

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成28年7月21日提出
【計算期間】	第1期(自 平成27年4月17日至 平成28年4月26日)
【ファンド名】	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）
【発行者名】	三井住友アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 松下 隆史
【本店の所在の場所】	東京都港区愛宕二丁目5番1号
【事務連絡者氏名】	土田 雅央
【連絡場所】	東京都港区愛宕二丁目5番1号
【電話番号】	03-5405-0740
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

- イ 当ファンドは、主として、投資信託証券等への投資を通じて、世界各国の債券、株式および不動産投資信託（リート）等に投資することにより、信託財産の中長期的な成長を目指して運用を行います。
- ロ 委託会社は、受託会社と合意の上、各ファンドそれぞれ金5,000億円を限度として信託金を追加することができます。この限度額は、委託会社、受託会社の合意により変更できます。
- ハ 当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

(イ) 当ファンドが該当する商品分類

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

(ロ) 当ファンドが該当する属性区分

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券、不動産投信）資産配分変更型））	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載しています。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は株式、債券および不動産投信であり、ファンドの収益はそれぞれの市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「資産複合」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル (日本を含む)	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファンド・オブ・ファンズ	一般社団法人投資信託協会「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいいます。
為替ヘッジ	為替ヘッジあり (部分ヘッジ)	目論見書または信託約款において、一部の資産に対円で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
追加型	内外	不動産投信
		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 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (日本を含む)		
	年2回	日本		
	年4回	北米	ファミリーファンド	あり (部分ヘッジ)
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回(隔月)	欧州		
	年12回(毎月)	アジア		
	日々	オセアニア		
	その他	中南米	ファンド・オブ・ファン ズ	なし
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) 資産配分変 更型))		中近東(中東)		
資産複合 () 資産配分固定 型 資産配分変更 型		エマージング		

(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】

平成27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。

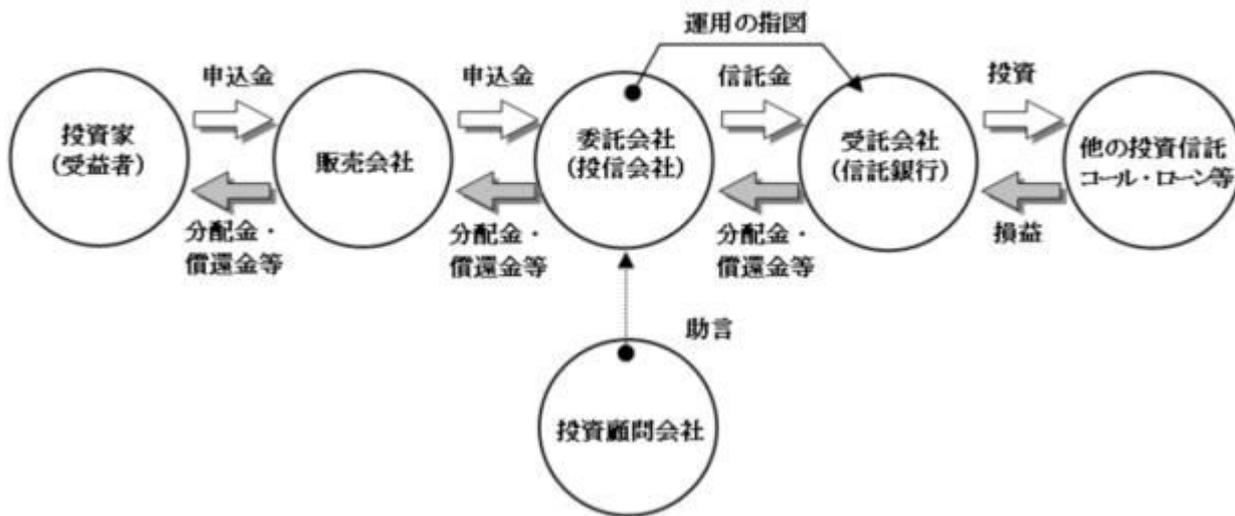
日興グローバルラップ株式会社

「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（平成28年 5月31日現在）

(ロ) 会社の沿革

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

(ハ) 大株主の状況

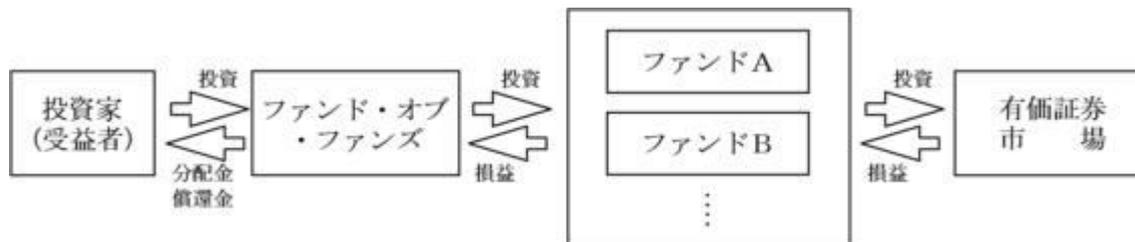
（平成28年 5月31日現在）

名称	住所	所有 株式数	比率 (%)
株式会社三井住友銀行	東京都千代田区丸の内一丁目1番2号	7,056	40.0
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	4,851	27.5
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	4,851	27.5
三井生命保険株式会社	東京都千代田区大手町二丁目1番1号	882	5.0

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)に連動する投資成果を目指します。 ●わが国の公社債および短期金融資産を主要投資対象とします。
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"> ●シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)をベンチマークとし、ベンチマークと連動する投資成果を目指します。 ●ベンチマーク採用国の国債を主要投資対象とします。 ●保有する外貨建て資産については、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"> ●シティ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、ベンチマークと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。 ●保有する外貨建て資産については、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"> ●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0.34%程度

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

ハイイールド債券…為替ヘッジなし*

ファンド名	SPDR 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"> ●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

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

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

▶ 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)と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)と連動する投資成果を目指して運用を行います。 外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行わないものとします。
信託財産留保額	追加設定時、一部解約時にそれぞれ0.15%

新興国株式…為替ヘッジなし

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

▶リート

国内リート

ファンド名	Jリート・インデックス・マザーファンド
形態	国内籍親投資信託
運用会社	三井住友アセットマネジメント株式会社
運用の基本方針	<ul style="list-style-type: none"> ● 東証REIT指数(配当込み)をベンチマークとし、ベンチマークに連動する投資成果を目指します。 ● わが国の取引所に上場(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、三井住友アセットマネジメント独自のリスク態度指数を使用します。

3 目標リスク水準の異なる「安定型」・「安定成長型」・「成長型」の3つのファンドからお選びいただけます。
各ファンド間でのスイッチングが可能です。

安定型 信託財産の安定性を重視した運用を行います。

安定成長型 信託財産の安定性と収益性のバランスを重視した運用を行います。

成長型 信託財産の収益性を重視した運用を行います。

- 一部のファンドのみの取扱いとなる場合があります。また、スイッチングが行えない場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

ファンドのしくみ

- ファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。
 各ファンド間でのスイッチングが可能です。

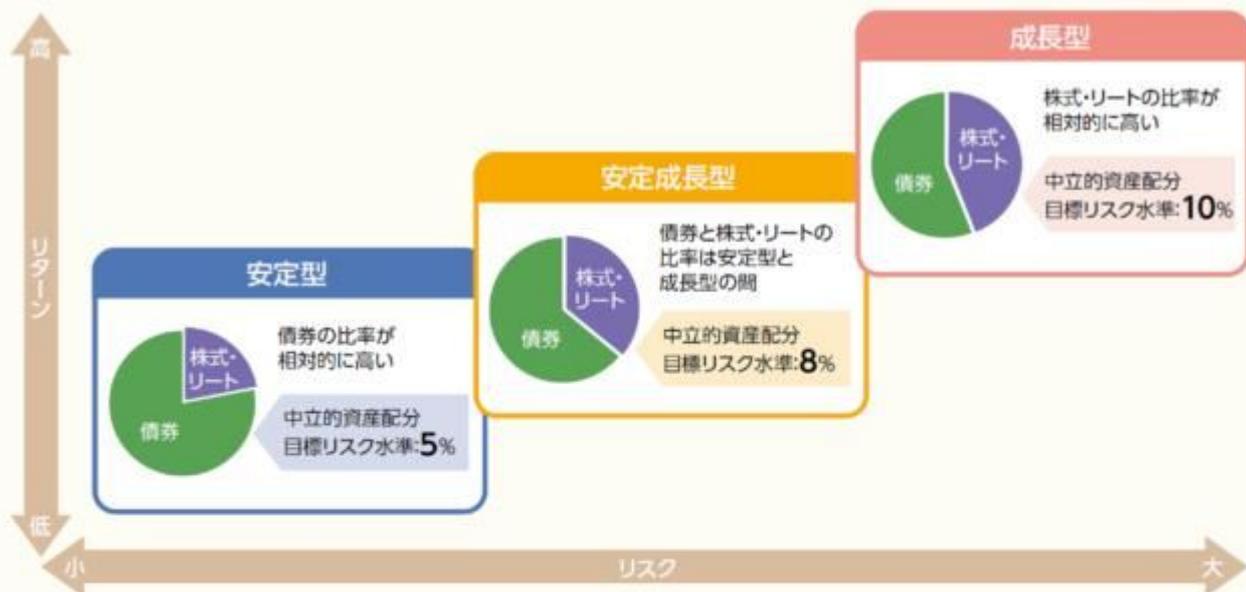


※一部のファンドのみの取扱いとなる場合があります。また、スイッチングが行えない場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

※上記はイメージ図であり、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2016年5月末時点のものであり、将来変更される場合があります。

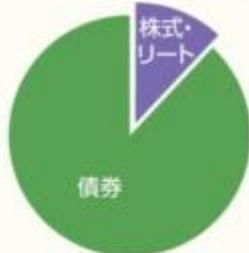
資産配分の調整について

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

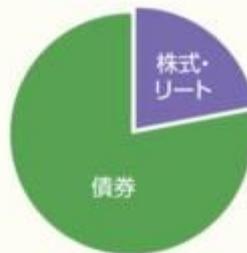
[市場のリスク選好状況に応じた資産配分の調整]

保守的資産配分

債券の比率が相対的に高い

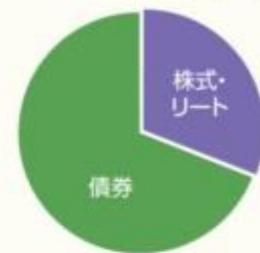


中立的資産配分



積極的資産配分

株式・リートの比率が相対的に高い



市場のリスク選好状況

低

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

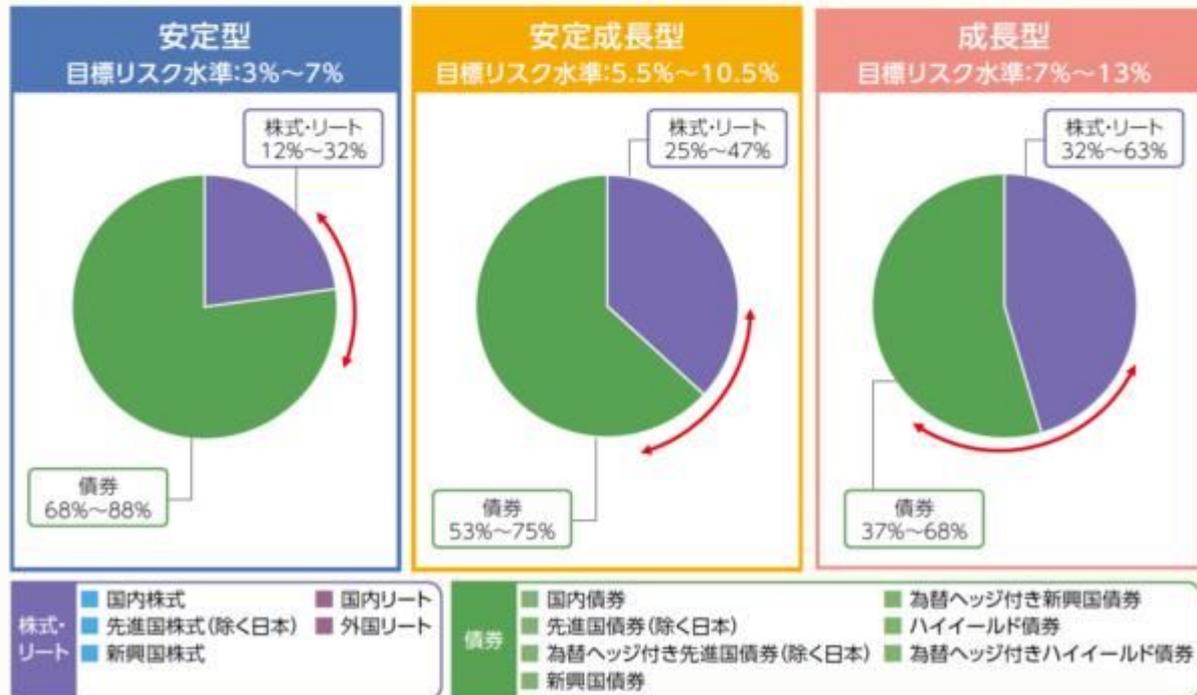
高

※資産配分の決定にあたっては、エドモンドゥ・ロスチャイルド・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図であり、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

※上記はイメージ図であり、実際とは異なる場合があります。

※上記の目標リスク水準は2016年5月末時点の日興グローバルラップからの助言に基づく資産配分であり、将来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。



(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。

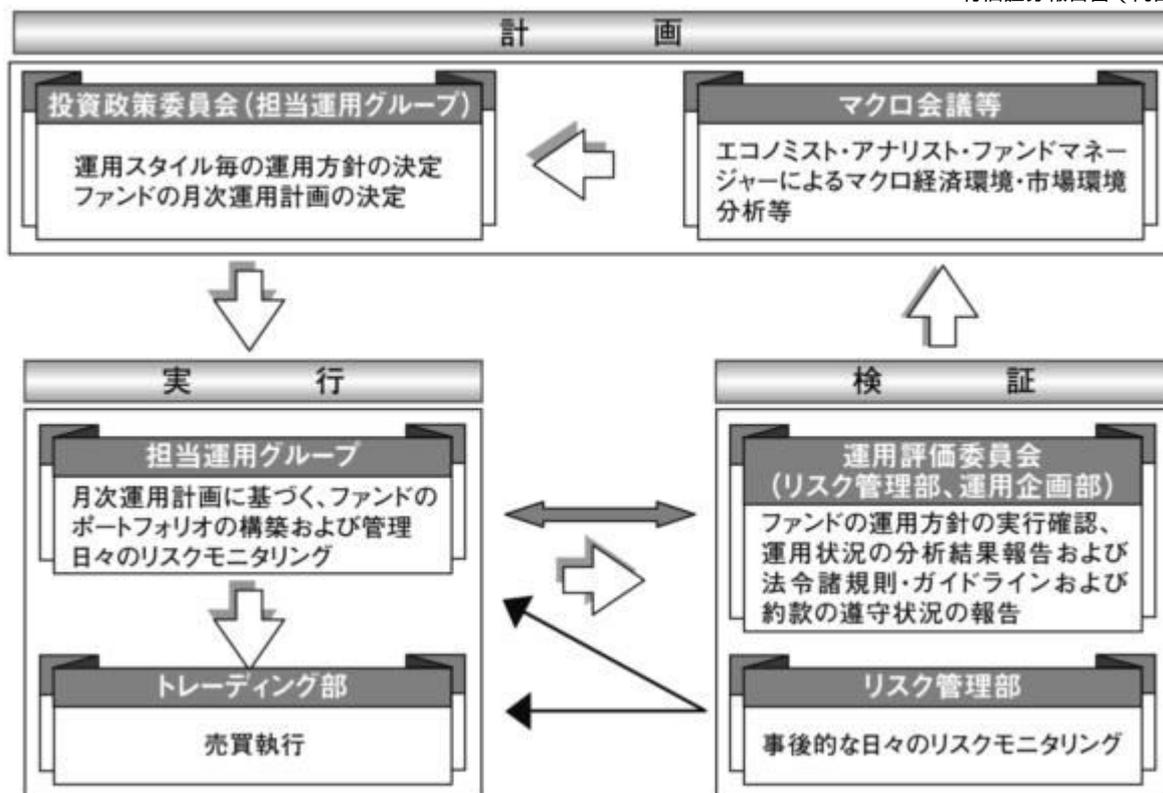
売買執行については、組織的に分離されたトレーディング部が、最良と思われる手法をもって売買を執行します。

(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9名程度、運用企画部は11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、収益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取引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。
- ハ 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いません。

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。

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

(参考情報) 投資リスクの定量的比較

■アセットアロケーション・ファンド(安定型)

〔 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 〕



〔 ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較 〕



■アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)

〔 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 〕



〔 ファンドと他の代表的な 資産クラスとの騰落率の比較 〕



■アセットアロケーション・ファンド(成長型)



※左グラフは2011年6月～2016年5月の各月末におけるファンドの直近1年間の騰落率および分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。右グラフは同期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。

※ファンドの設定日が2015年4月17日のため、左グラフの分配金再投資基準価額は2015年4月末以降のデータを、左右グラフのファンドの騰落率については各月末の直近1年間の騰落率であるため、ファンド設定1年後の2016年4月末以降のデータを表示しています。

※ファンドの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ており、実際の基準価額とは異なります。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、分配金再投資基準価額をもとに計算しており、実際の基準価額をもとに計算したものと異なります。

※右グラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものであり、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)

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)

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)

日本国債…NOMURA-BPI(国債)

先進国債…シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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)

※海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしております。

「TOPIX(配当込み)」は、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。

「MSCIコクサイインデックス(グロス配当込み、円ベース)」は、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。

「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)」は、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。

「NOMURA-BPI(国債)」は、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。

「シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)」は、Citigroup Index LLCが開発した指数で、日本を除く世界の主要国の国債を対象としています。

「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)」は、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。

※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1.0152%（税抜き0.94%）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0.48%	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0.02964%～年0.09092%	程度
	安定成長型	年0.07000%～年0.13548%	程度
	成長型	年0.09092%～年0.12960%	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1.04484%（税抜き0.96964%）～ 年1.10612%（税抜き1.03092%）程度		
安定成長型	年1.08520%（税抜き1.01000%）～ 年1.15068%（税抜き1.07548%）程度		

実質的な負担	成長型	年1.10612% (税抜き1.03092%) ~ 年1.14480% (税抜き1.06960%) 程度
	上記は直近の基本資産配分および管理報酬率を用いた試算の結果であり、基本資産配分の見直しおよび実際の組入れ状況等により変動します。 新興国債券の費用は、管理報酬がより高いETFの数値を用いて試算しています。	

(4) 【その他の手数料等】

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

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

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

(5) 【課税上の取扱い】

- イ 個別元本について
 - (イ) 追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等(申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。)が当該受益者の元本(個別元本)にあたります。
 - (ロ) 受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合には、各販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても同一受益者の顧客口座が複数存在する場合や、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」を併用するファンドの場合には、別々に個別元本の算出が行われることがあります。
 - (ハ) 受益者が元本払戻金(特別分配金)を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。(「元本払戻金(特別分配金)」については、下記の(収益分配金の課税について)を参照。)
- ロ 一部解約時および償還時の課税について

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

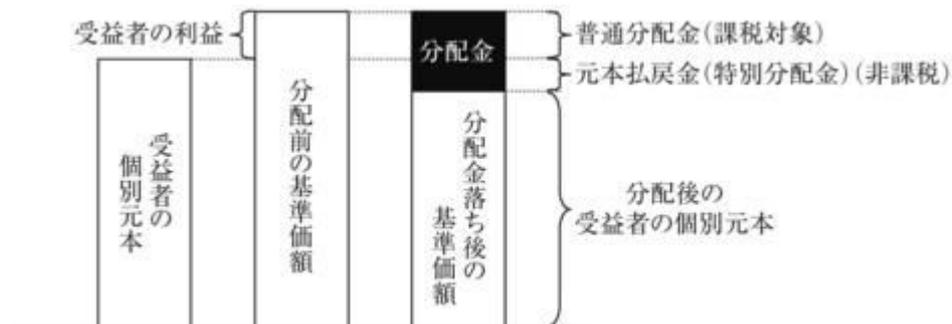
八 収益分配金の課税について

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、平成28年5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)

平成28年 5月31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	2,522,418,274	16.25
親投資信託受益証券	日本	12,837,675,198	82.69
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		165,052,380	1.06
合計(純資産総額)		15,525,145,852	100.00

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。以下同じ。

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	売建		2,054,048,700	13.23

アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)

平成28年 5月31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	3,664,779,570	26.57
親投資信託受益証券	日本	9,980,146,662	72.35
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		148,705,944	1.08
合計(純資産総額)		13,793,632,176	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	買建		10,137,308	0.07
	売建		3,043,420,354	22.06

アセットアロケーション・ファンド(成長型)

平成28年 5月31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	4,606,765,983	32.88
親投資信託受益証券	日本	9,207,596,471	65.71
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		197,741,966	1.41
合計(純資産総額)		14,012,104,420	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		37,475,494	0.26
	売建		3,821,542,527	27.27

(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

平成28年 5月31日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受 益証券	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マ ザーファンド	5,068,101,242	1.3923	7,056,809,694	1.4009	7,099,903,029	45.73
日本	親投資信託受 益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	1,402,277,437	1.2766	1,790,270,260	1.2802	1,795,195,574	11.56
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）	642,891,963	1.9779	1,271,611,464	2.0319	1,306,292,179	8.41
アメリカ	投資信託受益 証券	S P D R パークレイズ・ハイ・ イールド債券 E T F	294,769	3,868.89	1,140,429,993	3,912.85	1,153,388,001	7.43
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 E T F	80,482	12,311.82	990,880,082	12,318.77	991,439,859	6.39
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	304,961,145	2.5759	785,552,213	2.6397	805,005,934	5.19
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	781,782,098	0.9823	767,974,536	0.9914	775,058,771	4.99
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	260,563,760	2.0444	532,722,161	2.0028	521,857,098	3.36
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	225,726,250	1.6898	381,437,349	1.7052	384,908,401	2.48
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 E T F	43,770	8,597.08	376,294,497	8,626.69	377,590,414	2.43
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	79,425,101	1.8639	148,040,584	1.8817	149,454,212	0.96

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別の投資比率

平成28年 5月31日現在

種類	投資比率 (%)
投資信託受益証券	16.25
親投資信託受益証券	82.69
合計	98.94

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

平成28年 5月31日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド	2,448,916,105	1.3922	3,409,574,915	1.4009	3,430,686,571	24.87
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）	996,416,896	1.9930	1,985,882,157	2.0319	2,024,619,490	14.68
アメリカ	投資信託受益証券	SPDR バークレイズ・ハイ・イールド債券ETF	408,672	3,867.58	1,580,571,870	3,912.85	1,599,073,788	11.59
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	173,715	8,594.70	1,493,028,353	8,626.69	1,498,586,218	10.86
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	429,868,990	2.5796	1,108,926,715	2.6397	1,134,725,172	8.23
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	1,018,367,132	1.0070	1,025,557,384	0.9914	1,009,609,174	7.32
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	692,007,741	1.2766	883,445,203	1.2802	885,908,310	6.42
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	356,960,904	2.0479	731,033,445	2.0028	714,921,298	5.18
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	337,212,722	1.6918	570,517,393	1.7052	575,015,133	4.17
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	46,037	12,315.44	566,966,344	12,318.77	567,119,564	4.11
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	108,764,157	1.8783	204,295,480	1.8817	204,661,514	1.48

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

□ 種類別の投資比率

平成28年 5月31日現在

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	26.57
親投資信託受益証券	72.35
合計	98.92

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

平成28年 5月31日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受 益証券	国内株式インデックス・マザーファ ンド（B号）	1,273,721,055	1.9975	2,544,319,623	2.0319	2,588,073,811	18.47
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	222,986	8,594.78	1,916,516,986	8,626.69	1,923,632,077	13.73
アメリカ	投資信託受益 証券	SPDR バークレイズ・ハイ・ イールド債券ETF	491,477	3,868.67	1,901,366,113	3,912.85	1,923,077,647	13.72
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	1,164,693,508	1.3929	1,622,359,474	1.4009	1,631,619,135	11.64
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	513,552,091	2.5842	1,327,146,389	2.6397	1,355,623,454	9.67
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	1,267,750,343	1.0064	1,275,951,826	0.9914	1,256,847,690	8.97
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	456,754,932	2.0483	935,610,287	2.0028	914,788,777	6.53
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	61,699	12,315.44	759,850,912	12,318.77	760,056,259	5.42
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	438,585,571	1.6925	742,340,603	1.7052	747,876,115	5.34
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	355,350,515	1.2768	453,732,784	1.2802	454,919,729	3.25
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	137,029,155	1.8627	255,244,398	1.8817	257,847,760	1.84

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別の投資比率

平成28年 5月31日現在

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	32.88
親投資信託受益証券	65.71
合計	98.59

【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）

平成28年 5月31日現在

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	売建	18,535,000.00	2,033,697,270	2,054,048,700	13.23

(注) わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）

平成28年 5月31日現在

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	91,384.73	10,122,485	10,137,308	0.07
	米ドル	売建	27,462,608.89	3,013,266,972	3,043,420,354	22.06

(注) わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

アセットアロケーション・ファンド（成長型）

平成28年 5月31日現在

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	337,830.12	37,177,125	37,475,494	0.26
	米ドル	売建	34,484,068.58	3,783,642,186	3,821,542,527	27.27

(注) わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

(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（平成28年 4月26日）	13,358,665,467	13,358,665,467	9,514	9,514
平成27年 5月末日	1,891,298,453		9,977	
6月末日	3,053,845,763		9,761	
7月末日	3,873,179,836		9,796	
8月末日	4,839,353,167		9,689	
9月末日	5,757,565,809		9,646	
10月末日	6,566,259,791		9,777	
11月末日	7,260,780,273		9,779	
12月末日	8,389,350,919		9,643	
平成28年 1月末日	9,031,231,248		9,485	
2月末日	10,317,312,442		9,346	
3月末日	12,564,866,802		9,504	
4月末日	13,909,919,576		9,493	
5月末日	15,525,145,852		9,595	

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（平成28年 4月26日）	12,391,100,166	12,391,100,166	9,296	9,296
平成27年 5月末日	2,399,871,364		10,082	
6月末日	3,889,752,982		9,820	
7月末日	4,892,983,114		9,841	
8月末日	5,598,346,293		9,618	
9月末日	6,358,463,293		9,469	
10月末日	7,385,125,157		9,737	
11月末日	8,144,963,181		9,743	
12月末日	8,836,834,129		9,563	
平成28年 1月末日	9,224,169,739		9,259	
2月末日	9,777,568,939		9,018	
3月末日	11,769,804,534		9,274	
4月末日	12,600,023,476		9,260	
5月末日	13,793,632,176		9,359	

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（平成28年 4月26日）	12,509,183,920	12,509,183,920	9,159	9,159
平成27年 5月末日	1,848,687,955		10,174	
6月末日	3,673,718,705		9,880	
7月末日	4,867,730,815		9,888	
8月末日	5,591,530,797		9,596	
9月末日	6,523,187,007		9,384	
10月末日	7,417,296,109		9,729	
11月末日	7,931,214,974		9,740	
12月末日	8,529,241,101		9,531	
平成28年 1月末日	8,898,013,902		9,132	
2月末日	9,660,009,830		8,813	
3月末日	11,922,588,999		9,116	
4月末日	12,716,145,143		9,112	
5月末日	14,012,104,420		9,213	

【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	平成27年 4月17日～平成28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	平成27年 4月17日～平成28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	平成27年 4月17日～平成28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

（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

（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

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

（４）【設定及び解約の実績】

アセットアロケーション・ファンド（安定型）

	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	14,471,203,211	430,595,693

（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

（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
-----	----------------	-------------

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

(参考)

(1) 投資状況

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

平成28年 5月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	199,047,971,200	97.93
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,215,242,833	2.07
合計(純資産総額)		203,263,214,033	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	4,186,080,000	2.05
合計	買建		4,186,080,000	2.05

外国株式インデックス・マザーファンド

平成28年 5月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	92,283,028,940	57.58
	イギリス	11,831,303,966	7.38
	スイス	6,244,361,631	3.90
	カナダ	5,851,336,278	3.65
	フランス	5,697,690,059	3.56

	ドイツ	5,618,518,650	3.51
	オーストラリア	3,751,074,924	2.34
	オランダ	2,611,500,499	1.63
	アイルランド	2,608,721,850	1.63
	スペイン	2,014,363,452	1.26
	スウェーデン	1,767,522,850	1.10
	香港	1,417,949,587	0.88
	デンマーク	1,279,429,135	0.80
	イタリア	1,193,039,404	0.74
	シンガポール	1,035,108,098	0.65
	ベルギー	920,378,658	0.57
	ジャージー	799,491,013	0.50
	フィンランド	605,171,430	0.38
	キュラソー	560,684,156	0.35
	バミューダ	531,068,857	0.33
	イスラエル	409,426,353	0.26
	ノルウェー	372,363,892	0.23
	ケイマン諸島	354,699,345	0.22
	ルクセンブルグ	155,101,126	0.10
	ニュージーランド	112,607,730	0.07
	オーストリア	109,773,686	0.07
	ポルトガル	101,121,523	0.06
	リベリア	67,961,211	0.04
	英ヴァージン諸島	40,344,061	0.03
	パプアニューギニア	34,861,877	0.02
	マン島	15,786,864	0.01
	モーリシャス	10,809,906	0.01
	小計	150,406,601,011	93.85
投資証券	アメリカ	2,720,205,857	1.70
	オーストラリア	605,264,895	0.38
	フランス	248,613,222	0.16
	イギリス	210,618,138	0.13
	香港	88,875,150	0.06
	シンガポール	82,491,576	0.05
	カナダ	37,301,315	0.02
	小計	3,993,370,153	2.49

現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,862,718,556	3.66
合計(純資産総額)		160,262,689,720	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	3,990,367,023	2.48
	買建	ドイツ	1,005,749,316	0.62
	買建	イギリス	467,837,342	0.29
	買建	オーストラリア	280,790,796	0.17
合計	買建		5,744,744,477	3.56

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		399,144,700	0.24

エマージング株式インデックス・マザーファンド

平成28年 5月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	1,330,733,650	38.18
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,154,444,637	61.82
合計(純資産総額)		3,485,178,287	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	3,487,426,635	100.06

合計	買建		3,487,426,635	100.06
----	----	--	---------------	--------

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		222,648,439	6.38

Jリート・インデックス・マザーファンド

平成28年 5月31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	12,652,387,600	99.31
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		88,377,438	0.69
合計(純資産総額)		12,740,765,038	100.00

外国リート・インデックス・マザーファンド

平成28年 5月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
投資証券	アメリカ	2,688,434,246	71.06
	オーストラリア	308,335,801	8.15
	イギリス	232,303,854	6.14
	フランス	173,442,418	4.58
	シンガポール	111,974,529	2.96
	カナダ	75,756,454	2.00
	香港	59,801,355	1.58
	ベルギー	27,062,391	0.72
	オランダ	18,779,152	0.50
	ニュージーランド	18,120,605	0.48
	スペイン	16,415,074	0.43
	アイルランド	8,279,048	0.22
	ドイツ	7,754,809	0.20
	イタリア	4,941,922	0.13
	マン島	2,928,745	0.08
ガーンジー	2,292,036	0.06	
小計		3,756,622,439	99.29
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		26,969,447	0.71

合計(純資産総額)	3,783,591,886	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		32,559,635	0.86
	売建		1,002,742	0.02

国内債券パッシブ・マザーファンド

平成28年 5月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	183,668,619,550	75.20
地方債証券	日本	18,485,523,826	7.57
特殊債券	日本	26,773,395,334	10.96
社債券	日本	11,335,549,000	4.64
	オーストラリア	902,327,000	0.37
	オランダ	805,115,000	0.33
	アメリカ	603,251,000	0.25
	小計		13,646,242,000
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,662,872,387	0.68
合計(純資産総額)		244,236,653,097	100.00

外国債券パッシブ・マザーファンド

平成28年 5月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	75,665,485,654	41.93
	イタリア	17,489,200,658	9.69
	フランス	17,297,604,759	9.59
	イギリス	14,399,255,648	7.98
	ドイツ	12,942,257,924	7.17
	スペイン	9,685,133,293	5.37
	ベルギー	4,712,218,185	2.61
	オランダ	4,262,753,500	2.36
	カナダ	3,673,251,180	2.04
	オーストラリア	3,088,081,029	1.71
	オーストリア	2,697,108,701	1.49

	メキシコ	1,690,121,141	0.94
	アイルランド	1,670,941,121	0.93
	デンマーク	1,199,817,345	0.66
	フィンランド	1,067,669,031	0.59
	ポーランド	1,047,233,654	0.58
	スウェーデン	853,917,427	0.47
	マレーシア	852,596,409	0.47
	南アフリカ	728,592,715	0.40
	シンガポール	639,215,354	0.35
	スイス	548,010,616	0.30
	ノルウェー	539,059,400	0.30
	小計	176,749,524,744	97.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,703,275,928	2.05
合計(純資産総額)		180,452,800,672	100.00

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

平成28年 5月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	15,943,649,765	41.74
	イタリア	3,730,771,880	9.77
	フランス	3,693,835,272	9.67
	イギリス	3,040,453,646	7.96
	ドイツ	2,715,929,899	7.11
	スペイン	2,054,296,262	5.38
	ベルギー	975,338,590	2.55
	オランダ	867,108,732	2.27
	カナダ	770,277,438	2.02
	オーストラリア	626,726,014	1.64
	オーストリア	568,954,825	1.49
	メキシコ	354,448,055	0.93
	シンガポール	299,530,538	0.78
	アイルランド	297,883,979	0.78
	デンマーク	240,865,150	0.63
	フィンランド	229,512,947	0.60
	ポーランド	220,195,592	0.58
	スウェーデン	162,388,726	0.43
	南アフリカ	155,738,050	0.41
	ノルウェー	116,107,364	0.30
スイス	80,043,427	0.21	
小計		37,144,056,151	97.24

現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,054,579,872	2.76
合計(純資産総額)		38,198,636,023	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		37,353,581,000	97.78

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

平成28年 5月31日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,211,800	7,536.79	9,133,082,122	5,783.00	7,007,839,400	3.45
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	7,713,700	768.00	5,924,121,600	553.80	4,271,847,060	2.10
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	743,100	4,585.64	3,407,589,084	4,855.00	3,607,750,500	1.77
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	544,700	6,431.74	3,503,368,778	6,228.00	3,392,391,600	1.67
日本	株式	KDDI	情報・通信業	976,600	3,046.67	2,975,377,922	3,237.00	3,161,254,200	1.56
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	645,200	4,418.31	2,850,693,612	4,402.00	2,840,170,400	1.40
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	770,100	4,592.25	3,536,491,725	3,617.00	2,785,451,700	1.37
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	876,900	3,920.22	3,437,640,918	3,151.00	2,763,111,900	1.36
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	13,631,700	242.38	3,304,051,446	174.40	2,377,368,480	1.17
日本	株式	ソニー	電気機器	687,400	3,117.87	2,143,223,838	3,100.00	2,130,940,000	1.05
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	718,500	2,346.20	1,685,744,700	2,779.00	1,996,711,500	0.98
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	406,400	5,939.65	2,413,873,760	4,797.00	1,949,500,800	0.96
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	402,400	5,450.32	2,193,208,768	4,744.00	1,908,985,600	0.94
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	178,100	11,485.08	2,045,492,748	10,135.00	1,805,043,500	0.89
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,141,600	1,720.68	1,964,328,288	1,517.00	1,731,807,200	0.85
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	87,200	21,878.49	1,907,804,328	19,630.00	1,711,736,000	0.84
日本	株式	ファナック	電気機器	99,700	21,539.39	2,147,477,183	16,980.00	1,692,906,000	0.83
日本	株式	キヤノン	電気機器	524,800	3,680.93	1,931,752,064	3,212.00	1,685,657,600	0.83
日本	株式	花王	化学	274,300	6,279.33	1,722,420,219	6,101.00	1,673,504,300	0.82
日本	株式	キーエンス	電気機器	22,100	66,030.88	1,459,282,448	70,400.00	1,555,840,000	0.77
日本	株式	三菱地所	不動産業	715,000	2,548.58	1,822,234,700	2,139.50	1,529,742,500	0.75

日本	株式	日産自動車	輸送用機器	1,359,500	1,289.99	1,753,741,405	1,125.00	1,529,437,500	0.75
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	389,500	4,487.12	1,747,733,240	3,839.00	1,495,290,500	0.74
日本	株式	三菱商事	卸売業	721,400	2,054.80	1,482,332,720	1,967.00	1,418,993,800	0.70
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,038,000	1,343.11	1,394,148,180	1,339.50	1,390,401,000	0.68
日本	株式	三井不動産	不動産業	510,000	3,062.08	1,561,660,800	2,721.50	1,387,965,000	0.68
日本	株式	ダイキン工業	機械	141,800	8,574.81	1,215,908,058	9,496.00	1,346,532,800	0.66
日本	株式	村田製作所	電気機器	102,600	18,585.68	1,906,890,768	12,950.00	1,328,670,000	0.65
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	344,000	4,350.13	1,496,444,720	3,826.00	1,316,144,000	0.65
日本	株式	富士重工業	輸送用機器	307,500	4,992.15	1,535,086,125	4,150.00	1,276,125,000	0.63

□ 種類別・業種別の投資比率

平成28年 5月31日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.11
		鉱業	0.30
		建設業	3.16
		食料品	5.00
		繊維製品	0.72
		パルプ・紙	0.26
		化学	6.12
		医薬品	5.58
		石油・石炭製品	0.50
		ゴム製品	0.87
		ガラス・土石製品	0.92
		鉄鋼	1.19
		非鉄金属	0.85
		金属製品	0.62
		機械	4.72
		電気機器	11.51
		輸送用機器	9.34
		精密機器	1.57
		その他製品	1.61
		電気・ガス業	1.91
		陸運業	4.44
海運業	0.22		
空運業	0.64		
倉庫・運輸関連業	0.20		
情報・通信業	8.25		
卸売業	4.10		
小売業	4.75		

	銀行業	7.47
	証券、商品先物取引業	1.00
	保険業	2.26
	その他金融業	1.28
	不動産業	2.72
	サービス業	3.77
合計		97.93

外国株式インデックス・マザーファンド

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成28年 5月31日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	261,696	12,974.64	3,395,412,747	11,132.82	2,913,416,818	1.82
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	356,191	5,972.13	2,127,222,311	5,804.38	2,067,468,202	1.29
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	195,636	9,004.70	1,761,643,539	9,985.70	1,953,564,244	1.22
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	130,005	11,359.73	1,476,821,720	12,542.87	1,630,636,646	1.02
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	443,630	3,361.10	1,491,089,034	3,341.51	1,482,395,323	0.92
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	18,741	74,213.73	1,390,839,689	79,015.90	1,480,837,087	0.92
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	106,571	11,699.87	1,246,867,886	13,244.01	1,411,428,157	0.88
アメリカ	株式	WELLS FARGO & COMPANY	銀行	228,321	6,110.24	1,395,096,260	5,641.29	1,288,027,029	0.80
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	173,231	7,408.19	1,283,328,390	7,258.80	1,257,449,910	0.78
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	288,764	3,739.31	1,079,779,977	4,325.55	1,249,063,293	0.78
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	149,999	8,519.18	1,277,868,653	8,295.90	1,244,377,004	0.78
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	ソフトウェア・サービス	14,596	82,999.17	1,211,455,897	81,281.30	1,186,381,861	0.74
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	128,034	8,421.12	1,078,190,242	9,033.84	1,156,639,208	0.72
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	13,674	85,381.36	1,167,504,807	82,938.74	1,134,104,385	0.71
アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	290,423	3,624.63	1,052,677,532	3,839.63	1,115,117,851	0.70
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	191,202	5,038.16	963,307,196	5,615.78	1,073,748,903	0.67
アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION	エネルギー	88,608	10,006.48	886,655,049	11,318.09	1,002,874,098	0.63

スイス	株式	ROCHE HOLDING AG- GENUSSCHEIN	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	33,058	30,726.86	1,015,768,722	29,312.55	969,014,608	0.60
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	193,927	4,785.25	927,991,063	4,967.89	963,408,625	0.60
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	107,175	9,857.90	1,056,521,068	8,900.05	953,863,287	0.60
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	55,855	14,918.00	833,245,445	15,903.24	888,275,973	0.55
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	59,707	14,899.15	889,583,995	14,859.30	887,204,440	0.55
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア	73,970	12,683.83	938,222,967	11,126.17	823,002,987	0.51
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	131,267	5,972.25	783,959,704	6,265.89	822,504,740	0.51
アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア	116,993	6,808.45	796,541,597	6,975.90	816,132,311	0.51
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	490,684	1,916.05	940,177,909	1,650.78	810,014,866	0.51
アメリカ	株式	VISA INC	ソフトウェア・サービス	91,362	8,823.78	806,159,092	8,837.48	807,409,884	0.50
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	食品・飲料・タバコ	72,996	9,723.97	709,811,191	11,003.02	803,177,119	0.50
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	68,644	11,172.98	766,958,118	11,311.44	776,462,652	0.48
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	221,501	3,801.67	842,073,966	3,502.37	775,779,742	0.48

□ 種類別・業種別の投資比率

平成28年 5月31日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	6.89
		素材	4.42
		資本財	6.84
		商業・専門サービス	0.96
		運輸	1.73
		自動車・自動車部品	1.54
		耐久消費財・アパレル	1.70
		消費者サービス	1.73
		メディア	2.74
		小売	3.86
		食品・生活必需品小売り	2.08
		食品・飲料・タバコ	6.72
		家庭用品・パーソナル用品	1.83
		ヘルスケア機器・サービス	3.80
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	9.23
銀行	8.15		

	各種金融	4.09
	保険	4.16
	不動産	0.73
	ソフトウェア・サービス	8.52
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	3.81
	電気通信サービス	3.26
	公益事業	3.36
	半導体・半導体製造装置	1.69
投資証券		2.49
合計		96.34

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

平成28年 5月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	TREASURY BILL	4,000,000	11,072.92	442,916,856	11,092.25	443,690,108	0.000	2016/6/23	12.73
アメリカ	国債証券	TREASURY BILL	4,000,000	11,089.59	443,583,728	11,089.88	443,595,592	0.000	2016/7/21	12.73
アメリカ	国債証券	TREASURY BILL	4,000,000	11,087.40	443,496,332	11,086.19	443,447,950	0.000	2016/8/18	12.72

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別の投資比率

平成28年 5月31日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	38.18
合計	38.18

Jリート・インデックス・マザーファンド

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成28年 5月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人	1,503	678,766.04	1,020,185,358	659,000	990,477,000	7.77
日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人	1,393	687,738.71	958,020,023	649,000	904,057,000	7.10
日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人	2,715	264,871.01	719,124,792	257,700	699,655,500	5.49
日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人	3,961	156,264.62	618,964,159	175,000	693,175,000	5.44
日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人	2,928	182,298.87	533,771,091	175,000	512,400,000	4.02
日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人	1,960	245,334.01	480,854,659	240,400	471,184,000	3.70

日本	投資証券	オリックス不動産投資法人	2,575	174,626.14	449,662,310	175,300	451,397,500	3.54
日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人	929	460,870.37	428,148,573	474,500	440,810,500	3.46
日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人	1,384	274,310.83	379,646,188	280,500	388,212,000	3.05
日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人	638	589,455.57	376,072,653	566,000	361,108,000	2.83
日本	投資証券	G L P 投資法人	2,759	123,354.32	340,334,568	127,400	351,496,600	2.76
日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人	3,538	95,412.25	337,568,540	96,300	340,709,400	2.67
日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人	516	713,762.54	368,301,470	659,000	340,044,000	2.67
日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人	1,865	169,315.28	315,772,997	165,800	309,217,000	2.43
日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人	3,905	73,387.46	286,578,031	76,300	297,951,500	2.34
日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人	1,406	204,538.52	287,581,159	211,400	297,228,400	2.33
日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人	529	515,447.77	272,671,870	542,000	286,718,000	2.25
日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人	431	643,454.02	277,328,682	630,000	271,530,000	2.13
日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	516	415,149.69	214,217,240	457,000	235,812,000	1.85
日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人	936	244,597.94	228,943,671	244,400	228,758,400	1.80
日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人	374	479,563.67	179,356,812	599,000	224,026,000	1.76
日本	投資証券	大和ハウス・レジデンシャル投資法人	798	240,949.6	192,277,780	272,000	217,056,000	1.70
日本	投資証券	産業ファンド投資法人	376	533,859.9	200,731,322	572,000	215,072,000	1.69
日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人	1,344	153,622.85	206,469,110	149,400	200,793,600	1.58
日本	投資証券	プレミアム投資法人	1,400	139,762.37	195,667,318	141,300	197,820,000	1.55
日本	投資証券	イオンリート投資法人	1,395	130,425.23	181,943,195	141,200	196,974,000	1.55
日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人	1,016	183,924.36	186,867,149	189,800	192,836,800	1.51
日本	投資証券	福岡リート投資法人	794	192,308.53	152,692,972	203,400	161,499,600	1.27
日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人	1,043	166,371.64	173,525,620	152,700	159,266,100	1.25
日本	投資証券	日本賃貸住宅投資法人	1,749	88,993.66	155,649,911	86,200	150,763,800	1.18

□ 種類別の投資比率

平成28年 5月31日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	99.31
合計	99.31

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)

平成28年 5月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	投資比率(%)
アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	9,998	21,090.43	210,862,123	21,940.60	219,362,157	5.80
アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	4,636	27,796.88	128,866,342	28,315.21	131,269,342	3.47
フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO SE	3,125	28,040.37	87,626,182	30,263.33	94,572,930	2.50
アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	11,770	8,117.09	95,538,211	7,623.79	89,732,088	2.37
アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	4,483	19,122.98	85,728,339	19,985.84	89,596,525	2.37

アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	16,737	4,308.94	72,118,851	5,278.52	88,346,676	2.33
アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	11,324	6,937.11	78,555,930	7,684.81	87,022,831	2.30
アメリカ	投資証券	VENTAS INC	10,760	6,108.75	65,730,220	7,356.43	79,155,202	2.09
アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES INC	5,085	12,927.07	65,734,164	13,912.98	70,747,531	1.87
オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	168,413	354.91	59,773,135	372.75	62,777,529	1.66
アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	5,498	9,525.61	52,371,812	10,562.59	58,073,161	1.53
アメリカ	投資証券	GENERAL GROWTH PROPERTIES	19,076	3,009.67	57,412,626	2,989.83	57,034,054	1.51
アメリカ	投資証券	HCP, INC.	15,318	3,298.04	50,519,392	3,665.45	56,147,480	1.48
アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORPORATION	7,984	6,605.75	52,740,379	6,645.30	53,056,123	1.40
アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,079	23,232.83	48,301,055	25,172.28	52,333,183	1.38
オーストラリア	投資証券	WESTFIELD CORP	60,369	775.89	46,839,821	854.07	51,559,593	1.36
アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	4,777	9,108.66	43,512,116	10,501.58	50,166,050	1.33
香港	投資証券	LINK REIT	72,600	617.41	44,824,285	673.30	48,881,725	1.29
イギリス	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	24,900	1,573.30	39,175,394	1,932.87	48,128,612	1.27
アメリカ	投資証券	HOST HOTELS AND RESORTS INC	24,683	1,689.81	41,709,796	1,697.38	41,896,480	1.11
イギリス	投資証券	BRITISH LAND CO PLC	33,100	1,063.65	35,207,022	1,236.52	40,928,812	1.08
アメリカ	投資証券	KIMCO REALTY CORPORATION	12,647	2,947.51	37,277,206	3,118.52	39,439,965	1.04
アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	3,814	9,115.93	34,768,194	10,309.65	39,321,021	1.04
アメリカ	投資証券	UDR INC	8,912	3,798.62	33,853,372	4,011.59	35,751,294	0.94
アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	2,052	16,273.78	33,393,814	17,040.38	34,966,868	0.92
アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORP	3,106	9,819.29	30,498,744	11,158.34	34,657,820	0.92
アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	8,100	3,569.43	28,912,406	4,082.59	33,068,995	0.87
フランス	投資証券	KLEPIERRE	6,271	4,724.01	29,624,315	5,145.69	32,268,651	0.85
アメリカ	投資証券	MACERICH COMPANY/THE	3,787	8,687.71	32,900,363	8,452.51	32,009,688	0.85
アメリカ	投資証券	VEREIT INC	29,110	874.20	25,448,172	1,056.14	30,744,492	0.81

ロ 種類別の投資比率

平成28年 5月31日現在

種類	投資比率(%)
投資証券	99.29
合計	99.29

国内債券パッシブ・マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

平成28年 5月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第303回利付国債(10年)	3,495,000,000	105.44	3,685,442,550	105.47	3,686,351,250	1.400	2019/9/20	1.51
日本	国債証券	第310回利付国債(10年)	3,080,000,000	105.31	3,243,794,400	105.36	3,245,272,800	1.000	2020/9/20	1.33
日本	国債証券	第305回利付国債(10年)	2,970,000,000	105.48	3,132,845,100	105.49	3,133,231,200	1.300	2019/12/20	1.28

日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	2,675,000,000	107.26	2,869,214,550	107.41	2,873,431,500	0.800	2023/6/20	1.18
日本	国債証券	第341回利付国債(10年)	2,485,000,000	103.96	2,583,505,400	104.15	2,588,326,300	0.300	2025/12/20	1.06
日本	国債証券	第298回利付国債(10年)	2,470,000,000	103.93	2,567,243,900	103.93	2,567,268,600	1.300	2018/12/20	1.05
日本	国債証券	第125回利付国債(5年)	2,450,000,000	101.41	2,484,716,500	101.47	2,486,186,500	0.100	2020/9/20	1.02
日本	国債証券	第339回利付国債(10年)	2,330,000,000	104.91	2,444,403,000	105.09	2,448,666,900	0.400	2025/6/20	1.00
日本	国債証券	第124回利付国債(5年)	2,410,000,000	101.35	2,442,631,400	101.39	2,443,499,000	0.100	2020/6/20	1.00
日本	国債証券	第123回利付国債(5年)	2,410,000,000	101.26	2,440,582,900	101.30	2,441,378,200	0.100	2020/3/20	1.00
日本	国債証券	第301回利付国債(10年)	2,285,000,000	105.35	2,407,407,450	105.37	2,407,864,450	1.500	2019/6/20	0.99
日本	国債証券	第299回利付国債(10年)	2,245,000,000	104.31	2,341,939,100	104.33	2,342,343,200	1.300	2019/3/20	0.96
日本	国債証券	第312回利付国債(10年)	2,145,000,000	106.55	2,285,518,950	106.60	2,286,570,000	1.200	2020/12/20	0.94
日本	国債証券	第340回利付国債(10年)	2,165,000,000	104.94	2,272,145,850	105.13	2,276,237,700	0.400	2025/9/20	0.93
日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	2,105,000,000	107.36	2,260,117,450	107.42	2,261,212,050	1.300	2021/3/20	0.93
日本	国債証券	第296回利付国債(10年)	2,043,000,000	104.04	2,125,537,200	104.03	2,125,496,340	1.500	2018/9/20	0.87
日本	国債証券	第315回利付国債(10年)	1,950,000,000	107.27	2,091,766,400	107.33	2,092,974,000	1.200	2021/6/20	0.86
日本	国債証券	第297回利付国債(10年)	1,943,000,000	104.19	2,024,508,850	104.19	2,024,508,850	1.400	2018/12/20	0.83
日本	国債証券	第335回利付国債(10年)	1,815,000,000	105.60	1,916,785,200	105.81	1,920,614,850	0.500	2024/9/20	0.79
日本	国債証券	第332回利付国債(10年)	1,775,000,000	106.10	1,883,363,750	106.29	1,886,754,000	0.600	2023/12/20	0.77
日本	国債証券	第338回利付国債(10年)	1,790,000,000	104.86	1,877,083,500	105.04	1,880,269,700	0.400	2025/3/20	0.77
日本	国債証券	第330回利付国債(10年)	1,700,000,000	107.42	1,826,242,000	107.64	1,830,016,000	0.800	2023/9/20	0.75
日本	国債証券	第333回利付国債(10年)	1,705,000,000	106.22	1,811,102,150	106.42	1,814,461,000	0.600	2024/3/20	0.74
日本	国債証券	第306回利付国債(10年)	1,670,000,000	106.27	1,774,725,700	106.30	1,775,293,500	1.400	2020/3/20	0.73
日本	国債証券	第127回利付国債(5年)	1,665,000,000	101.60	1,691,797,400	101.62	1,692,056,250	0.100	2021/3/20	0.69
日本	国債証券	第325回利付国債(10年)	1,555,000,000	106.53	1,656,603,700	106.65	1,658,469,700	0.800	2022/9/20	0.68
日本	国債証券	第321回利付国債(10年)	1,545,000,000	107.21	1,656,487,200	107.29	1,657,630,500	1.000	2022/3/20	0.68
日本	国債証券	第59回利付国債(20年)	1,455,000,000	112.71	1,640,046,900	112.87	1,642,302,150	1.700	2022/12/20	0.67
日本	国債証券	第334回利付国債(10年)	1,510,000,000	106.34	1,605,734,000	106.54	1,608,814,400	0.600	2024/6/20	0.66
日本	国債証券	第342回利付国債(10年)	1,565,000,000	102.11	1,598,145,900	102.18	1,599,132,650	0.100	2026/3/20	0.65

□ 種類別の投資比率

平成28年 5月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	75.20

地方債証券	7.57
特殊債券	10.96
社債券	5.59
合計	99.32

外国債券パッシブ・マザーファンド

イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

平成28年 5月31日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	11,000,000	10,603.43	1,166,378,091	11,409.48	1,255,043,419	2.750	2042/11/15	0.70
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	7,000,000	11,319.34	792,354,281	11,722.37	820,565,980	2.500	2024/5/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	7,000,000	11,199.73	783,981,779	11,608.83	812,618,166	2.375	2024/8/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	6,000,000	12,544.02	752,641,231	13,409.00	804,540,350	3.625	2043/8/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	7,000,000	10,931.92	765,234,655	11,374.81	796,237,181	2.125	2025/5/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	7,000,000	10,826.18	757,832,878	11,268.21	788,774,737	2.000	2025/2/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	7,000,000	10,878.97	761,528,043	11,247.40	787,318,649	2.000	2025/8/15	0.44
イタリア	国債証券	BTPS 6	4,100,000	18,557.63	760,863,212	18,939.47	776,518,291	6.000	2031/5/1	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	6,500,000	11,158.66	725,313,483	11,479.68	746,179,843	2.250	2025/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	6,200,000	11,572.42	717,490,583	11,919.11	738,985,208	2.750	2023/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	6,000,000	11,989.32	719,359,231	12,071.65	724,299,525	3.625	2020/2/15	0.40
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.5	5,000,000	14,233.72	711,686,123	14,220.98	711,049,325	3.500	2020/4/25	0.39
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.75	5,000,000	14,178.94	708,947,276	14,111.30	705,565,448	3.750	2019/10/25	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.875	6,000,000	11,814.24	708,854,600	11,746.20	704,772,350	3.875	2018/5/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	6,000,000	11,069.59	664,175,592	11,495.29	689,717,450	2.250	2024/11/15	0.38
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 5.5	3,500,000	18,647.40	652,659,322	19,626.96	686,943,758	5.500	2029/4/25	0.38
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 5.75	3,200,000	20,022.02	640,704,840	21,363.62	683,636,120	5.750	2032/10/25	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.875	6,000,000	11,265.61	675,936,619	11,256.94	675,416,588	1.875	2017/10/31	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.875	6,000,000	11,260.41	675,624,600	11,250.44	675,026,562	1.875	2017/9/30	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1	6,000,000	10,840.05	650,403,088	11,035.92	662,155,794	1.000	2019/11/30	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	6,000,000	10,939.42	656,365,415	10,859.11	651,547,156	1.625	2026/2/15	0.36
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.25	4,000,000	15,816.07	632,642,860	16,190.11	647,604,510	4.250	2023/10/25	0.36
イタリア	国債証券	BTPS 5.25	3,700,000	17,296.76	639,980,251	17,457.89	645,942,159	5.250	2029/11/1	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	5,500,000	11,530.82	634,195,444	11,703.30	643,681,684	2.625	2020/11/15	0.36
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.5	4,000,000	15,353.24	614,129,982	16,023.55	640,942,248	3.500	2026/4/25	0.36
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 2.5	4,500,000	13,789.44	620,525,160	13,881.56	624,670,526	2.500	2020/10/25	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	5,500,000	11,012.52	605,689,064	11,352.28	624,375,520	2.000	2023/2/15	0.35
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.75	3,100,000	19,098.85	592,064,639	20,010.89	620,337,830	4.750	2035/4/25	0.34

フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.25	4,400,000	14,185.12	624,145,632	14,043.79	617,927,026	4.250	2019/4/25	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	5,000,000	12,071.65	603,582,937	12,227.66	611,383,406	3.625	2021/2/15	0.34

ロ 種類別の投資比率

平成28年 5月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	97.95
合計	97.95

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)

平成28年 5月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	1,700,000	10,626.07	180,643,256	10,760.31	182,925,326	2.500	2045/2/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	1,600,000	11,071.78	177,148,550	11,247.40	179,958,548	2.000	2025/8/15	0.47
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	1,500,000	11,660.03	174,900,516	11,722.37	175,835,567	2.500	2024/5/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	1,500,000	11,640.92	174,613,822	11,608.83	174,132,462	2.375	2024/8/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	1,500,000	11,124.42	166,866,328	11,268.21	169,023,157	2.000	2025/2/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.875	1,500,000	11,260.84	168,912,650	11,243.07	168,646,134	1.875	2017/8/31	0.44
イギリス	国債証券	UK TSY GILT 3.5	800,000	19,964.04	159,712,341	20,567.39	164,539,161	3.500	2045/1/22	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	1,500,000	10,937.12	164,056,859	10,859.11	162,886,789	1.625	2026/2/15	0.43
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.75	1,100,000	14,823.93	163,063,314	14,780.50	162,585,530	3.750	2021/4/25	0.43
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3	1,100,000	14,532.93	159,862,264	14,641.14	161,052,642	3.000	2022/4/25	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	1,400,000	11,315.02	158,410,289	11,495.29	160,934,071	2.250	2024/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	1,400,000	11,237.99	157,331,987	11,374.81	159,247,436	2.125	2025/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.125	1,300,000	11,929.65	155,085,453	12,206.00	158,678,002	3.125	2044/8/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	1,300,000	11,841.02	153,933,323	11,919.11	154,948,511	2.750	2023/11/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	1,300,000	11,433.45	148,634,979	11,479.68	149,235,968	2.250	2025/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.625	1,300,000	11,011.66	143,151,602	11,035.92	143,467,088	0.625	2018/4/30	0.38
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.75	700,000	19,209.02	134,463,192	20,010.89	140,076,284	4.750	2035/4/25	0.37
イギリス	国債証券	UK TSY GILT 4.25	600,000	22,078.96	132,473,790	22,344.73	134,068,380	4.250	2039/9/7	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	1,000,000	13,170.39	131,703,982	13,391.67	133,916,714	3.625	2044/2/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.375	1,200,000	11,113.06	133,356,814	11,144.26	133,731,236	1.375	2020/4/30	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.5	1,200,000	10,977.82	131,733,883	11,081.86	132,982,390	1.500	2022/1/31	0.35

イタリア	国債証券	BTPS 6	700,000	18,633.41	130,433,934	18,939.47	132,576,294	6.000	2031/5/1	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3	1,100,000	11,436.76	125,804,458	11,904.38	130,948,202	3.000	2045/11/15	0.34
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.25	800,000	15,969.32	127,754,562	16,190.11	129,520,902	4.250	2023/10/25	0.34
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 5.75	600,000	20,437.77	122,626,673	21,363.62	128,181,773	5.750	2032/10/25	0.34
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.5	900,000	14,283.30	128,549,755	14,220.98	127,988,879	3.500	2020/4/25	0.34
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.25	900,000	14,218.51	127,966,621	14,043.79	126,394,164	4.250	2019/4/25	0.33
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	1,100,000	11,216.20	123,378,281	11,228.34	123,511,755	1.625	2020/11/30	0.32
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.5	1,100,000	11,211.00	123,321,077	11,225.74	123,483,154	1.500	2019/10/31	0.32
イタリア	国債証券	BTPS 5.25	700,000	17,119.13	119,833,913	17,457.89	122,205,273	5.250	2029/11/1	0.32

ロ 種類別の投資比率

平成28年 5月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	97.24
合計	97.24

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）

平成28年 5月31日現在

種類	取引所等	名称	買建 / 売建	数量	通貨	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	304	日本円	3,998,984,080	4,186,080,000	2.05

（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

平成28年 5月31日現在

種類	地域	取引所等	名称	買建 / 売建	数量	通貨	帳簿価額	簿価 (円)	評価額	時価 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SPMNI 1606	買建	343	米ドル	35,402,279	3,927,528,832	35,968,695	3,990,367,023	2.48
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EUR 1606	買建	264	ユーロ	7,764,248	960,049,265	8,133,840	1,005,749,316	0.62
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SP1200 1606	買建	26	オーストラリアドル	3,338,842	266,506,368	3,517,800	280,790,796	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 1606	買建	46	英ポンド	2,851,367	463,917,411	2,875,460	467,837,342	0.29

（注）主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

平成28年 5月31日現在

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	売建	2,460,000.00	272,863,200	272,887,800	0.17
	カナダドル	売建	110,000.00	9,351,100	9,353,300	0.00
	ユーロ	売建	520,000.00	64,277,200	64,292,800	0.04
	英ポンド	売建	140,000.00	22,766,800	22,776,600	0.01
	スイスフラン	売建	60,000.00	6,711,000	6,712,800	0.00
	スウェーデンクローナ	売建	340,000.00	4,532,200	4,532,200	0.00
	ノルウェークローネ	売建	30,000.00	399,000	398,700	0.00
	デンマーククローネ	売建	120,000.00	1,994,400	1,994,400	0.00
	オーストラリアドル	売建	130,000.00	10,371,400	10,374,000	0.00
	香港ドル	売建	190,000.00	2,711,300	2,711,300	0.00
	シンガポールドル	売建	10,000.00	804,100	804,400	0.00
	イスラエルシェケル	売建	80,000.00	2,307,200	2,306,400	0.00

（注）わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

平成28年 5月31日現在

種類	地域	取引所等	名称	買建/ 売建	数量	通貨	帳簿価額	簿価 (円)	評価額	時価 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	インターコンチネンタル取引所	MSCIE 1606	買建	781	米ドル	31,170,656	3,458,072,577	31,435,250	3,487,426,635	100.06

(注) 主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

平成28年 5月31日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	2,007,107.55	220,000,000	222,648,439	6.38

(注) わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

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

平成28年 5月31日現在

種類	資産の名称	買建/ 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	買建	270,880.36	30,000,000	30,048,758	0.79
	カナダドル	買建	11,798.02	1,000,000	1,003,185	0.02
	英ポンド	買建	9,267.27	1,500,000	1,507,692	0.03
	シンガポールドル	売建	12,465.72	1,000,000	1,002,742	0.02

(注) わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

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

平成28年 5月31日現在

種類	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	米ドル	売建	145,000,000.00	15,428,783,000	16,080,500,000	42.09
	カナダドル	売建	9,100,000.00	771,898,400	773,591,000	2.02
	メキシコペソ	売建	61,900,000.00	382,232,500	371,400,000	0.97
	ユーロ	売建	122,800,000.00	15,004,200,400	15,182,992,000	39.74
	英ポンド	売建	18,600,000.00	2,890,886,400	3,025,290,000	7.91
	スイスフラン	売建	700,000.00	77,783,300	78,316,000	0.20
	スウェーデンクローナ	売建	12,300,000.00	163,257,900	163,959,000	0.42
	ノルウェークローネ	売建	8,900,000.00	117,542,300	118,281,000	0.30
	デンマーククローネ	売建	14,600,000.00	239,637,100	242,652,000	0.63
	ポーランドズロチ	売建	8,000,000.00	223,080,000	224,880,000	0.58
	オーストラリアドル	売建	7,800,000.00	630,653,400	622,128,000	1.62
	シンガポールドル	売建	3,800,000.00	300,694,000	305,558,000	0.79
	南アフリカランド	売建	23,400,000.00	174,213,000	164,034,000	0.42

(注) わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

参考情報

基準日:2016年5月31日

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

※委託会社ホームページにおいてもファンドの運用状況は適宜開示しています。

基準価額・純資産の推移

分配の推移

■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。

決算期	分配金
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
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)



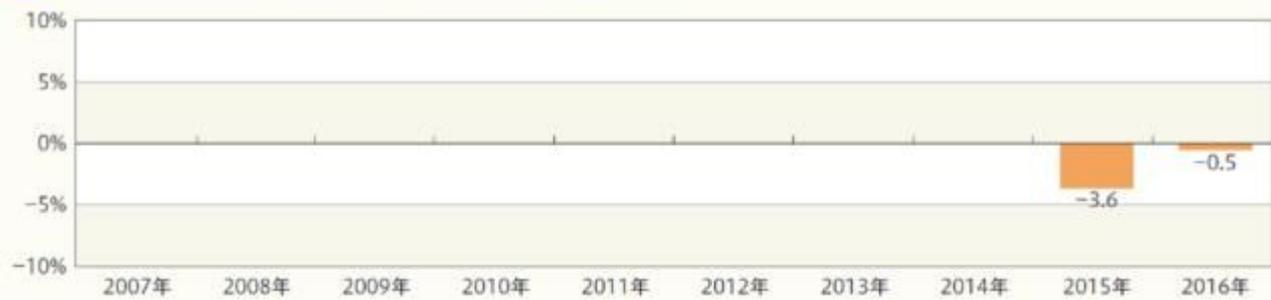
※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

決算期	分配金
2016年4月	0円
設定来累計	0円

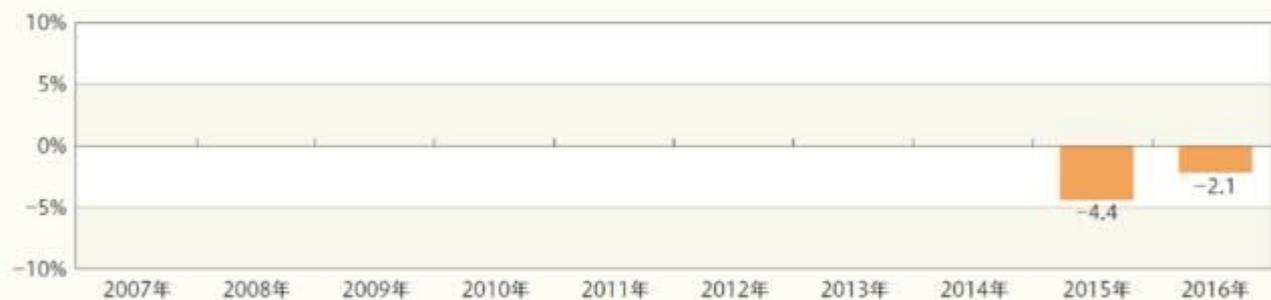
※分配金は1万口当たり、税引前です。

年間収益率の推移(暦年ベース)

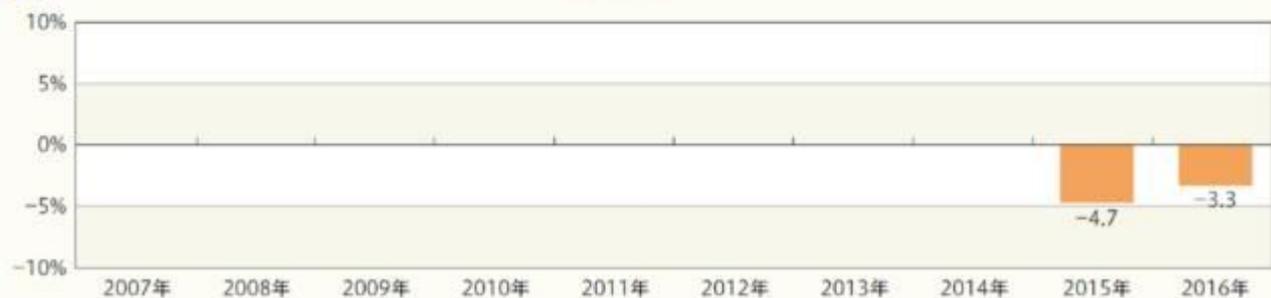
■アセットアロケーション・ファンド(安定型)



■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)



※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。

※2016年のファンドの収益率は、年初から2016年5月31日までの騰落率を表示しています。

※ファンドにはベンチマークはありません。

第2【管理及び運営】

1【申込(販売)手続等】

イ 申込方法

(イ) ファンドの取得申込者は、お申込みを取り扱う販売会社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。

- 二 申込単位

お申込単位の詳細は、取扱いの販売会社または委託会社にお問い合わせください。

- ホ 照会先

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

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

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

- ヘ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

- ト 払込期日

取得申込者は、申込金額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数）に申込手数料および当該手数料にかかる消費税等相当額を加算した額を、販売会社の指定の期日までに、指定の方法でお支払いください。

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

2【換金（解約）手続等】

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

お買付けの販売会社にお申し出ください。

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

解約請求のお申込みに関しては、原則として午後3時までに解約請求のお申込みが行われ、販売会

社所定の事務手続きが完了したものを当日の解約請求受付分とします。

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

一部解約金は、解約請求受付日から起算して6営業日目からお支払いします。

一部解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

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

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

イ 基準価額の算出方法

基準価額とは、信託財産に属する資産を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます（基準価額は、便宜上1万口単位で表示される場合があります。）。

なお、外貨建資産の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算するものとし、予約為替の評価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

ロ 基準価額の算出頻度・照会方法

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

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

平成27年4月17日から平成40年4月26日まで、もしくは下記「(5)その他イ 信託の終了」に記載された各事由が生じた場合における信託終了の日までとなります。

(4)【計算期間】

毎年4月27日から翌年4月26日までとすることを原則としますが、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始するものとします。なお、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

(5)【その他】

イ 信託の終了

(イ) 信託契約の解約

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

(ロ) 信託契約に関する監督官庁の命令

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

(ハ) 委託会社の登録取消等に伴う取扱い

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

(ニ) 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

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

信託を終了させます。

ロ 収益分配金、償還金の支払い

(イ) 収益分配金

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

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

(ロ) 償還金

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

八 信託約款の変更等

- (イ) 委託会社は、当ファンドの信託約款を変更することが受益者の利益のため必要と認めるとき、監督官庁より変更の命令を受けたとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託約款を変更すること、または当ファンドと他のファンドとの併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨および内容を監督官庁に届け出ます。
- (ロ) 委託会社は、上記（イ）の事項（変更についてはその内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあっては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、合わせて「重大な信託約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- (ハ) 上記（ロ）の書面決議において、受益者（委託会社等を除きます。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- (ニ) 書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います（書面決議は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。）。
- (ホ) 上記（ロ）から（ニ）までの取扱いは、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- (ヘ) 上記にかかわらず、当ファンドと他のファンドとの併合の場合は、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、相手方となる他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、併合を行うことはできません。

二 反対受益者の受益権請求の不適用

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、委託者が信託契約の一部解約を

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

ホ 販売会社との契約の更改等

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

ヘ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

ト 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

チ 運用にかかる報告書の開示方法

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

4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利は次の通りです。

イ 分配金請求権

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

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

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

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

ロ 償還金請求権

受益者は、持分に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します。）に支払われます。

償還金は、受益者がその支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、受益者はその権

利を失い、当該金銭は、委託会社に帰属します。

ハ 一部解約実行請求権

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

ニ 書面決議における議決権

委託会社が、当ファンドの解約(監督官庁の命令による解約等の場合を除きます。)または、重大な信託約款の変更等を行おうとする場合において、受益者は、それぞれの書面決議手続きにおいて、受益権の口数に応じて議決権を有しこれを行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1期（平成27年 4月17日から平成28年 4月26日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【アセットアロケーション・ファンド（安定型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

		第1期
		（平成28年 4月26日現在）
資産の部		
流動資産		
預金		4,266,067
金銭信託		239,336,382
コール・ローン		50,219,046
投資信託受益証券		997,238,469
親投資信託受益証券		12,211,292,294
未収入金		13,631,603
流動資産合計		13,515,983,861
資産合計		13,515,983,861
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		8,280,157
未払金		89,211,251
未払解約金		9,983,330
未払受託者報酬		1,580,551
未払委託者報酬		47,943,142
未払利息		147
その他未払費用		319,816
流動負債合計		157,318,394
負債合計		157,318,394
純資産の部		
元本等		
元本		14,040,607,518
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		681,942,051
元本等合計		13,358,665,467
純資産合計		13,358,665,467
負債純資産合計		13,515,983,861

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 平成27年 4月17日 至 平成28年 4月26日
営業収益	
受取配当金	33,122,949
受取利息	9,890
有価証券売買等損益	141,381,347
為替差損益	25,665,286
営業収益合計	133,913,794
営業費用	
支払利息	1,265
受託者報酬	2,128,351
委託者報酬	64,559,632
その他費用	718,593
営業費用合計	67,407,841
営業利益又は営業損失（ ）	201,321,635
経常利益又は経常損失（ ）	201,321,635
当期純利益又は当期純損失（ ）	201,321,635
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	10,767,186
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	11,626,018
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	11,626,018
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	503,013,620
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	503,013,620
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	681,942,051

(3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第1期
	自 平成27年 4月17日 至 平成28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>

(追加情報)

第1期
自 平成27年 4月17日 至 平成28年 4月26日
<p>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）等に投資しており、新興国債券への投資は「バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF」を通じて行っております。ファンドの資産増加に伴い、上記ETFの取引における各ファンドの比率が高くなっており、十分な流動性を確保するため、平成28年4月8日（効力発生日 平成28年4月8日）付けで新興国債券を投資対象とする「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」を追加する旨の約款変更を行いました。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	第1期 （平成28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. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損	681,942,051円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	0.9514円
	(10,000口当たりの純資産額)	9,514円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第1期 自 平成27年 4月17日 至 平成28年 4月26日	
	分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（94,822,904円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（20,766,882円）、および分配準備積立金（0円）より、分配対象収益は115,589,786円（1万口当たり82.32円）であります。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1期 自 平成27年 4月17日 至 平成28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</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	第1期 (平成28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（投資信託受益証券、親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第1期（自 平成27年 4月17日 至 平成28年 4月26日）

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

（デリバティブ取引に関する注記）

第1期（平成28年 4月26日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		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	713,483,543	-	721,763,700	8,280,157
	米ドル	713,483,543	-	721,763,700	8,280,157
	合計	713,483,543	-	721,763,700	8,280,157

（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）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項 目	第1期 (平成28年 4月26日現在)
期首元本額	88,512,206円
期中追加設定元本額	14,382,691,005円
期中一部解約元本額	430,595,693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	S P D R バークレイズ・ハイ・ イールド債券 E T F	204,385	7,137,124.20	
		バンガード・米ドル建て新興国政 府債券 E T F	23,876	1,849,434.96	
	米ドル 小計		228,261	8,986,559.16 (997,238,469)	
投資信託受益証券合計				997,238,469 (997,238,469)	
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）	281,954,244	577,611,464	
		外国株式インデックス・マザー ファンド	167,308,242	439,552,213	
		ヘッジ付き外国債券パッシブ・マ ザーファンド	4,699,301,222	6,540,487,440	
		外国債券パッシブ・マザーファン ド	116,419,683	198,437,349	
		国内債券パッシブ・マザーファン ド	3,001,070,375	3,831,466,547	
		Jリート・インデックス・マザー ファンド	154,724,236	319,722,161	

	外国リート・インデックス・マ ザーファンド	43,481,374	81,040,584	
	エマージング株式インデックス・ マザーファンド	216,585,271	222,974,536	
親投資信託受益証券合計		8,680,844,647	12,211,292,294	
合計			13,208,530,763 (997,238,469)	

(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 2銘柄	7.5%	100.0%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

【アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

		第1期
		(平成28年 4月26日現在)
資産の部		
流動資産		
預金		8,499,909
金銭信託		220,550,363
コール・ローン		46,277,247
投資信託受益証券		2,171,643,412
親投資信託受益証券		10,036,202,031
未収入金		34,404,231
流動資産合計		12,517,577,193
資産合計		12,517,577,193
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		20,530,242
未払金		55,511,975
未払解約金		309,966
未払受託者報酬		1,589,467
未払委託者報酬		48,213,896
未払利息		135
その他未払費用		321,346
流動負債合計		126,477,027
負債合計		126,477,027
純資産の部		
元本等		
元本		13,328,989,150
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()		937,888,984
元本等合計		12,391,100,166
純資産合計		12,391,100,166
負債純資産合計		12,517,577,193

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期 自 平成27年 4月17日 至 平成28年 4月26日
営業収益	
受取配当金	64,576,463
受取利息	12,084
有価証券売買等損益	379,159,717
為替差損益	45,327,377
営業収益合計	359,898,547
営業費用	
支払利息	1,174
受託者報酬	2,240,986
委託者報酬	67,976,654
その他費用	864,717
営業費用合計	71,083,531
営業利益又は営業損失()	430,982,078
経常利益又は経常損失()	430,982,078
当期純利益又は当期純損失()	430,982,078
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()	5,971,960
期首剰余金又は期首欠損金()	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,855,146
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,855,146
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	515,734,012
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	515,734,012
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金()	937,888,984

(3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第1期	
	自 平成27年 4月17日 至 平成28年 4月26日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。	
	(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。	
	(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。	
	(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。	
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。	
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。	

(追加情報)

第1期	
自 平成27年 4月17日 至 平成28年 4月26日	
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）等に投資しており、新興国債券への投資は「バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF」を通じて行っております。ファンドの資産増加に伴い、上記ETFの取引における各ファンドの比率が高くなっており、十分な流動性を確保するため、平成28年4月8日（効力発生日 平成28年4月8日）付けで新興国債券を投資対象とする「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」を追加する旨の約款変更を行いました。	

(貸借対照表に関する注記)

項 目	第1期 (平成28年 4月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	13,328,989,150口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損 937,888,984円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.9296円 (10,000口当たりの純資産額 9,296円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項 目	第1期 自 平成27年 4月17日 至 平成28年 4月26日
分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(116,723,687円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(21,490,914円)、および分配準備積立金(0円)より、分配対象収益は138,214,601円(1万口当たり103.69円)であります。分配を行っておりません。

(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1期 自 平成27年 4月17日 至 平成28年 4月26日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1)金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、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。 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。 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

	<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	第1期 (平成28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（投資信託受益証券、親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第1期（自 平成27年 4月17日 至 平成28年 4月26日）

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

（デリバティブ取引に関する注記）

第1期（平成28年 4月26日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		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	1,773,124,618	-	1,793,654,860	20,530,242
	米ドル	1,773,124,618	-	1,793,654,860	20,530,242
	合計	1,773,124,618	-	1,793,654,860	20,530,242

（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）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項 目	第1期 (平成28年 4月26日現在)
期首元本額	174,606,430円
期中追加設定元本額	13,299,171,437円
期中一部解約元本額	144,788,717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	S P D R バークレイズ・ハイ・ イールド債券 E T F	258,364	9,022,070.88	
		バンガード・米ドル建て新興国政 府債券 E T F	136,168	10,547,573.28	
	米ドル 小計		394,532	19,569,644.16 (2,171,643,412)	
投資信託受益証券合計				2,171,643,412 (2,171,643,412)	
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）	556,420,071	1,139,882,157	
		外国株式インデックス・マザー ファンド	244,719,365	642,926,715	
		ヘッジ付き外国債券パッシブ・マ ザーファンド	3,800,933,413	5,290,139,124	
		外国債券パッシブ・マザーファン ド	198,602,167	338,517,393	
		国内債券パッシブ・マザーファン ド	1,060,660,602	1,354,145,390	
		Jリート・インデックス・マザー ファンド	248,131,237	512,738,388	

	外国リート・インデックス・マ ザーファンド	64,006,589	119,295,480	
	エマージング株式インデックス・ マザーファンド	620,259,723	638,557,384	
親投資信託受益証券合計		6,793,733,167	10,036,202,031	
合計			12,207,845,443	(2,171,643,412)

(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 2銘柄	17.5%	100.0%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

【アセットアロケーション・ファンド（成長型）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

		第1期
		（平成28年 4月26日現在）
資産の部		
流動資産		
預金		11,074,135
金銭信託		210,788,567
コール・ローン		44,228,966
投資信託受益証券		2,838,102,106
親投資信託受益証券		9,410,163,174
未収入金		140,236,003
流動資産合計		12,654,592,951
資産合計		12,654,592,951
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		27,095,706
未払金		68,690,278
未払受託者報酬		1,573,552
未払委託者報酬		47,731,060
未払利息		129
その他未払費用		318,306
流動負債合計		145,409,031
負債合計		145,409,031
純資産の部		
元本等		
元本		13,657,972,258
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,148,788,338
元本等合計		12,509,183,920
純資産合計		12,509,183,920
負債純資産合計		12,654,592,951

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 平成27年 4月17日 至 平成28年 4月26日
営業収益	
受取配当金	74,464,831
受取利息	11,303
有価証券売買等損益	471,493,296
為替差損益	61,653,473
営業収益合計	458,670,635
営業費用	
支払利息	1,229
受託者報酬	2,205,626
委託者報酬	66,903,902
その他費用	885,905
営業費用合計	69,996,662
営業利益又は営業損失（ ）	528,667,297
経常利益又は経常損失（ ）	528,667,297
当期純利益又は当期純損失（ ）	528,667,297
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	7,997,324
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,642,464
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	5,642,464
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	633,760,829
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	633,760,829
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,148,788,338

(3) 【注記表】

(重要な会計方針の注記)

項 目	第1期	
	自 平成27年 4月17日 至 平成28年 4月26日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券、親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。	
	(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。	
	(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。	
	(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。	
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。	
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。	
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。	

(追加情報)

第1期	
自 平成27年 4月17日 至 平成28年 4月26日	
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）等に投資しており、新興国債券への投資は「バンガード・米ドル建て新興国政府債券ETF」を通じて行っております。ファンドの資産増加に伴い、上記ETFの取引における各ファンドの比率が高くなっており、十分な流動性を確保するため、平成28年4月8日（効力発生日 平成28年4月8日）付けで新興国債券を投資対象とする「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」を追加する旨の約款変更を行いました。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第1期 (平成28年 4月26日現在)	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数		13,657,972,258口
2. 「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額	元本の欠損	1,148,788,338円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	0.9159円
	(10,000口当たりの純資産額)	9,159円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第1期 自 平成27年 4月17日 至 平成28年 4月26日
分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(118,597,842円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(24,067,646円)、および分配準備積立金(0円)より、分配対象収益は142,665,488円(1万口当たり104.45円)であります。分配を行っておりません。

(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1期 自 平成27年 4月17日 至 平成28年 4月26日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1)金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、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。 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。 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

	<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	第1期 (平成28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（投資信託受益証券、親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第1期（自 平成27年 4月17日 至 平成28年 4月26日）

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

（デリバティブ取引に関する注記）

第1期（平成28年 4月26日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		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	2,340,644,014	-	2,367,739,720	27,095,706
	米ドル	2,340,644,014	-	2,367,739,720	27,095,706
	合計	2,340,644,014	-	2,367,739,720	27,095,706

（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）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項 目	第1期 (平成28年 4月26日現在)
期首元本額	175,410,861円
期中追加設定元本額	13,707,612,228円
期中一部解約元本額	225,050,831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	S P D R バークレイズ・ハイ・ イールド債券 E T F	329,661	11,511,762.12	
		バンガード・米ドル建て新興国政 府債券 E T F	181,560	14,063,637.60	
	米ドル 小計		511,221	25,575,399.72 (2,838,102,106)	
投資信託受益証券合計				2,838,102,106 (2,838,102,106)	
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）	760,345,139	1,557,643,051	
		外国株式インデックス・マザー ファンド	306,239,750	804,553,071	
		ヘッジ付き外国債券パッシブ・マ ザーファンド	2,824,867,699	3,931,650,863	
		外国債券パッシブ・マザーファン ド	265,051,792	451,780,779	
		国内債券パッシブ・マザーファン ド	807,656,739	1,031,135,358	
		Jリート・インデックス・マザー ファンド	333,044,826	688,203,828	

	外国リート・インデックス・マザーファンド	82,221,482	153,244,398	
	エマージング株式インデックス・マザーファンド	769,258,695	791,951,826	
親投資信託受益証券合計		6,148,686,122	9,410,163,174	
合計			12,248,265,280	(2,838,102,106)

(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 2銘柄	22.7%	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」および「SPDR バークレイズ・ハイ・イールド債券ETF」を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」および「投資信託受益証券」はこれらの親投資信託および投資信託の受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

貸借対照表

(単位:円)

(平成28年 4月26日現在)

資産の部	
流動資産	
金銭信託	914,048,541
コール・ローン	191,791,340
株式	201,765,513,030
派生商品評価勘定	79,446,320
未収入金	2,379,665,850
未収配当金	1,964,324,659
流動資産合計	207,294,789,740
資産合計	207,294,789,740
負債の部	
流動負債	
前受金	79,496,000
未払金	768,647,490

(平成28年 4月26日現在)

未払解約金	1,399,862,336
未払利息	562
その他未払費用	27,438
流動負債合計	2,248,033,826
負債合計	2,248,033,826
純資産の部	
元本等	
元本	100,093,353,772
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	104,953,402,142
元本等合計	205,046,755,914
純資産合計	205,046,755,914
負債純資産合計	207,294,789,740

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成27年 4月17日 至平成28年 4月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成28年 4月26日現在)
1. 担保資産	代用として、担保に供している資産は次の通りであります。

	株式	2,974,500,000円
2. 当計算期間の末日における受益権の総数		100,093,353,772口
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	2.0486円
	(10,000口当たりの純資産額)	20,486円)

(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27年 4月17日 至 平成28年 4月26日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。当計算期間については、先物取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<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28年 4月26日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（株式） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成28年 4月26日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,359,913,680	-	2,439,360,000	79,446,320
	東証株価指数先物	2,359,913,680	-	2,439,360,000	79,446,320
	合計	2,359,913,680	-	2,439,360,000	79,446,320

（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）

該当事項はありません。

（その他の注記）

（平成28年 4月26日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	119,585,187,546円
同期中における追加設定元本額	21,937,063,952円
同期中における一部解約元本額	41,428,897,726円
平成28年 4月26日現在における元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,817,037,466円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	525,966,938円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	2,601,422,021円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	1,873,657,801円
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）	81,677,905円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	7,950,556円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	18,222,038円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	60,165,679円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	46,189,394円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	27,526,819円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	61,397,469円

国内株式指数ファンド(TOPIX)	2,585,632,388円
三井住友・DC日本株式インデックスファンドS	895,132,016円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	281,954,244円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	556,420,071円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	760,345,139円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	16,667,156,051円
バランスファンドVA(安定運用型) <適格機関投資家限定>	115,477,819円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型 <適格機関投資家限定>	13,960,330,068円
SMAM・バランスファンドVA25 <適格機関投資家専用>	7,114,999,830円
SMAM・バランスファンドVA37.5 <適格機関投資家専用>	4,008,963,308円
SMAM・バランスファンドVA50 <適格機関投資家専用>	14,650,027,548円
SMAM・バランスファンドVL30 <適格機関投資家限定>	85,242,090円
SMAM・バランスファンドVL50 <適格機関投資家限定>	344,745,733円
世界6資産バランスファンドVA <適格機関投資家限定>	23,976,922円
SMAM・バランスファンドVA75 <適格機関投資家専用>	1,528,110,917円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型 <適格機関投資家限定>	85,688,096円
SMAM・インデックス・バランスVA25 <適格機関投資家専用>	573,208,020円
SMAM・インデックス・バランスVA50 <適格機関投資家専用>	1,715,554,716円
SMAM・バランスファンドVA40 <適格機関投資家専用>	2,896,392,095円
SMAM・バランスファンドVA35 <適格機関投資家専用>	5,243,649,784円
SMAM・バランスVA株40T <適格機関投資家限定>	130,398,140円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	3,472,384,673円
SMAM・グローバルバランス40VA <適格機関投資家限定>	107,938,271円
SMAM・バランスファンドVA20 <適格機関投資家専用>	187,530,886円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	3,090,785,104円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A <適格機関投資家専用>	165,880,067円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A <適格機関投資家専用>	76,427,722円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A <適格機関投資家専用>	36,368,520円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L <適格機関投資家専用>	371,939,767円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L <適格機関投資家専用>	628,248,942円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T <適格機関投資家専用>	265,305,051円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2 <適格機関投資家専用>	179,558,597円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2 <適格機関投資家専用>	82,740,483円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2 <適格機関投資家専用>	13,703,184円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2 <適格機関投資家専用>	133,711,700円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2 <適格機関投資家専用>	1,561,417,346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)	272,134,221円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2 <適格機関投資家専用>	33,498,132円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA <適格機関投資家限定>	305,920円
SMAM・FGグローバルバランス25VA <適格機関投資家限定>	1,582,929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>	150,170円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-01 <適格機関投資家限定>	67,123,006円
合計	100,093,353,772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	54,000	262.00	14,148,000	
日本水産	126,300	602.00	76,032,600	
マルハニチロ	22,500	2,465.00	55,462,500	
サカタのタネ	15,900	2,747.00	43,677,300	
ホクト	11,100	2,088.00	23,176,800	
日鉄鉱業	32,000	419.00	13,408,000	
三井松島産業	84,000	115.00	9,660,000	
国際石油開発帝石	577,900	905.00	522,999,500	
日本海洋掘削	3,600	2,485.00	8,946,000	
石油資源開発	17,600	2,635.00	46,376,000	
K&Oエナジーグループ	7,400	1,312.00	9,708,800	
ショーボンドホールディングス	11,200	4,795.00	53,704,000	
ミライト・ホールディングス	33,300	990.00	32,967,000	
タマホーム	11,900	437.00	5,200,300	
安藤・間	72,800	554.00	40,331,200	
東急建設	35,600	927.00	33,001,200	
コムシスホールディングス	47,200	1,718.00	81,089,600	
ミサワホーム	14,200	783.00	11,118,600	
高松コンストラクショングループ	7,800	2,430.00	18,954,000	
東建コーポレーション	4,400	8,790.00	38,676,000	
大成建設	568,000	762.00	432,816,000	
大林組	328,200	1,093.00	358,722,600	
清水建設	334,000	1,004.00	335,336,000	
飛鳥建設	91,100	187.00	17,035,700	
長谷工コーポレーション	128,100	1,063.00	136,170,300	
松井建設	13,400	819.00	10,974,600	
銭高組	18,000	467.00	8,406,000	
鹿島建設	513,000	701.00	359,613,000	
不動テトラ	82,700	140.00	11,578,000	
鉄建建設	68,000	277.00	18,836,000	
西松建設	128,000	483.00	61,824,000	
三井住友建設	428,100	97.00	41,525,700	
大豊建設	43,000	475.00	20,425,000	
前田建設工業	69,000	853.00	58,857,000	
ナカノフドー建設	10,300	521.00	5,366,300	
奥村組	105,000	593.00	62,265,000	

