129,257	22,443,325
固定資産合計		25,224,025	23,344,968
資産合計		46,576,717	53,831,157

(単位：千円)

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
負債の部		
流動負債		
顧客からの預り金	304	84
その他の預り金	80,380	92,326
未払金		
未払収益分配金	655	649
未払償還金	140,124	137,522
未払手数料	2,424,318	2,783,763
その他未払金	52,903	236,739
未払費用	2,564,625	3,433,641
未払消費税等	160,571	547,706
未払法人税等	661,467	1,785,341
賞与引当金	1,001,068	1,507,256
その他の流動負債	445	1,408
流動負債合計	7,086,864	10,526,438
固定負債		
退職給付引当金	3,177,131	3,319,830
賞与引当金	40,167	99,721
その他の固定負債	2,174	3,363
固定負債合計	3,219,473	3,422,915
負債合計	10,306,337	13,949,354

純資産の部

株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	8,628,984	8,628,984
資本剰余金合計	8,628,984	8,628,984
利益剰余金		
利益準備金	284,245	284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金	60,000	60,000
別途積立金	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金	23,493,074	26,561,078
利益剰余金合計	25,314,279	28,382,283
株主資本計	35,943,263	39,011,267
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	327,116	870,535
評価・換算差額等合計	327,116	870,535
純資産合計	36,270,379	39,881,802
負債・純資産合計	46,576,717	53,831,157

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)		(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬	31,628,014		36,538,981	
運用受託報酬	5,649,190		8,362,118	
投資助言報酬	1,726,511		1,440,233	
その他営業収益				
情報提供コンサルタント				
業務報酬	5,000		5,000	
サービス支援手数料	61,268		128,324	
その他	54,261		55,820	
営業収益計	39,124,246		46,530,479	
営業費用				
支払手数料	14,908,517		16,961,384	
広告宣伝費	366,227		353,971	
公告費	1,140		1,140	
調査費				
調査費	1,325,978		1,654,233	
委託調査費	4,343,104		5,972,473	
営業雑経費				
通信費	46,030		40,066	
印刷費	338,254		339,048	
協会費	21,669		-	
諸会費	20,054		45,465	
情報機器関連費	2,516,497		2,582,734	
販売促進費	24,896		34,333	
その他	149,177		136,669	
営業費用合計	24,061,549		28,121,520	

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本
--	------

	資本金	資本剰余金		利益剰余金					株主資本 合計
		資本準備金	資本剰余金 合計	利益準備金	その他利益剰余金			利益剰余金 合計	
					配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	21,984,811	23,806,015	34,434,999
当期変動額									
剰余金の配当							2,010,960	2,010,960	2,010,960
当期純利益							3,519,223	3,519,223	3,519,223
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,508,263	1,508,263	1,508,263
当期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	23,493,074	25,314,279	35,943,263

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

当事業年度（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益準備金	その他利益剰余金			利益剰余金 合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計		配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	23,493,074	25,314,279	35,943,263
当期変動額									
剰余金の配当							1,887,480	1,887,480	1,887,480
当期純利益							4,955,483	4,955,483	4,955,483
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	3,068,003	3,068,003	3,068,003
当期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	26,561,078	28,382,283	39,011,267

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算差 額等合計	
当期首残高	327,116	327,116	36,270,379
当期変動額			
剰余金の配当			1,887,480

当期純利益			4,955,483
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	543,419	543,419	543,419
当期変動額合計	543,419	543,419	3,611,423
当期末残高	870,535	870,535	39,881,802

[注記事項]

(重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 満期保有目的の債券

償却原価法

(2) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

(3) その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

時価のないもの

移動平均法による原価法

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	3～50年
器具備品	3～20年

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

(貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

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

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

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

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

3 保証債務

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

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

(損益計算書関係)

1 関係会社との取引に係るものが次のとおり含まれております。

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

2 固定資産除却損

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

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)

1.発行済株式数に関する事項

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

2.剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額等

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

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

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

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

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

1. 発行済株式数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額等

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

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

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

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

(リース取引関係)

オペレーティング・リース取引

(借主側)

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

(単位：千円)

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2)金融商品の内容及びそのリスク

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

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

営業債務である未払手数料は、すべて1年以内の支払期日であります。

(3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスクの管理

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

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

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

市場リスクの管理

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

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

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2.金融商品の時価等に関する事項

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

前事業年度（平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

当事業年度（平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

(注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資 産

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

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

(6)投資有価証券

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

(7)長期差入保証金

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

負 債

(1)顧客からの預り金、(2)未払手数料

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

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

（単位：千円）

	前事業年度 （平成29年3月31日）	当事業年度 （平成30年3月31日）
その他有価証券		
非上場株式	298	298
合計	298	298
子会社株式及び関連会社株式		
非上場株式	10,412,523	10,412,523
合計	10,412,523	10,412,523