東鉄工業	13,000	3,195.00	41,535,000
イチケン	16,000	286.00	4,576,000
戸田建設	129,000	522.00	67,338,000
熊谷組	160,000	297.00	47,520,000
青木あすなろ建設	8,700	695.00	6,046,500
北野建設	29,000	271.00	7,859,000
三井ホーム	16,000	545.00	8,720,000
矢作建設工業	16,200	798.00	12,927,600
ピーエス三菱	16,000	418.00	6,688,000
日本ハウスホールディングス	25,500	382.00	9,741,000
大東建託	40,400	15,820.00	639,128,000
新日本建設	15,200	536.00	8,147,200
N I P P O	25,000	1,861.00	46,525,000
東亜道路工業	24,000	366.00	8,784,000
前田道路	34,000	2,030.00	69,020,000
日本道路	32,000	535.00	17,120,000
東亜建設工業	97,000	255.00	24,735,000
若築建設	68,000	156.00	10,608,000
東洋建設	35,300	477.00	16,838,100
五洋建設	123,000	511.00	62,853,000
大林道路	13,700	778.00	10,658,600
世紀東急工業	19,600	497.00	9,741,200
福田組	18,000	1,187.00	21,366,000
住友林業	75,400	1,333.00	100,508,200
日本基礎技術	14,200	438.00	6,219,600
日成ビルド工業	33,000	418.00	13,794,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	74,000	90.00	6,660,000
巴コーポレーション	19,500	357.00	6,961,500
パナホーム	40,000	826.00	33,040,000
大和ハウス工業	324,000	3,102.00	1,005,048,000
ライト工業	21,100	1,140.00	24,054,000
積水ハウス	366,800	2,017.50	740,019,000
日特建設	14,000	456.00	6,384,000
北陸電気工事	6,200	852.00	5,282,400
ユアテック	17,000	812.00	13,804,000
中電工	15,300	2,206.00	33,751,800
関電工	43,000	796.00	34,228,000
きんでん	66,000	1,336.00	88,176,000
東京エネシス	13,000	845.00	10,985,000
トーエネック	17,000	715.00	12,155,000
住友電設	9,100	1,413.00	12,858,300
日本電設工業	17,600	2,221.00	39,089,600

協和エクシオ	43,400	1,279.00	55,508,600
新日本空調	10,600	995.00	10,547,000
N D S	24,000	298.00	7,152,000
九電工	20,000	2,722.00	54,440,000
三機工業	24,600	892.00	21,943,200
日揮	110,000	1,949.00	214,390,000
中外炉工業	41,000	200.00	8,200,000
ヤマト	12,400	478.00	5,927,200
太平電業	16,000	889.00	14,224,000
高砂熱学工業	32,400	1,444.00	46,785,600
三晃金属工業	14,000	351.00	4,914,000
朝日工業社	17,000	448.00	7,616,000
明星工業	21,500	498.00	10,707,000
大気社	13,800	2,577.00	35,562,600
ダイダン	16,000	762.00	12,192,000
日比谷総合設備	13,200	1,579.00	20,842,800
東芝プラントシステム	17,700	1,372.00	24,284,400
O S J Bホールディングス	26,900	257.00	6,913,300
東洋エンジニアリング	60,000	309.00	18,540,000
千代田化工建設	80,000	879.00	70,320,000
新興プランテック	22,900	844.00	19,327,600
日本製粉	69,000	849.00	58,581,000
日清製粉グループ本社	119,600	1,841.00	220,183,600
日東富士製粉	16,000	353.00	5,648,000
昭和産業	44,000	495.00	21,780,000
鳥越製粉	11,900	656.00	7,806,400
中部飼料	11,300	876.00	9,898,800
フィード・ワン	76,100	124.00	9,436,400
日本甜菜製糖	64,000	188.00	12,032,000
三井製糖	43,000	502.00	21,586,000
日新製糖	5,600	1,371.00	7,677,600
森永製菓	98,000	530.00	51,940,000
中村屋	31,000	460.00	14,260,000
江崎グリコ	25,300	5,450.00	137,885,000
名糖産業	6,800	1,331.00	9,050,800
不二家	75,000	195.00	14,625,000
山崎製パン	80,000	2,433.00	194,640,000
モロゾフ	23,000	438.00	10,074,000
亀田製菓	6,000	4,420.00	26,520,000
寿スピリッツ	7,900	2,122.00	16,763,800
カルビー	40,500	4,280.00	173,340,000
森永乳業	100,000	577.00	57,700,000

六甲バター	5,400	1,780.00	9,612,000
ヤクルト本社	58,800	5,590.00	328,692,000
明治ホールディングス	64,800	8,750.00	567,000,000
雪印メグミルク	26,000	2,567.00	66,742,000
プリマハム	68,000	315.00	21,420,000
日本ハム	80,000	2,522.00	201,760,000
林兼産業	46,000	102.00	4,692,000
丸大食品	55,000	464.00	25,520,000
S Foods	6,800	2,627.00	17,863,600
伊藤ハム米久ホールディングス	64,500	846.00	54,567,000
サッポロホールディングス	168,000	609.00	102,312,000
アサヒグループホールディングス	205,900	3,661.00	753,799,900
キリンホールディングス	444,800	1,664.50	740,369,600
宝ホールディングス	79,700	969.00	77,229,300
オエノンホールディングス	41,000	219.00	8,979,000
養命酒製造	4,200	1,974.00	8,290,800
コカ・コーラウエスト	37,100	2,743.00	101,765,300
コカ・コーライーストジャパン	38,900	1,844.00	71,731,600
サントリー食品インターナショナル	75,000	4,790.00	359,250,000
ダイドードリンコ	5,500	5,520.00	30,360,000
伊藤園	32,600	3,445.00	112,307,000
キーコーヒー	9,200	1,838.00	16,909,600
日清オイリオグループ	56,000	463.00	25,928,000
不二製油グループ本社	29,400	2,033.00	59,770,200
J - オイルミルズ	46,000	357.00	16,422,000
キッコーマン	83,000	3,730.00	309,590,000
味の素	230,900	2,626.00	606,343,400
キューピー	55,800	2,772.00	154,677,600
ハウス食品グループ本社	37,400	2,171.00	81,195,400
カゴメ	39,600	2,352.00	93,139,200
焼津水産化学工業	7,900	1,006.00	7,947,400
アリアケジャパン	8,900	5,900.00	52,510,000
ニチレイ	117,000	971.00	113,607,000
東洋水産	53,700	4,025.00	216,142,500
日清食品ホールディングス	46,300	5,220.00	241,686,000
永谷園ホールディングス	12,000	1,124.00	13,488,000
一正蒲鉾	5,300	1,018.00	5,395,400
フジッコ	10,600	2,348.00	24,888,800
ロック・フィールド	11,200	1,624.00	18,188,800
日本たばこ産業	648,400	4,664.00	3,024,137,600
ケンコーマヨネーズ	4,000	2,284.00	9,136,000
わらべや日洋	6,200	2,067.00	12,815,400

なとり	6,700	1,653.00	11,075,100
ユーグレナ	35,100	1,562.00	54,826,200
ミヨシ油脂	49,000	127.00	6,223,000
理研ビタミン	3,400	4,160.00	14,144,000
片倉工業	13,700	1,175.00	16,097,500
グンゼ	82,000	312.00	25,584,000
東洋紡	409,000	192.00	78,528,000
ユニチカ	305,000	55.00	16,775,000
富士紡ホールディングス	56,000	223.00	12,488,000
倉敷紡績	106,000	205.00	21,730,000
シキボウ	81,000	112.00	9,072,000
日本毛織	31,600	775.00	24,490,000
ダイドーリミテッド	17,400	480.00	8,352,000
帝国繊維	11,100	1,543.00	17,127,300
帝人	422,000	405.00	170,910,000
東レ	744,000	965.00	717,960,000
サカイオーベックス	35,000	170.00	5,950,000
住江織物	30,000	275.00	8,250,000
芦森工業	31,000	160.00	4,960,000
アツギ	93,000	116.00	10,788,000
ダイニック	38,000	152.00	5,776,000
セーレン	25,500	1,173.00	29,911,500
小松精練	18,000	648.00	11,664,000
ワコールホールディングス	62,000	1,347.00	83,514,000
ホギメディカル	6,500	5,980.00	38,870,000
レナウン	38,400	124.00	4,761,600
T S Iホールディングス	46,900	717.00	33,627,300
三陽商会	59,000	270.00	15,930,000
オンワードホールディングス	67,000	762.00	51,054,000
ゴールドウイン	4,400	4,320.00	19,008,000
デサント	23,200	1,583.00	36,725,600
特種東海製紙	60,000	350.00	21,000,000
王子ホールディングス	417,000	478.00	199,326,000
日本製紙	52,400	2,184.00	114,441,600
三菱製紙	168,000	82.00	13,776,000
北越紀州製紙	63,700	710.00	45,227,000
中越パルプ工業	43,000	205.00	8,815,000
巴川製紙所	23,000	191.00	4,393,000
大王製紙	44,700	1,114.00	49,795,800
レンゴー	91,000	599.00	54,509,000
トーモク	36,000	283.00	10,188,000
ザ・パック	7,100	2,658.00	18,871,800

クラレ	160,900	1,466.00	235,879,400
旭化成	640,000	787.60	504,064,000
共和レザー	8,200	839.00	6,879,800
昭和電工	684,000	117.00	80,028,000
住友化学	753,000	527.00	396,831,000
住友精化	23,000	563.00	12,949,000
日産化学工業	61,600	3,025.00	186,340,000
ラサ工業	54,000	109.00	5,886,000
クレハ	77,000	388.00	29,876,000
テイカ	19,000	508.00	9,652,000
石原産業	192,000	78.00	14,976,000
日東エフシー	7,300	916.00	6,686,800
日本曹達	66,000	612.00	40,392,000
東ソー	276,000	527.00	145,452,000
トクヤマ	172,000	184.00	31,648,000
セントラル硝子	112,000	618.00	69,216,000
東亜合成	64,800	980.00	63,504,000
大阪ソーダ	44,000	412.00	18,128,000
関東電化工業	25,000	809.00	20,225,000
デンカ	213,000	480.00	102,240,000
信越化学工業	183,900	6,272.00	1,153,420,800
日本カーバイド工業	38,000	165.00	6,270,000
堺化学工業	45,000	317.00	14,265,000
エア・ウォーター	84,000	1,744.00	146,496,000
大陽日酸	79,100	1,086.00	85,902,600
日本化学工業	43,000	209.00	8,987,000
日本パーカライズン	51,700	1,020.00	52,734,000
高圧ガス工業	17,000	641.00	10,897,000
四国化成工業	15,000	929.00	13,935,000
戸田工業	24,000	310.00	7,440,000
ステラ ケミファ	5,700	2,205.00	12,568,500
保土谷化学工業	35,000	229.00	8,015,000
日本触媒	14,900	6,030.00	89,847,000
大日精化工業	39,000	472.00	18,408,000
カネカ	138,000	946.00	130,548,000
三菱瓦斯化学	176,000	622.00	109,472,000
三井化学	435,000	386.00	167,910,000
J S R	96,100	1,599.00	153,663,900
東京応化工業	20,700	3,220.00	66,654,000
大阪有機化学工業	9,400	628.00	5,903,200
三菱ケミカルホールディングス	687,300	594.70	408,737,310
日本合成化学工業	24,000	682.00	16,368,000

ダイセル	143,900	1,437.00	206,784,300
住友ベークライト	98,000	465.00	45,570,000
積水化学工業	232,000	1,430.00	331,760,000
日本ゼオン	87,000	782.00	68,034,000
アイカ工業	31,000	2,425.00	75,175,000
宇部興産	549,000	214.00	117,486,000
積水樹脂	15,700	1,524.00	23,926,800
タキロン	25,000	550.00	13,750,000
旭有機材	41,000	209.00	8,569,000
日立化成	50,600	2,032.00	102,819,200
ニチバン	12,000	630.00	7,560,000
リケンテクノス	24,100	400.00	9,640,000
大倉工業	31,000	293.00	9,083,000
積水化成品工業	29,000	351.00	10,179,000
群栄化学工業	31,000	304.00	9,424,000
ダイキョーニシカワ	13,200	1,601.00	21,133,200
日本化薬	67,000	1,243.00	83,281,000
カーリットホールディングス	12,100	488.00	5,904,800
日本精化	10,800	782.00	8,445,600
扶桑化学工業	6,900	1,645.00	11,350,500
A D E K A	50,500	1,615.00	81,557,500
日油	77,000	887.00	68,299,000
新日本理化	19,700	186.00	3,664,200
花王	275,700	5,937.00	1,636,830,900
第一工業製薬	26,000	355.00	9,230,000
三洋化成工業	31,000	836.00	25,916,000
大日本塗料	65,000	201.00	13,065,000
日本ペイントホールディングス	79,000	3,005.00	237,395,000
関西ペイント	115,700	2,015.00	233,135,500
中国塗料	30,000	771.00	23,130,000
日本特殊塗料	8,500	891.00	7,573,500
藤倉化成	17,700	510.00	9,027,000
太陽ホールディングス	7,500	3,675.00	27,562,500
D I C	404,000	267.00	107,868,000
サカタインクス	20,700	1,295.00	26,806,500
東洋インキＳＣホールディングス	98,000	456.00	44,688,000
T & K T O K A	8,200	936.00	7,675,200
富士フイルムホールディングス	234,700	4,614.00	1,082,905,800
資生堂	194,800	2,549.00	496,545,200
ライオン	118,000	1,380.00	162,840,000
高砂香料工業	6,900	2,486.00	17,153,400
マンダム	9,400	5,070.00	47,658,000

ミルボン	6,000	4,740.00	28,440,000
ファンケル	23,700	1,570.00	37,209,000
コーセー	16,500	10,190.00	168,135,000
シーズ・ホールディングス	12,900	2,226.00	28,715,400
ポーラ・オルビスホールディングス	10,400	8,920.00	92,768,000
ノエビアホールディングス	6,300	3,125.00	19,687,500
エステー	8,900	1,106.00	9,843,400
コニシ	16,200	1,371.00	22,210,200
長谷川香料	12,600	1,835.00	23,121,000
星光PMC	6,200	1,188.00	7,365,600
小林製薬	15,500	8,950.00	138,725,000
荒川化学工業	10,000	976.00	9,760,000
メック	9,000	797.00	7,173,000
日本高純度化学	4,000	2,048.00	8,192,000
タカラバイオ	22,100	1,510.00	33,371,000
JCU	3,300	3,565.00	11,764,500
新田ゼラチン	8,800	766.00	6,740,800
デクセリアルズ	30,800	1,058.00	32,586,400
アース製薬	7,200	4,700.00	33,840,000
イハラケミカル工業	15,900	1,423.00	22,625,700
北興化学工業	16,000	320.00	5,120,000
大成ラミック	3,700	2,890.00	10,693,000
クミアイ化学工業	21,100	977.00	20,614,700
日本農薬	23,800	594.00	14,137,200
アキレス	95,000	143.00	13,585,000
有沢製作所	16,900	586.00	9,903,400
日東電工	79,300	6,212.00	492,611,600
藤森工業	8,700	2,674.00	23,263,800
前澤化成工業	8,600	1,025.00	8,815,000
JSP	6,800	1,968.00	13,382,400
エフピコ	9,000	4,800.00	43,200,000
天馬	7,900	1,741.00	13,753,900
信越ポリマー	21,000	717.00	15,057,000
東リ	31,000	321.00	9,951,000
ニフコ	19,700	5,190.00	102,243,000
日本バルカー工業	48,000	290.00	13,920,000
ユニ・チャーム	207,900	2,410.50	501,142,950
協和発酵キリン	122,300	1,999.00	244,477,700
武田薬品工業	408,200	5,499.00	2,244,691,800
アステラス製薬	1,147,700	1,575.50	1,808,201,350
大日本住友製薬	72,300	1,488.00	107,582,400
塩野義製薬	149,500	5,840.00	873,080,000

田辺三菱製薬	118,700	2,003.00	237,756,100
あすか製薬	13,200	1,486.00	19,615,200
日本新薬	23,500	4,990.00	117,265,000
ピオフェルミン製薬	1,900	3,485.00	6,621,500
中外製薬	101,700	3,850.00	391,545,000
科研製薬	17,600	6,360.00	111,936,000
エーザイ	126,300	7,294.00	921,232,200
ロート製薬	50,100	1,984.00	99,398,400
小野薬品工業	232,900	5,149.00	1,199,202,100
久光製薬	31,800	5,560.00	176,808,000
持田製薬	7,100	8,590.00	60,989,000
参天製薬	188,700	1,646.00	310,600,200
扶桑薬品工業	41,000	269.00	11,029,000
日本ケミファ	18,000	500.00	9,000,000
ツムラ	32,500	2,913.00	94,672,500
日医工	24,200	2,778.00	67,227,600
キッセイ薬品工業	18,300	2,610.00	47,763,000
生化学工業	19,600	1,720.00	33,712,000
栄研化学	8,800	2,179.00	19,175,200
日水製薬	5,400	1,286.00	6,944,400
鳥居薬品	6,800	2,670.00	18,156,000
JCRファーマ	8,000	2,665.00	21,320,000
東和薬品	4,700	5,150.00	24,205,000
富士製薬工業	4,100	1,990.00	8,159,000
沢井製薬	17,400	7,240.00	125,976,000
ゼリア新薬工業	21,100	1,409.00	29,729,900
第一三共	344,900	2,673.50	922,090,150
キョーリン製薬ホールディングス	27,400	2,314.00	63,403,600
大幸薬品	5,700	1,486.00	8,470,200
ダイト	6,000	2,982.00	17,892,000
大塚ホールディングス	220,400	4,439.00	978,355,600
大正製薬ホールディングス	24,500	9,200.00	225,400,000
ペプチドリーム	17,100	6,410.00	109,611,000
日本コークス工業	95,700	80.00	7,656,000
昭和シェル石油	102,500	1,175.00	120,437,500
ニチレキ	13,100	809.00	10,597,900
東燃ゼネラル石油	153,000	1,068.00	163,404,000
ユシロ化学工業	6,400	1,259.00	8,057,600
ビーピー・カストロール	4,900	1,273.00	6,237,700
富士石油	25,800	345.00	8,901,000
MORESCO	4,200	1,206.00	5,065,200
出光興産	53,100	2,370.00	125,847,000

J Xホールディングス	1,210,000	480.90	581,889,000
コスモエネルギーホールディングス	30,900	1,416.00	43,754,400
横浜ゴム	62,000	1,946.00	120,652,000
東洋ゴム工業	46,600	1,695.00	78,987,000
ブリヂストン	346,000	4,245.00	1,468,770,000
住友ゴム工業	95,900	1,748.00	167,633,200
藤倉ゴム工業	12,200	448.00	5,465,600
オカモト	33,000	853.00	28,149,000
ニッタ	11,100	2,801.00	31,091,100
住友理工	22,100	982.00	21,702,200
三ツ星ベルト	25,000	882.00	22,050,000
バンドー化学	38,000	540.00	20,520,000
日東紡績	68,000	355.00	24,140,000
旭硝子	540,000	658.00	355,320,000
日本板硝子	503,000	91.00	45,773,000
日本山村硝子	54,000	168.00	9,072,000
日本電気硝子	212,000	604.00	128,048,000
住友大阪セメント	204,000	481.00	98,124,000
太平洋セメント	640,000	299.00	191,360,000
日本ヒューム	12,000	596.00	7,152,000
日本コンクリート工業	24,200	287.00	6,945,400
三谷セキサン	5,700	1,708.00	9,735,600
アジアパイルホールディングス	15,100	426.00	6,432,600
東海カーボン	88,000	298.00	26,224,000
日本カーボン	54,000	234.00	12,636,000
東洋炭素	6,400	1,430.00	9,152,000
ノリタケカンパニーリミテド	61,000	246.00	15,006,000
TOTO	75,200	3,875.00	291,400,000
日本碍子	130,000	2,257.00	293,410,000
日本特殊陶業	88,200	2,276.00	200,743,200
MARUWA	4,100	2,927.00	12,000,700
品川リフラクトリーズ	34,000	199.00	6,766,000
黒崎播磨	26,000	250.00	6,500,000
ニッカトー	11,200	377.00	4,222,400
フジミインコーポレーテッド	9,200	1,511.00	13,901,200
ニチアス	52,000	727.00	37,804,000
ニチハ	13,900	1,687.00	23,449,300
新日鐵住金	462,500	2,479.00	1,146,537,500
神戸製鋼所	1,880,000	118.00	221,840,000
中山製鋼所	128,000	68.00	8,704,000
合同製鐵	62,000	209.00	12,958,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	280,400	1,759.00	493,223,600

日新製鋼	47,000	1,433.00	67,351,000
東京製鐵	56,600	687.00	38,884,200
共英製鋼	11,000	1,762.00	19,382,000
大和工業	22,700	2,689.00	61,040,300
東京鐵鋼	25,000	380.00	9,500,000
大阪製鐵	6,700	1,764.00	11,818,800
淀川製鋼所	15,100	2,535.00	38,278,500
東洋鋼鋳	26,700	366.00	9,772,200
丸一鋼管	34,100	3,290.00	112,189,000
モリ工業	24,000	299.00	7,176,000
大同特殊鋼	174,000	398.00	69,252,000
日本冶金工業	80,200	147.00	11,789,400
山陽特殊製鋼	61,000	506.00	30,866,000
愛知製鋼	60,000	435.00	26,100,000
日立金属	117,400	1,273.00	149,450,200
大平洋金属	72,000	346.00	24,912,000
新日本電工	66,000	177.00	11,682,000
栗本鐵工所	56,000	165.00	9,240,000
三菱製鋼	74,000	187.00	13,838,000
日亜鋼業	22,800	244.00	5,563,200
シンニッタン	11,500	616.00	7,084,000
大紀アルミニウム工業所	23,000	286.00	6,578,000
日本軽金属ホールディングス	234,600	196.00	45,981,600
三井金属鋳業	266,000	210.00	55,860,000
東邦亜鉛	55,000	308.00	16,940,000
三菱マテリアル	639,000	365.00	233,235,000
住友金属鋳山	284,000	1,277.00	362,668,000
D O W A ホールディングス	133,000	723.00	96,159,000
古河機械金属	160,000	163.00	26,080,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	10,600	1,492.00	15,815,200
東邦チタニウム	18,500	771.00	14,263,500
U A C J	143,000	230.00	32,890,000
古河電気工業	326,000	271.00	88,346,000
住友電気工業	410,700	1,415.00	581,140,500
フジクラ	144,000	558.00	80,352,000
タツタ電線	25,300	359.00	9,082,700
平河ヒューテック	7,700	889.00	6,845,300
リョービ	63,000	423.00	26,649,000
アーレスティ	14,600	673.00	9,825,800
アサヒホールディングス	15,600	1,498.00	23,368,800
稲葉製作所	6,400	1,348.00	8,627,200
宮地エンジニアリンググループ	45,000	153.00	6,885,000

トーカロ	7,700	2,023.00	15,577,100
SUMCO	81,100	720.00	58,392,000
川田テクノロジーズ	2,600	3,410.00	8,866,000
東洋製罐グループホールディングス	72,700	2,281.00	165,828,700
ホッカンホールディングス	33,000	335.00	11,055,000
コロナ	7,100	1,082.00	7,682,200
横河ブリッジホールディングス	19,900	1,047.00	20,835,300
駒井ハルテック	27,000	240.00	6,480,000
三和ホールディングス	102,400	870.00	89,088,000
文化シャッター	28,600	953.00	27,255,800
三協立山	13,400	1,551.00	20,783,400
アルインコ	9,700	1,055.00	10,233,500
LIXILグループ	142,700	2,408.00	343,621,600
日本フィルコン	14,100	433.00	6,105,300
ノーリツ	20,200	1,886.00	38,097,200
長府製作所	10,900	2,615.00	28,503,500
リンナイ	19,000	9,960.00	189,240,000
日東精工	21,000	297.00	6,237,000
岡部	21,900	833.00	18,242,700
ジーテクト	11,400	1,199.00	13,668,600
東プレ	19,500	2,258.00	44,031,000
高周波熱錬	20,100	782.00	15,718,200
東京製網	79,000	153.00	12,087,000
パイオラックス	5,200	6,110.00	31,772,000
日本発條	97,000	1,013.00	98,261,000
三益半導体工業	9,200	1,074.00	9,880,800
日本製鋼所	172,000	443.00	76,196,000
三浦工業	46,000	2,112.00	97,152,000
タクマ	38,000	965.00	36,670,000
ツガミ	30,000	477.00	14,310,000
オークマ	67,000	907.00	60,769,000
東芝機械	55,000	351.00	19,305,000
アマダホールディングス	148,700	1,171.00	174,127,700
アイダエンジニアリング	26,600	1,044.00	27,770,400
滝澤鉄工所	47,000	124.00	5,828,000
富士機械製造	33,000	1,167.00	38,511,000
牧野フライス製作所	51,000	737.00	37,587,000
オーエスジー	46,800	2,111.00	98,794,800
旭ダイヤモンド工業	27,300	1,129.00	30,821,700
DMG森精機	56,900	1,308.00	74,425,200
ソディック	25,200	885.00	22,302,000
ディスコ	13,100	9,830.00	128,773,000

日東工器	6,100	2,209.00	13,474,900
OKK	57,000	111.00	6,327,000
津田駒工業	33,000	127.00	4,191,000
島精機製作所	14,500	1,875.00	27,187,500
NCホールディングス	4,000	1,280.00	5,120,000
フリー	2,300	2,817.00	6,479,100
日阪製作所	14,500	831.00	12,049,500
やまびこ	19,200	818.00	15,705,600
ペガサスミシン製造	12,500	506.00	6,325,000
ナプテスコ	53,300	2,574.00	137,194,200
三井海洋開発	12,000	1,685.00	20,220,000
レオン自動機	9,900	629.00	6,227,100
S M C	30,700	28,760.00	882,932,000
ホソカワミクロン	20,000	572.00	11,440,000
ユニオンツール	4,300	3,100.00	13,330,000
オイレス工業	13,200	1,820.00	24,024,000
日精エー・エス・ビー機械	3,600	2,170.00	7,812,000
サトーホールディングス	13,800	2,353.00	32,471,400
日精樹脂工業	9,000	671.00	6,039,000
ワイエイシイ	5,000	1,029.00	5,145,000
小松製作所	502,500	1,962.50	986,156,250
住友重機械工業	299,000	495.00	148,005,000
日立建機	45,800	1,890.00	86,562,000
日工	20,000	333.00	6,660,000
巴工業	5,500	1,489.00	8,189,500
井関農機	107,000	240.00	25,680,000
T O W A	11,600	719.00	8,340,400
丸山製作所	32,000	174.00	5,568,000
北川鉄工所	52,000	208.00	10,816,000
クボタ	492,000	1,725.00	848,700,000
三菱化工機	38,000	224.00	8,512,000
月島機械	19,300	946.00	18,257,800
帝国電機製作所	8,700	815.00	7,090,500
新東工業	23,400	950.00	22,230,000
澁谷工業	9,200	1,368.00	12,585,600
アイチ コーポレーション	15,400	874.00	13,459,600
小森コーポレーション	24,800	1,306.00	32,388,800
鶴見製作所	8,200	1,499.00	12,291,800
住友精密工業	21,000	334.00	7,014,000
荏原製作所	228,000	523.00	119,244,000
西島製作所	12,300	1,048.00	12,890,400
北越工業	12,900	700.00	9,030,000

ダイキン工業	142,600	9,163.00	1,306,643,800
オルガノ	22,000	428.00	9,416,000
トーヨーカネツ	58,000	237.00	13,746,000
栗田工業	61,600	2,702.00	166,443,200
椿本チエイン	58,000	756.00	43,848,000
大同工業	31,000	192.00	5,952,000
木村化工機	12,800	381.00	4,876,800
アネスト岩田	16,700	1,163.00	19,422,100
ダイフク	52,700	2,014.00	106,137,800
加藤製作所	25,000	441.00	11,025,000
タダノ	47,700	1,116.00	53,233,200
フジテック	28,500	1,153.00	32,860,500
C K D	27,300	943.00	25,743,900
キトー	13,900	788.00	10,953,200
平和	29,800	2,372.00	70,685,600
理想科学工業	10,700	1,769.00	18,928,300
S A N K Y O	27,200	4,325.00	117,640,000
日本金銭機械	9,800	930.00	9,114,000
マースエンジニアリング	6,000	1,984.00	11,904,000
福島工業	6,000	2,486.00	14,916,000
ダイコク電機	4,900	1,323.00	6,482,700
竹内製作所	19,100	1,745.00	33,329,500
アマノ	29,900	1,795.00	53,670,500
J U K I	15,100	1,013.00	15,296,300
サンデンホールディングス	60,000	335.00	20,100,000
蛇の目マシン工業	11,400	617.00	7,033,800
マックス	15,000	1,162.00	17,430,000
グローリー	33,500	3,770.00	126,295,000
新晃工業	7,200	1,505.00	10,836,000
大和冷機工業	15,500	937.00	14,523,500
セガサミーホールディングス	105,200	1,263.00	132,867,600
日本ピストンリング	5,100	1,509.00	7,695,900
リケン	46,000	369.00	16,974,000
T P R	11,900	2,881.00	34,283,900
ツバキ・ナカシマ	11,800	1,467.00	17,310,600
ホシザキ電機	21,400	9,480.00	202,872,000
大豊工業	8,700	1,101.00	9,578,700
日本精工	200,700	1,034.00	207,523,800
N T N	243,000	365.00	88,695,000
ジェイテクト	104,100	1,552.00	161,563,200
不二越	93,000	376.00	34,968,000
日本トムソン	34,500	416.00	14,352,000

THK	65,200	2,292.00	149,438,400
ユーシン精機	4,300	1,963.00	8,440,900
前澤給装工業	5,200	1,449.00	7,534,800
イーグル工業	12,100	1,562.00	18,900,200
日本ピラー工業	11,000	962.00	10,582,000
キッツ	43,700	469.00	20,495,300
日立工機	25,300	776.00	19,632,800
マキタ	63,700	7,130.00	454,181,000
日立造船	79,100	571.00	45,166,100
三菱重工業	1,744,000	421.80	735,619,200
IHI	753,000	254.00	191,262,000
日清紡ホールディングス	54,600	1,258.00	68,686,800
イビデン	60,200	1,469.00	88,433,800
コニカミノルタ	244,200	1,026.00	250,549,200
ブラザー工業	126,300	1,350.00	170,505,000
ミネベア	156,000	940.00	146,640,000
日立製作所	2,497,000	539.10	1,346,132,700
東芝	2,063,000	241.90	499,039,700
三菱電機	1,044,000	1,235.50	1,289,862,000
富士電機	295,000	408.00	120,360,000
東洋電機製造	23,000	319.00	7,337,000
安川電機	121,600	1,389.00	168,902,400
シンフォニアテクノロジー	71,000	151.00	10,721,000
明電舎	90,000	476.00	42,840,000
オリジン電気	21,000	278.00	5,838,000
山洋電気	26,000	515.00	13,390,000
デンヨー	10,200	1,256.00	12,811,200
東芝テック	70,000	431.00	30,170,000
マブチモーター	27,900	5,500.00	153,450,000
日本電産	117,800	8,164.00	961,719,200
東光高岳	6,000	1,630.00	9,780,000
ダブル・スコープ	4,000	5,500.00	22,000,000
ダイヘン	58,000	559.00	32,422,000
田淵電機	12,400	494.00	6,125,600
JVCケンウッド	73,200	285.00	20,862,000
ミマキエンジニアリング	10,100	549.00	5,544,900
第一精工	4,700	1,239.00	5,823,300
日新電機	23,200	1,266.00	29,371,200
大崎電気工業	17,000	793.00	13,481,000
オムロン	110,400	3,575.00	394,680,000
日東工業	15,600	1,756.00	27,393,600
IDEC	13,400	1,038.00	13,909,200

ジーエス・ユアサ コーポレーション	190,000	465.00	88,350,000
サクサホールディングス	28,000	216.00	6,048,000
メルコホールディングス	5,700	2,201.00	12,545,700
テクノメディカ	2,700	2,395.00	6,466,500
日本電気	1,345,000	279.00	375,255,000
富士通	945,000	413.20	390,474,000
沖電気工業	427,000	159.00	67,893,000
電気興業	25,000	504.00	12,600,000
サンケン電気	54,000	384.00	20,736,000
アイホン	6,100	1,801.00	10,986,100
ルネサスエレクトロニクス	50,600	706.00	35,723,600
セイコーエプソン	145,600	1,943.00	282,900,800
ワコム	77,200	469.00	36,206,800
アルバック	18,000	3,675.00	66,150,000
E I Z O	9,700	2,791.00	27,072,700
ジャパンディスプレイ	185,000	222.00	41,070,000
日本信号	27,000	923.00	24,921,000
京三製作所	29,000	357.00	10,353,000
能美防災	11,000	1,610.00	17,710,000
ホーチキ	8,000	1,271.00	10,168,000
エレコム	8,700	1,896.00	16,495,200
日本無線	32,000	282.00	9,024,000
パナソニック	1,118,500	1,038.00	1,161,003,000
シャープ	761,000	152.00	115,672,000
アンリツ	60,400	638.00	38,535,200
富士通ゼネラル	30,000	1,894.00	56,820,000
日立国際電気	22,100	1,105.00	24,420,500
ソニー	690,900	2,850.00	1,969,065,000
T D K	59,000	6,790.00	400,610,000
ミツミ電機	36,900	558.00	20,590,200
タムラ製作所	41,000	300.00	12,300,000
アルプス電気	84,400	1,831.00	154,536,400
池上通信機	42,000	138.00	5,796,000
パイオニア	158,800	299.00	47,481,200
日本電波工業	11,500	719.00	8,268,500
日本トリム	2,700	6,200.00	16,740,000
ローランド ディー . ジー .	5,200	2,215.00	11,518,000
フォスター電機	12,300	2,346.00	28,855,800
クラリオン	52,000	334.00	17,368,000
S M K	30,000	558.00	16,740,000
ヨコオ	9,200	513.00	4,719,600
東光	22,000	413.00	9,086,000

ホシデン	30,200	726.00	21,925,200
ヒロセ電機	15,800	13,830.00	218,514,000
日本航空電子工業	28,000	1,275.00	35,700,000
TOA	11,700	1,123.00	13,139,100
日立マクセル	16,200	1,745.00	28,269,000
古野電気	13,200	648.00	8,553,600
ユニデンホールディングス	43,000	129.00	5,547,000
アルパイン	23,200	1,257.00	29,162,400
スミダコーポレーション	9,700	718.00	6,964,600
アイコム	6,000	2,168.00	13,008,000
リオン	4,500	1,649.00	7,420,500
船井電機	10,900	1,030.00	11,227,000
横河電機	98,100	1,270.00	124,587,000
新電元工業	36,000	408.00	14,688,000
アズビル	32,100	2,924.00	93,860,400
日本光電工業	41,000	2,881.00	118,121,000
チノー	6,000	1,006.00	6,036,000
共和電業	16,700	402.00	6,713,400
堀場製作所	18,200	4,275.00	77,805,000
アドバンテスト	67,400	1,115.00	75,151,000
エスベック	10,400	1,514.00	15,745,600
パナソニック デバイスSUNX	10,500	603.00	6,331,500
キーエンス	22,200	67,180.00	1,491,396,000
日置電機	5,700	2,382.00	13,577,400
シスメックス	75,900	7,200.00	546,480,000
日本マイクロニクス	18,500	1,021.00	18,888,500
メガチップス	10,900	1,152.00	12,556,800
OBARA GROUP	5,800	4,140.00	24,012,000
コーセル	13,300	1,063.00	14,137,900
新日本無線	9,100	445.00	4,049,500
オブテックス	7,300	3,600.00	26,280,000
千代田インテグレ	5,400	2,294.00	12,387,600
レーザーテック	11,700	1,477.00	17,280,900
スタンレー電気	70,000	2,449.00	171,430,000
岩崎電気	40,000	191.00	7,640,000
ウシオ電機	59,700	1,586.00	94,684,200
ヘリオス テクノ ホールディング	13,100	387.00	5,069,700
日本セラミック	6,100	1,999.00	12,193,900
遠藤照明	6,600	958.00	6,322,800
日本デジタル研究所	8,500	1,513.00	12,860,500
古河電池	8,000	692.00	5,536,000
山一電機	10,000	574.00	5,740,000

図研	8,000	1,053.00	8,424,000
日本電子	38,000	505.00	19,190,000
カシオ計算機	98,100	2,165.00	212,386,500
ファナック	100,200	18,930.00	1,896,786,000
日本シイエムケイ	23,600	411.00	9,699,600
エンプラス	5,100	3,250.00	16,575,000
大真空	26,000	249.00	6,474,000
ローム	48,200	5,050.00	243,410,000
浜松ホトニクス	76,200	3,160.00	240,792,000
三井ハイテック	15,100	693.00	10,464,300
新光電気工業	36,200	641.00	23,204,200
京セラ	160,700	5,517.00	886,581,900
太陽誘電	48,000	1,130.00	54,240,000
村田製作所	102,700	15,370.00	1,578,499,000
ユーシン	14,400	706.00	10,166,400
双葉電子工業	16,000	1,695.00	27,120,000
北陸電気工業	48,000	137.00	6,576,000
ニチコン	30,500	760.00	23,180,000
日本ケミコン	84,000	148.00	12,432,000
K O A	14,500	788.00	11,426,000
市光工業	27,000	244.00	6,588,000
小糸製作所	58,500	4,795.00	280,507,500
ミツバ	16,800	1,661.00	27,904,800
スター精密	18,600	1,311.00	24,384,600
S C R E E Nホールディングス	101,000	894.00	90,294,000
キャノン電子	8,400	1,628.00	13,675,200
キャノン	526,900	3,381.00	1,781,448,900
リコー	316,100	1,192.00	376,791,200
東京エレクトロン	80,400	7,645.00	614,658,000
トヨタ紡織	34,600	1,940.00	67,124,000
ユニプレス	20,900	1,965.00	41,068,500
豊田自動織機	88,800	5,050.00	448,440,000
モリタホールディングス	17,700	1,342.00	23,753,400
三櫻工業	17,000	611.00	10,387,000
デンソー	241,800	4,518.00	1,092,452,400
東海理化電機製作所	29,000	2,064.00	59,856,000
三井造船	386,000	176.00	67,936,000
川崎重工業	762,000	334.00	254,508,000
名村造船所	29,900	859.00	25,684,100
日本車輛製造	46,000	278.00	12,788,000
ニチユ三菱フォークリフト	13,100	505.00	6,615,500
近畿車輛	22,000	323.00	7,106,000

日産自動車	1,366,500	1,049.50	1,434,141,750	
いすゞ自動車	284,500	1,289.50	366,862,750	
トヨタ自動車	1,217,900	5,949.00	7,245,287,100	代用有価証券 500,000株
日野自動車	139,500	1,259.00	175,630,500	
三菱自動車工業	389,500	434.00	169,043,000	
エフテック	7,200	1,081.00	7,783,200	
武蔵精密工業	10,700	2,189.00	23,422,300	
日産車体	48,300	1,172.00	56,607,600	
新明和工業	43,000	806.00	34,658,000	
極東開発工業	20,000	1,127.00	22,540,000	
日信工業	21,900	1,541.00	33,747,900	
トピー工業	83,000	221.00	18,343,000	
ティラド	53,000	173.00	9,169,000	
曙ブレーキ工業	53,300	295.00	15,723,500	
タチエス	16,000	1,557.00	24,912,000	
N O K	47,700	1,952.00	93,110,400	
フタバ産業	31,300	449.00	14,053,700	
K Y B	110,000	348.00	38,280,000	
大同メタル工業	15,500	833.00	12,911,500	
プレス工業	53,600	387.00	20,743,200	
ミクニ	18,600	355.00	6,603,000	
カルソニックカンセイ	74,000	791.00	58,534,000	
太平洋工業	22,600	1,015.00	22,939,000	
ケーヒン	22,600	1,670.00	37,742,000	
河西工業	12,700	1,124.00	14,274,800	
アイシン精機	100,100	4,285.00	428,928,500	
富士機工	14,500	457.00	6,626,500	
マツダ	310,600	1,813.00	563,117,800	
ダイハツ工業	117,000	1,559.00	182,403,000	
今仙電機製作所	10,800	995.00	10,746,000	
本田技研工業	880,900	3,165.00	2,788,048,500	
スズキ	179,300	3,076.00	551,526,800	
富士重工業	309,200	3,894.00	1,204,024,800	
ヤマハ発動機	138,300	1,972.00	272,727,600	
ショーワ	25,700	989.00	25,417,300	
T B K	18,000	390.00	7,020,000	
エクセディ	12,900	2,586.00	33,359,400	
豊田合成	35,900	2,127.00	76,359,300	
愛三工業	18,000	907.00	16,326,000	
ヨロズ	9,500	2,279.00	21,650,500	
エフ・シー・シー	16,100	1,866.00	30,042,600	
シマノ	39,400	17,490.00	689,106,000	

テイ・エス テック	22,900	2,578.00	59,036,200
ジャムコ	6,000	2,897.00	17,382,000
テルモ	150,300	4,380.00	658,314,000
日機装	35,300	862.00	30,428,600
島津製作所	126,000	1,748.00	220,248,000
JMS	26,000	292.00	7,592,000
ブイ・テクノロジー	2,500	4,645.00	11,612,500
東京計器	39,000	159.00	6,201,000
愛知時計電機	21,000	305.00	6,405,000
東京精密	18,700	2,346.00	43,870,200
マニー	13,100	1,848.00	24,208,800
ニコン	182,500	1,656.00	302,220,000
トプコン	32,800	1,454.00	47,691,200
オリンパス	145,700	4,535.00	660,749,500
理研計器	9,300	1,090.00	10,137,000
タムロン	7,900	1,844.00	14,567,600
H O Y A	221,400	4,412.00	976,816,800
ノーリツ鋼機	9,700	639.00	6,198,300
シチズンホールディングス	120,800	659.00	79,607,200
リズム時計工業	52,000	151.00	7,852,000
大研医器	8,900	893.00	7,947,700
メニコン	6,600	3,660.00	24,156,000
松風	6,000	1,392.00	8,352,000
セイコーホールディングス	63,000	414.00	26,082,000
ニプロ	73,600	1,105.00	81,328,000
スノーピーク	1,200	3,580.00	4,296,000
パラマウントベッドホールディングス	10,300	4,170.00	42,951,000
ニホンフラッシュ	4,800	1,032.00	4,953,600
前田工織	10,600	1,179.00	12,497,400
永大産業	18,000	416.00	7,488,000
アートネイチャー	11,600	919.00	10,660,400
ダンロップスポーツ	7,600	1,024.00	7,782,400
バンダイナムコホールディングス	101,100	2,423.00	244,965,300
S H O E I	5,200	1,691.00	8,793,200
フランスベッドホールディングス	13,500	1,022.00	13,797,000
パイロットコーポレーション	17,200	4,350.00	74,820,000
萩原工業	3,100	2,560.00	7,936,000
トッパン・フォームズ	16,500	1,251.00	20,641,500
フジシールインターナショナル	11,900	3,780.00	44,982,000
タカラトミー	31,600	792.00	25,027,200
アーケ	49,300	87.00	4,289,100
プロネクサス	10,200	1,098.00	11,199,600

ウッドワン	29,000	255.00	7,395,000
大建工業	42,000	321.00	13,482,000
凸版印刷	274,000	978.00	267,972,000
大日本印刷	288,000	1,079.00	310,752,000
図書印刷	19,000	550.00	10,450,000
共同印刷	36,000	330.00	11,880,000
日本写真印刷	16,000	1,752.00	28,032,000
宝印刷	5,900	1,381.00	8,147,900
アシックス	91,300	2,266.00	206,885,800
ツツミ	5,000	2,372.00	11,860,000
小松ウオール工業	4,000	1,720.00	6,880,000
ヤマハ	71,800	3,300.00	236,940,000
河合楽器製作所	4,500	2,032.00	9,144,000
クリナップ	12,900	767.00	9,894,300
ピジョン	55,500	2,976.00	165,168,000
キングジム	10,700	853.00	9,127,100
リンテック	23,500	2,211.00	51,958,500
T A S A K I	2,300	1,602.00	3,684,600
イトーキ	20,000	740.00	14,800,000
任天堂	60,300	16,665.00	1,004,899,500
三菱鉛筆	7,200	5,260.00	37,872,000
タカラスタANDARD	40,000	984.00	39,360,000
コクヨ	51,100	1,479.00	75,576,900
ナカバヤシ	25,000	279.00	6,975,000
グローブライド	5,600	1,365.00	7,644,000
岡村製作所	33,700	1,038.00	34,980,600
美津濃	52,000	540.00	28,080,000
アデランス	18,800	572.00	10,753,600
東京電力ホールディングス	829,800	606.00	502,858,800
中部電力	300,000	1,496.00	448,800,000
関西電力	400,200	995.80	398,519,160
中国電力	134,600	1,453.00	195,573,800
北陸電力	96,000	1,558.00	149,568,000
東北電力	244,000	1,377.00	335,988,000
四国電力	88,300	1,440.00	127,152,000
九州電力	216,100	1,113.00	240,519,300
北海道電力	91,000	934.00	84,994,000
沖縄電力	10,400	2,853.00	29,671,200
電源開発	83,300	3,425.00	285,302,500
イーレックス	3,200	1,454.00	4,652,800
東京瓦斯	1,093,000	503.20	549,997,600
大阪瓦斯	1,015,000	416.60	422,849,000

東邦瓦斯	246,000	753.00	185,238,000
北海道瓦斯	32,000	276.00	8,832,000
広島ガス	20,500	357.00	7,318,500
西部瓦斯	110,000	255.00	28,050,000
静岡ガス	27,800	761.00	21,155,800
メタウォーター	6,300	2,814.00	17,728,200
SBSホールディングス	10,900	707.00	7,706,300
東武鉄道	522,000	577.00	301,194,000
相鉄ホールディングス	168,000	727.00	122,136,000
東京急行電鉄	569,000	995.00	566,155,000
京浜急行電鉄	268,000	1,022.00	273,896,000
小田急電鉄	313,000	1,277.00	399,701,000
京王電鉄	272,000	1,023.00	278,256,000
京成電鉄	146,000	1,613.00	235,498,000
富士急行	27,000	1,458.00	39,366,000
新京成電鉄	19,000	442.00	8,398,000
東日本旅客鉄道	178,900	10,230.00	1,830,147,000
西日本旅客鉄道	94,300	6,979.00	658,119,700
東海旅客鉄道	87,600	20,615.00	1,805,874,000
西武ホールディングス	104,000	2,405.00	250,120,000
鴻池運輸	13,600	1,287.00	17,503,200
西日本鉄道	127,000	693.00	88,011,000
ハマキョウレックス	7,700	1,983.00	15,269,100
サカイ引越センター	4,100	2,665.00	10,926,500
近鉄グループホールディングス	982,000	467.00	458,594,000
阪急阪神ホールディングス	655,000	728.00	476,840,000
南海電気鉄道	221,000	600.00	132,600,000
京阪ホールディングス	220,000	837.00	184,140,000
神戸電鉄	31,000	367.00	11,377,000
名古屋鉄道	355,000	571.00	202,705,000
山陽電気鉄道	37,000	505.00	18,685,000
日本通運	377,000	525.00	197,925,000
ヤマトホールディングス	175,100	2,317.50	405,794,250
山九	130,000	518.00	67,340,000
丸全昭和運輸	33,000	413.00	13,629,000
センコー	43,700	710.00	31,027,000
トナミホールディングス	25,000	290.00	7,250,000
ニッコンホールディングス	31,300	2,094.00	65,542,200
福山通運	61,000	570.00	34,770,000
セイノーホールディングス	69,400	1,198.00	83,141,200
神奈川中央交通	14,000	646.00	9,044,000
日立物流	19,900	1,900.00	37,810,000

丸和運輸機関	3,200	2,701.00	8,643,200
C & F ロジホールディングス	11,400	825.00	9,405,000
日本郵船	877,000	233.00	204,341,000
商船三井	478,000	257.00	122,846,000
川崎汽船	430,000	240.00	103,200,000
N S ユナイテッド海運	53,000	158.00	8,374,000
飯野海運	52,600	448.00	23,564,800
乾汽船	9,700	899.00	8,720,300
日本航空	187,200	4,072.00	762,278,400
A N A ホールディングス	1,818,000	315.70	573,942,600
パスコ	11,000	391.00	4,301,000
トランコム	2,900	5,990.00	17,371,000
日新	42,000	322.00	13,524,000
三菱倉庫	70,000	1,585.00	110,950,000
三井倉庫ホールディングス	59,000	300.00	17,700,000
住友倉庫	73,000	565.00	41,245,000
澁澤倉庫	34,000	284.00	9,656,000
東陽倉庫	27,000	237.00	6,399,000
日本トランスシティ	27,000	369.00	9,963,000
安田倉庫	10,400	717.00	7,456,800
東洋埠頭	39,000	150.00	5,850,000
上組	116,000	1,062.00	123,192,000
キューソー流通システム	3,000	2,722.00	8,166,000
郵船ロジスティクス	9,300	1,331.00	12,378,300
近鉄エクスプレス	17,300	1,469.00	25,413,700
東海運	15,300	273.00	4,176,900
エーアイティー	7,400	916.00	6,778,400
N E C ネットエスアイ	11,900	1,746.00	20,777,400
システナ	9,700	1,675.00	16,247,500
デジタルアーツ	5,100	2,225.00	11,347,500
新日鉄住金ソリューションズ	16,000	2,014.00	32,224,000
コア	4,900	1,206.00	5,909,400
I T ホールディングス	32,200	2,631.00	84,718,200
電算システム	4,200	1,615.00	6,783,000
グリー	58,400	637.00	37,200,800
コーエーテクモホールディングス	22,700	1,682.00	38,181,400
三菱総合研究所	4,000	3,180.00	12,720,000
ファインデックス	6,800	1,379.00	9,377,200
ヒト・コミュニケーションズ	2,500	2,019.00	5,047,500
K L a b	16,000	635.00	10,160,000
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	7,500	935.00	7,012,500
ネクソン	92,800	1,722.00	159,801,600

アイスタイル	15,600	868.00	13,540,800
エイチーム	5,700	1,631.00	9,296,700
テクノスジャパン	2,400	3,005.00	7,212,000
コロプラ	26,900	2,450.00	65,905,000
モバイルクリエイト	9,200	455.00	4,186,000
ブロードリーフ	10,600	1,128.00	11,956,800
ハーツユナイテッドグループ	3,100	2,482.00	7,694,200
メディアドゥ	2,500	1,759.00	4,397,500
ブイキューブ	7,000	1,197.00	8,379,000
VOYAGE GROUP	3,900	1,396.00	5,444,400
オブティム	900	5,320.00	4,788,000
ベリサーブ	1,300	4,760.00	6,188,000
ティーガイア	9,700	1,375.00	13,337,500
日本アジアグループ	12,700	509.00	6,464,300
豆蔵ホールディングス	9,400	670.00	6,298,000
テクマトリックス	4,700	1,934.00	9,089,800
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	224,000	298.00	66,752,000
GMOペイメントゲートウェイ	8,000	7,100.00	56,800,000
インターネットイニシアティブ	15,700	2,253.00	35,372,100
さくらインターネット	6,100	1,275.00	7,777,500
GMOクラウド	2,900	1,260.00	3,654,000
SRAホールディングス	5,800	2,620.00	15,196,000
朝日ネット	14,300	482.00	6,892,600
コムチュア	2,000	2,545.00	5,090,000
gumi	11,000	905.00	9,955,000
フェイス	4,100	1,311.00	5,375,100
野村総合研究所	67,600	4,030.00	272,428,000
サイバネットシステム	9,500	732.00	6,954,000
インタージホールディングス	6,300	1,428.00	8,996,400
クレスコ	3,000	1,758.00	5,274,000
フジ・メディア・ホールディングス	100,700	1,278.00	128,694,600
オービック	33,300	5,910.00	196,803,000
ジャストシステム	17,900	920.00	16,468,000
ヤフー	692,000	500.00	346,000,000
トレンドマイクロ	46,900	4,300.00	201,670,000
日本オラクル	15,500	6,000.00	93,000,000
アルファシステムズ	4,000	1,749.00	6,996,000
フューチャー	12,900	805.00	10,384,500
CAC Holdings	9,700	854.00	8,283,800
ソフトバンク・テクノロジー	3,300	1,751.00	5,778,300
オービックビジネスコンサルタント	4,900	4,600.00	22,540,000
伊藤忠テクノソリューションズ	22,100	2,205.00	48,730,500

アイティフォー	15,600	502.00	7,831,200
大塚商会	25,900	5,500.00	142,450,000
サイボウズ	19,500	350.00	6,825,000
電通国際情報サービス	6,300	2,034.00	12,814,200
E Mシステムズ	4,600	1,228.00	5,648,800
ウェザーニューズ	3,600	3,700.00	13,320,000
C I J	14,700	468.00	6,879,600
日本エンタープライズ	12,400	257.00	3,186,800
WOWOW	4,900	2,418.00	11,848,200
フュージョンパートナー	8,200	529.00	4,337,800
イマジカ・ロボット ホールディングス	11,100	391.00	4,340,100
ネットワンシステムズ	42,200	580.00	24,476,000
アルゴグラフィックス	5,500	1,762.00	9,691,000
マーベラス	16,800	920.00	15,456,000
エイベックス・グループ・ホールディングス	18,000	1,433.00	25,794,000
日本ユニシス	26,600	1,367.00	36,362,200
兼松エレクトロニクス	6,600	1,919.00	12,665,400
東京放送ホールディングス	58,100	1,608.00	93,424,800
日本テレビホールディングス	88,200	1,863.00	164,316,600
朝日放送	11,400	671.00	7,649,400
テレビ朝日ホールディングス	26,700	1,902.00	50,783,400
スカパーJ S A Tホールディングス	72,500	615.00	44,587,500
テレビ東京ホールディングス	9,000	1,960.00	17,640,000
U - N E X T	3,700	975.00	3,607,500
ワイヤレスゲート	3,200	2,118.00	6,777,600
コネクシオ	9,200	1,252.00	11,518,400
日本通信	71,400	216.00	15,422,400
日本電信電話	746,900	4,941.00	3,690,432,900
K D D I	981,400	3,238.00	3,177,773,200
光通信	11,600	8,320.00	96,512,000
N T T ドコモ	721,800	2,658.50	1,918,905,300
エムティーアイ	15,600	786.00	12,261,600
G M O インターネット	35,300	1,325.00	46,772,500
カドカワ	30,100	1,586.00	47,738,600
学研ホールディングス	38,000	252.00	9,576,000
ゼンリン	13,000	2,431.00	31,603,000
アイネット	7,400	1,175.00	8,695,000
松竹	66,000	1,092.00	72,072,000
東宝	68,700	2,923.00	200,810,100
東映	36,000	859.00	30,924,000
A O I P r o .	7,000	859.00	6,013,000
エヌ・ティ・ティ・データ	59,700	5,930.00	354,021,000

D T S	10,700	2,261.00	24,192,700
スクウェア・エニックス・ホールディングス	41,000	2,939.00	120,499,000
シーイーシー	6,800	1,768.00	12,022,400
カプコン	25,100	2,578.00	64,707,800
ジャステック	8,000	942.00	7,536,000
S C S K	23,000	4,070.00	93,610,000
アイネス	14,200	1,139.00	16,173,800
T K C	8,900	3,020.00	26,878,000
富士ソフト	14,300	2,553.00	36,507,900
N S D	20,000	1,742.00	34,840,000
コナミホールディングス	43,700	3,520.00	153,824,000
福井コンピュータホールディングス	3,300	1,460.00	4,818,000
J B C Cホールディングス	11,400	686.00	7,820,400
ミロク情報サービス	7,900	1,105.00	8,729,500
ソフトバンクグループ	547,500	6,277.00	3,436,657,500
伊藤忠食品	2,600	4,175.00	10,855,000
エレマテック	5,000	2,029.00	10,145,000
J A L U X	3,800	2,102.00	7,987,600
あらた	4,600	2,491.00	11,458,600
東京エレクトロン デバイス	5,200	1,505.00	7,826,000
フィールズ	8,800	1,857.00	16,341,600
双日	609,100	229.00	139,483,900
アルフレッサ ホールディングス	121,000	2,204.00	266,684,000
横浜冷凍	24,000	1,080.00	25,920,000
ラクーン	5,200	589.00	3,062,800
アルコニックス	6,500	1,609.00	10,458,500
神戸物産	6,400	2,401.00	15,366,400
あい ホールディングス	17,100	3,115.00	53,266,500
ダイワボウホールディングス	88,000	218.00	19,184,000
マクニカ・富士エレホールディングス	17,000	1,307.00	22,219,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	16,900	951.00	16,071,900
U K Cホールディングス	6,500	2,055.00	13,357,500
T O K A Iホールディングス	43,200	600.00	25,920,000
三洋貿易	6,000	1,484.00	8,904,000
ウイン・パートナーズ	3,900	1,493.00	5,822,700
シップヘルスケアホールディングス	19,600	2,792.00	54,723,200
小野建	9,400	1,157.00	10,875,800
佐島電機	10,700	746.00	7,982,200
伯東	9,100	926.00	8,426,600
コンドーテック	9,300	894.00	8,314,200
ナガイレーベン	14,000	2,227.00	31,178,000
三菱食品	10,300	2,884.00	29,705,200

松田産業	7,700	1,196.00	9,209,200
第一興商	17,100	4,620.00	79,002,000
メディカルホールディングス	96,400	1,855.00	178,822,000
アドヴァン	11,100	1,036.00	11,499,600
S P K	3,600	2,012.00	7,243,200
萩原電気	4,200	1,930.00	8,106,000
アズワン	7,600	4,055.00	30,818,000
尾家産業	6,500	875.00	5,687,500
シモジマ	7,600	1,139.00	8,656,400
ドウシシャ	11,200	2,055.00	23,016,000
小津産業	3,100	2,220.00	6,882,000
高速	8,800	873.00	7,682,400
黒田電気	18,000	1,713.00	30,834,000
丸文	10,800	770.00	8,316,000
ハピネット	9,800	951.00	9,319,800
エクセル	5,500	1,433.00	7,881,500
マルカキカイ	4,500	1,334.00	6,003,000
ガリバーインターナショナル	26,100	1,087.00	28,370,700
日本エム・ディ・エム	9,400	752.00	7,068,800
進和	6,900	1,465.00	10,108,500
シークス	6,200	3,205.00	19,871,000
オーハシテクニカ	6,800	1,212.00	8,241,600
伊藤忠商事	758,300	1,443.00	1,094,226,900
丸紅	952,500	604.10	575,405,250
長瀬産業	58,300	1,285.00	74,915,500
蝶理	7,000	1,592.00	11,144,000
豊田通商	107,000	2,712.00	290,184,000
三共生興	21,200	381.00	8,077,200
兼松	204,000	168.00	34,272,000
三井物産	874,000	1,387.00	1,212,238,000
日本紙パルプ商事	50,000	328.00	16,400,000
日立ハイテクノロジーズ	33,500	3,165.00	106,027,500
カメイ	13,300	1,019.00	13,552,700
スターゼン	4,000	3,205.00	12,820,000
山善	36,800	901.00	33,156,800
住友商事	609,000	1,211.50	737,803,500
内田洋行	27,000	452.00	12,204,000
三菱商事	725,000	1,912.50	1,386,562,500
第一実業	25,000	513.00	12,825,000
キャノンマーケティングジャパン	27,700	2,110.00	58,447,000
西華産業	40,000	229.00	9,160,000
佐藤商事	12,600	660.00	8,316,000

菱洋エレクトロ	11,200	1,325.00	14,840,000
東京産業	15,200	389.00	5,912,800
ユアサ商事	9,000	2,561.00	23,049,000
阪和興業	98,000	505.00	49,490,000
カナデン	11,500	855.00	9,832,500
菱電商事	17,000	651.00	11,067,000
フルサト工業	6,000	1,698.00	10,188,000
岩谷産業	116,000	650.00	75,400,000
すてきナイスグループ	54,000	140.00	7,560,000
極東貿易	21,000	221.00	4,641,000
三愛石油	23,800	823.00	19,587,400
稲畑産業	22,900	1,113.00	25,487,700
G S I クレオス	39,000	114.00	4,446,000
ワキタ	21,100	780.00	16,458,000
東邦ホールディングス	31,100	2,626.00	81,668,600
サンゲツ	34,100	2,050.00	69,905,000
ミツウロコグループホールディングス	18,200	546.00	9,937,200
シナネンホールディングス	26,000	428.00	11,128,000
伊藤忠エネクス	24,600	916.00	22,533,600
サンリオ	30,200	2,207.00	66,651,400
サンワテクノス	9,200	721.00	6,633,200
リョーサン	15,200	2,725.00	41,420,000
新光商事	12,500	1,126.00	14,075,000
トーヨー	5,200	2,468.00	12,833,600
三信電気	14,400	918.00	13,219,200
東陽テクニカ	13,300	1,143.00	15,201,900
モスフードサービス	12,500	2,896.00	36,200,000
加賀電子	9,600	1,340.00	12,864,000
ソーダニッカ	16,400	462.00	7,576,800
立花エレテック	8,300	1,214.00	10,076,200
P A L T A C	15,300	1,928.00	29,498,400
三谷産業	14,100	349.00	4,920,900
太平洋興発	80,000	74.00	5,920,000
ヤマタネ	58,000	152.00	8,816,000
日鉄住金物産	83,000	389.00	32,287,000
トラスコ中山	10,900	4,360.00	47,524,000
オートバックスセブン	37,400	1,913.00	71,546,200
加藤産業	14,800	2,765.00	40,922,000
イノテック	14,200	440.00	6,248,000
イエローハット	9,100	2,280.00	20,748,000
J Kホールディングス	13,700	474.00	6,493,800
日伝	4,400	2,997.00	13,186,800

杉本商事	7,000	1,217.00	8,519,000
因幡電機産業	13,300	3,575.00	47,547,500
バイテックホールディングス	5,200	961.00	4,997,200
ミスミグループ本社	108,600	1,639.00	177,995,400
タキヒヨー	22,000	426.00	9,372,000
スズケン	43,900	3,965.00	174,063,500
ジェコス	7,700	1,027.00	7,907,900
ローソン	36,600	8,590.00	314,394,000
サンエー	6,500	5,130.00	33,345,000
カワチ薬品	7,700	2,095.00	16,131,500
エービーシー・マート	12,600	7,160.00	90,216,000
ハードオフコーポレーション	5,800	1,513.00	8,775,400
アスクル	11,800	4,440.00	52,392,000
ゲオホールディングス	16,300	1,833.00	29,877,900
アダストリア	17,900	3,775.00	67,572,500
ジーフット	7,100	780.00	5,538,000
くらコーポレーション	5,700	4,740.00	27,018,000
キャンドウ	6,600	1,621.00	10,698,600
パル	5,800	2,537.00	14,714,600
エディオン	40,500	902.00	36,531,000
サーラコーポレーション	11,900	561.00	6,675,900
ハローズ	3,600	2,331.00	8,391,600
あみやき亭	2,300	4,225.00	9,717,500
ひらまつ	15,300	705.00	10,786,500
ゲンキー	2,200	3,500.00	7,700,000
大黒天物産	2,600	4,900.00	12,740,000
ハニーズ	9,500	1,120.00	10,640,000
アルペン	8,700	1,878.00	16,338,600
クオール	10,200	1,575.00	16,065,000
ジェイアイエヌ	6,600	4,015.00	26,499,000
ビックカメラ	55,200	1,105.00	60,996,000
D C Mホールディングス	47,800	837.00	40,008,600
MonotaRO	34,300	3,330.00	114,219,000
アーランドサービス	3,300	2,980.00	9,834,000
J.フロント リテイリング	122,200	1,444.00	176,456,800
ドトール・日レスホールディングス	16,900	1,957.00	33,073,300
マツモトキヨシホールディングス	20,000	5,460.00	109,200,000
ブロンコビリー	5,300	3,030.00	16,059,000
スタートトゥデイ	29,600	4,645.00	137,492,000
トレジャー・ファクトリー	3,600	1,113.00	4,006,800
物語コーポレーション	2,700	5,190.00	14,013,000
ココカラファイン	10,000	4,940.00	49,400,000

三越伊勢丹ホールディングス	192,000	1,251.00	240,192,000
ウエルシアホールディングス	8,200	5,990.00	49,118,000
クリエイトSDホールディングス	14,200	2,682.00	38,084,400
チムニー	2,800	2,923.00	8,184,400
シュッピン	4,200	1,382.00	5,804,400
ジョイフル本田	15,700	2,517.00	39,516,900
ホットランド	4,300	1,037.00	4,459,100
すかいらーく	29,600	1,442.00	42,683,200
綿半ホールディングス	4,500	1,432.00	6,444,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	30,700	1,015.00	31,160,500
ブックオフコーポレーション	8,600	898.00	7,722,800
あさひ	7,800	1,607.00	12,534,600
日本調剤	2,900	3,650.00	10,585,000
コスモス薬品	4,900	18,940.00	92,806,000
セブン&アイ・ホールディングス	404,100	4,651.00	1,879,469,100
薬王堂	2,000	3,595.00	7,190,000
クリエイト・レストランツ・ホールディング	25,900	1,031.00	26,702,900
ツルハホールディングス	22,200	10,740.00	238,428,000
サンマルクホールディングス	7,600	3,010.00	22,876,000
トリドール	12,100	1,937.00	23,437,700
クスリのアオキ	8,600	5,700.00	49,020,000
メディカルシステムネットワーク	12,700	642.00	8,153,400
総合メディカル	4,800	3,305.00	15,864,000
カッパ・クリエイト	14,600	1,217.00	17,768,200
ライトオン	7,900	1,478.00	11,676,200
良品計画	11,100	25,240.00	280,164,000
三城ホールディングス	18,300	452.00	8,271,600
アルビス	3,600	2,012.00	7,243,200
コナカ	15,800	537.00	8,484,600
G-7ホールディングス	4,100	1,254.00	5,141,400
コジマ	21,100	255.00	5,380,500
コーナン商事	13,900	1,906.00	26,493,400
エコス	4,600	1,432.00	6,587,200
ドンキホーテホールディングス	62,500	4,025.00	251,562,500
西松屋チェーン	19,000	1,260.00	23,940,000
ゼンショーホールディングス	50,700	1,404.00	71,182,800
幸楽苑ホールディングス	6,900	1,505.00	10,384,500
サイゼリヤ	16,000	1,955.00	31,280,000
VTホールディングス	33,200	562.00	18,658,400
魚力	4,800	1,264.00	6,067,200
ユナイテッドアローズ	13,800	4,350.00	60,030,000
ハイデイ日高	8,900	2,639.00	23,487,100

京都きもの友禅	9,300	897.00	8,342,100
コロワイド	32,000	1,782.00	57,024,000
ピーシーデポコーポレーション	11,100	1,173.00	13,020,300
壱番屋	4,400	7,050.00	31,020,000
スギホールディングス	17,400	5,580.00	97,092,000
スクロール	17,600	445.00	7,832,000
ヨンドシーホールディングス	7,400	2,658.00	19,669,200
ファミリーマート	29,400	5,970.00	175,518,000
木曽路	12,200	2,306.00	28,133,200
サトレストランシステムズ	15,100	810.00	12,231,000
千趣会	20,500	757.00	15,518,500
ケーヨー	19,100	539.00	10,294,900
上新電機	24,000	882.00	21,168,000
日本瓦斯	15,000	2,506.00	37,590,000
ベスト電器	39,800	118.00	4,696,400
ロイヤルホールディングス	15,900	2,169.00	34,487,100
いなげや	11,000	1,400.00	15,400,000
島忠	25,200	2,583.00	65,091,600
チヨダ	11,300	2,913.00	32,916,900
ライフコーポレーション	6,200	2,955.00	18,321,000
リンガーハット	9,200	2,274.00	20,920,800
AOKIホールディングス	22,100	1,315.00	29,061,500
オークワ	15,000	1,183.00	17,745,000
コメリ	15,300	2,580.00	39,474,000
青山商事	18,600	4,105.00	76,353,000
しまむら	11,200	15,050.00	168,560,000
高島屋	141,000	851.00	119,991,000
松屋	20,300	883.00	17,924,900
エイチ・ツー・オー リテイリング	49,900	1,886.00	94,111,400
近鉄百貨店	42,000	302.00	12,684,000
パルコ	9,900	976.00	9,662,400
丸井グループ	118,700	1,742.00	206,775,400
アクシアル リテイリング	7,600	3,550.00	26,980,000
イオン	398,100	1,669.50	664,627,950
ユニーグループ・ホールディングス	95,200	826.00	78,635,200
イズミ	19,300	4,405.00	85,016,500
平和堂	19,400	2,313.00	44,872,200
フジ	10,900	2,407.00	26,236,300
ヤオコー	10,800	4,830.00	52,164,000
ゼビオホールディングス	13,000	1,807.00	23,491,000
ケーズホールディングス	20,600	3,760.00	77,456,000
Olympicグループ	8,300	590.00	4,897,000

日産東京販売ホールディングス	21,900	264.00	5,781,600
アインホールディングス	11,700	5,470.00	63,999,000
元気寿司	4,000	2,140.00	8,560,000
ヤマダ電機	294,000	559.00	164,346,000
アークランドサカモト	16,800	1,179.00	19,807,200
ニトリホールディングス	41,700	10,560.00	440,352,000
グルメ杵屋	9,000	996.00	8,964,000
愛眼	19,800	218.00	4,316,400
吉野家ホールディングス	37,300	1,402.00	52,294,600
松屋フーズ	5,400	2,848.00	15,379,200
サガミチェーン	14,800	1,218.00	18,026,400
王将フードサービス	7,200	3,485.00	25,092,000
プレナス	10,700	2,023.00	21,646,100
ミニストップ	7,700	1,787.00	13,759,900
アークス	18,000	2,607.00	46,926,000
パローホールディングス	21,200	2,716.00	57,579,200
ベルク	4,700	4,380.00	20,586,000
大庄	6,900	1,419.00	9,791,100
ファーストリテイリング	16,100	30,540.00	491,694,000
サンドラッグ	20,400	7,920.00	161,568,000
サックスパー ホールディングス	9,400	1,443.00	13,564,200
ヤマザワ	3,600	1,667.00	6,001,200
やまや	2,600	2,070.00	5,382,000
ベルーナ	24,800	568.00	14,086,400
じもとホールディングス	75,300	152.00	11,445,600
足利ホールディングス	71,900	344.00	24,733,600
東京ＴＹフィナンシャルグループ	13,400	2,911.00	39,007,400
九州フィナンシャルグループ	146,100	628.00	91,750,800
ゆうちょ銀行	248,000	1,401.00	347,448,000
富山第一銀行	27,100	519.00	14,064,900
コンコルディア・フィナンシャルグループ	670,900	545.70	366,110,130
新生銀行	832,000	166.00	138,112,000
あおぞら銀行	609,000	403.00	245,427,000
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	7,752,600	560.90	4,348,433,340
りそなホールディングス	1,125,300	426.80	480,278,040
三井住友トラスト・ホールディングス	2,013,000	373.10	751,050,300
三井住友フィナンシャルグループ	773,700	3,686.00	2,851,858,200
第四銀行	120,000	406.00	48,720,000
北越銀行	109,000	203.00	22,127,000
西日本シティ銀行	313,000	214.00	66,982,000
千葉銀行	369,000	611.00	225,459,000
常陽銀行	348,000	413.00	143,724,000

群馬銀行	213,000	482.00	102,666,000	
武蔵野銀行	15,300	2,986.00	45,685,800	
千葉興業銀行	28,200	506.00	14,269,200	
筑波銀行	44,500	312.00	13,884,000	
七十七銀行	150,000	410.00	61,500,000	
青森銀行	72,000	349.00	25,128,000	
秋田銀行	66,000	314.00	20,724,000	
山形銀行	56,000	425.00	23,800,000	
岩手銀行	6,900	4,320.00	29,808,000	
東邦銀行	86,000	382.00	32,852,000	
東北銀行	46,000	149.00	6,854,000	
みちのく銀行	46,000	180.00	8,280,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	415,000	406.00	168,490,000	
静岡銀行	281,000	902.00	253,462,000	
十六銀行	120,000	351.00	42,120,000	
スルガ銀行	91,200	2,234.00	203,740,800	
八十二銀行	171,100	521.00	89,143,100	
山梨中央銀行	62,000	437.00	27,094,000	
大垣共立銀行	128,000	360.00	46,080,000	
福井銀行	87,000	223.00	19,401,000	
北國銀行	103,000	326.00	33,578,000	
清水銀行	2,900	2,482.00	7,197,800	
富山銀行	2,100	3,920.00	8,232,000	
滋賀銀行	91,000	497.00	45,227,000	
南都銀行	94,000	328.00	30,832,000	
百五銀行	87,000	435.00	37,845,000	
京都銀行	183,000	814.00	148,962,000	
紀陽銀行	38,100	1,364.00	51,968,400	
三重銀行	44,000	211.00	9,284,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	649,000	155.00	100,595,000	
広島銀行	283,000	441.00	124,803,000	
山陰合同銀行	58,200	757.00	44,057,400	
中国銀行	67,000	1,241.00	83,147,000	
鳥取銀行	34,000	176.00	5,984,000	
伊予銀行	101,400	782.00	79,294,800	
百十四銀行	107,000	336.00	35,952,000	
四国銀行	80,000	225.00	18,000,000	
阿波銀行	77,000	582.00	44,814,000	
大分銀行	58,000	350.00	20,300,000	
宮崎銀行	67,000	303.00	20,301,000	
佐賀銀行	65,000	230.00	14,950,000	
十八銀行	63,000	283.00	17,829,000	

沖縄銀行	7,600	3,795.00	28,842,000
琉球銀行	20,400	1,332.00	27,172,800
セブン銀行	360,800	491.00	177,152,800
みずほフィナンシャルグループ	13,695,500	179.00	2,451,494,500
高知銀行	50,000	120.00	6,000,000
山口フィナンシャルグループ	89,000	1,078.00	95,942,000
長野銀行	30,000	196.00	5,880,000
名古屋銀行	83,000	391.00	32,453,000
北洋銀行	144,600	303.00	43,813,800
愛知銀行	3,400	5,240.00	17,816,000
第三銀行	51,000	159.00	8,109,000
中京銀行	46,000	227.00	10,442,000
大光銀行	37,000	218.00	8,066,000
愛媛銀行	63,000	235.00	14,805,000
トマト銀行	41,000	156.00	6,396,000
みなと銀行	91,000	165.00	15,015,000
京葉銀行	79,000	431.00	34,049,000
関西アーバン銀行	14,000	1,108.00	15,512,000
栃木銀行	52,000	447.00	23,244,000
北日本銀行	3,500	2,888.00	10,108,000
東和銀行	194,000	92.00	17,848,000
福島銀行	133,000	94.00	12,502,000
大東銀行	66,000	184.00	12,144,000
トモニホールディングス	76,800	337.00	25,881,600
フィデアホールディングス	83,600	183.00	15,298,800
池田泉州ホールディングス	102,000	440.00	44,880,000
F P G	34,800	1,314.00	45,727,200
S B Iホールディングス	115,900	1,222.00	141,629,800
ジャフコ	16,400	3,235.00	53,054,000
大和証券グループ本社	903,000	696.60	629,029,800
野村ホールディングス	1,858,500	534.60	993,554,100
岡三証券グループ	82,000	617.00	50,594,000
丸三証券	29,800	1,015.00	30,247,000
東洋証券	38,000	268.00	10,184,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	111,000	620.00	68,820,000
水戸証券	31,600	309.00	9,764,400
いちよし証券	21,500	943.00	20,274,500
松井証券	46,700	986.00	46,046,200
だいこう証券ビジネス	6,500	732.00	4,758,000
マネックスグループ	113,600	294.00	33,398,400
カブドットコム証券	83,400	367.00	30,607,800
極東証券	13,400	1,327.00	17,781,800

岩井コスモホールディングス	9,400	1,080.00	10,152,000
藍澤證券	18,500	600.00	11,100,000
マネースクウェアHD	4,300	993.00	4,269,900
マネーパートナーズグループ	9,400	681.00	6,401,400
かんぽ生命保険	39,500	2,649.00	104,635,500
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	214,600	3,166.00	679,423,600
アニコムホールディングス	7,100	2,739.00	19,446,900
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	288,500	3,178.00	916,853,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	92,800	1,465.00	135,952,000
第一生命保険	619,100	1,459.50	903,576,450
東京海上ホールディングス	391,300	3,922.00	1,534,678,600
T&Dホールディングス	351,900	1,160.50	408,379,950
全国保証	25,200	4,075.00	102,690,000
クレディセゾン	73,200	2,142.00	156,794,400
アクリーティブ	10,100	492.00	4,969,200
芙蓉総合リース	11,100	4,785.00	53,113,500
興銀リース	18,300	1,967.00	35,996,100
東京センチュリーリース	22,300	3,985.00	88,865,500
日本証券金融	46,400	451.00	20,926,400
アイフル	161,900	398.00	64,436,200
ポケットカード	11,900	549.00	6,533,100
リコーリース	7,800	3,245.00	25,311,000
イオンフィナンシャルサービス	63,300	2,510.00	158,883,000
アコム	193,900	596.00	115,564,400
ジャックス	55,000	442.00	24,310,000
オリエントコーポレーション	417,400	232.00	96,836,800
日立キャピタル	22,800	2,515.00	57,342,000
アプラスフィナンシャル	50,700	107.00	5,424,900
オリックス	682,800	1,657.50	1,131,741,000
三菱UFJリース	242,500	515.00	124,887,500
日本取引所グループ	283,200	1,798.00	509,193,600
イー・ギャランティ	3,700	2,478.00	9,168,600
NECキャピタルソリューション	4,600	1,616.00	7,433,600
いちごグループホールディングス	106,700	503.00	53,670,100
日本駐車場開発	123,900	124.00	15,363,600
ヒューリック	201,500	1,136.00	228,904,000
三栄建築設計	4,600	1,215.00	5,589,000
野村不動産ホールディングス	64,300	2,130.00	136,959,000
三重交通グループホールディングス	19,200	561.00	10,771,200
サムティ	7,600	1,111.00	8,443,600
エー・ディー・ワークス	108,500	45.00	4,882,500
日本商業開発	4,500	2,251.00	10,129,500

プレサンスコーポレーション	3,300	4,010.00	13,233,000
ユニゾホールディングス	6,200	4,695.00	29,109,000
日本管理センター	6,700	1,622.00	10,867,400
フージャースホールディングス	16,900	515.00	8,703,500
オープンハウス	14,200	2,489.00	35,343,800
東急不動産ホールディングス	233,700	802.00	187,427,400
飯田グループホールディングス	88,900	2,186.00	194,335,400
ムゲンエステート	1,800	2,221.00	3,997,800
パーク24	48,900	3,165.00	154,768,500
パラカ	4,100	1,459.00	5,981,900
三井不動産	512,000	2,911.50	1,490,688,000
三菱地所	718,000	2,255.50	1,619,449,000
平和不動産	18,600	1,377.00	25,612,200
東京建物	105,600	1,546.00	163,257,600
ダイビル	25,200	973.00	24,519,600
京阪神ビルディング	19,900	609.00	12,119,100
住友不動産	231,000	3,501.00	808,731,000
大京	176,000	182.00	32,032,000
テーオーシー	38,000	926.00	35,188,000
東京楽天地	22,000	488.00	10,736,000
レオパレス21	114,500	674.00	77,173,000
スターツコーポレーション	10,900	2,339.00	25,495,100
フジ住宅	15,800	683.00	10,791,400
空港施設	15,400	499.00	7,684,600
住友不動産販売	6,800	2,291.00	15,578,800
ゴールドクレスト	8,300	1,671.00	13,869,300
日神不動産	18,500	370.00	6,845,000
タカラレーベン	42,500	713.00	30,302,500
サンヨーハウジング名古屋	7,200	982.00	7,070,400
イオンモール	62,800	1,616.00	101,484,800
トーセイ	15,600	806.00	12,573,600
エヌ・ティ・ティ都市開発	61,000	1,093.00	66,673,000
サンフロンティア不動産	12,100	1,080.00	13,068,000
エフ・ジェー・ネクスト	10,500	515.00	5,407,500
日本空港ビルデング	30,900	4,210.00	130,089,000
日本工営	38,000	358.00	13,604,000
ネクスト	29,200	1,203.00	35,127,600
ジェイエイシーリクルートメント	6,700	1,331.00	8,917,700
日本M&Aセンター	15,900	6,430.00	102,237,000
アコーディア・ゴルフ	28,900	1,049.00	30,316,100
タケエイ	10,400	960.00	9,984,000
トラスト・テック	4,800	1,446.00	6,940,800

パソナグループ	9,900	708.00	7,009,200
G C A サヴィアン	9,900	1,068.00	10,573,200
エス・エム・エス	12,900	1,942.00	25,051,800
テンプホールディングス	71,800	1,664.00	119,475,200
リニカル	6,300	2,095.00	13,198,500
クックパッド	22,900	1,625.00	37,212,500
学情	4,500	1,163.00	5,233,500
スタジオアリス	5,200	2,667.00	13,868,400
シミックホールディングス	6,100	1,650.00	10,065,000
総合警備保障	34,100	6,210.00	211,761,000
カカクコム	73,800	2,047.00	151,068,600
アイロムグループ	3,500	1,163.00	4,070,500
ルネサンス	7,600	1,224.00	9,302,400
ディップ	11,300	2,673.00	30,204,900
オプトホールディング	8,600	677.00	5,822,200
新日本科学	11,300	418.00	4,723,400
ツクイ	12,700	1,351.00	17,157,700
エムスリー	88,700	2,859.00	253,593,300
ツカダ・グローバルホールディング	10,200	750.00	7,650,000
アウトソーシング	4,800	3,630.00	17,424,000
ウェルネット	4,000	3,715.00	14,860,000
ディー・エヌ・エー	46,200	2,001.00	92,446,200
博報堂D Yホールディングス	141,400	1,299.00	183,678,600
ぐるなび	11,900	2,702.00	32,153,800
エスアールジータカミヤ	10,900	464.00	5,057,600
ジャパンベストレスキューシステム	21,100	229.00	4,831,900
ファンコミュニケーションズ	23,800	772.00	18,373,600
ジェイコムホールディングス	2,500	2,596.00	6,490,000
W D Bホールディングス	4,700	944.00	4,436,800
バリューコマース	12,400	378.00	4,687,200
インフォマート	20,100	989.00	19,878,900
J Pホールディングス	28,000	400.00	11,200,000
E P Sホールディングス	12,700	1,389.00	17,640,300
プレステージ・インターナショナル	9,500	1,216.00	11,552,000
アミューズ	5,800	2,315.00	13,427,000
ドリームインキュベータ	3,900	2,389.00	9,317,100
クイック	6,200	879.00	5,449,800
ケネディクス	137,600	500.00	68,800,000
電通	113,900	5,880.00	669,732,000
ぴあ	4,300	2,023.00	8,698,900
イオンファンタジー	3,900	2,342.00	9,133,800
ネクシィーズグループ	4,100	1,573.00	6,449,300

みらかホールディングス	26,300	4,925.00	129,527,500
アルプス技研	4,300	2,251.00	9,679,300
日本空調サービス	11,700	546.00	6,388,200
オリエンタルランド	110,600	7,854.00	868,652,400
ダスキン	26,900	2,096.00	56,382,400
明光ネットワークジャパン	12,300	1,222.00	15,030,600
ファルコホールディングス	5,900	1,387.00	8,183,300
ラウンドワン	32,800	654.00	21,451,200
リゾートトラスト	43,300	2,355.00	101,971,500
ビー・エム・エル	6,100	4,765.00	29,066,500
りらいあコミュニケーションズ	16,800	1,120.00	18,816,000
リソー教育	21,500	422.00	9,073,000
ユー・エス・エス	124,100	1,819.00	225,737,900
東京個別指導学院	5,900	723.00	4,265,700
サイバーエージェント	27,000	5,320.00	143,640,000
楽天	479,200	1,292.00	619,126,400
テー・オー・ダブリュー	10,300	702.00	7,230,600
セントラルスポーツ	4,600	2,297.00	10,566,200
フルキャストホールディングス	10,500	737.00	7,738,500
テクノプロ・ホールディングス	16,700	3,180.00	53,106,000
リブセンス	8,900	456.00	4,058,400
ジャパンマテリアル	4,500	2,668.00	12,006,000
ベクトル	3,400	2,863.00	9,734,200
I B J	9,600	542.00	5,203,200
アサンテ	4,900	1,511.00	7,403,900
N・フィールド	5,100	1,833.00	9,348,300
ライドオン・エクスプレス	2,900	1,525.00	4,422,500
リクルートホールディングス	205,900	3,485.00	717,561,500
日本郵政	300,300	1,559.00	468,167,700
ベルシステム24ホールディングス	19,500	952.00	18,564,000
リロ・ホールディング	3,800	14,400.00	54,720,000
東祥	3,300	3,935.00	12,985,500
エイチ・アイ・エス	16,600	2,815.00	46,729,000
共立メンテナンス	7,600	8,360.00	63,536,000
イチネンホールディングス	12,700	1,006.00	12,776,200
建設技術研究所	7,700	991.00	7,630,700
スペース	6,500	1,338.00	8,697,000
東京テアトル	62,000	120.00	7,440,000
ナガワ	2,100	2,847.00	5,978,700
よみうりランド	23,000	512.00	11,776,000
東京都競馬	72,000	220.00	15,840,000
常磐興産	54,000	152.00	8,208,000

カナモト	14,300	2,885.00	41,255,500
東京ドーム	82,000	476.00	39,032,000
西尾レントオール	8,300	2,953.00	24,509,900
トランス・コスモス	11,700	2,915.00	34,105,500
乃村工藝社	21,800	1,861.00	40,569,800
藤田観光	39,000	500.00	19,500,000
KNT-CTホールディングス	55,000	170.00	9,350,000
日本管財	9,100	1,689.00	15,369,900
トーカイ	4,700	3,255.00	15,298,500
白洋舎	22,000	260.00	5,720,000
セコム	106,300	8,741.00	929,168,300
セントラル警備保障	5,100	2,273.00	11,592,300
丹青社	19,500	870.00	16,965,000
メイテック	12,600	3,900.00	49,140,000
アサツー ディ・ケイ	18,300	2,825.00	51,697,500
応用地質	10,300	1,231.00	12,679,300
船井総研ホールディングス	14,700	1,625.00	23,887,500
オオバ	9,900	464.00	4,593,600
ベネッセホールディングス	34,500	3,225.00	111,262,500
イオンディライト	9,800	3,010.00	29,498,000
ナック	8,600	879.00	7,559,400
ニチイ学館	18,700	807.00	15,090,900
ダイセキ	19,300	2,095.00	40,433,500
合 計	162,025,800		201,765,513,030

(b) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

外国株式インデックス・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

（平成28年 4月26日現在）

資産の部

流動資産

預金	3,637,979,845
金銭信託	169,893,059
コール・ローン	35,648,016
株式	149,825,025,362

（平成28年 4月26日現在）

投資証券	3,934,204,370
派生商品評価勘定	106,122,759
未収入金	42,432,592
未収配当金	223,847,436
差入委託証拠金	1,522,490,920
流動資産合計	159,497,644,359
資産合計	159,497,644,359
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	11,409,385
前受金	94,676,574
未払解約金	193,192,657
未払利息	104
その他未払費用	8,749
流動負債合計	299,287,469
負債合計	299,287,469
純資産の部	
元本等	
元本	60,595,656,831
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	98,602,700,059
元本等合計	159,198,356,890
純資産合計	159,198,356,890
負債純資産合計	159,497,644,359

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自平成27年 4月17日 至平成28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</p>

項目	自 平成27年 4月17日 至 平成28年 4月26日
	個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。

(貸借対照表に関する注記)

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

(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27年 4月17日 至 平成28年 4月26日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、投資証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。 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。

項目	自 平成27年 4月17日 至 平成28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	(平成28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（株式、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

（平成28年 4月26日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

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

（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）

該当事項はありません。

（その他の注記）

（平成28年 4月26日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	69,360,029,291円
同期中における追加設定元本額	15,388,983,831円
同期中における一部解約元本額	24,153,356,291円
平成28年 4月26日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	8,795,281,236円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	200,831,501円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	873,812,975円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	583,556,304円
S M A M・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	31,160,710円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	3,083,623円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	6,895,840円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	26,520,031円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	25,236,236円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	15,756,688円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	36,426,019円
外国株式指数ファンド	435,879,343円
三井住友・DC全海外株式インデックスファンド	597,508,328円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	167,308,242円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	244,719,365円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	306,239,750円
S M A M・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	7,666,075,277円
バランスファンドVA（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	45,288,459円
S M A M・バランスファンドVA安定成長型＜適格機関投資家限定＞	5,296,983,372円
S M A M・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	3,680,514,668円
S M A M・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	2,721,234,810円
S M A M・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	11,262,781,335円
S M A M・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	30,694,337円
S M A M・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	179,198,981円

(平成28年 4月26日現在)	
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	13,782,411円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	1,343,045,993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>	100,455,805円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	295,414,154円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	1,324,189,446円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	2,298,633,991円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	3,035,654,992円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	100,751,800円
三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,234,361,763円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	2,719,996,061円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	256,808,648円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	148,942,135円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	2,420,994,748円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	43,589,645円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	23,914,178円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	11,985,311円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	94,837,863円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	211,165,907円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	204,909,839円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定>	224,527円
SMAM・FGグローバルバランス25VA<適格機関投資家限定>	2,208,393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>	1,406,257,655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>	117,335円
SMAM・マルチアセットストラテジーファンド2016-01<適格機関投資家限定>	70,426,801円
合計	60,595,656,831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	24,486	51.09	1,250,989.74	
	ANTERO RESOURCES CORP	4,800	28.23	135,504.00	
	APACHE CORPORATION	17,646	54.41	960,118.86	
	BAKER HUGHES INC	20,189	45.04	909,312.56	
	CABOT OIL & GAS CORPORATION	22,720	22.29	506,428.80	
	CHENIERE ENERGY INC	9,802	36.75	360,223.50	
	CHEVRON CORPORATION	87,768	101.51	8,909,329.68	
	CIMAREX ENERGY CO	4,508	106.19	478,704.52	