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

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

(注3)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成29年3月31日）

（単位：千円）

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超

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

当事業年度（平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

（有価証券関係）

1. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（平成29年3月31日）

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

当事業年度（平成30年3月31日）

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

2. その他有価証券

前事業年度（平成29年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1) 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	4,921,829	4,267,927	653,902
小計	4,921,829	4,267,927	653,902
(2) 貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	7,176,244	7,358,662	182,417
小計	7,176,244	7,358,662	182,417
合計	12,098,074	11,626,589	471,485

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

当事業年度（平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

小計	3,249,626	3,315,328	65,701
合計	10,616,296	9,361,560	1,254,735

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

3. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

(単位:千円)

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

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

(単位:千円)

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

(退職給付関係)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位:千円)

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

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

(単位:千円)

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

(単位:千円)

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

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

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎(加重平均で表わしております。)

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

3. 確定拠出制度

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

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

(単位:千円)

	前事業年度 (平成29年3月31日)	当事業年度 (平成30年3月31日)
流動の部		
繰延税金資産		
賞与引当金	308,929	461,521
調査費	79,381	90,509
未払金	45,745	59,821
未払事業税	46,406	102,103
その他	2,071	2,032
繰延税金資産合計	482,535	715,988
固定の部		
繰延税金資産		
退職給付引当金	972,837	1,016,532
ソフトウェア償却	18,718	11,289
賞与引当金	12,299	30,534
投資有価証券評価損	95	95
その他	14,592	6,805
繰延税金資産小計	1,018,544	1,065,256
評価性引当額	2,597	2,597
繰延税金資産合計	1,015,946	1,062,659
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	144,368	384,200
繰延税金負債合計	144,368	384,200
繰延税金資産の純額	1,354,113	1,394,447

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

要な項目別の内訳

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

(セグメント情報等)

前事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

1.セグメント情報

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

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

2.関連情報

(1)製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

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

(2)地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

3.報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4.報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

5.報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

1.セグメント情報

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

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

2.関連情報

(1)製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

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

(2)地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

3.報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4.報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

5.報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

(関連当事者情報)

前事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(1)子会社及び関連会社等

(単位：千円)

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

(注)取引条件及び取引条件の決定方針等
受取配当金については、剰余金の分配可能額を基礎とした一定の基準に基づき合理的に決定しております。

(2)兄弟会社等

（単位：千円）

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

- (注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等は含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等
投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。
3. ㈱三井住友銀行の属性が、平成28年7月29日付けで、「その他の関係会社」より「親会社」、平成28年10月1日付けで「親会社」より「親会社の子会社」に異動となりました。なお、取引金額の中には、「その他の関係会社」及び「親会社」であった期間の取引金額が含まれております。
4. SMBC日興証券㈱の属性が、平成28年10月1日付けで、「その他の関係会社の子会社」より「親会社の子会社」に異動となりました。なお、取引金額の中には、「その他の関係会社の子会社」であった期間の取引金額が含まれております。

2. 親会社に関する注記

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

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(1) 兄弟会社等

（単位：千円）

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

- (注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等は含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等
投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2. 親会社に関する注記

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

(1 株当たり情報)

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

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

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

期中平均株式数(株)	17,640	17,640
------------	--------	--------

(重要な後発事象)

前事業年度(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

該当事項はありません。

当事業年度(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

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

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

中間財務諸表

(1)中間貸借対照表

(単位：千円)

		第34期中間会計期間 (平成30年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		19,085,678
顧客分別金信託		20,010
前払費用		414,616
未収委託者報酬		7,225,367
未収運用受託報酬		1,541,190
未収投資助言報酬		306,565
未収収益		51,614
その他		53,465
流動資産合計		28,698,508
固定資産		
有形固定資産	1	508,186
無形固定資産		437,397
投資その他の資産		
投資有価証券		9,519,317
関係会社株式		10,412,523
繰延税金資産		1,364,662
その他		1,500,406
投資その他の資産合計		22,796,910
固定資産合計		23,742,493
資産合計		52,441,002
負債の部		
流動負債		
顧客からの預り金		649
その他の預り金		116,730
未払金		3,491,463
未払費用		3,428,351

未払法人税等		1,080,277
前受収益		8,509
賞与引当金		1,233,571
その他	2	228,340
流動負債合計		9,587,893
固定負債		
退職給付引当金		3,435,254
賞与引当金		41,631
その他		1,383
固定負債合計		3,478,268
負債合計		13,066,162
純資産の部		
株主資本		
資本金		2,000,000
資本剰余金		
資本準備金		8,628,984
資本剰余金合計		8,628,984
利益剰余金		
利益準備金		284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金		60,000
別途積立金		1,476,959
繰越利益剰余金		26,222,740
利益剰余金合計		28,043,944
株主資本合計		38,672,928
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		701,911
評価・換算差額等合計		701,911
純資産合計		39,374,840
負債純資産合計		52,441,002