CONCHO RESOURCES INC	5,959	113.20	674,558.80
CONOCOPHILLIPS	57,562	46.27	2,663,393.74
CONTINENTAL RESOURCES, INC.	4,214	37.66	158,699.24
CORE LABORATORIES N.V.	2,101	128.65	270,293.65
DEVON ENERGY CORPORATION	21,418	33.95	727,141.10
EOG RESOURCES INC	25,275	79.76	2,015,934.00
EQT CORPORATION	7,021	68.45	480,587.45
EXXON MOBIL CORPORATION	194,136	87.33	16,953,896.88
FMC TECHNOLOGIES INC	10,651	28.85	307,281.35
HALLIBURTON CO	39,703	40.04	1,589,708.12
HELMERICH & PAYNE INC	5,427	62.95	341,629.65
HESS CORPORATION	13,053	61.87	807,589.11
HOLLYFRONTIER CORP	8,311	36.67	304,764.37
KINDER MORGAN INC	89,053	17.49	1,557,536.97
MARATHON OIL CORP	35,686	13.83	493,537.38
MARATHON PETROLEUM CORPORATION	25,098	41.18	1,033,535.64
MURPHY OIL CORPORATION	7,419	33.51	248,610.69
NATIONAL-OILWELL VARCO INC.	17,446	29.32	511,516.72
NOBLE ENERGY INC	19,748	35.08	692,759.84
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	35,616	75.10	2,674,761.60
OCEANEERING INTL INC	4,001	33.73	134,953.73
ONEOK INC	9,311	35.38	329,423.18
PHILLIPS 66	24,877	87.93	2,187,434.61
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	7,605	153.50	1,167,367.50
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	11,469	9.46	108,496.74
RANGE RESOURCES CORPORATION	8,475	39.00	330,525.00
SCHLUMBERGER LTD	65,491	78.77	5,158,726.07
SOUTHWESTERN ENERGY COMPANY	17,747	12.10	214,738.70
SPECTRA ENERGY CORPORATION	31,453	30.79	968,437.87
TESORO CORPORATION	5,612	86.53	485,606.36
VALERO ENERGY CORP	22,455	61.77	1,387,045.35
WEATHERFORD INTL PLC	37,360	7.92	295,891.20
WILLIAMS COS INC	32,245	19.06	614,589.70
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	9,605	147.96	1,421,155.80
AIRGAS INC	3,207	141.89	455,041.23
ALBEMARLE CORPORATION	5,355	66.59	356,589.45
ALCOA INC	59,096	10.16	600,415.36
ASHLAND INC	2,691	114.10	307,043.10
AVERY DENNISON CORP	4,362	72.79	317,509.98
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	6,556	29.69	194,647.64
BALL CORPORATION	6,010	74.70	448,947.00
CELANESE CORPORATION	6,817	70.81	482,711.77

CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	10,460	33.17	346,958.20
CROWN HOLDINGS INC	6,079	53.27	323,828.33
DOW CHEMICAL	52,105	52.54	2,737,596.70
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	40,784	65.97	2,690,520.48
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	7,159	75.95	543,726.05
ECOLAB INC	12,353	115.73	1,429,612.69
FMC CORPORATION	6,226	42.67	265,663.42
FREEMONT-MCMORAN INC	51,256	11.35	581,755.60
INTERNATIONAL PAPER CO	18,567	42.85	795,595.95
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	3,872	120.11	465,065.92
LYONDELLBASELL INDU-CL A	18,008	88.25	1,589,206.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	2,447	169.54	414,864.38
MONSANTO CO	20,375	94.08	1,916,880.00
MOSAIC CO/THE	14,768	28.28	417,639.04
NEWMONT MINING CORP	25,587	31.11	796,011.57
NUCOR CORP	15,086	49.12	741,024.32
PACKAGING CORP OF AMERICA	4,571	65.11	297,617.81
PPG INDUSTRIES INC	12,675	112.60	1,427,205.00
PRAXAIR INC	13,484	119.19	1,607,157.96
SEALED AIR CORP	9,368	51.63	483,669.84
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	3,596	299.25	1,076,103.00
VULCAN MATERIALS CO	6,171	109.06	673,009.26
WESTLAKE CHEMICAL CORP	2,235	50.82	113,582.70
WESTROCK CO	12,328	39.74	489,914.72
WR GRACE & CO	3,500	77.73	272,055.00
3M COMPANY	28,707	168.38	4,833,684.66
ACUITY BRANDS INC	1,995	252.90	504,535.50
AERCAP HOLDINGS NV	3,735	40.60	151,641.00
AGCO CORP	3,447	53.04	182,828.88
AMETEK INC	10,549	51.04	538,420.96
BE AEROSPACE INC	4,293	49.25	211,430.25
BOEING CO	29,881	130.75	3,906,940.75
CATERPILLAR INC	27,254	76.79	2,092,834.66
CHICAGO BRIDGE & IRON COMPANY NV	4,593	39.25	180,275.25
CUMMINS INC	7,713	114.91	886,300.83
DANAHER CORP	28,769	96.45	2,774,770.05
DEERE & CO	14,339	82.41	1,181,676.99
DOVER CORP	7,500	66.79	500,925.00
EATON CORP PLC	21,439	62.26	1,334,792.14
EMERSON ELECTRIC CO	30,995	55.31	1,714,333.45
FASTENAL COMPANY	12,936	45.60	589,881.60
FLUOR CORP	6,212	46.15	286,683.80

FLUOR CORP	6,997	53.39	373,569.83
GENERAL DYNAMICS CORP	12,666	136.79	1,732,582.14
GENERAL ELECTRIC CO	440,130	30.68	13,503,188.40
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	33,903	113.25	3,839,514.75
ILLINOIS TOOL WORKS	15,256	104.48	1,593,946.88
INGERSOLL-RAND PLC	12,263	64.03	785,199.89
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	5,610	43.61	244,652.10
JARDINE MATHESON HOLDINGS LIMITED	11,500	58.14	668,610.00
L-3 COMMUNICATIONS HLDGS INC	3,735	123.85	462,579.75
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	12,897	226.30	2,918,591.10
MASCO CORP	15,275	32.24	492,466.00
NORTHROP GRUMMAN CORP	8,192	200.73	1,644,380.16
PACCAR INC	17,150	56.05	961,257.50
PARKER HANNIFIN CORPORATION	6,098	113.41	691,574.18
PENTAIR PLC-REGISTERED	8,019	56.13	450,106.47
QUANTA SERVICES INC	8,580	22.95	196,911.00
RAYTHEON COMPANY	13,822	125.50	1,734,661.00
ROCKWELL AUTOMATION INC	6,156	114.77	706,524.12
ROCKWELL COLLINS INC.	6,171	89.23	550,638.33
ROPER TECHNOLOGIES INC	4,691	179.66	842,785.06
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	8,113	37.82	306,833.66
SNAP-ON INC	2,746	161.67	443,945.82
STANLEY BLACK & DECKER INC	7,063	111.52	787,665.76
TEXTRON INC	13,079	38.99	509,950.21
TRANSDIGM GROUP INC	2,545	224.43	571,174.35
UNITED RENTALS INC	4,660	64.82	302,061.20
UNITED TECHNOLOGIES CORP	39,026	105.20	4,105,535.20
WABTEC CORP	4,643	79.60	369,582.80
WW GRAINGER INC	2,690	229.19	616,521.10
XYLEM INC	8,801	42.21	371,490.21
CINTAS CORP	4,370	89.46	390,940.20
DUN & BRADSTREET CORP	1,471	110.01	161,824.71
EQUIFAX INC	5,415	116.31	629,818.65
IHS INC-CLASS A	3,017	122.89	370,759.13
MANPOWERGROUP	3,518	81.11	285,344.98
NIELSEN HOLDINGS PLC	16,428	51.63	848,177.64
REPUBLIC SERVICES INC	10,780	45.76	493,292.80
ROBERT HALF INTL INC	6,506	43.71	284,377.26
STERICYCLE, INC.	3,750	122.80	460,500.00
THE ADT CORPORATION	8,262	41.93	346,425.66
TYCO INTERNATIONAL PLC	19,845	39.14	776,733.30
VERISK ANALYTICS INC	7,324	78.43	574,421.32

WASTE CONNECTIONS INC	6,000	64.54	387,240.00
WASTE MANAGEMENT INC	20,370	56.35	1,147,849.50
AMERCO	290	347.85	100,876.50
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	7,431	37.00	274,947.00
C.H.ROBINSON WORLDWIDE, INC.	6,364	74.60	474,754.40
CSX CORPORATION	45,626	27.14	1,238,289.64
DELTA AIR LINES INC	8,821	43.93	387,506.53
EXPEDITORS INTL WASH INC	8,693	48.91	425,174.63
FEDEX CORP	12,623	165.56	2,089,863.88
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	18,331	8.77	160,762.87
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	4,585	84.96	389,541.60
KANSAS CITY SOUTHERN	5,231	96.92	506,988.52
NORFOLK SOUTHERN CORP	13,773	91.37	1,258,439.01
SOUTHWEST AIRLINES	7,984	46.85	374,050.40
UNION PACIFIC CORP	39,491	87.61	3,459,806.51
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	3,971	49.37	196,048.27
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	32,610	105.07	3,426,332.70
AUTOLIV INC	3,884	112.95	438,697.80
BORGWARNER INC	10,148	38.44	390,089.12
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	13,056	76.04	992,778.24
FORD MOTOR COMPANY	172,682	13.58	2,345,021.56
GENERAL MOTORS CO	66,829	31.95	2,135,186.55
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	12,804	32.22	412,544.88
HARLEY-DAVIDSON INC	9,124	48.58	443,243.92
JOHNSON CONTROLS INC	30,264	41.68	1,261,403.52
LEAR CORP	3,675	113.15	415,826.25
MOBILEYE NV	3,705	38.52	142,716.60
TESLA MOTORS INC	4,580	251.82	1,153,335.60
WABCO HOLDINGS INC	2,607	112.14	292,348.98
COACH INC	12,806	40.19	514,673.14
D.R.HORTON INC	15,704	31.12	488,708.48
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY	7,453	57.37	427,578.61
GARMIN LTD	5,408	42.08	227,568.64
HANESBRANDS INC	19,101	27.69	528,906.69
HARMAN INTERNATIONAL	3,248	87.05	282,738.40
HASBRO INC	5,206	87.24	454,171.44
LEGGETT & PLATT INC	5,956	47.92	285,411.52
LENNAR CORP-CL A	8,789	47.20	414,840.80
LULULEMON ATHLETICA INC	5,461	66.00	360,426.00
MATTEL INC	15,850	32.07	508,309.50
MICHAEL KORS HOLDINGS LIMITED	8,702	51.84	451,111.68
MOHAWK INDUSTRIES INC	2,838	197.56	560,675.28

NEWELL BRANDS INC	20,235	44.04	891,149.40
NIKE INC -CL B	63,236	59.21	3,744,203.56
POLARIS INDUSTRIES INC	3,113	100.90	314,101.70
PULTE GROUP INC	13,149	18.81	247,332.69
PVH CORP	3,849	95.24	366,578.76
RALPH LAUREN CORPORATION	2,738	94.38	258,412.44
TOLL BROTHERS INC	7,285	28.78	209,662.30
UNDER ARMOUR INC	8,351	46.59	389,073.09
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	8,351	44.26	369,615.26
VF CORP	15,651	63.38	991,960.38
WHIRLPOOL CORP	3,779	186.04	703,045.16
ARAMARK	10,000	33.80	338,000.00
CARNIVAL CORP	19,432	49.24	956,831.68
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,451	443.10	642,938.10
DARDEN RESTAURANTS INC	5,517	63.46	350,108.82
H&R BLOCK INC	10,337	24.04	248,501.48
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	22,274	21.74	484,236.76
LAS VEGAS SANDS CORP	18,558	45.82	850,327.56
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	9,857	66.98	660,221.86
MCDONALD'S CORPORATION	42,603	127.46	5,430,178.38
MELCO CROWN ENTERTAINME-ADR	3,843	14.67	56,376.81
MGM MIRAGE	22,459	21.76	488,707.84
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS	7,708	49.31	380,081.48
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	7,877	75.00	590,775.00
STARBUCKS CORP	69,243	57.77	4,000,168.11
STARWOOD HOTELS & RESORTS	7,867	79.67	626,763.89
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	5,415	76.07	411,919.05
WYNN RESORTS LTD	3,642	90.94	331,203.48
YUM! BRANDS INC	19,774	81.36	1,608,812.64
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	9,712	33.77	327,974.24
CBS CORP-CL B	20,262	56.29	1,140,547.98
CHARTER COMMUNICATTION-A	3,790	207.01	784,567.90
COMCAST CORP-CL A	115,793	61.00	7,063,373.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-A	6,972	27.93	194,727.96
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-C	13,489	27.40	369,598.60
DISH NETWORK CORP.	10,483	51.26	537,358.58
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	18,385	23.44	430,944.40
LIBERTY GLOBAL PLC-A	12,566	37.90	476,251.40
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	28,327	37.06	1,049,798.62
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	9,534	32.68	311,571.12
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	3,927	33.05	129,787.35
NEWS CORP-CLASS A	15,889	12.62	200,519.18

OMNICOM GROUP	11,397	83.52	951,877.44
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	3,392	63.85	216,579.20
SIRIUS XM HOLDINGS INC	97,893	3.97	388,635.21
TEGNA INC	10,189	24.00	244,536.00
THE WALT DISNEY CO.	73,240	104.57	7,658,706.80
TIME WARNER CABLE, INC.	13,075	209.63	2,740,912.25
TIME WARNER INC	36,913	76.35	2,818,307.55
TWENTY-FIRST CE CL-A	53,635	31.06	1,665,903.10
TWENTY-FIRST CE CL-B	20,085	30.93	621,229.05
VIACOM INC-CLASS B	16,362	43.25	707,656.50
ADVANCE AUTO PARTS	3,481	157.39	547,874.59
AMAZON.COM INC	18,581	626.20	11,635,422.20
AUTONATION INC	3,089	49.54	153,029.06
AUTOZONE INC	1,411	774.65	1,093,031.15
BED BATH & BEYOND INC	8,340	48.21	402,071.40
BEST BUY COMPANY INC	13,895	32.47	451,170.65
CARMAX INC	9,696	52.99	513,791.04
DICK'S SPORTING GOODS INC	4,201	45.72	192,069.72
DOLLAR GENERAL CORP	13,966	82.00	1,145,212.00
DOLLAR TREE INC	10,642	80.92	861,150.64
EXPEDIA INC	5,769	106.43	613,994.67
FOOT LOCKER INC	6,434	60.36	388,356.24
GAMESTOP CORP-CL A	5,557	32.80	182,269.60
GAP INC/THE	11,563	23.41	270,689.83
GENUINE PARTS CO	7,329	96.90	710,180.10
HOME DEPOT INC	59,127	135.65	8,020,577.55
KOHL'S CORP	9,070	44.96	407,787.20
L BRANDS INC	11,410	77.89	888,724.90
LIBERTY INTERACTIVE CORP QVC GROUP-A	21,340	26.55	566,577.00
LKQ CORPORATION	13,314	33.08	440,427.12
LOWE'S COMPANIES INC	42,482	76.19	3,236,703.58
MACY'S INC	14,660	40.33	591,237.80
NETFLIX INC	18,976	93.56	1,775,394.56
NORDSTROM INC	6,499	52.01	338,012.99
O'REILLY AUTOMOTIVE INC NEW	4,706	270.30	1,272,031.80
PRICELINE GROUP INC/THE	2,322	1,335.27	3,100,496.94
ROSS STORES INC	19,002	57.00	1,083,114.00
SIGNET JEWELERS LTD	3,437	109.36	375,870.32
STAPLES INC	31,615	10.45	330,376.75
TARGET CORP	27,293	82.60	2,254,401.80
TIFFANY & CO	6,182	72.09	445,660.38
TJX COMPANIES INC	31,223	76.50	2,388,559.50

TRACTOR SUPPLY COMPANY	6,118	95.14	582,066.52
TRIPADVISOR INC-W/I	5,824	62.55	364,291.20
ULTA SALON COSMETICS & FRAGRANCE INC	2,921	207.37	605,727.77
COSTCO WHOLESALE CORP	20,222	151.51	3,063,835.22
CVS HEALTH CORPORATION	51,639	101.95	5,264,596.05
KROGER CO	43,255	36.77	1,590,486.35
RITE AID CORP	48,792	8.07	393,751.44
SYSCO CORP	26,587	46.30	1,230,978.10
WAL-MART STORES INC	74,360	69.47	5,165,789.20
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	41,008	80.39	3,296,633.12
WHOLE FOODS MARKET INC	15,915	29.74	473,312.10
ALTRIA GROUP INC	91,435	61.22	5,597,650.70
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	28,158	39.26	1,105,483.08
BROWN-FORMAN CORPORATION	5,392	94.06	507,171.52
BUNGE LIMITED	6,595	59.28	390,951.60
CAMPBELL SOUP CO	9,076	61.04	553,999.04
COCA-COLA CO/THE	192,672	44.71	8,614,365.12
COCA-COLA ENTERPRISES INC	10,446	51.94	542,565.24
CONAGRA FOODS INC	20,161	44.55	898,172.55
CONSTELLATION BRANDS INC-A	8,152	156.84	1,278,559.68
DR.PEPPER SNAPPLE GROUP, INC	8,846	87.63	775,174.98
GENERAL MILLS INC	27,873	61.09	1,702,761.57
HORMEL FOODS CORPORATION	13,718	37.91	520,049.38
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	5,536	127.43	705,452.48
KELLOGG CO	12,445	75.80	943,331.00
KRAFT HEINZ COMPANY	27,949	78.73	2,200,424.77
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	5,445	93.29	507,964.05
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	9,062	84.04	761,570.48
MOLSON COORS BREWING COMPANY	9,009	96.44	868,827.96
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	73,429	42.26	3,103,109.54
MONSTER BEVERAGE CORPORATION	6,708	124.92	837,963.36
PEPSICO INC	67,729	102.80	6,962,541.20
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	71,976	97.53	7,019,819.28
REYNOLDS AMERICAN INC	40,104	48.41	1,941,434.64
THE HERSHEY COMPANY	7,097	91.37	648,452.89
TYSON FOODS INC-CL A	13,389	64.08	857,967.12
WHITEWAVE FOODS CO	7,662	40.60	311,077.20
CHURCH & DWIGHT CO INC	5,983	92.48	553,307.84
CLOROX COMPANY	6,144	123.63	759,582.72
COLGATE-PALMOLIVE COMPANY	39,736	69.42	2,758,473.12
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	2,963	82.09	243,232.67
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	10,328	94.72	978,268.16

KIMBERLY-CLARK CORP	16,929	126.21	2,136,609.09
PROCTER & GAMBLE CO	126,872	81.41	10,328,649.52
ABBOTT LABORATORIES	69,566	44.01	3,061,599.66
AETNA INC	16,364	114.30	1,870,405.20
AMERISOURCEBERGEN CORP	9,332	91.51	853,971.32
ANTHEM INC	12,135	146.09	1,772,802.15
BARD(C.R.) INC	3,414	206.93	706,459.02
BAXALTA INC	31,095	41.31	1,284,534.45
BAXTER INTERNATIONAL INC	25,602	43.63	1,117,015.26
BECTON DICKINSON & CO	10,045	160.26	1,609,811.70
BOSTON SCIENTIFIC CORP	62,550	19.74	1,234,737.00
CARDINAL HEALTH INC	15,363	86.35	1,326,595.05
CENTENE CORP	8,130	62.86	511,051.80
CERNER CORP	14,818	58.57	867,890.26
CIGNA CORP	12,013	140.25	1,684,823.25
COOPER COMPANIES INC (THE)	2,282	157.36	359,095.52
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	7,918	74.71	591,553.78
DENTSPLY SIRONA INC	11,510	61.11	703,376.10
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	10,124	107.98	1,093,189.52
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	8,500	22.52	191,420.00
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	31,624	73.72	2,331,321.28
HCA HOLDINGS, INC.	15,366	80.12	1,231,123.92
HENRY SCHEIN INC	3,867	172.15	665,704.05
HOLOGIC INC	10,700	37.79	404,353.00
HUMANA INC.	7,085	176.11	1,247,739.35
IMS HEALTH HOLDINGS INC	7,700	26.49	203,973.00
INTUITIVE SURGICAL INC	1,772	638.74	1,131,847.28
LABORATORY CRP OF AMR HLDGS	4,739	125.10	592,848.90
MALLINCKRODT PLC	5,503	64.09	352,687.27
MCKESSON CORP	10,759	177.16	1,906,064.44
MEDNAX INC	4,300	72.20	310,460.00
MEDTRONIC PLC	65,923	79.39	5,233,626.97
PATTERSON COS INC	4,102	44.95	184,384.90
QUEST DIAGNOSTICS	6,376	75.36	480,495.36
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLDINGS INC	4,422	70.00	309,540.00
RESMED INC	6,797	61.16	415,704.52
ST JUDE MEDICAL INC	12,789	60.55	774,373.95
STRYKER CORP	15,689	109.49	1,717,788.61
UNITEDHEALTH GROUP INC	44,239	133.78	5,918,293.42
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,394	127.81	561,597.14
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	4,743	84.61	401,305.23
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	8,551	114.66	980,457.66

ABBVIE INC	75,757	60.97	4,618,904.29
AGILENT TECHNOLOGIES INC	16,003	41.63	666,204.89
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	10,499	158.02	1,659,051.98
ALKERMES PLC	6,377	42.72	272,425.44
ALLERGAN PLC	18,287	224.85	4,111,831.95
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	3,571	71.95	256,933.45
AMGEN INC	35,178	163.46	5,750,195.88
BIOGEN INC	10,395	284.85	2,961,015.75
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	7,516	90.22	678,093.52
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	77,800	70.63	5,495,014.00
CELGENE CORP	36,368	110.57	4,021,209.76
ELI LILLY & CO	46,821	77.94	3,649,228.74
ENDO INTERNATIONAL PLC	10,390	30.04	312,115.60
GILEAD SCIENCES INC	66,918	102.29	6,845,042.22
ILLUMINA INC	6,791	143.07	971,588.37
INCYTE CORP	7,807	76.55	597,625.85
IONIS PHARMACEUTICALS INC	5,769	43.08	248,528.52
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	2,928	154.55	452,522.40
JOHNSON & JOHNSON	129,035	113.51	14,646,762.85
MEDIVATION INC	7,392	52.07	384,901.44
MERCK & CO. INC.	129,767	56.22	7,295,500.74
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,322	361.45	477,836.90
MYLAN NV	19,492	45.02	877,529.84
PERRIGO CO PLC	6,780	99.40	673,932.00
PFIZER INC	287,423	33.21	9,545,317.83
REGENERON PHARMACEUTICALS	3,586	406.92	1,459,215.12
TARO PHARMACEUTICAL INDUSTRIES	312	144.07	44,949.84
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	18,418	146.56	2,699,342.08
UNITED THERAPEUTICS CORP	2,212	117.30	259,467.60
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	11,118	85.66	952,367.88
WATERS CORP	4,006	137.57	551,105.42
ZOETIS INC	22,514	47.32	1,065,362.48
BANK OF AMERICA CORP	484,931	14.96	7,254,567.76
BB & T CORPORATION	37,292	35.46	1,322,374.32
CIT GROUP INC	8,202	33.78	277,063.56
CITIGROUP INC	138,900	46.69	6,485,241.00
CITIZENS FINANCIAL GROUP	24,353	23.38	569,373.14
COMERICA INC	8,610	43.68	376,084.80
FIFTH THIRD BANCORP	36,500	18.53	676,345.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	6,528	70.74	461,790.72
HUNTINGTON BANCSHARES INC	35,918	10.16	364,926.88
JPMORGAN CHASE & CO	171,581	63.60	10,912,551.60

KEYCORP	38,474	12.41	477,462.34
M & T BANK CORP	6,915	118.89	822,124.35
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	21,566	15.27	329,312.82
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	15,218	16.04	244,096.72
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	24,013	87.71	2,106,180.23
REGIONS FINANCIAL CORPORATION	60,408	9.30	561,794.40
SIGNATURE BANK	2,300	142.47	327,681.00
SUNTRUST BANKS INC	23,766	41.99	997,934.34
US BANCORP	81,271	43.05	3,498,716.55
WELLS FARGO & COMPANY	226,382	50.51	11,434,554.82
AFFILIATED MANAGERS GROUP	2,457	174.93	429,803.01
ALLY FINANCIAL INC	20,464	18.48	378,174.72
AMERICAN EXPRESS COMPANY	39,265	65.70	2,579,710.50
AMERIPRISE FINANCIAL INC	8,391	98.86	829,534.26
BANK OF NEW YORK MELLON CORP(THE)	51,766	40.67	2,105,323.22
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	55,208	146.18	8,070,305.44
BLACKROCK INC	5,775	363.66	2,100,136.50
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	25,066	74.99	1,879,699.34
CME GROUP INC.	14,985	93.70	1,404,094.50
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	20,303	56.88	1,154,834.64
E*TRADE FINANCIAL CORPORATION	13,758	25.96	357,157.68
EATON VANCE CORP	5,530	35.76	197,752.80
FRANKLIN RESOURCES INC	17,532	40.15	703,909.80
GOLDMAN SACHS GROUP INC	17,856	165.09	2,947,847.04
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	5,527	240.41	1,328,746.07
INVESCO LIMITED	20,708	31.82	658,928.56
LEGG MASON INC	4,006	34.63	138,727.78
LEUCADIA NATIONAL CORPORATION	15,223	16.89	257,116.47
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	12,330	103.16	1,271,962.80
MOODY'S CORP	8,503	98.88	840,776.64
MORGAN STANLEY	67,738	27.53	1,864,827.14
MSCI INC-A	5,000	75.34	376,700.00
NASDAQ INC	5,692	64.17	365,255.64
NAVIENT CORPORATION	15,911	13.45	214,002.95
NORTHERN TRUST CORP	10,598	71.67	759,558.66
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	5,579	53.50	298,476.50
SCHWAB (CHARLES) CORP	55,256	29.63	1,637,235.28
SEI INVESTMENTS COMPANY	7,092	48.36	342,969.12
STATE STREET CORP	19,301	61.41	1,185,274.41
SYNCHRONY FINANCIAL	38,885	30.44	1,183,659.40
T ROWE PRICE GROUP INC	11,704	76.97	900,856.88
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	11,968	31.76	380,103.68

AFLAC INC	20,314	67.87	1,378,711.18
ALLEGHANY CORPORATION	770	512.31	394,478.70
ALLSTATE CORP	17,660	65.61	1,158,672.60
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	57,492	55.95	3,216,677.40
AON PLC	12,982	103.45	1,342,987.90
ARCH CAPITAL GROUP LTD.	5,391	71.07	383,138.37
ARTHUR J GALLAGHER & CO	8,087	44.91	363,187.17
ASSURANT INC	3,249	78.98	256,606.02
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	4,260	54.59	232,553.40
CHUBB LTD	21,268	119.05	2,531,955.40
CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,722	64.56	498,532.32
EVEREST RE GROUP LTD	2,147	193.43	415,294.21
FNF GROUP	11,145	32.66	363,995.70
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	18,985	44.80	850,528.00
LINCOLN NATIONAL CORP	11,366	43.79	497,717.14
LOEWS CORPORATION	13,343	39.68	529,450.24
MARKEL CORP	630	894.69	563,654.70
MARSH & MCLENNAN COS	24,458	62.09	1,518,597.22
METLIFE INC	43,953	46.24	2,032,386.72
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	13,370	43.43	580,659.10
PROGRESSIVE CORP	27,420	32.86	901,021.20
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	21,195	78.85	1,671,225.75
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,159	115.76	249,925.84
TORCHMARK CORPORATION	5,751	57.04	328,037.04
TRAVELERS COS INC(THE)	14,351	110.34	1,583,489.34
UNUM GROUP	11,114	33.61	373,541.54
VOYA FINANCIAL INC	10,075	32.65	328,948.75
W.R.BERKLEY CORPORATION	4,740	55.85	264,729.00
WILLIS TOWERS WATSON PLC	6,260	123.30	771,858.00
XL GROUP PLC	13,694	35.76	489,697.44
CBRE GROUP INC-A	14,256	30.01	427,822.56
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	15,252	87.18	1,329,669.36
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	25,000	6.46	161,500.00
JONES LANG LASALLE INC	2,108	116.48	245,539.84
REALOGY HOLDINGS CORP	6,236	36.08	224,994.88
WEYERHAEUSER CO	36,775	31.89	1,172,754.75
ACCENTURE PLC-CL A	29,144	114.10	3,325,330.40
ACTIVISION BLIZZARD INC	24,807	34.92	866,260.44
ADOBE SYSTEMS INC	23,611	95.80	2,261,933.80
AKAMAI TECHNOLOGIES	8,580	51.09	438,352.20
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	2,793	203.90	569,492.70
ALPHABET INC-CL A	13,579	742.21	10,078,469.59

ALPHABET INC-CL C	14,503	723.15	10,487,844.45
ANSYS INC	4,110	91.49	376,023.90
AUTODESK INC	10,253	59.99	615,077.47
AUTOMATIC DATA PROCESSING	21,592	89.58	1,934,211.36
CA INC	14,472	30.22	437,343.84
CDK GLOBAL INC	6,408	47.50	304,380.00
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	3,494	84.34	294,683.96
CITRIX SYSTEMS INC	7,141	82.79	591,203.39
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATION	28,634	60.21	1,724,053.14
EBAY INC	51,558	24.22	1,248,734.76
ELECTRONIC ARTS INC	14,215	65.93	937,194.95
EQUINIX INC	3,182	326.82	1,039,941.24
FACEBOOK INC-A	105,794	110.10	11,647,919.40
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	13,249	65.70	870,459.30
FISERV INC	10,876	98.88	1,075,418.88
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	3,469	153.46	532,352.74
FORTINET INC	6,500	31.29	203,385.00
GARTNER INC	4,207	87.84	369,542.88
GLOBAL PAYMENTS INC	5,600	73.29	410,424.00
INTL BUSINESS MACHINES CORP	42,876	148.81	6,380,377.56
INTUIT INC	11,882	102.36	1,216,241.52
LINKEDIN CORP-A	5,651	120.48	680,832.48
MASTERCARD INC-CL A	46,187	96.98	4,479,215.26
MICROSOFT CORP	353,569	52.11	18,424,480.59
NETSUITE INC	2,000	77.73	155,460.00
NUANCE COMMUNICATIONS INC	11,121	17.90	199,065.90
ORACLE CORPORATION	148,799	40.78	6,068,023.22
PAYCHEX INC	15,132	52.57	795,489.24
PAYPAL HOLDINGS INC	50,583	39.82	2,014,215.06
RED HAT INC	8,251	74.47	614,451.97
SABRE CORP	8,000	27.89	223,120.00
SALESFORCE.COM, INC.	29,649	76.51	2,268,444.99
SERVICENOW INC	6,961	73.41	511,007.01
SPLUNK INC	5,933	51.81	307,388.73
SYMANTEC CORPORATION	31,068	18.10	562,330.80
SYNOPSYS INC	7,563	48.84	369,376.92
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	2,186	49.86	108,993.96
TERADATA CORP	7,209	26.32	189,740.88
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	7,323	51.51	377,207.73
TWITTER INC	25,955	17.09	443,570.95
VANTIV INC-CL A	7,696	54.63	420,432.48
VERISIGN INC	4,574	89.28	408,366.72

VISA INC	90,433	78.14	7,066,434.62
VMWARE INC	3,826	57.38	219,535.88
WESTERN UNION COMPANY	24,601	19.97	491,281.97
WORKDAY INC-CLASS A	5,247	76.23	399,978.81
XEROX CORP	42,168	9.68	408,186.24
YAHOO! INC	42,241	37.23	1,572,632.43
ZILLOW GROUP INC-C	5,184	24.86	128,874.24
AMPHENOL CORPORATION -CL A	14,435	56.75	819,186.25
APPLE INC	259,887	105.08	27,308,925.96
ARROW ELECTRONICS INC	4,041	63.57	256,886.37
AVNET INC	6,544	43.63	285,514.72
CDW CORP/DE	6,500	40.17	261,105.00
CISCO SYSTEMS INC	235,855	28.23	6,658,186.65
CORNING INC	56,637	20.97	1,187,677.89
EMC CORP/MASS	89,406	26.50	2,369,259.00
F5 NETWORKS INC	3,338	105.31	351,524.78
FLEXTRONICS INTL LTD	27,993	12.12	339,275.16
FLIR SYSTEMS INC	7,048	33.92	239,068.16
HARRIS CORP	5,694	78.77	448,516.38
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE C	83,000	17.21	1,428,430.00
HP INC	86,101	12.57	1,082,289.57
JUNIPER NETWORKS INC	15,583	23.54	366,823.82
MOTOROLA SOLUTIONS INC	7,104	75.51	536,423.04
NETAPP INC	13,593	24.52	333,300.36
PALO ALTO NETWORKS INC	3,859	150.51	580,818.09
QORVO INC	6,774	45.05	305,168.70
QUALCOMM INC	69,660	52.43	3,652,273.80
SANDISK CORP	9,525	75.67	720,756.75
SEAGATE TECHNOLOGY	14,132	26.29	371,530.28
SKYWORKS SOLUTIONS INC	8,902	70.72	629,549.44
TE CONNECTIVITY LTD	18,347	60.19	1,104,305.93
TRIMBLE NAVIGATION LTD	11,191	25.55	285,930.05
WESTERN DIGITAL CORP	10,774	43.34	466,945.16
AT&T INC	286,226	38.21	10,936,695.46
CENTURYLINK INC	26,370	31.18	822,216.60
FRONTIER COMMUNICATIONS CORPORATION	55,620	5.55	308,691.00
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	14,158	53.59	758,727.22
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	6,014	103.49	622,388.86
SPRINT CORP	33,034	3.80	125,529.20
T-MOBILE US INC	12,915	41.18	531,839.70
VERIZON COMMUNICATIONS INC	189,750	50.76	9,631,710.00
AES CORPORATION	29,997	11.00	329,967.00

AGL RESOURCES INC	5,474	65.59	359,039.66
ALLIANT ENERGY CORP	4,948	68.96	341,214.08
AMEREN CORPORATION	11,406	46.97	535,739.82
AMERICAN ELECTRIC POWER	22,853	62.81	1,435,396.93
AMERICAN WATER WORKS CO INC	8,493	70.80	601,304.40
ATMOS ENERGY CORP	4,610	71.32	328,785.20
CALPINE CORP	16,738	14.99	250,902.62
CENTERPOINT ENERGY INC	20,686	21.06	435,647.16
CMS ENERGY CORPORATION	12,676	39.59	501,842.84
COLUMBIA PIPELINE GROUP	17,511	25.55	447,406.05
CONSOLIDATED EDISON INC	13,701	72.25	989,897.25
DOMINION RESOURCES INC/VA	28,256	70.20	1,983,571.20
DTE ENERGY COMPANY	8,619	86.27	743,561.13
DUKE ENERGY CORP	32,212	76.76	2,472,593.12
EDISON INTERNATIONAL	14,818	68.72	1,018,292.96
ENERGY CORP	8,476	74.29	629,682.04
EVERSOURCE ENERGY	15,201	55.50	843,655.50
EXELON CORP	42,120	34.17	1,439,240.40
FIRSTENERGY CORP	19,917	34.45	686,140.65
NEXTERA ENERGY INC	21,249	114.47	2,432,373.03
NRG ENERGY INC	16,034	14.18	227,362.12
OGE ENERGY CORP	9,238	27.90	257,740.20
P G & E CORPORATION	22,413	57.10	1,279,782.30
PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	4,942	71.61	353,896.62
PPL CORPORATION	30,607	36.55	1,118,685.85
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	24,048	45.24	1,087,931.52
SCANA CORP	6,092	66.89	407,493.88
SEMPRA ENERGY	11,320	101.30	1,146,716.00
SOUTHERN CO	42,573	49.27	2,097,571.71
TECO ENERGY INC	12,013	27.72	333,000.36
WEC ENERGY GROUP INC	14,370	56.82	816,503.40
XCEL ENERGY INC	23,635	39.15	925,310.25
ANALOG DEVICES INC	14,416	58.43	842,326.88
APPLIED MATERIALS INC	57,332	20.94	1,200,532.08
BROADCOM LTD	18,024	149.10	2,687,378.40
INTEL CORP	219,427	31.39	6,887,813.53
KLA-TENCOR CORPORATION	7,639	71.59	546,876.01
LAM RESEARCH CORP	7,797	80.22	625,475.34
LINEAR TECHNOLOGY CORP	11,842	45.94	544,021.48
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	18,071	9.95	179,806.45
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	13,285	37.57	499,117.45
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	8,913	49.57	441,817.41

	MICRON TECHNOLOGY INC	50,896	10.55	536,952.80
	NVIDIA CORP	24,940	36.45	909,063.00
	NXP SEMICONDUCTORS NV	6,231	83.34	519,291.54
	TEXAS INSTRUMENTS INC	47,540	59.02	2,805,810.80
	XILINX INC	11,585	45.79	530,477.15
	米ドル 小計	14,725,515		871,439,704.95 (96,703,664,058)
カナダドル	ALTAGAS LTD	6,948	30.06	208,856.88
	ARC RESOURCES LTD	16,083	20.62	331,631.46
	CAMECO CORP	19,538	16.42	320,813.96
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	50,029	38.17	1,909,606.93
	CENOVUS ENERGY INC	39,619	18.91	749,195.29
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	23,425	21.12	494,736.00
	ENBRIDGE INC	43,607	53.05	2,313,351.35
	ENCANA CORP	34,842	9.03	314,623.26
	HUSKY ENERGY INC	15,674	17.54	274,921.96
	IMPERIAL OIL LTD	13,562	41.14	557,940.68
	INTER PIPELINE LTD	17,300	26.40	456,720.00
	KEYERA CORP	7,761	40.15	311,604.15
	PEMBINA PIPELINE CORP	18,567	37.13	689,392.71
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	6,265	32.05	200,793.25
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	9,911	25.14	249,162.54
	SEVEN GENERATIONS ENERGY-A	6,800	22.18	150,824.00
	SUNCOR ENERGY INC	72,773	36.17	2,632,199.41
	TOURMALINE OIL CORP	8,005	28.80	230,544.00
	TRANSCANADA CORP	32,655	50.80	1,658,874.00
	VERESEN INC	13,299	9.06	120,488.94
	VERMILION ENERGY INC	5,586	40.78	227,797.08
	AGNICO EAGLE MINES LIMITED	9,597	51.49	494,149.53
	AGRIUM INC	5,976	109.62	655,089.12
	BARRICK GOLD CORP	53,489	20.49	1,095,989.61
	CCL INDUSTRIES INC-CL B	1,385	230.09	318,674.65
	ELDORADO GOLD CORPORATION	41,255	4.80	198,024.00
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	32,770	8.47	277,561.90
	FRANCO-NEVADA CORPORATION	8,418	82.88	697,683.84
	GOLDCORP INC	38,306	21.48	822,812.88
	KINROSS GOLD CORP	51,579	5.88	303,284.52
	METHANEX CORPORATION	3,622	44.70	161,903.40
	POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	40,782	22.57	920,449.74
	SILVER WHEATON CORPORATION	17,420	23.25	405,015.00
	TECK RESOURCES LIMITED-CL B	27,750	13.06	362,415.00
	TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	45,107	3.52	158,776.64

WEST FRASER TIMBER CO LTD	2,873	40.82	117,275.86
YAMANA GOLD INC	51,365	5.32	273,261.80
BOMBARDIER INC 'B'	80,493	1.80	144,887.40
CAE INC	13,932	14.82	206,472.24
FINNING INTERNATIONAL INC	9,972	21.89	218,287.08
SNC-LAVALIN GROUP INC	6,787	46.62	316,409.94
PROGRESSIVE WASTE SOLUTIONS	4,000	39.09	156,360.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	37,475	82.77	3,101,805.75
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	6,565	183.49	1,204,611.85
LINAMAR CORP	2,200	57.62	126,764.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	19,720	54.85	1,081,642.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	10,518	39.28	413,147.04
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	9,229	52.09	480,738.61
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	18,916	23.70	448,309.20
THOMSON REUTERS CORP	16,217	51.81	840,202.77
CANADIAN TIRE CORP -CL A	3,288	136.07	447,398.16
DOLLARAMA INC	5,395	89.98	485,442.10
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B	19,555	53.90	1,054,014.50
EMPIRE CO LTD A	7,235	20.98	151,790.30
JEAN COUTU GROUP INC A	5,801	20.07	116,426.07
LOBLAW COMPANIES LTD	10,287	69.41	714,020.67
METRO INC	11,599	42.88	497,365.12
WESTON (GEORGE) LTD	2,473	109.89	271,757.97
SAPUTO INC	11,403	40.02	456,348.06
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	15,376	44.85	689,613.60
BANK OF MONTREAL	29,626	81.95	2,427,850.70
BANK OF NOVA SCOTIA	56,105	64.93	3,642,897.65
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	19,002	100.20	1,904,000.40
NATIONAL BANK OF CANADA	15,972	44.96	718,101.12
ROYAL BANK OF CANADA	69,086	77.29	5,339,656.94
TORONTO-DOMINION BANK	86,464	55.67	4,813,450.88
CI FINANCIAL CORP	10,961	27.95	306,359.95
ELEMENT FINANCIAL CORP	19,611	14.62	286,712.82
IGM FINANCIAL INC	5,296	39.31	208,185.76
ONEX CORPORATION	4,217	77.19	325,510.23
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,023	710.00	726,330.00
GREAT-WEST LIFECO INC	14,253	36.87	525,508.11
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANC	3,892	41.39	161,089.88
INTACT FINANCIAL CORPORATION	5,933	91.90	545,242.70
MANULIFE FINANCIAL CORP	93,979	18.82	1,768,684.78
POWER CORP OF CANADA	17,850	30.82	550,137.00
POWER FINANCIAL CORP	10,930	33.19	362,766.70

	SUN LIFE FINANCIAL INC	29,069	43.05	1,251,420.45
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	41,410	43.21	1,789,326.10
	FIRST CAPITAL REALTY INC	4,000	20.35	81,400.00
	CGI GROUP INC - CL A	10,638	59.49	632,854.62
	CONSTELLATION SOFTWARE	897	522.32	468,521.04
	OPEN TEXT CORPORATION	5,489	69.33	380,552.37
	BLACKBERRY LIMITED	23,701	9.22	218,523.22
	BCE INC	6,388	58.37	372,867.56
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	17,418	48.45	843,902.10
	TELUS CORPORATION	9,642	39.57	381,533.94
	ATCO LTD-CLASS I	3,354	38.75	129,967.50
	CANADIAN UTILITIES LIMITED	5,884	35.00	205,940.00
	FORTIS INC	13,071	39.09	510,945.39
	カナダドル 小計	1,857,540		67,170,499.68 (5,880,777,246)
ユーロ	ENI SPA	118,635	14.08	1,670,380.80
	GALP ENERGIA SGPS S.A	20,587	11.89	244,882.36
	NESTE OYJ	6,068	28.99	175,911.32
	OMV AG	7,833	25.60	200,524.80
	REPSOL SA	51,336	11.09	569,316.24
	SAIPEM	254,172	0.37	95,161.99
	TECHNIP S.A.	4,653	51.65	240,327.45
	TENARIS S.A.	22,139	11.85	262,347.15
	TOTAL SA	102,350	43.62	4,464,507.00
	VOPAK	3,334	45.38	151,296.92
	AIR LIQUIDE	16,342	105.75	1,728,166.50
	AKZO NOBEL	11,711	63.30	741,306.30
	ARCELOR MITTAL	69,497	4.84	336,990.95
	ARKEMA	2,963	69.75	206,669.25
	BASF SE	43,458	70.33	3,056,401.14
	CRH PLC	39,026	25.51	995,748.39
	EVONIK INDUSTRIES AG	5,616	27.86	156,489.84
	FUCHS PETROLUB SE-PREF	3,370	39.49	133,081.30
	HEIDELBERGCEMENT AG	6,427	78.88	506,961.76
	IMERYS SA	2,030	63.60	129,108.00
	K+S AG	9,644	21.98	212,023.34
	KONINKLIJKE DSM NV	8,792	52.16	458,590.72
	LANXESS	4,066	45.15	183,579.90
	LINDE AG	8,671	133.00	1,153,243.00
	SOLVAY SA	3,467	89.48	310,227.16
	STORA ENSO OYJ-R SHS	25,257	7.46	188,417.22
	SYMRISE AG	5,820	59.38	345,591.60

THYSSENKRUPP AG	15,738	20.83	327,822.54
UMICORE	4,218	46.12	194,534.16
UPM-KYMMENE OYJ	24,716	14.91	368,515.56
VOESTALPINE AG	4,961	31.25	155,031.25
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	9,330	29.01	270,709.95
AIRBUS GROUP SE	27,244	58.64	1,597,588.16
ALSTOM RGPT	8,041	22.72	182,731.72
ANDRITZ AG	3,301	48.31	159,487.81
BOSKALIS WESTMINSTER NV	3,523	37.02	130,421.46
BOUYGUES SA	10,038	30.61	307,313.37
BRENTAG AG	6,928	50.75	351,596.00
CNH INDUSTRIAL NV	44,474	6.34	282,187.53
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	22,389	40.54	907,762.00
FERROVIAL SA	22,950	19.18	440,181.00
FINMECCANICA SPA	18,294	11.00	201,234.00
GEA GROUP AG	8,548	42.40	362,435.20
KONE OYJ-B	15,772	39.93	629,775.96
KONINKLIJKE PHILIPS NV	45,338	24.07	1,091,512.35
LEGRAND SA	12,536	48.67	610,127.12
MAN SE	1,882	95.29	179,335.78
METSO OYJ	4,880	21.11	103,016.80
OCI NV	3,391	18.28	61,987.48
OSRAM LICHT AG	3,738	45.14	168,752.01
PRYSMIAN SPA	9,328	20.11	187,586.08
REXEL SA	13,762	12.59	173,263.58
SAFRAN SA	14,674	62.35	914,923.90
SCHNEIDER ELECTRIC SE	26,320	58.66	1,543,931.20
SIEMENS AG-REG	36,976	95.44	3,528,989.44
THALES SA	5,075	76.23	386,867.25
VINCI S.A.	22,009	65.48	1,441,149.32
WARTSILA OYJ-B SHARES	6,712	38.25	256,734.00
ZARDOYA OTIS SA	6,593	9.52	62,765.36
ZODIAC AEROSPACE	10,335	20.95	216,569.92
BIC	1,337	136.25	182,166.25
BUREAU VERITAS SA	11,223	20.77	233,157.82
ELENRED	8,942	17.67	158,049.85
PADDY POWER BETFAIR PLC	3,991	107.45	428,832.95
RANDSTAD HOLDING NV	6,118	47.66	291,583.88
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	23,172	14.28	331,012.02
AENA SA	3,179	120.70	383,705.30
AEROPORTS DE PARIS (ADP)	1,346	108.85	146,512.10
ATLANTIA SPA	19,813	24.06	476,700.78

BOLLORE	39,433	3.54	139,789.98
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	12,281	13.85	170,153.25
DEUTSCHE POST AG-REG	45,255	26.04	1,178,440.20
FRAPORT AG	1,856	52.24	96,957.44
GROUPE EUROTUNNEL SE	19,368	10.80	209,174.40
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP	41,090	6.81	279,822.90
RYANAIR HOLDINGS PLC	1,614	13.07	21,094.98
TNT EXPRESS NV	24,873	7.93	197,292.63
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	15,473	81.94	1,267,857.62
BAYERISCHE MOTOREN WERKE(BMW)AG-PFD	2,879	70.96	204,293.84
CONTINENTAL AG	5,286	193.95	1,025,219.70
DAIMLER AG	44,765	62.81	2,811,689.65
FERRARI NV	6,007	38.13	229,046.91
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	40,074	7.22	289,534.65
MICHELIN (CGDE)-B	8,897	96.22	856,069.34
NOKIAN RENKAAT OYJ	5,578	31.77	177,213.06
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PEF	7,484	48.49	362,899.16
PSA PEUGEOT CITROEN	21,050	14.03	295,331.50
RENAULT SA	8,797	88.00	774,136.00
VALEO	3,848	135.20	520,249.60
VOLKSWAGEN AG	1,615	134.55	217,298.25
VOLKSWAGEN AG PFD	7,364	123.10	906,508.40
ADIDAS AG	9,937	107.85	1,071,705.45
CHRISTIAN DIOR SE	2,471	154.95	382,881.45
HERMES INTERNATIONAL	1,283	308.30	395,548.90
HUGO BOSS AG	3,209	56.38	180,923.42
KERING	3,490	150.90	526,641.00
LUXOTTICA GROUP SPA	7,912	47.50	375,820.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	12,870	148.80	1,915,056.00
ACCOR SA	9,735	40.42	393,537.37
SODEXO	4,408	89.81	395,882.48
ALTICE NV -A W/I	16,172	13.59	219,777.48
ALTICE NV -B W/I	3,935	13.72	53,988.20
AXEL SPRINGER SE	2,125	49.20	104,550.00
EUTELSAT COMMUNICATIONS	8,726	26.99	235,558.37
JC DECAUX SA	2,828	38.98	110,249.58
LAGARDERE S.C.A.	6,108	23.66	144,515.28
NUMERICABLE-SFR	4,599	28.66	131,807.34
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE-REG	10,650	45.09	480,208.50
PUBLICIS GROUPE	9,036	64.72	584,809.92
RELX NV	48,624	15.11	734,708.64
RTL GROUP	1,967	73.15	143,886.05

SES	15,312	23.62	361,669.44
TELENET GROUP HOLDINGS NV	2,936	44.16	129,668.44
WOLTERS KLUWER-CVA	14,127	33.71	476,221.17
INDITEX	50,060	29.22	1,462,753.20
CARREFOUR SA	25,669	25.90	664,827.10
CASINO GUICHARD PERRACHON	2,725	52.00	141,700.00
COLRUYT NV	3,273	50.50	165,286.50
DELHAIZE GROUP	4,870	90.76	442,001.20
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	29,663	4.97	147,662.41
JERONIMO MARTINS SGPS S.A.	11,930	14.25	170,002.50
KONINKLIJKE AHOLD NV	39,764	18.95	753,726.62
METRO AG	8,566	29.01	248,499.66
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	37,500	114.30	4,286,250.00
DANONE	27,808	62.95	1,750,513.60
HEINEKEN HOLDING NV	4,695	71.78	337,007.10
HEINEKEN NV	11,060	81.16	897,629.60
KERRY GROUP PLC-A	7,513	81.15	609,679.95
PERNOD-RICARD SA	9,663	96.64	933,832.32
REMY COINTREAU	1,273	74.37	94,673.01
UNILEVER NV-CVA	75,361	40.27	3,035,164.27
BEIERSDORF AG	4,749	79.49	377,498.01
HENKEL AG & CO KGAA	4,785	89.35	427,539.75
HENKEL AG & CO KGAA	8,152	101.75	829,466.00
L'OREAL	11,816	163.50	1,931,916.00
ESSILOR INTERNATIONAL	9,594	115.25	1,105,708.50
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	10,198	78.73	802,888.54
FRESENIUS SE & CO KGAA	17,792	65.71	1,169,112.32
BAYER AG	38,564	109.70	4,230,470.80
GRIFOLS S.A.	14,594	19.80	288,961.20
MERCK KGAA	6,176	81.04	500,503.04
ORION OYJ	4,336	30.04	130,253.44
QIAGEN N.V.	9,901	21.16	209,505.16
SANOFI	54,791	78.67	4,310,407.97
UCB SA	6,014	70.60	424,588.40
ZALANDO SE	4,200	28.67	120,414.00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	300,021	6.41	1,925,234.75
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA-RTS	300,021	0.13	39,302.75
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	1,933,869	0.04	78,901.85
BANCO DE SABADELL SA	247,418	1.68	416,404.49
BANCO DE SABADELL SA-RTS	244,482	0.04	11,490.65
BANCO ESPIRITO SANTO,S.A(BES)	187,906	0.01	1,879.06
BANCO POPOLARE SOCIETA COOPERATIVA	19,054	6.00	114,324.00

BANCO POPULAR ESPANOL	75,616	2.46	186,166.59
BANCO SANTANDER SA	667,146	4.38	2,922,099.48
BANK OF IRELAND	1,306,054	0.26	343,492.20
BANKIA SA	203,996	0.87	177,680.51
BANKINTER,S.A.	34,025	6.66	226,810.65
BNP PARIBAS	48,847	46.64	2,278,468.31
CAIXABANK	128,637	2.74	353,237.20
COMMERZBANK AG	46,558	8.16	380,332.30
CREDIT AGRICOLE SA	48,700	9.86	480,230.70
ERSTE GROUP BANK AG	12,920	25.03	323,387.60
INTESA SANPAOLO	595,505	2.40	1,429,212.00
INTESA SANPAOLO-RSP	50,545	2.27	114,737.15
KBC GROUPE SA	11,308	48.66	550,303.82
NATIXIS	41,035	4.73	194,423.83
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	6,210	13.61	84,549.15
SOCIETE GENERALE	33,109	34.90	1,155,504.10
UNICREDIT SPA	222,882	3.32	741,305.53
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	43,951	3.60	158,487.30
DEUTSCHE BANK AG -REG	63,116	16.07	1,014,589.70
DEUTSCHE BOERSE AG	8,800	74.72	657,536.00
EURAZEO	1,835	62.62	114,907.70
EXOR SPA	4,723	32.75	154,678.25
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,000	76.98	307,920.00
ING GROEP NV-CVA	178,548	11.24	2,006,879.52
MEDIOBANCA SPA	26,522	7.00	185,786.61
WENDEL	1,155	99.60	115,038.00
AEGON NV	83,989	5.11	429,771.71
AGEAS	9,255	34.40	318,372.00
ALLIANZ SE-REG	21,483	154.25	3,313,752.75
ASSICURAZIONI GENERALI	53,806	13.69	736,604.14
AXA SA	92,925	22.65	2,105,215.87
CNP ASSURANCES	10,007	14.93	149,454.54
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	3,033	102.85	311,944.05
MAPFRE SA	43,669	2.26	98,691.94
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	7,756	181.00	1,403,836.00
NN GROUP NV	11,219	30.65	343,862.35
SAMPO OYJ-A SHS	20,982	39.57	830,257.74
SCOR SE	7,073	32.66	231,004.18
UNIPOLSAI SPA	49,963	2.01	100,525.55
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	16,186	26.13	422,940.18
VONOVIA SE	22,617	29.45	666,070.65
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	20,344	39.70	807,656.80

	ATOS SE	4,317	78.16	337,416.72
	CAP GEMINI SA	7,755	78.70	610,318.50
	DASSAULT SYSTEMES SA	5,686	70.18	399,043.48
	GEMALTO	3,838	58.50	224,523.00
	SAP SE	45,495	70.80	3,221,046.00
	UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5,981	42.90	256,614.80
	INGENICO S.A.	2,687	98.32	264,185.84
	NOKIA OYJ	270,408	5.23	1,415,585.88
	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	151,332	15.75	2,383,479.00
	ELISA OYJ	7,124	33.13	236,018.12
	ILIAD SA	1,212	190.45	230,825.40
	KONINKLIJKE KPN NV	144,663	3.38	490,118.24
	ORANGE S.A.	93,233	14.78	1,378,449.90
	PROXIMUS SA	6,287	30.12	189,364.44
	TELECOM ITALIA SPA	510,414	0.85	436,403.97
	TELECOM ITALIA-RNC	281,876	0.69	196,185.69
	TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	31,357	4.67	146,656.68
	TELEFONICA S.A.	212,136	9.79	2,078,084.25
	VIVENDI SA	52,932	18.40	973,948.80
	E.ON SE	94,260	9.04	852,581.70
	EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	112,522	3.07	346,117.67
	ELECTRICITE DE FRANCE(EDF)	10,011	10.88	108,969.73
	ENAGAS	9,716	26.42	256,696.72
	ENDESA S.A.	14,812	17.82	264,023.90
	ENEL SPA	370,188	3.88	1,436,329.44
	ENGIE	69,213	14.03	971,404.45
	FORTUM OYJ	19,645	12.57	246,937.65
	GAS NATURAL SDG SA	15,578	18.30	285,155.29
	IBERDROLA SA	253,407	6.10	1,545,782.70
	RED ELECTRICA CORPORATION S.A.	5,265	77.84	409,827.60
	RWE AG	22,761	12.49	284,284.89
	SNAM SPA	99,230	5.24	519,965.20
	SUEZ ENVIRONNEMENT SA	14,573	16.14	235,208.22
	TERNA SPA	66,992	4.82	323,169.40
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	20,789	21.09	438,440.01
	ASML HOLDING NV	16,167	85.41	1,380,823.47
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	52,646	12.57	661,760.22
	STMICROELECTRONICS NV	28,920	5.07	146,740.08
	ユーロ 小計	13,243,050		151,823,691.97 (18,977,961,496)
英債券	BP PLC	859,512	3.60	3,097,251.49
	PETROFAC LIMITED	9,677	8.66	83,802.82

ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	184,325	17.60	3,244,120.00
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	184,811	17.65	3,262,838.20
ANGLO AMERICAN PLC	59,787	6.79	406,013.51
ANTOFAGASTA PLC	19,439	4.70	91,363.30
BHP BILLITON PLC	101,664	9.30	945,780.19
CRODA INTERNATIONAL PLC	6,446	30.38	195,829.48
FRESNILLO PLC	11,248	10.61	119,341.28
GLENCORE PLC	558,145	1.55	865,124.75
JOHNSON MATTHEY PLC	9,122	28.71	261,892.62
MONDI PLC	17,394	12.92	224,730.48
RANDGOLD RESOURCES LTD	4,386	63.05	276,537.30
REXAM PLC	30,633	6.36	194,979.04
RIO TINTO PLC	57,473	22.37	1,285,958.37
ASHTED GROUP PLC	23,485	9.14	214,652.90
BAE SYSTEMS PLC	144,830	4.89	709,522.17
BUNZL PLC	15,459	20.67	319,537.53
COBHAM PLC	52,943	2.15	113,933.33
IMI PLC	11,445	9.61	109,986.45
MEGGITT PLC	36,073	4.16	150,135.82
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	82,971	6.73	558,394.83
SMITHS GROUP PLC	19,422	11.32	219,857.04
TRAVIS PERKINS PLC	12,496	18.50	231,176.00
WEIR GROUP PLC/THE	10,014	11.87	118,866.18
WOLSELEY PLC	11,749	39.04	458,680.96
AGGREKO PLC	12,848	10.71	137,602.08
BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	11,442	9.60	109,900.41
CAPITA PLC	31,057	10.10	313,675.70
EXPERIAN PLC	45,981	12.59	578,900.79
G4S PLC	81,122	1.96	159,161.36
INTERTEK GROUP PLC	7,790	33.26	259,095.40
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	33,608	4.40	147,875.20
EASYJET PLC	7,630	14.45	110,253.50
ROYAL MAIL PLC	42,103	4.77	201,168.13
GKN PLC	75,574	2.92	220,676.08
BURBERRY GROUP PLC	22,103	12.34	272,751.02
PERSIMMON PLC	14,611	19.19	280,385.09
TAYLOR WIMPEY PLC	151,898	1.79	272,201.21
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	6,152	29.79	183,268.08
CARNIVAL PLC	9,170	35.01	321,041.70
COMPASS GROUP PLC	75,185	12.23	919,512.55
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	10,332	27.70	286,196.40
TUI AG-DI	25,116	9.81	246,513.54

WHITBREAD PLC	8,382	38.67	324,131.94
WILLIAM HILL PLC	41,877	3.23	135,597.72
ITV PLC	177,733	2.32	412,340.56
PEARSON PLC	38,947	8.08	314,691.76
RELX PLC	51,390	12.45	639,805.50
SKY PLC	48,018	9.63	462,653.43
WPP PLC	60,331	16.04	967,709.24
DIXONS CARPHONE PLC	49,868	4.30	214,582.00
KINGFISHER PLC	104,645	3.65	382,372.83
MARKS & SPENCER GROUP PLC	80,284	4.32	347,549.43
NEXT PLC	6,615	51.50	340,672.50
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	11,278	4.07	45,969.12
SAINSBURY (J) PLC	64,189	2.89	185,955.53
TESCO PLC	382,885	1.84	707,380.03
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	114,809	1.90	218,825.95
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	17,085	31.25	533,906.25
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	86,466	41.62	3,599,147.25
COCA-COLA HBC AG-CDI	8,704	13.98	121,681.92
DIAGEO PLC	116,296	18.91	2,199,738.84
IMPERIAL BRANDS PLC	44,210	36.81	1,627,370.10
SABMILLER PLC	44,870	42.17	1,892,167.90
TATE & LYLE PLC	24,535	5.96	146,228.60
UNILEVER PLC	60,021	31.87	1,912,869.27
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	47,273	5.24	247,946.88
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	29,912	66.97	2,003,206.64
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	20,802	9.10	189,298.20
SMITH & NEPHEW PLC	42,313	11.43	483,637.59
ASTRAZENECA PLC	58,913	40.84	2,406,006.92
GLAXOSMITHKLINE PLC	225,614	14.74	3,326,678.43
SHIRE PLC	27,626	42.48	1,173,552.48
BARCLAYS PLC	798,323	1.70	1,359,943.23
HSBC HOLDINGS PLC	909,044	4.59	4,177,511.70
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,662,779	0.67	1,799,772.32
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	157,044	2.48	389,940.25
STANDARD CHARTERED PLC	150,529	5.20	783,653.97
3I GROUP PLC	42,520	4.78	203,288.12
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	49,855	3.09	154,201.51
HARGREAVES LANSDOWN PLC	11,178	13.01	145,425.78
ICAP PLC	27,845	4.79	133,544.62
INVESTEC PLC	24,264	5.29	128,477.88
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	14,510	27.43	398,009.30
PROVIDENT FINANCIAL PLC	7,000	29.46	206,220.00

	SCHRODERS PLC	5,835	25.58	149,259.30
	ADMIRAL GROUP PLC	10,760	18.51	199,167.60
	AVIVA PLC	191,080	4.35	831,389.08
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	63,880	3.48	222,302.40
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	273,638	2.43	665,213.97
	OLD MUTUAL PLC	223,346	1.90	425,697.47
	PRUDENTIAL PLC	118,451	14.13	1,674,304.88
	RSA INSURANCE GROUP PLC	49,032	4.64	227,704.60
	ST JAMES' S PLACE PLC	26,198	9.15	239,842.69
	STANDARD LIFE PLC	98,946	3.34	331,172.26
	AUTO TRADER GROUP PLC	44,900	3.69	165,860.60
	SAGE GROUP PLC/THE	47,258	6.00	283,784.29
	WORLDPAY GROUP PLC	56,000	2.55	143,304.00
	BT GROUP PLC	394,887	4.29	1,695,842.22
	INMARSAT PLC	20,829	9.46	197,146.48
	VODAFONE GROUP PLC	1,230,315	2.27	2,797,121.15
	CENTRICA PLC	244,720	2.32	568,484.56
	NATIONAL GRID PLC	172,671	9.65	1,667,483.84
	SEVERN TRENT PLC	10,991	21.71	238,614.61
	SSE PLC	47,906	14.88	712,841.28
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	31,939	9.23	294,956.66
	ARM HOLDINGS PLC	64,682	9.30	601,542.60
	英債券 小計	13,577,717		74,557,184.31 (11,988,795,237)
スイスフラン	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	421	475.75	200,290.75
	GIVAUDAN-REG	440	1,921.00	845,240.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	20,616	47.78	985,032.48
	SIKA AG	96	3,985.00	382,560.00
	SYNGENTA AG	4,387	400.40	1,756,554.80
	ABB LTD	102,973	20.15	2,074,905.95
	GEBERIT AG-REG	1,786	352.10	628,850.60
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,025	178.90	183,372.50
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,055	179.00	367,845.00
	SULZER AG	478	87.60	41,872.80
	ADECCO SA-REG	7,984	63.75	508,980.00
	SGS SA	252	2,154.00	542,808.00
	KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	2,501	139.70	349,389.70
	CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-REGD A	23,917	64.10	1,533,079.70
	THE SWATCH GROUP AG-B	1,413	327.70	463,040.10
	THE SWATCH GROUP AG-REG	2,516	64.80	163,036.80
	DUFREY AG-REG	2,088	128.80	268,934.40
	ARYZTA AG	4,011	36.78	147,524.58

	BARRY CALLEBAUT AG-REG	75	1,132.00	84,900.00
	LINDT & SPRUENGLI AG	45	6,000.00	270,000.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	5	71,910.00	359,550.00
	NESTLE SA-REGISTERED	148,594	72.40	10,758,205.60
	SONOVA HOLDING AG	2,594	129.50	335,923.00
	ACTELION LTD	4,637	156.90	727,545.30
	GALENICA AG-REG	170	1,462.00	248,540.00
	LONZA GROUP AG-REG	2,430	162.40	394,632.00
	NOVARTIS AG-REG SHS	106,192	74.70	7,932,542.40
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	32,764	248.90	8,154,959.60
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	83,165	14.74	1,225,852.10
	JULIUS BAER GROUP LTD	10,048	40.93	411,264.64
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,867	66.35	123,875.45
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	813	394.75	320,931.75
	UBS GROUP AG	172,904	16.20	2,801,044.80
	BALOISE HOLDING AG	2,242	121.30	271,954.60
	SWISS LIFE HOLDING AG	1,572	252.90	397,558.80
	SWISS RE AG	16,128	92.75	1,495,872.00
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	6,896	215.00	1,482,640.00
	SWISS PRIME SITE-REG	2,983	84.35	251,616.05
	SWISSCOM AG-REG	1,198	491.40	588,697.20
	スイスフラン 小計	776,281		50,081,423.45 (5,701,269,245)
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	9,278	143.30	1,329,537.40
	BOLIDEN AB	12,521	138.40	1,732,906.40
	ALFA LAVAL AB	13,757	132.30	1,820,051.10
	ASSA ABLOY AB-B	46,371	165.20	7,660,489.20
	ATLAS COPCO AB-A SHS	30,896	220.50	6,812,568.00
	ATLAS COPCO AB-B SHS	18,623	205.10	3,819,577.30
	SANDVIK AB	52,526	86.90	4,564,509.40
	SKANSKA AB-B SHS	18,229	176.90	3,224,710.10
	SKF AB-B SHARES	18,017	146.00	2,630,482.00
	VOLVO AB-B SHS	69,481	98.45	6,840,404.45
	SECURITAS AB-B SHS	16,445	132.80	2,183,896.00
	ELECTROLUX AB-SER B	11,157	218.60	2,438,920.20
	HUSQVARNA AB-B SHS	18,159	64.40	1,169,439.60
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	45,336	297.30	13,478,392.80
	ICA GRUPPEN AB	3,550	263.70	936,135.00
	SWEDISH MATCH AB	8,874	276.20	2,450,998.80
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	27,897	248.40	6,929,614.80
	GETINGE AB-B SHS	9,231	174.70	1,612,655.70
	NORDEA BANK AB	138,782	79.25	10,998,473.50

	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A	69,802	80.50	5,619,061.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	70,549	107.10	7,555,797.90	
	SWEDBANK AB - A SHARES	41,670	168.90	7,038,063.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	9,247	146.00	1,350,062.00	
	INVESTOR AB-B SHS	20,877	307.40	6,417,589.80	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	11,257	254.40	2,863,780.80	
	ERICSSON LM-B SHS	143,702	66.35	9,534,627.70	
	HEXAGON AB-B SHS	11,565	328.30	3,796,789.50	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	3,357	486.40	1,632,844.80	
	TELE2 AB-B SHS	13,516	76.90	1,039,380.40	
	TELIA CO AB	125,223	39.34	4,926,272.82	
	スウェーデンクローナ 小計	1,089,895		134,408,031.47 (1,831,981,468)	
ノルウェーク ローネ	STATOIL ASA	51,550	136.00	7,010,800.00	
	NORSK HYDRO ASA	67,630	34.72	2,348,113.60	
	YARA INTERNATIONAL ASA	8,259	323.10	2,668,482.90	
	SCHIBSTED ASA	3,623	236.70	857,564.10	
	SCIBSTED ASA-B SHS	4,063	231.60	940,990.80	
	ORKLA ASA	36,819	68.90	2,536,829.10	
	DNB ASA	45,573	104.40	4,757,821.20	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	9,626	135.70	1,306,248.20	
	TELENOR ASA	35,231	135.60	4,777,323.60	
	ノルウェークローネ 小計	262,374		27,204,173.50 (367,800,425)	
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	4,400	408.00	1,795,200.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	11,427	314.10	3,589,220.70	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	10,326	430.00	4,440,180.00	
	ISS A/S	7,233	254.50	1,840,798.50	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-A	178	9,055.00	1,611,790.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	334	9,340.00	3,119,560.00	
	DSV A/S	8,652	269.50	2,331,714.00	
	PANDORA A/S	4,936	841.50	4,153,644.00	
	CARLSBERG AS-B	5,061	629.00	3,183,369.00	
	COLOPLAST-B	5,574	487.50	2,717,325.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	1,329	676.00	898,404.00	
	GENMAB A/S	2,452	970.00	2,378,440.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	90,882	371.50	33,762,663.00	
	DANSKE BANK A/S	32,814	176.60	5,794,952.40	
	TRYG A/S	5,005	124.60	623,623.00	
TDC A/S	39,176	33.20	1,300,643.20		
	デンマーククローネ 小計	229,779		73,541,526.80 (1,235,497,650)	

オーストラリア ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	12,366	33.01	408,201.66
	OIL SEARCH LTD	63,482	6.95	441,199.90
	ORIGIN ENERGY LIMITED	79,413	5.39	428,036.07
	SANTOS LTD	77,838	4.62	359,611.56
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	34,805	27.85	969,319.25
	ALUMINA LTD	106,977	1.41	150,837.57
	AMCOR LIMITED	51,549	15.13	779,936.37
	BHP BILLITON LTD	151,035	20.36	3,075,072.60
	BORAL LIMITED	36,380	6.28	228,466.40
	FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	68,421	3.36	229,894.56
	ILUKA RESOURCES LIMITED	22,902	6.27	143,595.54
	INCITEC PIVOT LTD	85,406	3.20	273,299.20
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	19,258	18.72	360,509.76
	NEWCREST MINING LIMITED	36,185	17.90	647,711.50
	ORICA LIMITED	17,233	15.37	264,871.21
	RIO TINTO LIMITED	19,122	51.00	975,222.00
	SOUTH32 LTD	251,285	1.67	419,645.95
	CIMIC GROUP LTD	4,188	35.01	146,621.88
	BRAMBLES LIMITED	73,679	12.51	921,724.29
	SEEK LIMITED	16,538	16.21	268,080.98
	ASCIANO LTD	30,546	8.86	270,637.56
	AURIZON HOLDINGS LTD	92,162	4.29	395,374.98
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	24,631	3.37	83,006.47
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	28,401	9.82	278,897.82
	CROWN RESORTS LTD	16,142	11.80	190,475.60
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	2,650	39.36	104,304.00
	TABCORP HOLDINGS LIMITED	36,322	4.50	163,449.00
	TATTS GROUP LTD	66,783	3.80	253,775.40
	REA GROUP LTD	2,708	50.15	135,806.20
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	23,253	4.28	99,522.84
	WESFARMERS LIMITED	52,853	41.82	2,210,312.46
	WOOLWORTHS LIMITED	57,686	21.72	1,252,939.92
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	26,498	8.56	226,822.88
	TREASURY WINE ESTATES LTD	38,653	9.35	361,405.55
	COCHLEAR LIMITED	2,717	105.50	286,643.50
	HEALTHSCOPE LTD	88,691	2.76	244,787.16
RAMSAY HEALTH CARE LTD	6,579	63.58	418,292.82	
SONIC HEALTHCARE LTD	18,440	19.63	361,977.20	
CSL LIMITED	21,651	104.65	2,265,777.15	
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	134,375	24.35	3,272,031.25	
BANK OF QUEENSLAND LIMITED	17,851	12.02	214,569.02	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	18,619	9.33	173,715.27	

	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	79,155	75.04	5,939,791.20
	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	122,872	27.64	3,396,182.08
	WESTPAC BANKING CORPORATION	153,810	31.32	4,817,329.20
	ASX LTD	9,096	44.10	401,133.60
	CHALLENGER FINANCIAL SERVICE	30,000	8.89	266,700.00
	MACQUARIE GROUP LTD	14,650	67.05	982,282.50
	PLATINUM ASSET MANAGEMENT	7,772	6.05	47,020.60
	AMP LIMITED	139,602	5.85	816,671.70
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	117,694	5.79	681,448.26
	MEDIBANK PRIVATE LTD	115,915	3.13	362,813.95
	QBE INSURANCE GROUP LIMITED	64,545	11.34	731,940.30
	SUNCORP GROUP LTD	63,980	12.59	805,508.20
	COMPUTERSHARE LIMITED	21,847	10.27	224,368.69
	VOCUS COMMUNICATIONS LTD	20,917	8.80	184,069.60
	TELSTRA CORPORATION LIMITED	194,462	5.40	1,050,094.80
	TPG TELECOM LTD	13,145	10.64	139,862.80
	AGL ENERGY LIMITED	31,834	18.27	581,607.18
	AUSNET SERVICES	85,220	1.52	129,960.50
	オーストラリアドル 小計	3,322,789		46,315,167.46 (3,964,578,334)
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	34,160	8.36	285,577.60
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	45,835	6.40	293,573.17
	RYMAN HEALTHCARE LIMITED	15,480	8.82	136,533.60
	SPARK NEW ZEALAND LIMITED	82,677	3.54	292,676.58
	CONTACT ENERGY LIMITED	35,357	5.10	180,320.70
	MERIDIAN ENERGY LTD	46,571	2.65	123,413.15
	MIGHTY RIVER POWER	40,157	3.01	120,872.57
	ニュージーランドドル 小計	300,237		1,432,967.37 (109,292,421)
香港ドル	NWS HOLDINGS LTD	67,500	11.94	805,950.00
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	48,000	13.18	632,640.00
	MTR CORPORATION	68,000	38.70	2,631,600.00
	LI & FUNG LTD	267,200	4.87	1,301,264.00
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	64,500	29.20	1,883,400.00
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	28,500	27.50	783,750.00
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	115,000	27.75	3,191,250.00
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	44,000	11.34	498,960.00
	SANDS CHINA LTD	112,000	28.15	3,152,800.00
	SHANGRI-LA ASIA LTD.	64,000	9.41	602,240.00
	SJM HOLDINGS LIMITED	92,000	5.40	496,800.00
	WYNN MACAU LTD	78,000	11.66	909,480.00
	WH GROUP LIMITED	257,000	6.13	1,575,410.00
	BANK OF EAST ASIA	53,020	29.00	1,537,580.00

	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	178,000	24.20	4,307,600.00	
	HANG SENG BANK LTD	35,400	140.70	4,980,780.00	
	CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	131,924	52.10	6,873,240.40	
	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	126,924	96.40	12,235,473.60	
	FIRST PACIFIC COMPANY	86,000	4.88	419,680.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	54,500	199.70	10,883,650.00	
	AIA GROUP LTD	557,600	47.30	26,374,480.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	105,000	16.08	1,688,400.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	56,232	49.85	2,803,165.20	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	29,000	33.00	957,000.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	27,500	21.85	600,875.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	259,333	7.85	2,035,764.05	
	SINO LAND CO	124,200	12.36	1,535,112.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	82,000	98.35	8,064,700.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	25,000	84.45	2,111,250.00	
	SWIRE PROPERTIES LIMITED	51,400	21.00	1,079,400.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	65,000	43.35	2,817,750.00	
	WHELOCK&COMPANY LTD	46,000	36.30	1,669,800.00	
	PCCW LIMITED	236,000	5.28	1,246,080.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	32,000	74.95	2,398,400.00	
	CLP HOLDINGS LTD	88,600	72.90	6,458,940.00	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS-SS	99,000	6.94	687,060.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	319,074	14.58	4,652,098.92	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	66,500	77.70	5,167,050.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	12,200	58.00	707,600.00	
	香港ドル 小計	4,253,107		132,758,473.17 (1,899,773,751)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	65,600	5.55	364,080.00	
	NOBLE GROUP LTD	245,400	0.45	110,430.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	42,020	2.92	122,698.40	
	SEMBCORP MARINE LTD	37,100	1.75	64,925.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG	64,400	3.25	209,300.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	90,000	0.99	89,550.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	107,000	2.87	307,090.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	24,266	11.46	278,088.36	
	GENTING SINGAPORE PLC	258,200	0.83	215,597.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	78,350	4.13	323,585.50	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	5,500	42.80	235,400.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	353,600	0.41	144,976.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	85,700	3.55	304,235.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	81,000	15.70	1,271,700.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	144,200	9.28	1,338,176.00	

	UNITED OVERSEAS BANK LTD	59,700	19.52	1,165,344.00
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	38,700	7.73	299,151.00
	CAPITALAND LTD	122,300	3.09	377,907.00
	CITY DEVELOPMENTS LTD	21,000	8.71	182,910.00
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LIMITED	128,000	1.91	245,120.00
	UOL GROUP LIMITED	16,100	6.11	98,371.00
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	382,915	3.89	1,489,539.35
	STARHUB LIMITED	24,500	3.32	81,340.00
	シンガポールドル 小計	2,475,551		9,319,513.61 (764,945,677)
イスラエルシュケル	DELEK GROUP LTD	213	664.00	141,432.00
	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	20,822	18.40	383,124.80
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	42,286	217.10	9,180,290.60
	BANK HAPOLIM BM	53,151	19.60	1,041,759.60
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	64,754	14.00	906,556.00
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	4,453	44.10	196,377.30
	AZRIELI GROUP	1,863	150.60	280,567.80
	NICE SYSTEMS LTD	2,554	241.10	615,769.40
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	96,068	8.10	778,150.80
	イスラエルシュケル 小計	286,164		13,524,028.30 (398,688,354)
	合 計	56,399,999		149,825,025,362 (149,825,025,362)

(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 601銘柄	60.7%	64.5%
カナダドル	株式 90銘柄	3.7%	3.9%
ユーロ	株式 233銘柄	11.9%	12.7%
英ポンド	株式 108銘柄	7.5%	8.0%
スイスフラン	株式 39銘柄	3.6%	3.8%
スウェーデンクローナ	株式 30銘柄	1.2%	1.2%
ノルウェークローネ	株式 9銘柄	0.2%	0.2%
デンマーククローネ	株式 16銘柄	0.8%	0.8%
オーストラリアドル	株式 60銘柄	2.5%	2.6%
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 39銘柄	1.2%	1.3%
シンガポールドル	株式 23銘柄	0.5%	0.5%
イスラエルシュケル	株式 9銘柄	0.3%	0.3%

(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
投資証券	米ドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	15,293	285,367.38	
		AMERICAN TOWER CORP	19,734	2,055,888.12	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	45,539	472,694.82	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,240	1,133,496.00	
		BOSTON PROPERTIES INC	7,225	939,250.00	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	7,861	200,219.67	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,186	345,638.02	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	6,689	584,685.49	
		DUKE REALTY CORP	16,643	368,975.31	
		EQUITY RESIDENTIAL	16,955	1,208,213.30	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,011	684,882.06	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	5,203	449,799.35	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	3,095	471,616.10	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	26,153	749,806.51	
		HCP, INC.	21,687	737,574.87	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	34,373	524,875.71	
		HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	283,000	130,180.00	
		IRON MOUNTAIN INC	9,338	331,499.00	
		KIMCO REALTY CORPORATION	19,336	549,915.84	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	7,065	246,144.60	
		MACERICH COMPANY/THE	6,260	482,082.60	
		MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	3,800	369,550.00	
		PROLOGIS INC	23,826	1,090,992.54	
		PUBLIC STORAGE	6,764	1,748,426.36	
		REALTY INCOME CORPORATION	11,331	683,485.92	
		REGENCY CENTERS CORP	4,147	307,002.41	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	14,456	2,944,253.52	
		SL GREEN REALTY CORP	4,650	492,481.50	
		UDR INC	12,366	451,111.68	
		VENTAS INC	15,512	951,971.44	
		VEREIT INC	41,004	363,295.44	
		VORNADO REALTY TRUST	7,967	766,106.72	
	WELLTOWER INC	16,318	1,130,837.40		
	米ドル 小計		727,027	24,252,319.68 (2,691,279,914)	
カナダドル		H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	4,711	101,522.05	
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	6,847	185,896.05	
		SMART REAL ESTATE INVESTMENT	2,057	68,806.65	
			13,615	356,224.75	

カナダドル 小計			(31,187,476)
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	1,550	128,448.50
	GECINA SA	1,519	188,811.70
	ICADE	1,873	125,097.67
	KLEPIERRE	10,809	438,575.17
	UNIBAIL-RODAMCO SE	4,575	1,091,137.50
ユーロ 小計		20,326	1,972,070.54 (246,508,817)
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	42,823	301,259.80
	HAMMERSON PLC	37,833	219,242.23
	INTU PROPERTIES PLC	38,514	114,348.06
	LAND SECURITIES GROUP PLC	35,900	393,105.00
	SEGRO PLC	36,381	150,399.05
英ポンド 小計		191,451	1,178,354.14 (189,479,345)
オーストラリアドル	APA GROUP	53,427	458,403.66
	DEXUS PROPERTY GROUP	42,722	350,747.62
	DUET GROUP	95,542	213,058.66
	GOODMAN GROUP	83,175	562,263.00
	GPT GROUP	90,527	435,434.87
	LENDLEASE GROUP	27,382	341,179.72
	MIRVAC GROUP	186,000	349,680.00
	SCENTRE GROUP	257,708	1,167,417.24
	STOCKLAND	107,141	454,277.84
	SYDNEY AIRPORT	54,494	360,205.34
	TRANSURBAN GROUP	94,148	1,073,287.20
	VICINITY CENTRES	149,882	487,116.50
	WESTFIELD CORP	91,040	904,937.60
オーストラリアドル 小計		1,333,188	7,158,009.25 (612,725,591)
香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	121,000	1,323,740.00
	LINK REIT	103,000	4,964,600.00
香港ドル 小計		224,000	6,288,340.00 (89,986,145)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	109,000	268,140.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	120,300	175,638.00
	CAPITALAND MALL TRUST	130,700	273,163.00
	SUNTEC REIT	101,400	172,887.00
シンガポールドル 小計		461,400	889,828.00 (73,037,082)
合計			3,934,204,370 (3,934,204,370)

（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 33銘柄	1.7%	68.4%
カナダドル	投資証券 3銘柄	0.0%	0.8%
ユーロ	投資証券 5銘柄	0.2%	6.3%
英ポンド	投資証券 5銘柄	0.1%	4.8%
オーストラリアドル	投資証券 13銘柄	0.4%	15.6%
香港ドル	投資証券 2銘柄	0.1%	2.3%
シンガポールドル	投資証券 4銘柄	0.0%	1.9%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

エマージング株式インデックス・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

（平成28年 4月26日現在）

資産の部	
流動資産	
預金	193,185,264
金銭信託	4,495,676
コール・ローン	943,311
国債証券	887,573,630
派生商品評価勘定	101,017,159
未収入金	32,000,000
差入委託証拠金	947,154,178
流動資産合計	2,166,369,218
資産合計	2,166,369,218
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	857,806
前受金	100,261,949
未払利息	2
その他未払費用	318
流動負債合計	101,120,075
負債合計	101,120,075
純資産の部	
元本等	
元本	2,006,026,513
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	59,222,630
元本等合計	2,065,249,143
純資産合計	2,065,249,143
負債純資産合計	2,166,369,218

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成27年 4月17日 至 平成28年 4月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

項目	(平成28年 4月26日現在)
1. 担保資産	<p>代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p style="text-align: right;">国債証券 110,937,263円</p>
2. 当計算期間の末日における受益権の総数	2,006,026,513口
3. 1単位当たり純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.0295円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 10,295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27年 4月17日 至 平成28年 4月26日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1)金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。当計算期間については、先物取引、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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28年 4月26日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（国債証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

（平成28年 4月26日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

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

（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）

該当事項はありません。

（その他の注記）

（平成28年 4月26日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	119,552,288円
同期中における追加設定元本額	4,468,494,427円
同期中における一部解約元本額	2,582,020,202円
平成28年 4月26日現在における元本の内訳	
三井住友・DC全海外株式インデックスファンド	180,024,359円
三井住友・DC新興国株式インデックスファンド	219,672,433円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	216,585,271円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	620,259,723円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	769,258,695円
S M A M ・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	226,032円
合計	2,006,026,513円

附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	TREASURY BILL	4,000,000.00	3,999,500.54	
		TREASURY BILL	4,000,000.00	3,998,820.00	代用有価証券で 1,000,000米ドル(券 面総額)担保差入
	米ドル 小計		8,000,000.00	7,998,320.54 (887,573,630)	
合計				887,573,630 (887,573,630)	

(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 2銘柄	43.0%	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。

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28年 4月26日現在)

資産の部

流動資産

金銭信託	9,126,219
コール・ローン	1,914,920
投資証券	12,244,364,800
未収入金	132,111,100
未収配当金	96,781,619
流動資産合計	12,484,298,658

資産合計

12,484,298,658

負債の部

流動負債

未払解約金	32,235,000
未払利息	5
その他未払費用	827
流動負債合計	32,235,832

（平成28年 4月26日現在）

負債合計	32,235,832
純資産の部	
元本等	
元本	6,025,953,718
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	6,426,109,108
元本等合計	12,452,062,826
純資産合計	12,452,062,826
負債純資産合計	12,484,298,658

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成27年 4月17日 至 平成28年 4月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

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

（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27年 4月17日 至 平成28年 4月26日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1)金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</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>

項目	自 平成27年 4月17日 至 平成28年 4月26日
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28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）

該当事項はありません。

（その他の注記）

(平成28年 4月26日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	6,918,251,344円
同期中における追加設定元本額	2,079,164,602円
同期中における一部解約元本額	2,971,462,228円
平成28年 4月26日現在における元本の内訳	

（平成28年 4月26日現在）	
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	154,724,236円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	248,131,237円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	333,044,826円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	12,171,451円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	3,540,901,696円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	1,580,488,457円
S M A M・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定>	339,743円
S M A M・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定>	47,708,545円
S M A M・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	261,016円
S M A M・マルチアセットストラテジーファンド2016-01<適格機関投資家限定>	108,182,511円
合計	6,025,953,718円

附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	486	234,738,000	
	M C U B S M i d C i t y 投資法人	266	96,957,000	
	森ヒルズリート投資法人	1,757	291,837,700	
	産業ファンド投資法人	354	195,762,000	
	大和ハウスリート投資法人	352	204,160,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	1,305	390,717,000	
	ケネディクス・レジデンシャル投資法人	351	107,757,000	
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	601	350,383,000	
	G L P 投資法人	2,599	342,028,400	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	516	125,852,400	
	日本プロロジスリート投資法人	1,845	499,810,500	
	星野リゾート・リート投資法人	78	107,328,000	
	S I A 不動産投資法人	75	32,700,000	
	イオンリート投資法人	1,314	179,755,200	
	ヒューリックリート投資法人	957	186,423,600	
	日本リート投資法人	393	114,441,600	

インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	542	53,658,000
日本ヘルスケア投資法人	75	14,220,000
積水ハウス・リート投資法人	793	103,407,200
トーセイ・リート投資法人	158	18,422,800
ケネディクス商業リート投資法人	422	121,747,000
ヘルスケア&メディカル投資法人	122	13,359,000
サムティ・レジデンシャル投資法人	169	16,139,500
ジャパン・シニアリビング投資法人	87	14,476,800
野村不動産マスターファンド投資法人	3,731	637,254,800
いちごホテルリート投資法人	136	22,684,800
ラサールロジポート投資法人	1,105	114,699,000
日本ビルファンド投資法人	1,415	987,670,000
ジャパンリアルエステイト投資法人	1,312	896,096,000
日本リテールファンド投資法人	2,557	685,787,400
オリックス不動産投資法人	2,425	452,020,000
日本プライムリアルティ投資法人	875	428,750,000
プレミア投資法人	1,319	184,000,500
東急リアル・エステート投資法人	983	160,130,700
グローバル・ワン不動産投資法人	195	89,505,000
ユナイテッド・アーバン投資法人	2,757	534,306,600
森トラスト総合リート投資法人	1,325	285,405,000
インヴィンシブル投資法人	3,660	297,924,000
フロンティア不動産投資法人	498	274,896,000
平和不動産リート投資法人	1,013	93,398,600
日本ロジスティクスファンド投資法人	882	216,972,000
福岡リート投資法人	747	148,727,700
ケネディクス・オフィス投資法人	406	260,652,000
積水ハウス・S I投資法人	1,021	122,928,400
いちごオフィスリート投資法人	1,416	120,076,800
大和証券オフィス投資法人	485	343,865,000
阪急リート投資法人	602	83,437,200
スターツプロシード投資法人	176	30,043,200
トップリート投資法人	177	73,543,500
大和ハウス・レジデンシャル投資法人	751	198,789,700
ジャパン・ホテル・リート投資法人	3,332	336,198,800
日本賃貸住宅投資法人	1,648	144,694,400
ジャパンエクセレント投資法人	1,266	203,826,000
合計	53,832	12,244,364,800

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国リート・インデックス・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）	
（平成28年 4月26日現在）	
資産の部	
流動資産	
預金	21,517,980
金銭信託	851,471
コール・ローン	178,661
投資証券	3,475,903,318
未収入金	33,462,757
未収配当金	5,089,920
流動資産合計	3,537,004,107
資産合計	3,537,004,107
負債の部	
流動負債	
その他未払費用	21
流動負債合計	21
負債合計	21
純資産の部	
元本等	
元本	1,897,750,493
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,639,253,593
元本等合計	3,537,004,086
純資産合計	3,537,004,086
負債純資産合計	3,537,004,107

注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 平成27年 4月17日 至 平成28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>
	為替予約取引

項目	自 平成27年 4月17日 至 平成28年 4月26日
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。
3.収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。
4.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成28年 4月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	1,897,750,493口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.8638円 (10,000口当たりの純資産額 18,638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27年 4月17日 至 平成28年 4月26日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1)金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。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。 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。

項目	自 平成27年 4月17日 至 平成28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	(平成28年 4月26日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

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

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	2,808	94,573.44	
		AGREE REALTY CORP	553	21,970.69	

ALEXANDER'S INC	136	52,362.72	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES, INC.	2,311	215,408.31	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	1,100	41,976.00	
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES INC	3,680	165,673.60	
AMERICAN HOMES 4 RENT-A	6,135	96,626.25	
APARTMENT INVESTMENT & MANEGEMENT CO-A	5,113	208,099.10	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	5,700	107,502.00	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	100	1,168.00	
ASHFORD HOSPITALITY PRIME INC	602	6,411.30	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	512	2,856.96	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	4,083	741,676.95	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	600	6,504.00	
BOSTON PROPERTIES INC	4,535	589,550.00	
BRANDYWINE REALTY TRUST	4,125	61,710.00	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	5,600	142,632.00	
CAMDEN PROPERTY TRUST	2,568	212,039.76	
CARE CAPITAL PROPERTIES INC	2,652	70,781.88	
CARETRUST REIT INC	1,749	22,667.04	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	4,501	53,291.84	
CEDAR REALTY TRUST INC	130	899.60	
CHATHAM LODGING TRUST	800	16,912.00	
CHESAPEAKE LODGING TRUST	1,800	44,190.00	
CITY OFFICE REIT INC	600	6,708.00	
COLONY STARWOOD HOMES	1,000	24,410.00	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	3,900	83,538.00	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	300	5,490.00	
CORESITE REALTY CORPORATION	800	57,456.00	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	3,417	90,072.12	
CORRECTIONS CORPORATION OF AMERICA	3,505	107,673.60	
COUSINS PROPERTIES INC	5,833	61,188.17	
CUBESMART	5,747	175,168.56	
CYRUSONE INC	2,100	91,224.00	
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	2,200	89,078.00	
DDR CORPORATION	9,795	172,489.95	
DIAMONDROCK HOSPITALITY COMPANY	5,857	53,122.99	
DIGITAL REALTY TRUST INC	4,177	365,111.57	
DOUGLAS EMMETT INC	4,500	146,520.00	
DUKE REALTY CORP	9,415	208,730.55	
DUPONT FABROS TECHNOLOGY	2,600	105,664.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES	400	7,320.00	
EASTGROUP PROPERTIES INC	1,002	60,821.40	