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

		第34期中間会計期間 (自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日)
営業収益		
委託者報酬		20,003,107
運用受託報酬		3,216,910
投資助言報酬		696,543
その他の営業収益		117,677
営業収益計		24,034,239
営業費用		15,495,987
一般管理費	1	5,200,633

営業利益		3,337,618
営業外収益	2	13,622
営業外費用	3	10,296
経常利益		3,340,944
特別利益	4	293,441
特別損失	5	35,355
税引前中間純利益		3,599,031
法人税、住民税及び事業税		1,010,764
法人税等調整額		104,205
法人税等合計		1,114,969
中間純利益		2,484,061

(3)中間株主資本等変動計算書

第34期中間会計期間（自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日）

（単位：千円）

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

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	870,535	870,535	39,881,802
当中間期変動額			
剰余金の配当			2,822,400
中間純利益			2,484,061
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）	168,624	168,624	168,624
当中間期変動額合計	168,624	168,624	506,962
当中間期末残高	701,911	701,911	39,374,840

注記事項

（重要な会計方針）

1. 資産の評価基準及び評価方法

(1)有価証券

子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

その他有価証券

時価のあるもの

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

時価のないもの

移動平均法による原価法

2. 固定資産の減価償却の方法

(1)有形固定資産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 3～50年

器具備品 3～20年

(2)無形固定資産

定額法によっております。

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

3. 引当金の計上基準

(1)賞与引当金

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

(2)退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

（表示方法の変更）

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

（中間貸借対照表関係）

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

（中間損益計算書関係）

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

(中間株主資本等変動計算書関係)

第34期中間会計期間(自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日)

1. 発行済株式数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

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

(リース取引関係)

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の時価等に関する事項

第34期中間会計期間(平成30年9月30日)

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

(単位:千円)

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

(1)顧客からの預り金	649	649	-
(2)未払金 未払手数料	3,310,988	3,310,988	-
負債計	3,311,637	3,311,637	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資 産

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

(6)投資有価証券

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)

区分	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34期中間会計期間（平成30年9月30日）

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

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

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

(デリバティブ取引関係)

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

（資産除去債務等）

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

第34期中間会計期間（自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日）

1. セグメント情報

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

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

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

（単位：千円）

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

(2) 地域ごとの情報

営業収益

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

3. 報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。

（1株当たり情報）

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

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

(追加情報)

当社と大和住銀投信投資顧問株式会社との間での合併契約の締結について

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

1. 企業結合の概要

(1)被取得企業の名称及び事業の内容

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

(2)企業結合を行う主な理由

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

(3)企業結合日

平成31年4月1日(予定)

(4)企業結合の法的形式

当社を存続会社とし、大和住銀を消滅会社とする吸収合併方式であります。

(5)結合後企業の名称

三井住友DSアセットマネジメント株式会社

(6)取得企業を決定するに至った主な根拠

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

2. 合併比率及びその算定方法並びに交付予定の株式数

(1) 合併比率

大和住銀の普通株式 1 株に対し、当社の普通株式4.2156株を割当て交付いたします。

(2) 合併比率の算定方法

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

(3) 交付予定の株式数

普通株式：16,230,060株

（重要な後発事象）

株式分割

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

1. 株式分割の目的

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

2. 株式分割の概要

(1) 分割の方法

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

(2) 分割により増加した株式数

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

(3) 株式分割の日程

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

(4) 1株当たり情報に及ぼす影響

1株当たり情報に及ぼす影響については、当該箇所に記載しております。

4【利害関係人との取引制限】

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

- イ 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ロ 運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)
- ハ 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業

者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)または子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。

ニ 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

ホ 上記八、ニに掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

5【その他】

イ 定款の変更、その他の重要事項

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

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

ロ 訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実
該当ありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

イ 受託会社

(イ) 名称 三井住友信託銀行株式会社
(ロ) 資本金の額 342,037百万円(2018年9月末現在)
(ハ) 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

[参考情報：再信託受託会社の概要]

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

ロ 販売会社

(イ) 名称	(ロ) 資本金の額	(ハ) 事業の内容
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	8,557百万円	
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、2018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。

ロ 販売会社

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

3【資本関係】

該当ありません。

第3【その他】

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

独立監査人の監査報告書

平成30年 6月14日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以上

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

独立監査人の監査報告書

平成30年6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30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30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 . 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30年6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30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30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. 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30年6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30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30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 . X B R L データは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

平成30年11月22日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友アセットマネジメント株式会社の平成30年4月1日から平成31年3月31日までの第34期事業年度の中間会計期間（平成30年4月1日から平成30年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

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

強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以上

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

独立監査人の中間監査報告書

平成30年12月4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30年4月27日から平成30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30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30年4月27日から平成30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30年12月4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30年4月27日から平成30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30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30年4月27日から平成30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30年12月4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30年4月27日から平成30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な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30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30年4月27日から平成30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。