EDUCATION REALTY TRUST INC	2,394	95,305.14
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	3,500	64,785.00
EPR PROPERTIES	2,104	137,580.56
EQUITY COMMONWEALTH REIT	3,008	81,817.60
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	2,058	144,348.12
EQUITY ONE INC	2,087	58,477.74
EQUITY RESIDENTIAL	10,870	774,596.20
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,849	420,573.54
EXTRA SPACE STORAGE INC	3,814	329,720.30
FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	2,052	312,683.76
FELCOR LODGING TRUST INC	2,567	19,791.57
FIRST INDUSTRIAL REALTY TRUST INC	3,194	73,206.48
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	3,166	26,721.04
FOREST CITY REALTY TRUST-A	6,500	136,370.00
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	1,639	29,452.83
FRANKLIN STREET PROPERTIES CORPORATION	3,700	40,441.00
GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC	3,200	103,040.00
GENERAL GROWTH PROPERTIES	17,076	489,568.92
GEO GROUP INC	3,000	97,020.00
GETTY REALTY CORPORATION	1,428	28,417.20
GLADSTONE COMMERCIAL CORPORATION	1,440	24,408.00
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME TRUST	1,400	25,550.00
GRAMERCY PROPERTY TRUST	12,187	103,589.50
GROBAL NET LEASE INC	5,300	44,997.00
HCP, INC.	13,618	463,148.18
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	2,272	68,546.24
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA INC	3,200	92,064.00
HERSHA HOSPITALITY TRUST	1,018	20,471.98
HIGHWOODS PROPERTIES INC	2,386	112,452.18
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	4,764	124,816.80
HOST HOTELS AND RESORTS INC	21,383	326,518.41
HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC	2,000	59,600.00
INDEPENDENCE REALTY TRUST	141	1,001.10
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	3,233	22,243.04
IRON MOUNTAIN INC	5,100	181,050.00
KILROY REALTY CORP	2,904	187,540.32
KIMCO REALTY CORPORATION	12,647	359,680.68
KITE REALTY GROUP TRUST	2,261	61,702.69
LASALLE HOTEL PROPERTIES	3,651	88,098.63

LEXINGTON REALTY TRUST	8,927	79,003.95
LIBERTY PROPERTY TRUST	5,195	180,993.80
LTC PROPERTIES INC	976	45,393.76
MACERICH COMPANY/THE	3,787	291,636.87
MACK-CALI REALTY CORPORATION	1,699	42,424.03
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	6,631	87,462.89
MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	2,034	197,806.50
MONMOUTH REAL ESTATE INVESTMENT CORP	3,536	40,593.28
MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST I	4,500	45,675.00
NATIONAL HEALTH INVESTORS INC	1,225	83,361.25
NATIONAL RETAIL PROPERTIES	4,001	178,764.68
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	500	10,170.00
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	2,800	30,828.00
NEW YORK REIT INC	4,500	43,875.00
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST	500	6,980.00
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	2,216	25,949.36
NORTHSTAR REALTY FINANCE	6,650	87,048.50
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC	5,710	197,109.20
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	1,000	22,780.00
PARKWAY PROPERTIES INC	1,994	30,328.74
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	1,900	53,276.00
PENNSYLVANIA REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	2,331	52,564.05
PHYSICIANS REALTY TRUST	3,100	56,606.00
PIEDMONT OFFICE REALTY TRUST INC	4,600	92,184.00
POST PROPERTIES INC	1,882	110,172.28
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	100	1,230.00
PROLOGIS INC	15,487	709,149.73
PS BUSINESS PARKS INC/CA	604	57,984.00
PUBLIC STORAGE	4,416	1,141,491.84
QTS REALTY TRUST INC-CL A	1,000	47,900.00
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	1,740	31,093.80
REALTY INCOME CORPORATION	7,084	427,306.88
REGENCY CENTERS CORP	3,247	240,375.41
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMENTS CORP	4,100	79,540.00
RETAIL PROPERTIES OF AMERICA	7,200	116,208.00
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	1,500	28,380.00
RLJ LODGING TRUST	4,800	104,880.00
ROUSE PROPERTIES INC	478	8,776.08
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	1,500	77,205.00

SABRA HEALTH CARE REIT	2,800	57,596.00	
SAUL CENTERS INC	703	36,830.17	
SELECT INCOME REIT	1,900	43,643.00	
SENIOR HOUSING PROPERTIES TRUST	7,461	132,059.70	
SERITAGE GROWTH PROP- A REIT	500	26,530.00	
SILVER BAY REALTY TRUST CORP	100	1,449.00	
SIMON PROPERTY GROUP INC	9,368	1,907,980.56	
SL GREEN REALTY CORP	3,106	328,956.46	
SOVRAN SELF STORAGE INC	953	104,077.13	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	12,500	140,500.00	
STAG INDUSTRIAL INC	1,900	38,494.00	
STORE CAPITAL CORP	3,200	82,880.00	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	2,700	30,402.00	
SUN COMMUNITIES INC	1,738	119,192.04	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	6,659	86,766.77	
TANGER FACTORY OUTLET CENTERS, INC	2,970	106,920.00	
TAUBMAN CENTERS INC	1,925	134,076.25	
TERRENO REALTY CORP	1,500	34,605.00	
UDR INC	7,412	270,389.76	
UMH PROPERTIES INC	800	7,856.00	
UNIVERSAL HEALTH REALTY INCOME TRUST	715	39,332.15	
URBAN EDGE PROPERTIES	2,634	66,798.24	
URSTADT BIDDLE PROPERTIES - CL A	442	9,034.48	
VENTAS INC	9,810	602,039.70	
VEREIT INC	29,110	257,914.60	
VORNADO REALTY TRUST	5,498	528,687.68	
WASHINGTON REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	2,070	60,775.20	
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	4,067	154,057.96	
WELLTOWER INC	10,544	730,699.20	
WHITESTONE REIT	200	2,590.00	
WINTHROP REALTY TRUST INC	1,200	15,024.00	
WP CAREY INC	3,000	185,220.00	
WP GLIMCHER INC	5,230	53,293.70	
XENIA HOTELS & RESORTS INC	4,000	61,360.00	
米ドル 小計	593,317	22,343,204.73 (2,479,425,428)	
カナダドル			
ALLIED PROPERTIES REAL ESTATE	1,100	37,972.00	
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	1,800	24,318.00	
BOARDWALK REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	735	39,653.25	

	BROOKFIELD CANADA OFFICE PROPERTI-U	800	22,616.00
	CAN APARTMENT PROP	1,797	52,652.10
	CANADIAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,110	49,039.80
	CHOICE PROPERTIES REIT	800	10,168.00
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR	2,692	46,706.20
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,500	20,910.00
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	200	2,882.00
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	2,000	17,800.00
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVEST TR	100	828.00
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	1,476	30,745.08
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	1,000	37,340.00
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	4,012	86,458.60
	INNVEST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,629	8,878.05
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	3,000	22,020.00
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	2,000	24,100.00
	MILESTONE APARTMENTS REAL E	100	1,690.00
	MORGUARD NORTH AMERICAN RE	100	1,177.00
	MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	1,503	22,650.21
	NORTHVIEW APARTMENT REIT	152	2,964.00
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERTIES	1,500	14,190.00
	ONEREIT	3,500	11,760.00
	PLAZA RETAIL REIT	1,500	7,020.00
	PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE	5,000	25,250.00
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,827	103,903.05
	SLATE RETAIL REIT	500	6,750.00
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT	2,005	67,067.25
	カナダドル 小計	47,438	799,508.59 (69,996,977)
ユーロ	AEDIFICA	410	24,932.10
	AFFINE	200	3,232.00
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	3,370	41,029.75
	ALTAREA	70	13,286.00
	ANF IMMOBILIER	750	17,670.00
	AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA	1,730	22,429.45
	BEFIMMO S.C.A.	744	42,817.20
	BENI STABILU SPA	55,650	36,033.37
	COFINIMMO	705	75,928.50

	EUROCOMMERCIAL	1,614	65,528.40
	FONCIERE DES MURS	300	8,103.00
	FONCIERE DES REGIONS	1,467	121,570.29
	GECINA SA	944	117,339.20
	GREEN REIT PLC	24,000	34,200.00
	HAMBORNER REIT AG	2,340	22,562.28
	HIBERNIA REIT PLC	15,000	19,155.00
	ICADE	1,050	70,129.50
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	3,800	3,002.00
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	300	7,215.00
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	10,100	11,160.50
	KLEPIERRE	5,271	213,870.82
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIMI SA	2,620	23,318.00
	MERCIALYS	480	9,249.60
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	9,000	91,665.00
	NSI NV	5,816	23,729.28
	RETAIL ESTATES	200	15,600.00
	UNIBAIL-RODAMCO SE	2,915	695,227.50
	VASTNED RETAIL	525	20,160.00
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	182	14,663.74
	WARELDHAVE BELGIUM CVA/SCA	80	8,908.00
	WERELDHAVE NV	845	39,317.85
	XIOR STUDENT HOUSING NV	50	1,587.50
	ユーロ 小計	152,528	1,914,620.83 (239,327,603)
英ポンド	ASSURA PLC	45,000	24,435.00
	BIG YELLOW GROUP PLC	3,900	29,796.00
	BRITISH LAND CO PLC	29,800	209,643.00
	DERWENT LONDON PLC	3,450	112,884.00
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	10,000	11,075.00
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	11,400	85,671.00
	HAMMERSON PLC	21,400	124,013.00
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	17,900	18,186.40
	INTU PROPERTIES PLC	21,100	62,645.90
	LAND SECURITIES GROUP PLC	24,900	272,655.00
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	20,740	33,163.26
	MCKAY SECURITIES PLC-ORD	100	233.00
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC	18,648	19,580.40
	REDEFINE INTERNATIONAL PLC	40,100	18,678.58
	REGIONAL REIT LTD	5,000	5,300.00
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	7,100	23,714.00
		15,000	9,000.00

	SCHRODER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		
	SEGRO PLC	19,193	79,343.86
	SHAFTESBURY PLC	9,400	85,352.00
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	30,000	40,410.00
	WORKSPACE GROUP PLC	4,660	38,072.20
	英債券 小計	358,791	1,303,851.60 (209,659,337)
オーストラリアドル	360 CAPITAL GROUP LTD	100	97.50
	360 CAPITAL OFFICE FUND	8,000	16,320.00
	ABACUS PROPERTY GROUP	12,723	39,314.07
	ALE PROPERTY GROUP	7,000	29,330.00
	ARENA REIT	100	194.50
	ASPEN GROUP	15,400	17,094.00
	ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	1,983	12,314.43
	BWP TRUST	15,260	52,189.20
	CHARTER HALL GROUP	11,484	54,204.48
	CHARTER HALL RETAIL REIT	11,701	54,760.68
	CROMWELL PROPERTY GROUP	37,000	36,445.00
	DEXUS PROPERTY GROUP	25,868	212,376.28
	FOLKESTONE EDUCATION TRUST	7,100	17,040.00
	GALILEO JAPAN TRUST	100	240.00
	GDI PROPERTY GROUP	2,000	1,690.00
	GOODMAN GROUP	48,756	329,590.56
	GPT GROUP	58,000	278,980.00
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUS	1,000	3,140.00
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS LTD	100	269.00
	INDUSTRIA REIT	1,000	2,050.00
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	166	464.80
	INVESTA OFFICE FUND	16,559	67,891.90
	MIRVAC GROUP	122,322	229,965.36
	NATIONAL STORAGE REIT	1,000	1,635.00
	SCENTRE GROUP	156,413	708,550.89
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA PROPERTY GR	25,000	55,750.00
	STOCKLAND	76,730	325,335.20
	VICINITY CENTRES	97,571	317,105.75
	WESTFIELD CORP	54,869	545,397.86
	オーストラリアドル 小計	815,305	3,409,736.46 (291,873,440)
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	30,000	36,150.00
	GOODMAN PROPERTY TRUST	30,925	41,439.50
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	44,907	66,013.29

	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEAL	31,000	40,145.00
	PROPERTY FOR INDUSTRY LTD	9,000	15,210.00
	STRIDE PROPERTY LTD	9,000	20,340.00
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	9,000	19,080.00
	ニュージーランドドル 小計	163,832	238,377.79 (18,181,074)
香港ドル	CHAMPION REAL ESTATE INVESTMENT	25,000	103,000.00
	FORTUNE REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	48,000	402,240.00
	LINK REIT	69,600	3,354,720.00
	NEW CENTURY REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,000	2,720.00
	PROSPERITY REIT	60,000	181,800.00
	REGAL REAL ESTATE INVESTMENT	3,000	5,970.00
	SPRING REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	28,000	92,400.00
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	22,000	91,080.00
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	22,000	94,380.00
	香港ドル 小計	278,600	4,328,310.00 (61,938,116)
シンガポールドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT	23,500	32,195.00
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	50,000	34,000.00
	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	64,000	157,440.00
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	40,000	44,800.00
	CACHE LOGISTICS TRUST	15,000	13,350.00
	CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	48,000	25,920.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	69,000	100,740.00
	CAPITALAND MALL TRUST	68,500	143,165.00
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	15,000	21,975.00
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	10,350	14,904.00
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	46,000	30,590.00
	FIRST REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	28,000	34,860.00
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	18,000	36,000.00
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	6,800	8,908.00
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	1,000	815.00
	KEPPEL DC REIT	25,000	27,500.00
	KEPPEL REIT	43,000	44,075.00
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL T	100,000	32,500.00
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	37,000	55,130.00
	MAPLETREE GREATER CHINA COMM	66,000	64,680.00
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	42,800	70,192.00

	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	35,250	37,893.75	
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMENT	2,000	1,300.00	
	QUE HOSPITALITY TRUST	36,000	25,200.00	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	10,000	24,500.00	
	SABANA SHARIAH COMPLIANT INDUSTRIAL REIT	1,000	620.00	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	26,000	18,330.00	
	SPH REIT	10,000	9,550.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	54,000	42,930.00	
	SUNTEC REIT	77,000	131,285.00	
	シンガポールドル 小計	1,068,200	1,285,347.75 (105,501,343)	
	合計		3,475,903,318 (3,475,903,318)	

(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 155銘柄	70.1%	71.3%
カナダドル	投資証券 29銘柄	2.0%	2.0%
ユーロ	投資証券 32銘柄	6.8%	6.9%
英ポンド	投資証券 21銘柄	5.9%	6.0%
オーストラリアドル	投資証券 29銘柄	8.3%	8.4%
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 9銘柄	1.8%	1.8%
シンガポールドル	投資証券 30銘柄	3.0%	3.0%

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

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28年 4月26日現在)

資産の部	
流動資産	
金銭信託	592,030,680
コール・ローン	124,223,553
国債証券	187,022,593,690
地方債証券	19,729,099,215
特殊債券	27,476,730,827
社債券	14,060,015,000
未収入金	189,125,200

（平成28年 4月26日現在）

未収利息	646,118,982
前払費用	17,968,934
流動資産合計	249,857,906,081
資産合計	249,857,906,081
負債の部	
流動負債	
未払解約金	93,158,597
未払利息	364
その他未払費用	19,393
流動負債合計	93,178,354
負債合計	93,178,354
純資産の部	
元本等	
元本	195,629,774,814
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	54,134,952,913
元本等合計	249,764,727,727
純資産合計	249,764,727,727
負債純資産合計	249,857,906,081

注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自 平成27年 4月17日 至 平成28年 4月26日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

（貸借対照表に関する注記）

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

（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27年 4月17日 至 平成28年 4月26日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1)金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 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>

項目	自 平成27年 4月17日 至 平成28年 4月26日
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28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、地方債証券、特殊債券、社債券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

(平成28年 4月26日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	249,241,043,434円
同期中における追加設定元本額	12,597,305,591円
同期中における一部解約元本額	66,208,574,211円
平成28年 4月26日現在における元本の内訳	

(平成28年 4月26日現在)	
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	2,238,062,965円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	4,074,327,867円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	897,628,430円
S M A M・グローバルバランスファンド(機動的資産配分型)	337,524,972円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	44,290,137円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	81,347,134円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	170,742,995円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	74,505,679円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	34,589,102円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	64,222,576円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	6,059,237円
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	3,001,070,375円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	1,060,660,602円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	807,656,739円
S M A M・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	6,086,628,952円
S M A M・バランスファンドV A 2 5<適格機関投資家専用>	29,652,243,763円
S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5<適格機関投資家専用>	9,321,431,116円
S M A M・バランスファンドV A 5 0<適格機関投資家専用>	22,464,089,653円
S M A M・バランスファンドV L 3 0<適格機関投資家限定>	385,746,395円
S M A M・バランスファンドV L 5 0<適格機関投資家限定>	714,264,941円
世界6資産バランスファンドV A<適格機関投資家限定>	66,006,960円
S M A M・バランスファンドV A 7 5<適格機関投資家専用>	330,459,356円
S M A M・バランスファンドV L 国際分散型<適格機関投資家限定>	133,253,321円
S M A M・インデックス・バランスV A 2 5<適格機関投資家専用>	2,376,703,215円
S M A M・インデックス・バランスV A 5 0<適格機関投資家専用>	2,697,590,770円
S M A M・バランスファンドV A 4 0<適格機関投資家専用>	6,843,122,379円
S M A M・バランスファンドV A 3 5<適格機関投資家専用>	14,386,000,378円
S M A M・バランスV A 株4 0 T<適格機関投資家限定>	208,544,294円
三井住友・国内債券インデックスファンド・V A S(適格機関投資家専用)	7,509,648,579円
三井住友・5資産バランスファンド・V A S(適格機関投資家専用)	33,059,136,364円
S M A M・グローバルバランス4 0 V A<適格機関投資家限定>	681,827,212円
S M A M・バランスファンドV A 2 0<適格機関投資家専用>	1,196,087,768円
三井住友・7資産バランスファンド・V A S(適格機関投資家専用)	21,852,275,825円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A<適格機関投資家専用>	1,115,205,205円
S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A<適格機関投資家専用>	240,044,186円
S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A<適格機関投資家専用>	53,970,912円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 L<適格機関投資家専用>	2,798,502,611円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 5 L<適格機関投資家専用>	3,218,771,132円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 T<適格機関投資家専用>	2,998,873,719円
S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A 2<適格機関投資家専用>	1,241,809,743円
S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A 2<適格機関投資家専用>	261,712,641円
S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A 2<適格機関投資家専用>	21,167,802円
S M A M・アセットバランスファンドV A 3 0 L 2<適格機関投資家専用>	488,152,676円

(平成28年 4月26日現在)	
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 >	8,043,150,764円
S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T 2 < 適格機関投資家専用 >	382,692,836円
S M A M ・ F G 新興国重視型バランス2 0 V A < 適格機関投資家限定 >	436,835円
S M A M ・ F G グローバルバランス2 5 V A < 適格機関投資家限定 >	4,705,729円
S M A M ・ グローバル・マルチアセット・グロース・ファンド(安定成長型) < 適格機関投資家限定 >	7,619,291円
S M A M ・ 年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド < 適格機関投資家限定 >	3,278,510円
S M A M ・ 年金Wリスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	3,164,472円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド2 0 1 6 - 0 1 < 適格機関投資家限定 >	1,888,765,699円
合計	195,629,774,814円

附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第1 1 1 回利付国債(5年)	30,000,000	30,382,200	
	第1 1 6 回利付国債(5年)	150,000,000	151,878,000	
	第1 2 1 回利付国債(5年)	100,000,000	101,216,000	
	第1 2 2 回利付国債(5年)	1,550,000,000	1,569,964,000	
	第1 2 3 回利付国債(5年)	2,410,000,000	2,442,679,600	
	第1 2 4 回利付国債(5年)	2,410,000,000	2,444,800,400	
	第1 2 5 回利付国債(5年)	2,450,000,000	2,487,019,500	
	第1 2 6 回利付国債(5年)	1,015,000,000	1,031,209,550	
	第1 2 7 回利付国債(5年)	465,000,000	472,825,950	
	第1 回利付国債(40年)	40,000,000	64,356,800	
	第2 回利付国債(40年)	352,000,000	549,760,640	
	第3 回利付国債(40年)	330,000,000	520,492,500	
	第4 回利付国債(40年)	485,000,000	771,198,500	
	第5 回利付国債(40年)	455,000,000	699,972,000	
	第6 回利付国債(40年)	495,000,000	750,593,250	
	第7 回利付国債(40年)	495,000,000	722,190,150	
	第8 回利付国債(40年)	585,000,000	796,635,450	
	第2 9 3 回利付国債(10年)	2,240,000,000	2,340,038,400	

第296回利付国債(10年)	3,543,000,000	3,694,286,100	
第297回利付国債(10年)	1,943,000,000	2,028,938,890	
第298回利付国債(10年)	2,470,000,000	2,572,677,900	
第299回利付国債(10年)	2,245,000,000	2,347,080,150	
第300回利付国債(10年)	1,100,000,000	1,156,430,000	
第301回利付国債(10年)	2,285,000,000	2,412,137,400	
第303回利付国債(10年)	3,495,000,000	3,692,572,350	
第305回利付国債(10年)	2,970,000,000	3,138,814,800	
第306回利付国債(10年)	1,670,000,000	1,777,614,800	
第307回利付国債(10年)	940,000,000	996,879,400	
第308回利付国債(10年)	1,160,000,000	1,234,785,200	
第309回利付国債(10年)	550,000,000	580,855,000	
第310回利付国債(10年)	3,080,000,000	3,249,708,000	
第312回利付国債(10年)	2,145,000,000	2,289,594,450	
第313回利付国債(10年)	2,105,000,000	2,264,937,900	
第315回利付国債(10年)	2,090,000,000	2,246,770,900	
第317回利付国債(10年)	950,000,000	1,019,606,500	
第318回利付国債(10年)	1,150,000,000	1,227,970,000	
第319回利付国債(10年)	1,150,000,000	1,238,205,000	
第320回利付国債(10年)	1,080,000,000	1,156,647,600	
第321回利付国債(10年)	1,545,000,000	1,659,515,400	
第322回利付国債(10年)	790,000,000	843,830,600	
第323回利付国債(10年)	510,000,000	546,092,700	
第324回利付国債(10年)	1,295,000,000	1,378,566,350	
第325回利付国債(10年)	1,635,000,000	1,744,904,700	
第326回利付国債(10年)	660,000,000	701,428,200	
第327回利付国債(10年)	675,000,000	721,926,000	
第328回利付国債(10年)	1,405,000,000	1,486,672,650	
第329回利付国債(10年)	2,540,000,000	2,728,061,600	
第330回利付国債(10年)	1,610,000,000	1,732,182,900	
第332回利付国債(10年)	1,840,000,000	1,954,300,800	
第333回利付国債(10年)	1,945,000,000	2,068,118,500	
第334回利付国債(10年)	1,610,000,000	1,714,505,100	
第335回利付国債(10年)	1,815,000,000	1,919,398,800	
第336回利付国債(10年)	1,035,000,000	1,095,371,550	
第337回利付国債(10年)	1,480,000,000	1,539,688,400	
第338回利付国債(10年)	1,820,000,000	1,910,217,400	
第339回利付国債(10年)	2,385,000,000	2,504,297,700	
第340回利付国債(10年)	2,165,000,000	2,274,159,300	
第341回利付国債(10年)	2,485,000,000	2,586,860,150	
第342回利付国債(10年)	340,000,000	346,966,600	
第2回利付国債(30年)	510,000,000	675,841,800	

第4回利付国債(30年)	300,000,000	422,706,000
第5回利付国債(30年)	290,000,000	381,770,500
第7回利付国債(30年)	474,000,000	637,316,700
第9回利付国債(30年)	100,000,000	120,595,000
第10回利付国債(30年)	585,000,000	676,002,600
第11回利付国債(30年)	570,000,000	716,478,600
第12回利付国債(30年)	590,000,000	783,071,600
第14回利付国債(30年)	860,000,000	1,190,953,800
第16回利付国債(30年)	465,000,000	654,775,800
第18回利付国債(30年)	510,000,000	702,417,900
第19回利付国債(30年)	490,000,000	675,376,800
第21回利付国債(30年)	345,000,000	477,442,050
第22回利付国債(30年)	335,000,000	476,936,150
第23回利付国債(30年)	329,000,000	469,621,180
第24回利付国債(30年)	310,000,000	443,644,100
第25回利付国債(30年)	190,000,000	265,169,700
第26回利付国債(30年)	483,000,000	685,787,550
第27回利付国債(30年)	395,000,000	572,603,850
第28回利付国債(30年)	466,000,000	679,404,700
第29回利付国債(30年)	392,000,000	565,950,000
第30回利付国債(30年)	560,000,000	800,777,600
第31回利付国債(30年)	535,000,000	758,057,550
第32回利付国債(30年)	775,000,000	1,121,820,250
第33回利付国債(30年)	795,000,000	1,102,235,700
第34回利付国債(30年)	850,000,000	1,225,504,500
第35回利付国債(30年)	750,000,000	1,050,885,000
第36回利付国債(30年)	545,000,000	768,526,300
第37回利付国債(30年)	850,000,000	1,182,656,000
第38回利付国債(30年)	615,000,000	843,515,550
第39回利付国債(30年)	565,000,000	791,909,650
第40回利付国債(30年)	470,000,000	647,660,000
第41回利付国債(30年)	495,000,000	670,205,250
第42回利付国債(30年)	550,000,000	747,230,000
第43回利付国債(30年)	435,000,000	592,287,300
第44回利付国債(30年)	740,000,000	1,009,774,400
第45回利付国債(30年)	655,000,000	860,073,950
第46回利付国債(30年)	710,000,000	934,047,600
第47回利付国債(30年)	480,000,000	645,508,800
第48回利付国債(30年)	690,000,000	891,424,800
第49回利付国債(30年)	840,000,000	1,087,119,600
第50回利付国債(30年)	120,000,000	135,162,000
第39回利付国債(20年)	308,000,000	324,819,880
第40回利付国債(20年)	300,000,000	318,564,000

第42回利付国債(20年)	480,000,000	520,089,600
第43回利付国債(20年)	1,120,000,000	1,240,668,800
第46回利付国債(20年)	775,000,000	853,918,250
第48回利付国債(20年)	955,000,000	1,077,516,950
第50回利付国債(20年)	918,000,000	1,014,619,500
第52回利付国債(20年)	720,000,000	811,951,200
第54回利付国債(20年)	965,000,000	1,099,463,100
第56回利付国債(20年)	818,000,000	931,702,000
第59回利付国債(20年)	1,455,000,000	1,644,542,850
第61回利付国債(20年)	1,215,000,000	1,319,672,250
第64回利付国債(20年)	1,025,000,000	1,187,052,500
第65回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,185,872,400
第69回利付国債(20年)	1,020,000,000	1,206,690,600
第70回利付国債(20年)	800,000,000	969,816,000
第72回利付国債(20年)	753,000,000	897,847,080
第74回利付国債(20年)	664,000,000	795,219,680
第75回利付国債(20年)	490,000,000	589,102,500
第78回利付国債(20年)	590,000,000	701,173,700
第82回利付国債(20年)	620,000,000	751,173,400
第84回利付国債(20年)	850,000,000	1,024,862,000
第85回利付国債(20年)	645,000,000	785,997,000
第88回利付国債(20年)	742,000,000	923,567,400
第89回利付国債(20年)	20,000,000	24,689,200
第90回利付国債(20年)	580,000,000	718,643,200
第92回利付国債(20年)	739,000,000	911,497,380
第93回利付国債(20年)	802,000,000	984,230,440
第95回利付国債(20年)	240,000,000	303,549,600
第97回利付国債(20年)	757,000,000	952,230,300
第99回利付国債(20年)	888,000,000	1,111,003,440
第100回利付国債(20年)	392,000,000	496,632,640
第101回利付国債(20年)	425,000,000	548,590,000
第102回利付国債(20年)	492,000,000	637,341,720
第105回利付国債(20年)	425,000,000	536,643,250
第106回利付国債(20年)	400,000,000	510,044,000
第107回利付国債(20年)	503,000,000	636,984,110
第108回利付国債(20年)	480,000,000	595,708,800
第109回利付国債(20年)	760,000,000	945,561,600
第111回利付国債(20年)	646,000,000	831,175,900
第113回利付国債(20年)	807,000,000	1,030,587,420
第114回利付国債(20年)	628,000,000	804,675,240
第116回利付国債(20年)	825,000,000	1,071,947,250
第118回利付国債(20年)	310,000,000	395,181,800

	第119回利付国債(20年)	560,000,000	698,135,200
	第120回利付国債(20年)	645,000,000	785,971,200
	第121回利付国債(20年)	625,000,000	789,712,500
	第122回利付国債(20年)	710,000,000	886,967,500
	第123回利付国債(20年)	380,000,000	492,548,400
	第124回利付国債(20年)	430,000,000	551,113,800
	第125回利付国債(20年)	480,000,000	630,230,400
	第126回利付国債(20年)	280,000,000	359,385,600
	第127回利付国債(20年)	195,000,000	247,414,050
	第128回利付国債(20年)	520,000,000	661,616,800
	第129回利付国債(20年)	1,010,000,000	1,269,943,700
	第130回利付国債(20年)	535,000,000	673,934,150
	第131回利付国債(20年)	460,000,000	572,470,000
	第132回利付国債(20年)	490,000,000	610,775,200
	第133回利付国債(20年)	730,000,000	921,179,700
	第134回利付国債(20年)	90,000,000	113,757,300
	第135回利付国債(20年)	85,000,000	106,109,750
	第136回利付国債(20年)	250,000,000	308,182,500
	第137回利付国債(20年)	210,000,000	262,550,400
	第138回利付国債(20年)	245,000,000	298,547,200
	第139回利付国債(20年)	415,000,000	512,276,000
	第140回利付国債(20年)	1,060,000,000	1,327,183,600
	第141回利付国債(20年)	600,000,000	752,262,000
	第142回利付国債(20年)	520,000,000	660,415,600
	第143回利付国債(20年)	405,000,000	501,337,350
	第144回利付国債(20年)	295,000,000	360,613,900
	第145回利付国債(20年)	790,000,000	993,014,200
	第146回利付国債(20年)	815,000,000	1,025,701,950
	第147回利付国債(20年)	835,000,000	1,037,788,100
	第148回利付国債(20年)	780,000,000	956,818,200
	第149回利付国債(20年)	1,140,000,000	1,399,486,800
	第150回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,428,720,400
	第151回利付国債(20年)	1,210,000,000	1,421,120,800
	第152回利付国債(20年)	1,040,000,000	1,221,542,400
	第153回利付国債(20年)	1,130,000,000	1,348,010,900
	第154回利付国債(20年)	915,000,000	1,073,825,700
	第155回利付国債(20年)	1,290,000,000	1,464,317,700
	第156回利付国債(20年)	200,000,000	203,754,000
	国債証券合計	161,694,000,000	187,022,593,690
地方債証券	第1回東京都公募公債(20年)	100,000,000	110,854,000
	第1回東京都公募公債(30年)	100,000,000	130,415,000
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	117,727,000

第7回東京都公募公債(20年)	100,000,000	120,007,000	
第8回東京都公募公債(20年)	100,000,000	122,958,000	
第8回東京都公募公債(30年)	400,000,000	541,308,000	
第13回東京都公募公債(30年)	500,000,000	663,565,000	
第634回東京都公募公債	6,000,000	6,016,320	
第646回東京都公募公債	100,000,000	102,289,000	
第652回東京都公募公債	200,000,000	205,616,000	
第653回東京都公募公債	200,000,000	205,120,000	
第660回東京都公募公債	700,000,000	723,786,000	
第662回東京都公募公債	100,000,000	104,001,000	
第668回東京都公募公債	200,000,000	208,926,000	
第674回東京都公募公債	100,100,000	104,780,676	
平成19年度第7回北海道公募公債	100,000,000	102,469,000	
平成20年度第4回北海道公募公債	100,000,000	104,139,000	
平成20年度第12回北海道公募公債	100,000,000	104,436,000	
平成21年度第14回北海道公募公債	100,000,000	105,570,000	
平成25年度第15回北海道公募公債	100,000,000	104,716,000	
第1回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	120,479,000	
第3回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	118,967,000	
第7回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	123,119,000	
第57回神奈川県公募公債(5年)	200,000,000	201,450,000	
第157回神奈川県公募公債	115,600,000	120,395,088	
第167回神奈川県公募公債	100,000,000	105,119,000	
第97回大阪府公募公債(5年)	102,000,000	102,583,440	
第306回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	204,984,000	
第313回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,173,000	
第326回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	209,756,000	
第332回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	105,348,000	
第361回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	210,454,000	
第373回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	106,066,000	
第377回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	105,123,000	
平成19年度第1回京都府公募公債	130,260,000	133,597,261	
平成20年度第3回京都府公募公債	100,000,000	104,090,000	
平成26年度第6回京都府公募公債	100,000,000	100,502,000	
平成26年度第13回京都府公募公債	100,000,000	103,986,000	
平成27年度第4回京都府公募公債	100,000,000	104,775,000	
第5回兵庫県公募公債(15年)	300,000,000	340,755,000	
平成20年度第5回兵庫県公募公債	100,000,000	104,038,000	
平成21年度第3回兵庫県公募公債	200,000,000	209,554,000	
平成21年度第11回兵庫県公募公債	200,000,000	210,052,000	
平成21年度第23回兵庫県公募公債	200,000,000	209,060,000	
第7回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	135,786,000	

平成19年度第7回静岡県公募公債	100,000,000	102,876,000	
平成20年度第1回静岡県公募公債	200,000,000	240,386,000	
平成20年度第7回静岡県公募公債	100,000,000	104,373,000	
平成21年度第5回静岡県公募公債	300,000,000	313,872,000	
平成19年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,557,000	
平成20年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,828,000	
平成21年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	104,775,000	
平成21年度第7回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	210,162,000	
平成21年度第8回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	104,714,000	
平成21年度第10回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	104,773,000	
平成22年度第12回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	104,842,000	
平成23年度第18回愛知県公募公債(7年)	100,000,000	101,533,000	
平成19年度第3回広島県公募公債	200,000,000	205,688,000	
平成20年度第1回広島県公募公債	100,000,000	103,733,000	
平成21年度第1回広島県公募公債	100,000,000	104,846,000	
平成20年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	104,141,000	
平成21年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	104,504,000	
平成21年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	104,774,000	
平成21年度第4回埼玉県公募公債	200,000,000	209,340,000	
平成20年度第10回福岡県公募公債	100,000,000	104,257,000	
平成21年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	105,146,000	
平成25年度第11回福岡県公募公債	100,000,000	105,268,000	
平成25年度第12回福岡県公募公債	100,000,000	100,452,000	
平成26年度第10回福岡県公募公債	100,000,000	103,721,000	
平成20年度第8回千葉県公募公債	100,000,000	104,137,000	
平成21年度第2回千葉県公募公債	345,000,000	361,425,450	
平成21年度第6回千葉県公募公債	100,000,000	104,763,000	
第9回群馬県公募公債(10年)	100,000,000	105,138,000	
平成19年度第1回岐阜県公募公債(10年)	200,000,000	205,644,000	
平成21年度第1回岐阜県公募公債(10年)	200,000,000	209,430,000	
第40回共同発行市場公募地方債	50,000,000	50,247,000	
第51回共同発行市場公募地方債	100,500,000	102,706,980	
第55回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,514,000	
第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,695,000	
第57回共同発行市場公募地方債	300,000,000	308,190,000	
第62回共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,188,000	
第64回共同発行市場公募地方債	300,000,000	311,967,000	
第65回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,748,000	
第73回共同発行市場公募地方債	300,000,000	314,124,000	
第75回共同発行市場公募地方債	900,000,000	946,251,000	
第76回共同発行市場公募地方債	300,000,000	313,482,000	

第77回共同発行市場公募地方債	200,000,000	210,104,000	
第79回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,633,000	
第81回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,781,000	
第82回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,223,000	
第115回共同発行市場公募地方債	600,000,000	630,396,000	
第137回共同発行市場公募地方債	200,000,000	209,058,000	
平成19年度第10回大阪市公募公債	100,000,000	102,827,000	
平成21年度第4回大阪市公募公債	300,000,000	315,756,000	
平成26年度第2回大阪市公募公債(5年)	200,000,000	201,126,000	
第1回名古屋市公募公債(20年)	200,000,000	229,836,000	
第3回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	118,238,000	
第467回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	105,021,000	
第1回京都市公募公債(30年)	100,000,000	140,334,000	
第7回京都市公募公債(20年)	100,000,000	127,073,000	
平成19年度第2回京都市公募公債	100,000,000	102,864,000	
平成26年度第1回京都市公募公債	100,000,000	100,430,000	
平成19年度第10回神戸市公募公債	100,000,000	102,992,000	
平成26年度第17回神戸市公募公債	100,000,000	102,117,000	
第4回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	117,784,000	
第9回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	123,038,000	
第14回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	125,864,000	
平成20年度第6回横浜市公募公債	200,000,000	208,306,000	
平成21年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	105,451,000	
平成25年度第1回横浜市公債「八マ債5」	100,000,000	100,573,000	
平成26年度第4回札幌市公募公債(10年)	100,000,000	104,151,000	
第2回川崎市15年公募公債	100,000,000	106,685,000	
第4回川崎市15年公募公債	100,000,000	111,770,000	
平成19年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	102,677,000	
平成20年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	103,906,000	
平成25年度第5回福岡市公募公債(5年)	100,000,000	100,627,000	
平成19年度第1回広島市公募公債	100,000,000	102,910,000	
平成21年度第1回千葉市公募公債	200,000,000	209,426,000	
地方債証券合計	18,349,460,000	19,729,099,215	
特殊債券			
第1回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	104,107,000	
第2回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	207,414,000	
第3回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	232,196,000	
第5回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	104,159,000	
第15回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	111,347,000	
第20回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	113,334,000	
第20回日本政策投資銀行債券	100,000,000	107,332,000	
第23回政府保証日本政策投資銀行債券	400,000,000	414,864,000	
第27回日本政策投資銀行債券	100,000,000	100,765,000	

第30回日本政策投資銀行債券	100,000,000	105,548,000	
第36回日本政策投資銀行債券	100,000,000	122,695,000	
第51回日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,946,000	
第2回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	216,816,000	
第7回道路債券	100,000,000	116,426,000	
第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,638,000	
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	109,311,000	
第9回道路債券	100,000,000	139,499,000	
第17回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	102,000,000	102,697,680	
第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	158,652,000	
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	459,252,000	
第25回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,366,000	
第27回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	304,518,000	
第30回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,112,000	
第34回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,862,000	
第36回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	653,000,000	667,418,240	
第37回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	307,275,000	
第40回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	307,764,000	
第40回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,618,000	
第41回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	409,804,000	
第42回道路債券	200,000,000	237,384,000	
第45回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,795,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	255,142,000	
第49回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,673,000	
第52回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,926,000	
第56回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,584,000	
第58回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	500,000,000	517,925,000	
第60回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,934,000	
第62回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,857,000	
第67回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	208,048,000	
第69回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,146,000	

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	250,590,000	
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	140,445,000	
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	377,034,000	
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	127,490,000	
第3 4 0 回政府保証道路債券	100,000,000	106,790,000	
第1 回政府保証地方公営企業等金融機構債券	300,000,000	311,895,000	
第1 回政府保証地方公共団体金融機構債券	300,000,000	314,100,000	
第2 回地方公営企業等金融機構債券(20年)	100,000,000	125,860,000	
第3 回公営企業債券(20年)	100,000,000	106,849,000	
第3 回地方公共団体金融機構債券	300,000,000	315,603,000	
第5 回公営企業債券(20年)	100,000,000	115,187,000	
第6 回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	103,754,000	
第6 回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	210,714,000	
第7 回政府保証地方公営企業等金融機構債券	500,000,000	520,795,000	
第8 回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	100,549,000	
第1 1 回公営企業債券(20年)	100,000,000	117,739,000	
第1 1 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,749,000	
第1 6 回公営企業債券(20年)	100,000,000	118,761,000	
第1 7 回公営企業債券(20年)	100,000,000	121,967,000	
第1 8 回公営企業債券(20年)	100,000,000	124,539,000	
第2 2 回公営企業債券(20年)	100,000,000	123,662,000	
第2 4 回公営企業債券(20年)	200,000,000	248,980,000	
第3 0 回公営企業債券	100,000,000	104,227,000	
第4 2 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,041,000	
第4 5 回地方公共団体金融機構債券	200,000,000	210,320,000	
第6 1 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,960,000	
第6 3 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,101,000	
第6 5 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	103,742,000	
F 7 4 回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,877,000	
第8 7 5 回政府保証公営企業債券	200,000,000	203,664,000	
第8 8 3 回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,663,000	
第8 8 4 回政府保証公営企業債券	300,000,000	308,340,000	
第8 8 5 回政府保証公営企業債券	200,000,000	207,092,000	
第8 8 6 回政府保証公営企業債券	200,000,000	207,772,000	
第3 4 回株式会社日本政策金融公庫社債	200,000,000	201,168,000	
第2 7 回国際協力銀行債券	100,000,000	101,553,000	
第1 9 回都市再生債券	100,000,000	103,856,000	
第7 回本州四国連絡橋債券	100,000,000	119,410,000	
第3 3 2 回東京交通債券	100,000,000	109,309,000	
第3 4 2 回東京交通債券	100,000,000	114,415,000	

第13回関西国際空港株式会社社債	100,000,000	104,122,000	
第16回関西国際空港株式会社社債	100,000,000	104,864,000	
第51回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	113,361,000	
第14回独立行政法人福祉医療機構債券	200,000,000	204,596,000	
第17回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	104,269,000	
第199回政府保証預金保険機構債	300,000,000	300,741,000	
第201回政府保証預金保険機構債	200,000,000	200,560,000	
第203回政府保証預金保険機構債	300,000,000	301,137,000	
第1回貸付債権担保住宅金融公庫債券	26,370,000	27,111,524	
第3回貸付債権担保住宅金融公庫債券	13,501,000	13,948,018	
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	19,784,000	20,938,989	
第4回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,081,000	14,539,899	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,446,000	30,776,011	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	20,303,000	21,462,910	
第6回貸付債権担保住宅金融公庫債券	30,434,000	31,705,532	
第7回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	26,275,000	28,246,938	
第8回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,661,000	16,214,146	
第8回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,442,000	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	43,922,000	47,369,877	
第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	26,580,000	28,573,500	
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	68,322,000	73,633,352	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	26,647,000	28,291,919	
第11回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	28,156,000	30,150,289	
第12回貸付債権担保住宅金融公庫債券	17,989,000	18,728,707	
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	31,878,000	33,267,562	
第14回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	207,032,000	
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	70,510,000	73,955,823	
第19回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,194,000	41,416,809	
第21回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,601,000	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,226,000	85,868,680	
第25回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	208,776,000	
第26回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	114,513,000	124,767,639	
第27回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,978,000	44,540,217	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,386,000	49,263,325	
第29回貸付債権担保住宅金融公庫債券	24,492,000	25,860,612	
第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	47,398,000	51,396,495	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,372,000	52,453,629	
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	29,883,000	31,608,145	
第32回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,948,000	102,073,847	
第35回貸付債権担保住宅金融公庫債券	29,447,000	31,295,977	

第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,539,000	59,756,076
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,930,000	62,146,724
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	26,834,000	28,508,173
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	28,976,000	31,159,341
第43回貸付債権担保住宅金融公庫債券	55,350,000	60,133,900
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,166,000	77,583,501
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,275,000	74,029,217
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	132,248,000	143,413,698
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,986,000	71,118,391
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	26,753,000	28,986,072
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	141,096,000	151,736,049
第52回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	123,418,000
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	27,525,000	29,688,189
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	156,614,000	167,307,603
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,507,000	82,875,134
第58回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,287,000	83,576,069
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	156,088,000	166,970,455
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	236,301,000	251,440,805
第61回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,487,000	83,133,430
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,698,000	87,954,043
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	169,264,000	179,980,103
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	165,110,000	174,917,534
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,463,000	91,031,769
第95回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,122,000
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,267,000	101,452,399
第130回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	244,124,000
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,526,000	58,449,690
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	57,802,000	62,314,024
第3回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	24,185,000	26,097,791
第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	28,208,000	30,347,294
第5回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	49,900,000	53,426,932
第10回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	100,332,000
い第756号商工債	100,000,000	100,587,000
い第758号商工債	100,000,000	100,889,000
い第778号商工債	100,000,000	100,725,000
い第735号農林債	400,000,000	400,596,000
い第749号農林債	300,000,000	301,320,000
い第752号農林債	500,000,000	502,480,000
第281回信金中金債(5年)	100,000,000	100,474,000
第283回信金中金債(5年)	100,000,000	100,719,000
第291回信金中金債(5年)	100,000,000	100,667,000
第293回信金中金債(5年)	100,000,000	100,680,000
第297回信金中金債(5年)	200,000,000	201,166,000

	第301回信金中金債(5年)	300,000,000	302,088,000	
	第304回信金中金債(5年)	100,000,000	100,744,000	
	第308回信金中金債(5年)	100,000,000	100,912,000	
	第165号商工債(3年)	200,000,000	200,202,000	
	第171号商工債(3年)	300,000,000	300,597,000	
	第175号商工債(3年)	100,000,000	100,201,000	
	第177号商工債(3年)	300,000,000	300,663,000	
	第181号商工債(3年)	100,000,000	100,254,000	
	第183号商工債(3年)	500,000,000	501,370,000	
	第185号商工債(3年)	200,000,000	200,540,000	
	第5回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	208,918,000	
	第6回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	104,546,000	
	第10回政府保証中日本高速道路債券	100,000,000	101,006,000	
	第12回政府保証中日本高速道路債券	103,000,000	104,365,780	
	第14回政府保証中日本高速道路債券	100,000,000	102,187,000	
	第19回政府保証中日本高速道路債券	124,000,000	127,276,080	
	第21回政府保証中日本高速道路債券	200,000,000	207,080,000	
	第25回政府保証中日本高速道路債券	200,000,000	209,394,000	
	第46回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,980,000	
	第8回政府保証西日本高速道路債券	233,000,000	237,238,270	
	第15回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	103,867,000	
	第19回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	104,134,000	
	第20回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	105,191,000	
	第3回東京地下鉄株式会社社債	200,000,000	201,470,000	
	特殊債券合計	25,773,081,000	27,476,730,827	
社債券	第23回ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポレーション	200,000,000	200,178,000	
	第10回ジェー・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニー	100,000,000	100,043,000	
	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	202,062,000	
	第9回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク	100,000,000	101,318,000	
	第5回オーストラリア・コモンウェルス銀行円貨社債(2011)	300,000,000	300,315,000	
	第7回オーストラリア・コモンウェルス銀行円貨社債	100,000,000	100,097,000	
	第8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	300,000,000	300,780,000	
	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	200,910,000	
	第20回コーペラティブ・セントラル・ライフアイゼン・ボエレンリールバンク・ピー・エー	100,000,000	100,034,000	
	第21回コーペラティブ・セントラル・ライフアイゼン・ボエレンリールバンク・ピー・エー	200,000,000	202,570,000	

第10回コーペラティブ・セントラル・ライフアイゼン・ポエレンリールバンク・ピー・エー	300,000,000	300,273,000	
第18回コーペラティブ・セントラル・ライフアイゼン・ポエレンリールバンク・ピー・エー	300,000,000	303,105,000	
第18回 積水ハウス株式会社無担保社債	100,000,000	100,552,000	
第7回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	210,750,000	
第8回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	100,979,000	
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	103,617,000	
第35回三菱化学株式会社無担保社債	100,000,000	101,210,000	
第8回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	103,395,000	
第4回花王株式会社無担保社債	100,000,000	102,304,000	
第14回武田薬品工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,397,000	
第64回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	105,413,000	
第62回株式会社神戸製鋼所無担保社債	100,000,000	99,060,000	
第13回株式会社クボタ無担保社債	100,000,000	101,600,000	
第16回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	104,692,000	
第44回三菱電機株式会社無担保社債	100,000,000	100,615,000	
日本電産株式会社第1回無担保社債	100,000,000	100,462,000	
第36回富士通株式会社無担保社債	100,000,000	101,578,000	
第12回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	201,966,000	
第13回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	203,022,000	
第1回日本生命2011基金特定目的会社特定社債 第1回 - B	200,000,000	202,430,000	
第1回住友生命第4回基金流動化特定目的会社特定社債	100,000,000	100,250,000	
第1回日本生命2012基金特定目的会社特定社債	100,000,000	101,651,000	
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	101,501,000	
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	101,140,000	
第63回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	121,780,000	
第47回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,642,000	
第3回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	103,840,000	
第8回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	123,695,000	
株式会社三菱東京UFJ銀行第12回無担保社債	200,000,000	205,212,000	
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	300,000,000	315,501,000	
第110回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	105,049,000	
	100,000,000	103,057,000	

株式会社三井住友フィナンシャル第1回無担保社債			
第4回株式会社りそな銀行無担保社債	100,000,000	108,047,000	
第9回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	107,324,000	
第7回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	101,839,000	
第8回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	121,564,000	
第6回株式会社セブン銀行無担保社債	200,000,000	200,868,000	
第1回株式会社みずほフィナンシャルグループ無担保社債	100,000,000	103,427,000	
第20回株式会社三井住友銀行無担保社債	200,000,000	213,432,000	
第24回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	107,193,000	
第8回株式会社みずほ銀行無担保社債	200,000,000	203,572,000	
第9回株式会社みずほ銀行無担保社債	100,000,000	121,366,000	
第17回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	108,135,000	
第21回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,302,000	
第53回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,670,000	
第54回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	101,874,000	
第113回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	102,022,000	
第162回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,904,000	
第165回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,966,000	
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	106,662,000	
第39回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	202,774,000	
第58回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	135,029,000	
第110回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	101,672,000	
第41回小田急電鉄株式会社無担保社債	200,000,000	201,230,000	
第15回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	111,211,000	
第34回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	119,685,000	
第110回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	127,708,000	
第3回西日本旅客鉄道株式会社社債	200,000,000	204,420,000	
第28回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,183,000	
第41回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	123,702,000	
第42回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	251,768,000	
第45回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,994,000	
第51回日本電信電話株式会社電信電話債券	300,000,000	300,903,000	
第53回日本電信電話株式会社電信電話債券	300,000,000	307,611,000	
第15回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	105,851,000	
第522回東京電力株式会社社債	300,000,000	301,965,000	
第524回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,270,000	

第526回東京電力株式会社社債	300,000,000	304,830,000	
第528回東京電力株式会社社債	100,000,000	104,539,000	
第532回東京電力株式会社社債	100,000,000	102,006,000	
第537回東京電力株式会社社債	100,000,000	104,975,000	
第544回東京電力株式会社社債	100,000,000	103,536,000	
第547回東京電力株式会社社債	100,000,000	106,038,000	
第440回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,160,000	
第449回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,504,000	
第451回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,737,000	
第453回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,035,000	
第467回関西電力株式会社社債	100,000,000	103,663,000	
第286回北陸電力株式会社社債	100,000,000	105,994,000	
第303回北陸電力株式会社社債	100,000,000	102,101,000	
第471回東北電力株式会社社債	100,000,000	106,511,000	
第472回東北電力株式会社社債	100,000,000	104,957,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	105,427,000	
第400回九州電力株式会社社債	100,000,000	106,151,000	
第328回北海道電力株式会社社債	100,000,000	100,832,000	
第11回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	114,827,000	
第18回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	218,398,000	
第22回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	101,135,000	
第27回東邦瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	107,167,000	
第30回東邦瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	100,304,000	
社債券合計	13,500,000,000	14,060,015,000	
合計		248,288,438,732	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(平成28年 4月26日現在)

資産の部

流動資産

預金	656,087,540
金銭信託	197,479,819
コール・ローン	41,436,442
国債証券	176,600,324,596
未収入金	52,000,000
未収利息	1,591,010,285
前払費用	29,000,885
流動資産合計	179,167,339,567

資産合計

179,167,339,567

(平成28年 4月26日現在)

負債の部	
流動負債	
未払解約金	8,544,129
未払利息	121
その他未払費用	3,984
流動負債合計	8,548,234
負債合計	8,548,234
純資産の部	
元本等	
元本	105,109,279,423
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	74,049,511,910
元本等合計	179,158,791,333
純資産合計	179,158,791,333
負債純資産合計	179,167,339,567

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成27年 4月17日 至平成28年 4月26日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成28年 4月26日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	105,109,279,423口

項目	(平成28年 4月26日現在)	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1,7045円
	(10,000口当たりの純資産額)	17,045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27年 4月17日 至 平成28年 4月26日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいておりません。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。当計算期間については、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	自 平成27年 4月17日 至 平成28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	(平成28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（国債証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

（平成28年 4月26日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	125,038,069,926円
同期中における追加設定元本額	6,887,957,759円
同期中における一部解約元本額	26,816,748,262円
平成28年 4月26日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	7,346,122,605円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	294,158,923円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	867,016,532円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	445,519,150円
SMAM・グローバルバランスファンド（機動的資産配分型）	51,994,867円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	8,071,455円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	20,293,188円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	58,678,871円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	37,995,060円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	20,804,114円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	44,568,324円
三井住友・DC年金バランスゼロ（債券型）	1,187,989円
アセットアロケーション・ファンド（安定型）	116,419,683円
アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）	198,602,167円
アセットアロケーション・ファンド（成長型）	265,051,792円
SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞	1,500,589,758円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型＜適格機関投資家限定＞	3,821,555,609円
SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	19,243,724,359円
SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	7,379,971,636円
SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	16,312,945,354円
SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	45,968,708円
SMAM・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	130,038,973円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	13,644,843円
SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	939,503,001円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型＜適格機関投資家限定＞	142,165,035円

(平成28年 4月26日現在)	
S M A M ・ インデックス ・ バランス V A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	1,513,583,466円
S M A M ・ インデックス ・ バランス V A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	1,924,991,258円
S M A M ・ バランスファンド V A 4 0 < 適格機関投資家専用 >	4,909,027,048円
S M A M ・ バランスファンド V A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	9,047,341,588円
S M A M ・ バランス V A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	150,974,873円
S M A M ・ 外国債券パッシブファンド V A < 適格機関投資家限定 >	14,447,331,155円
三井住友 ・ 外国債券インデックスファンド ・ V A S (適格機関投資家専用)	1,238,240,133円
三井住友 ・ 5 資産バランスファンド ・ V A S (適格機関投資家専用)	4,140,231,510円
S M A M ・ グローバルバランス 4 0 V A < 適格機関投資家限定 >	250,225,830円
S M A M ・ バランスファンド V A 2 0 < 適格機関投資家専用 >	861,343,324円
三井住友 ・ 7 資産バランスファンド ・ V A S (適格機関投資家専用)	3,639,387,901円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	185,069,203円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	52,811,680円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	16,896,401円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	209,180,765円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	717,216,112円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 T < 適格機関投資家専用 >	226,773,526円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	203,301,882円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 >	57,130,687円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	6,475,605円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 >	1,767,576,019円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 T 2 < 適格機関投資家専用 >	27,895,415円
S M A M ・ F G 新興国重視型バランス 2 0 V A < 適格機関投資家限定 >	2,078,450円
S M A M ・ F G グローバルバランス 2 5 V A < 適格機関投資家限定 >	13,397,833円
S M A M ・ 年金 W リスクコントロールファンド < 適格機関投資家限定 >	395,826円
S M A M ・ マルチアセットストラテジーファンド 2 0 1 6 - 0 1 < 適格機関投資家限定 >	193,809,937円
合計	105,109,279,423円

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 0.5	4,000,000.00	3,990,312.52	
		US TREASURY N/B 0.625	5,000,000.00	4,998,437.50	
		US TREASURY N/B 0.625	4,000,000.00	3,994,375.00	

US TREASURY N/B 0.625	3,000,000.00	2,994,375.00	
US TREASURY N/B 0.625	5,000,000.00	4,987,109.40	
US TREASURY N/B 0.625	3,000,000.00	2,985,703.14	
US TREASURY N/B 0.75	5,000,000.00	5,005,078.15	
US TREASURY N/B 0.75	1,000,000.00	999,609.38	
US TREASURY N/B 0.75	2,000,000.00	1,998,281.26	
US TREASURY N/B 0.75	5,000,000.00	4,992,578.15	
US TREASURY N/B 0.75	3,000,000.00	2,995,078.14	
US TREASURY N/B 0.75	4,000,000.00	3,991,562.52	
US TREASURY N/B 0.75	2,000,000.00	1,986,875.00	
US TREASURY N/B 0.875	4,000,000.00	4,010,937.52	
US TREASURY N/B 0.875	5,000,000.00	5,012,695.30	
US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	3,007,500.00	
US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	3,006,796.89	
US TREASURY N/B 0.875	4,000,000.00	4,006,562.52	
US TREASURY N/B 0.875	4,000,000.00	4,003,750.00	
US TREASURY N/B 0.875	2,000,000.00	2,002,031.26	
US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	2,998,359.39	
US TREASURY N/B 0.875	2,000,000.00	1,996,562.50	
US TREASURY N/B 1	5,000,000.00	5,018,750.00	
US TREASURY N/B 1	4,000,000.00	4,014,375.00	
US TREASURY N/B 1	2,000,000.00	2,006,250.00	
US TREASURY N/B 1	4,000,000.00	4,012,187.52	
US TREASURY N/B 1	2,000,000.00	2,004,843.76	
US TREASURY N/B 1	3,000,000.00	3,004,687.50	
US TREASURY N/B 1	3,000,000.00	2,994,843.75	
US TREASURY N/B 1	4,000,000.00	3,987,812.52	
US TREASURY N/B 1	2,000,000.00	1,992,656.26	
US TREASURY N/B 1	6,000,000.00	5,967,187.50	
US TREASURY N/B 1.125	2,000,000.00	2,010,468.76	
US TREASURY N/B 1.125	2,000,000.00	2,005,625.00	
US TREASURY N/B 1.125	4,000,000.00	3,992,812.52	
US TREASURY N/B 1.125	2,800,000.00	2,789,937.50	
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,985,703.14	
US TREASURY N/B 1.125	1,800,000.00	1,780,453.13	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	3,022,031.25	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	3,022,031.25	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	3,022,031.25	
US TREASURY N/B 1.25	4,000,000.00	4,029,375.00	
US TREASURY N/B 1.25	2,000,000.00	2,013,750.00	
US TREASURY N/B 1.25	2,000,000.00	2,008,125.00	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	3,003,515.64	

US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	4,042,187.52
US TREASURY N/B 1.375	4,500,000.00	4,547,460.96
US TREASURY N/B 1.375	5,000,000.00	5,052,343.75
US TREASURY N/B 1.375	2,000,000.00	2,021,406.26
US TREASURY N/B 1.375	5,000,000.00	5,053,125.00
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	4,025,937.52
US TREASURY N/B 1.375	2,000,000.00	2,011,562.50
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	4,021,562.52
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	4,018,437.52
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	3,011,953.14
US TREASURY N/B 1.375	2,000,000.00	2,006,093.76
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	3,006,328.14
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	3,005,390.64
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	3,001,875.00
US TREASURY N/B 1.5	5,000,000.00	5,067,578.15
US TREASURY N/B 1.5	4,700,000.00	4,766,460.96
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	3,042,187.50
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	3,037,031.25
US TREASURY N/B 1.5	2,000,000.00	2,018,125.00
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,994,843.75
US TREASURY N/B 1.5	2,000,000.00	1,976,875.00
US TREASURY N/B 1.625	5,000,000.00	5,088,281.25
US TREASURY N/B 1.625	4,000,000.00	4,070,312.52
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,053,437.50
US TREASURY N/B 1.625	2,000,000.00	2,034,843.76
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,052,265.64
US TREASURY N/B 1.625	2,000,000.00	2,031,875.00
US TREASURY N/B 1.625	2,000,000.00	2,027,500.00
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,040,546.89
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,039,609.39
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	3,005,390.64
US TREASURY N/B 1.625	3,500,000.00	3,498,906.25
US TREASURY N/B 1.625	4,000,000.00	3,900,312.52
US TREASURY N/B 1.75	1,000,000.00	1,020,234.38
US TREASURY N/B 1.75	2,300,000.00	2,341,328.12
US TREASURY N/B 1.75	2,000,000.00	2,035,625.00
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,033,281.25
US TREASURY N/B 1.75	2,500,000.00	2,526,757.82
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,030,468.75
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,029,296.89
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,021,328.14
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,014,531.25
US TREASURY N/B 1.75	5,000,000.00	5,023,046.90

US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,046,406.25	
US TREASURY N/B 1.875	6,000,000.00	6,095,156.28	
US TREASURY N/B 1.875	6,000,000.00	6,099,843.78	
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,073,359.39	
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,061,171.89	
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,051,562.50	
US TREASURY N/B 1.875	2,000,000.00	2,030,468.76	
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,043,359.39	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,087,187.50	
US TREASURY N/B 2	2,300,000.00	2,366,664.07	
US TREASURY N/B 2	4,000,000.00	4,115,312.52	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,086,484.39	
US TREASURY N/B 2	2,000,000.00	2,057,500.00	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,082,500.00	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,079,218.75	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,081,562.50	
US TREASURY N/B 2	3,100,000.00	3,182,828.12	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,069,375.00	
US TREASURY N/B 2	5,000,000.00	5,107,812.50	
US TREASURY N/B 2	5,500,000.00	5,618,593.75	
US TREASURY N/B 2	7,000,000.00	7,083,125.00	
US TREASURY N/B 2	7,000,000.00	7,068,906.25	
US TREASURY N/B 2.125	3,500,000.00	3,617,851.58	
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,140,000.00	
US TREASURY N/B 2.125	2,000,000.00	2,069,218.76	
US TREASURY N/B 2.125	5,000,000.00	5,171,484.40	
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	3,101,015.64	
US TREASURY N/B 2.125	4,000,000.00	4,132,187.52	
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	3,092,343.75	
US TREASURY N/B 2.125	7,000,000.00	7,149,296.91	
US TREASURY N/B 2.25	3,000,000.00	3,069,609.39	
US TREASURY N/B 2.25	2,000,000.00	2,060,312.50	
US TREASURY N/B 2.25	4,000,000.00	4,163,437.52	
US TREASURY N/B 2.25	2,000,000.00	2,082,187.50	
US TREASURY N/B 2.25	2,000,000.00	2,081,718.76	
US TREASURY N/B 2.25	6,000,000.00	6,197,812.50	
US TREASURY N/B 2.25	6,500,000.00	6,700,585.97	
US TREASURY N/B 2.375	4,000,000.00	4,084,687.52	
US TREASURY N/B 2.375	2,000,000.00	2,064,531.26	
US TREASURY N/B 2.375	2,000,000.00	2,092,031.26	
US TREASURY N/B 2.375	7,000,000.00	7,304,609.41	
US TREASURY N/B 2.5	3,000,000.00	3,063,984.39	

US TREASURY N/B 2.5	4,000,000.00	4,222,500.00
US TREASURY N/B 2.5	7,000,000.00	7,377,343.75
US TREASURY N/B 2.5	3,500,000.00	3,340,585.95
US TREASURY N/B 2.5	3,300,000.00	3,148,921.87
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,125,625.00
US TREASURY N/B 2.625	2,000,000.00	2,071,406.26
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,220,000.00
US TREASURY N/B 2.625	5,500,000.00	5,809,375.00
US TREASURY N/B 2.75	5,000,000.00	5,113,671.90
US TREASURY N/B 2.75	4,000,000.00	4,129,062.52
US TREASURY N/B 2.75	3,000,000.00	3,149,765.64
US TREASURY N/B 2.75	6,200,000.00	6,652,890.65
US TREASURY N/B 2.75	5,000,000.00	5,364,062.50
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	2,027,656.26
US TREASURY N/B 2.75	11,000,000.00	11,127,187.50
US TREASURY N/B 2.875	3,000,000.00	3,117,187.50
US TREASURY N/B 2.875	4,000,000.00	4,123,750.00
US TREASURY N/B 3	2,800,000.00	2,981,125.00
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	4,231,875.00
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	4,228,437.52
US TREASURY N/B 3	3,000,000.00	3,172,031.25
US TREASURY N/B 3.125	4,000,000.00	4,100,625.00
US TREASURY N/B 3.125	2,000,000.00	2,127,187.50
US TREASURY N/B 3.125	5,000,000.00	5,421,484.40
US TREASURY N/B 3.125	2,000,000.00	2,182,343.76
US TREASURY N/B 3.125	2,500,000.00	2,726,562.50
US TREASURY N/B 3.125	4,000,000.00	4,337,812.52
US TREASURY N/B 3.25	4,000,000.00	4,098,125.00
US TREASURY N/B 3.375	5,000,000.00	5,387,890.65
US TREASURY N/B 3.375	4,000,000.00	4,545,625.00
US TREASURY N/B 3.5	2,500,000.00	2,619,726.57
US TREASURY N/B 3.5	2,500,000.00	2,721,875.00
US TREASURY N/B 3.5	2,000,000.00	2,338,593.76
US TREASURY N/B 3.625	5,000,000.00	5,412,500.00
US TREASURY N/B 3.625	6,000,000.00	6,547,031.28
US TREASURY N/B 3.625	5,000,000.00	5,524,218.75
US TREASURY N/B 3.625	6,000,000.00	7,143,281.28
US TREASURY N/B 3.625	3,000,000.00	3,567,656.25
US TREASURY N/B 3.75	3,000,000.00	3,214,687.50
US TREASURY N/B 3.75	2,000,000.00	2,420,312.50
US TREASURY N/B 3.75	3,000,000.00	3,652,734.39
US TREASURY N/B 3.875	6,000,000.00	6,376,406.28
US TREASURY N/B 3.875	2,000,000.00	2,462,187.50

	US TREASURY N/B 4	2,500,000.00	2,683,007.82	
	US TREASURY N/B 4.25	3,000,000.00	3,161,015.64	
	US TREASURY N/B 4.25	2,000,000.00	2,601,562.50	
	US TREASURY N/B 4.375	1,200,000.00	1,594,125.00	
	US TREASURY N/B 4.375	1,500,000.00	1,983,867.19	
	US TREASURY N/B 4.375	1,500,000.00	1,984,335.94	
	US TREASURY N/B 4.375	2,000,000.00	2,654,062.50	
	US TREASURY N/B 4.5	3,000,000.00	3,121,406.25	
	US TREASURY N/B 4.5	1,500,000.00	2,024,296.87	
	US TREASURY N/B 4.5	1,000,000.00	1,350,468.75	
	US TREASURY N/B 4.5	1,000,000.00	1,345,312.50	
	US TREASURY N/B 4.625	3,000,000.00	4,107,187.50	
	US TREASURY N/B 4.75	3,000,000.00	3,156,796.89	
	US TREASURY N/B 4.75	1,500,000.00	2,093,789.07	
	US TREASURY N/B 5.25	1,000,000.00	1,351,562.50	
	US TREASURY N/B 5.25	500,000.00	678,085.94	
	US TREASURY N/B 5.375	1,320,000.00	1,864,706.25	
	US TREASURY N/B 5.5	500,000.00	686,992.19	
	US TREASURY N/B 6	1,000,000.00	1,370,703.13	
	US TREASURY N/B 6.125	1,000,000.00	1,425,000.00	
	US TREASURY N/B 6.25	800,000.00	1,052,375.00	
	US TREASURY N/B 6.25	1,000,000.00	1,504,765.63	
	US TREASURY N/B 6.5	500,000.00	718,437.50	
	US TREASURY N/B 8	1,300,000.00	1,754,085.94	
	US TREASURY N/B 8.75	1,000,000.00	1,085,859.38	
	US TREASURY N/B 8.75	1,000,000.00	1,313,125.00	
	US TREASURY N/B 8.875	1,100,000.00	1,342,171.87	
	米ドル 小計	651,520,000.00	679,001,707.83 (75,348,819,517)	
カナダドル	CANADA-GOV'T 0.25	1,000,000.00	993,500.00	
	CANADA-GOV'T 0.75	1,000,000.00	996,550.00	
	CANADA-GOV'T 0.75	1,000,000.00	993,701.00	
	CANADA-GOV'T 1.25	2,000,000.00	2,014,180.00	
	CANADA-GOV'T 1.25	2,000,000.00	2,020,400.00	
	CANADA-GOV'T 1.25	1,000,000.00	1,012,970.00	
	CANADA-GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,007,270.00	
	CANADA-GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,010,840.00	
	CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	2,035,440.00	
	CANADA-GOV'T 1.75	1,000,000.00	1,028,470.00	
	CANADA-GOV'T 1.75	1,000,000.00	1,032,430.00	
	CANADA-GOV'T 2.25	1,000,000.00	1,067,360.00	
	CANADA-GOV'T 2.5	2,000,000.00	2,172,020.00	

	CANADA-GOV'T 2.75	1,000,000.00	1,097,400.00
	CANADA-GOV'T 3.25	1,000,000.00	1,113,830.00
	CANADA-GOV'T 3.5	2,000,000.00	2,212,420.00
	CANADA-GOV'T 3.5	1,500,000.00	1,959,000.00
	CANADA-GOV'T 3.75	2,500,000.00	2,728,250.00
	CANADA-GOV'T 4	2,000,000.00	2,072,820.00
	CANADA-GOV'T 4	3,000,000.00	4,088,670.00
	CANADA-GOV'T 4.25	1,500,000.00	1,610,550.00
	CANADA-GOV'T 5	1,500,000.00	2,238,075.00
	CANADA-GOV'T 5.75	1,500,000.00	2,183,250.00
	CANADA-GOV'T 5.75	1,500,000.00	2,309,430.00
	CANADA-GOV'T 8	500,000.00	821,775.00
	カナダドル 小計	36,500,000.00	41,820,601.00 (3,661,393,617)
メキシコペソ	MEXICAN BONOS 6.5	30,000,000.00	31,547,640.00
	MEXICAN BONOS 7.25	20,000,000.00	20,418,200.00
	MEXICAN BONOS 7.75	20,000,000.00	21,168,120.00
	MEXICAN BONOS 8	50,000,000.00	55,317,600.00
	MEXICAN BONOS 8	20,000,000.00	22,829,320.00
	MEXICAN BONOS 8.5	50,000,000.00	60,206,350.00
	MEXICAN BONOS 8.5	40,000,000.00	48,919,160.00
	メキシコペソ 小計	230,000,000.00	260,406,390.00 (1,645,768,384)
ユーロ	BELGIAN 0326 4	1,000,000.00	1,413,630.00
	BELGIAN 0.8	2,000,000.00	2,056,160.00
	BELGIAN 0291 5.5	2,000,000.00	3,064,800.00
	BELGIAN 0300 5.5	740,000.00	803,122.00
	BELGIAN 0304 5	2,500,000.00	4,048,075.00
	BELGIAN 0308 4	1,500,000.00	1,862,520.00
	BELGIAN 0312 4	1,000,000.00	1,086,070.00
	BELGIAN 0315 4	1,500,000.00	1,694,250.00
	BELGIAN 0318 3.75	2,000,000.00	2,355,200.00
	BELGIAN 0320 4.25	1,500,000.00	2,352,000.00
	BELGIAN 0321 4.25	1,700,000.00	2,104,311.00
	BELGIAN 0323 3.5	2,000,000.00	2,093,300.00
	BELGIAN 0324 4.5	1,000,000.00	1,383,530.00
	BELGIAN 0325 4.25	2,000,000.00	2,545,600.00
	BELGIAN 0327 3	1,000,000.00	1,114,980.00
	BELGIAN 0328 2.25	1,000,000.00	1,153,080.00
	BELGIAN 0329 1.25	1,000,000.00	1,036,500.00
	BELGIAN 0332 2.6	2,000,000.00	2,371,160.00
	BELGIAN 0333 3	500,000.00	637,665.00
BELGIAN 1.9	1,000,000.00	1,073,050.00	

BELGIAN 3.75	1,000,000.00	1,490,380.00
BTAN 1	2,500,000.00	2,545,675.00
BTPS 0.3	1,000,000.00	1,006,250.00
BTPS 0.75	1,000,000.00	1,013,150.00
BTPS 1.05	1,000,000.00	1,029,980.00
BTPS 1.15	2,000,000.00	2,025,300.00
BTPS 1.35	2,000,000.00	2,067,600.00
BTPS 1.5	2,000,000.00	2,010,600.00
BTPS 2	1,000,000.00	1,042,250.00
BTPS 2.15	2,000,000.00	2,162,200.00
BTPS 2.5	1,000,000.00	1,071,100.00
BTPS 2.5	2,000,000.00	2,181,300.00
BTPS 2.7	1,000,000.00	1,002,860.00
BTPS 3.25	1,500,000.00	1,686,450.00
BTPS 3.5	1,000,000.00	1,053,180.00
BTPS 3.5	3,400,000.00	3,647,452.00
BTPS 3.5	2,000,000.00	2,178,940.00
BTPS 3.5	1,000,000.00	1,189,750.00
BTPS 3.75	3,000,000.00	3,466,500.00
BTPS 3.75	2,000,000.00	2,315,600.00
BTPS 3.75	3,300,000.00	3,840,870.00
BTPS 3.75	2,000,000.00	2,377,860.00
BTPS 4	3,500,000.00	4,046,000.00
BTPS 4	3,000,000.00	3,783,600.00
BTPS 4.25	2,400,000.00	2,676,600.00
BTPS 4.25	3,500,000.00	3,973,830.00
BTPS 4.25	3,300,000.00	3,804,735.00
BTPS 4.5	4,000,000.00	4,317,600.00
BTPS 4.5	3,000,000.00	3,303,450.00
BTPS 4.5	2,700,000.00	3,037,905.00
BTPS 4.5	2,700,000.00	3,130,731.00
BTPS 4.5	1,800,000.00	2,226,510.00
BTPS 4.5	2,000,000.00	2,485,900.00
BTPS 4.5	2,000,000.00	2,537,040.00
BTPS 4.75	1,000,000.00	1,048,600.00
BTPS 4.75	2,000,000.00	2,105,100.00
BTPS 4.75	2,600,000.00	3,166,228.00
BTPS 4.75	2,500,000.00	3,146,750.00
BTPS 4.75	2,000,000.00	2,638,360.00
BTPS 4.75	1,000,000.00	1,421,950.00
BTPS 5	2,000,000.00	2,485,800.00
BTPS 5	3,000,000.00	3,888,690.00
BTPS 5	2,470,000.00	3,490,060.60

BTPS 5	2,000,000.00	2,883,260.00	
BTPS 5	2,500,000.00	3,598,250.00	
BTPS 5.25	3,000,000.00	3,200,340.00	
BTPS 5.25	3,700,000.00	5,158,725.00	
BTPS 5.5	2,500,000.00	3,215,825.00	
BTPS 5.5	2,500,000.00	3,224,325.00	
BTPS 5.75	2,200,000.00	3,310,230.00	
BTPS 6	4,100,000.00	6,185,670.00	
BTPS 6.5	2,960,000.00	4,404,864.80	
BTPS 7.25	1,000,000.00	1,540,430.00	
BTPS 9	1,000,000.00	1,563,930.00	
BUNDESUBL-163 0.5	1,000,000.00	1,009,550.00	
BUNDESUBL-164 0.5	2,000,000.00	2,029,400.00	
BUNDESUBL-165 0.5	2,000,000.00	2,036,600.00	
BUNDESUBL-166 0.25	2,000,000.00	2,029,800.00	
BUNDESUBL-167 1	2,000,000.00	2,074,400.00	
BUNDESUBL-168 1	1,000,000.00	1,042,480.00	
BUNDESUBL-169 0.5	1,000,000.00	1,029,330.00	
BUNDESUBL-170 0.25	1,000,000.00	1,024,770.00	
BUNDESUBL-171 0	1,000,000.00	1,016,780.00	
BUNDESUBL-172 0.25	2,000,000.00	2,055,900.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	2,000,000.00	2,065,560.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	1,000,000.00	1,022,900.00	
DEUTSCHLAND REP 1	2,000,000.00	2,158,060.00	
DEUTSCHLAND REP 1	2,000,000.00	2,148,600.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,500,000.00	2,772,925.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	1,500,000.00	1,669,020.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,000,000.00	2,230,060.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,000,000.00	2,240,560.00	
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,500,000.00	2,806,875.00	
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,000,000.00	2,277,140.00	
DEUTSCHLAND REP 2	2,000,000.00	2,259,700.00	
DEUTSCHLAND REP 2	1,500,000.00	1,730,400.00	
DEUTSCHLAND REP 2.25	1,500,000.00	1,675,005.00	
DEUTSCHLAND REP 2.25	2,000,000.00	2,276,660.00	
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,000,000.00	2,270,600.00	
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,200,000.00	3,031,380.00	
DEUTSCHLAND REP 2.5	1,000,000.00	1,391,830.00	
DEUTSCHLAND REP 3	3,000,000.00	3,431,400.00	
DEUTSCHLAND REP 3.25	3,000,000.00	3,413,250.00	
DEUTSCHLAND REP 3.25	2,000,000.00	2,373,300.00	
DEUTSCHLAND REP 3.25	1,500,000.00	2,302,920.00	

DEUTSCHLAND REP 3.5	4,000,000.00	4,509,920.00
DEUTSCHLAND REP 3.75	3,500,000.00	3,902,080.00
DEUTSCHLAND REP 4	3,000,000.00	3,229,950.00
DEUTSCHLAND REP 4	2,200,000.00	3,525,060.00
DEUTSCHLAND REP 4.25	2,000,000.00	2,113,200.00
DEUTSCHLAND REP 4.25	3,200,000.00	3,534,560.00
DEUTSCHLAND REP 4.25	1,500,000.00	2,554,350.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,300,000.00	1,976,975.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	2,100,000.00	3,538,290.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,400,000.00	2,568,062.00
DEUTSCHLAND REP 5.5	1,800,000.00	3,046,464.00
DEUTSCHLAND REP 5.625	1,580,000.00	2,536,895.40
DEUTSCHLAND REP 6.25	1,200,000.00	1,784,196.00
DEUTSCHLAND REP 6.25	1,000,000.00	1,768,650.00
DEUTSCHLAND REP 6.5	1,000,000.00	1,683,600.00
FINNISH GOV'T 1.625	1,000,000.00	1,103,380.00
FINNISH GOV'T 2	1,000,000.00	1,137,680.00
FINNISH GOV'T 2.625	500,000.00	663,790.00
FINNISH GOV'T 2.75	600,000.00	741,078.00
FINNISH GOV'T 3.375	1,200,000.00	1,376,340.00
FINNISH GOV'T 3.5	1,000,000.00	1,183,730.00
FINNISH GOV'T 3.875	1,000,000.00	1,060,850.00
FINNISH GOV'T 4	1,000,000.00	1,327,500.00
FRANCE O.A.T. 0	2,000,000.00	2,020,460.00
FRANCE O.A.T. 0.5	2,000,000.00	2,058,100.00
FRANCE O.A.T. 0.5	3,000,000.00	3,015,450.00
FRANCE O.A.T. 1	3,000,000.00	3,089,700.00
FRANCE O.A.T. 1	1,000,000.00	1,036,370.00
FRANCE O.A.T. 1	1,000,000.00	1,041,970.00
FRANCE O.A.T. 1	3,000,000.00	3,133,740.00
FRANCE O.A.T. 1.5	1,000,000.00	1,056,700.00
FRANCE O.A.T. 1.75	3,000,000.00	3,347,100.00
FRANCE O.A.T. 1.75	3,000,000.00	3,355,290.00
FRANCE O.A.T. 2.25	2,800,000.00	3,201,856.00
FRANCE O.A.T. 2.25	3,000,000.00	3,479,190.00
FRANCE O.A.T. 2.5	4,500,000.00	5,050,800.00
FRANCE O.A.T. 2.5	3,000,000.00	3,591,090.00
FRANCE O.A.T. 2.75	3,000,000.00	3,658,650.00
FRANCE O.A.T. 3	4,000,000.00	4,728,920.00
FRANCE O.A.T. 3.25	3,800,000.00	4,500,910.00
FRANCE O.A.T. 3.25	1,700,000.00	2,348,771.00
FRANCE O.A.T. 3.5	5,000,000.00	5,756,750.00
FRANCE O.A.T. 3.5	4,000,000.00	5,147,320.00

FRANCE O.A.T. 3.75	3,000,000.00	3,126,450.00	
FRANCE O.A.T. 3.75	5,000,000.00	5,716,100.00	
FRANCE O.A.T. 3.75	3,700,000.00	4,424,571.00	
FRANCE O.A.T. 4	4,000,000.00	4,356,000.00	
FRANCE O.A.T. 4	2,700,000.00	4,030,155.00	
FRANCE O.A.T. 4	1,370,000.00	2,231,360.10	
FRANCE O.A.T. 4	1,500,000.00	2,476,950.00	
FRANCE O.A.T. 4.25	4,500,000.00	4,818,825.00	
FRANCE O.A.T. 4.25	4,000,000.00	4,467,880.00	
FRANCE O.A.T. 4.25	4,400,000.00	5,012,040.00	
FRANCE O.A.T. 4.25	4,000,000.00	5,224,520.00	
FRANCE O.A.T. 4.5	2,700,000.00	4,400,946.00	
FRANCE O.A.T. 4.75	3,100,000.00	4,919,948.00	
FRANCE O.A.T. 5.5	3,500,000.00	5,489,050.00	
FRANCE O.A.T. 5.75	3,200,000.00	5,438,400.00	
FRANCE O.A.T. 6	2,500,000.00	3,797,750.00	
FRANCE O.A.T. 8.5	850,000.00	1,114,010.00	
FRANCE O.A.T. 8.5	1,200,000.00	1,906,656.00	
IRISH GOVT 2	1,000,000.00	1,014,730.00	
IRISH GOVT 3.4	1,000,000.00	1,208,500.00	
IRISH GOVT 3.9	1,000,000.00	1,234,180.00	
IRISH GOVT 4.4	1,000,000.00	1,145,480.00	
IRISH GOVT 4.5	1,000,000.00	1,119,880.00	
IRISH GOVT 4.5	1,490,000.00	1,760,628.70	
IRISH GOVT 5	1,000,000.00	1,223,180.00	
IRISH GOVT 5.4	1,500,000.00	2,081,820.00	
IRISH GOVT 5.5	500,000.00	543,350.00	
IRISH GOVT 5.9	800,000.00	967,984.00	
NETHERLANDS GOVT 0	1,000,000.00	1,009,230.00	
NETHERLANDS GOVT 0.25	1,000,000.00	1,023,550.00	
NETHERLANDS GOVT 0.25	1,000,000.00	991,580.00	
NETHERLANDS GOVT 0.5	1,000,000.00	1,009,630.00	
NETHERLANDS GOVT 0.5	500,000.00	501,375.00	
NETHERLANDS GOVT 1.25	1,500,000.00	1,544,925.00	
NETHERLANDS GOVT 1.25	2,000,000.00	2,092,460.00	
NETHERLANDS GOVT 1.75	2,200,000.00	2,469,896.00	
NETHERLANDS GOVT 2	2,000,000.00	2,294,460.00	
NETHERLANDS GOVT 2.25	2,000,000.00	2,291,860.00	
NETHERLANDS GOVT 2.5	1,100,000.00	1,383,085.00	
NETHERLANDS GOVT 2.75	500,000.00	707,465.00	
NETHERLANDS GOVT 3.25	1,500,000.00	1,773,450.00	
NETHERLANDS GOVT 3.5	2,000,000.00	2,326,200.00	

NETHERLANDS GOVT 3.75	1,000,000.00	1,254,500.00
NETHERLANDS GOVT 3.75	2,000,000.00	3,222,300.00
NETHERLANDS GOVT 4	1,500,000.00	1,648,995.00
NETHERLANDS GOVT 4	1,500,000.00	1,714,800.00
NETHERLANDS GOVT 4	1,200,000.00	1,890,420.00
NETHERLANDS GOVT 4.5	2,000,000.00	2,122,140.00
NETHERLANDS GOVT 5.5	1,500,000.00	2,343,750.00
REP OF AUSTRIA 1.2	500,000.00	534,965.00
REP OF AUSTRIA 1.65	1,000,000.00	1,115,950.00
REP OF AUSTRIA 1.75	1,000,000.00	1,124,350.00
REP OF AUSTRIA 1.95	1,000,000.00	1,073,130.00
REP OF AUSTRIA 3.15	500,000.00	708,665.00
REP OF AUSTRIA 3.4	1,000,000.00	1,224,820.00
REP OF AUSTRIA 3.5	2,000,000.00	2,396,660.00
REP OF AUSTRIA 3.65	1,000,000.00	1,223,900.00
REP OF AUSTRIA 3.8	500,000.00	881,400.00
REP OF AUSTRIA 3.9	2,000,000.00	2,356,500.00
REP OF AUSTRIA 4.15	1,300,000.00	2,009,514.00
REP OF AUSTRIA 4.3	1,500,000.00	1,599,675.00
REP OF AUSTRIA 4.35	1,200,000.00	1,364,724.00
REP OF AUSTRIA 4.65	1,000,000.00	1,088,400.00
REP OF AUSTRIA 4.85	1,000,000.00	1,423,150.00
REP OF AUSTRIA 6.25	1,000,000.00	1,616,950.00
SPANISH GOV'T 0.5	1,000,000.00	1,008,480.00
SPANISH GOV'T 1.4	2,000,000.00	2,081,560.00
SPANISH GOV'T 1.6	2,000,000.00	2,020,860.00
SPANISH GOV'T 1.95	500,000.00	514,366.50
SPANISH GOV'T 1.95	1,000,000.00	985,380.00
SPANISH GOV'T 2.1	2,000,000.00	2,044,800.00
SPANISH GOV'T 2.15	2,000,000.00	2,103,560.00
SPANISH GOV'T 2.75	1,000,000.00	1,078,520.00
SPANISH GOV'T 2.75	3,000,000.00	3,315,240.00
SPANISH GOV'T 3.75	2,200,000.00	2,406,096.00
SPANISH GOV'T 3.8	2,000,000.00	2,372,100.00
SPANISH GOV'T 4	3,000,000.00	3,431,610.00
SPANISH GOV'T 4.1	3,000,000.00	3,278,190.00
SPANISH GOV'T 4.2	2,050,000.00	2,600,220.00
SPANISH GOV'T 4.3	3,000,000.00	3,426,300.00
SPANISH GOV'T 4.4	1,000,000.00	1,231,800.00
SPANISH GOV'T 4.5	2,500,000.00	2,699,575.00
SPANISH GOV'T 4.6	3,500,000.00	4,000,255.00
SPANISH GOV'T 4.65	2,000,000.00	2,536,400.00
SPANISH GOV'T 4.7	1,500,000.00	2,048,220.00

	SPANISH GOV'T 4.8	3,000,000.00	3,791,340.00	
	SPANISH GOV'T 4.85	2,000,000.00	2,389,260.00	
	SPANISH GOV'T 4.9	1,500,000.00	2,093,550.00	
	SPANISH GOV'T 5.15	1,500,000.00	2,030,670.00	
	SPANISH GOV'T 5.15	1,000,000.00	1,466,100.00	
	SPANISH GOV'T 5.4	2,000,000.00	2,580,600.00	
	SPANISH GOV'T 5.5	3,380,000.00	3,618,053.40	
	SPANISH GOV'T 5.5	2,000,000.00	2,487,600.00	
	SPANISH GOV'T 5.75	2,200,000.00	3,271,686.00	
	SPANISH GOV'T 5.85	2,500,000.00	3,224,425.00	
	SPANISH GOV'T 5.9	1,500,000.00	2,094,600.00	
	SPANISH GOV'T 6	2,400,000.00	3,495,312.00	
	ユーロ 小計	476,890,000.00	578,375,328.50 (72,296,916,062)	
英bond	TREASURY 1	3,300,000.00	3,323,661.00	
	TREASURY 1.25	1,500,000.00	1,524,120.00	
	TREASURY 1.75	1,000,000.00	1,033,365.00	
	TREASURY 1.75	3,000,000.00	3,107,073.00	
	TREASURY 2	1,000,000.00	1,046,550.00	
	TREASURY 2.25	2,700,000.00	2,868,939.00	
	TREASURY 2.75	2,000,000.00	2,197,800.00	
	TREASURY 3.25	2,000,000.00	2,338,790.00	
	TREASURY 3.5	1,500,000.00	1,831,770.00	
	TREASURY 3.5	1,000,000.00	1,388,137.00	
	TREASURY 3.75	3,000,000.00	3,313,470.00	
	TREASURY 3.75	2,800,000.00	3,154,004.00	
	TREASURY 3.75	2,400,000.00	2,745,144.00	
	TREASURY 3.75	2,300,000.00	3,127,333.00	
	TREASURY 4	1,500,000.00	1,753,312.50	
	TREASURY 4	2,000,000.00	2,986,584.00	
	TREASURY 4.25	1,300,000.00	1,637,896.00	
	TREASURY 4.25	2,000,000.00	2,584,000.00	
	TREASURY 4.25	2,000,000.00	2,621,520.00	
	TREASURY 4.25	1,500,000.00	2,001,915.00	
	TREASURY 4.25	2,000,000.00	2,703,360.00	
	TREASURY 4.25	1,900,000.00	2,673,433.00	
	TREASURY 4.25	1,900,000.00	2,741,529.00	
	TREASURY 4.25	2,100,000.00	3,206,931.00	
	TREASURY 4.5	2,700,000.00	3,004,884.00	
	TREASURY 4.5	2,500,000.00	3,347,050.00	
	TREASURY 4.5	2,000,000.00	2,826,380.00	
	TREASURY 4.75	2,700,000.00	3,112,587.00	

	TREASURY 4.75	1,800,000.00	2,423,385.00
	TREASURY 4.75	1,500,000.00	2,137,110.00
	TREASURY 5	2,500,000.00	2,714,800.00
	TREASURY 5	2,500,000.00	3,226,387.50
	TREASURY 6	1,200,000.00	1,770,672.00
	TREASURY 8	1,620,000.00	2,188,312.20
	TREASURY 8.75	800,000.00	890,392.00
	UNITED KINGDOM G 2	1,500,000.00	1,551,454.50
英ポンド 小計		71,020,000.00	87,104,050.70 (14,006,331,352)
スイスフラン	SWISS (GOVT) 2.25	900,000.00	1,016,460.00
	SWISS (GOVT) 3	500,000.00	533,000.00
	SWISS (GOVT) 3	1,000,000.00	1,120,500.00
	SWISS (GOVT) 4	500,000.00	657,800.00
	SWISS (GOVT) 4	700,000.00	1,049,090.00
	SWISS (GOVT) 4.25	500,000.00	528,200.00
スイスフラン 小計		4,100,000.00	4,905,050.00 (558,390,892)
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVRNMNT 1.5	8,000,000.00	8,592,640.00
	SWEDISH GOVRNMNT 2.5	5,000,000.00	5,800,150.00
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	11,000,000.00	13,147,640.00
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	6,000,000.00	7,744,620.00
	SWEDISH GOVRNMNT 3.75	8,200,000.00	8,662,480.00
	SWEDISH GOVRNMNT 4.25	12,000,000.00	13,611,240.00
	SWEDISH GOVRNMNT 5	5,000,000.00	6,159,500.00
スウェーデンクローナ 小計		55,200,000.00	63,718,270.00 (868,480,020)
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOV'T 2	10,000,000.00	10,634,000.00
	NORWEGIAN GOV'T 3	4,000,000.00	4,552,400.00
	NORWEGIAN GOV'T 3.75	11,000,000.00	12,582,350.00
	NORWEGIAN GOV'T 4.25	6,000,000.00	6,235,080.00
	NORWEGIAN GOV'T 4.5	6,000,000.00	6,715,200.00
ノルウェークローネ 小計		37,000,000.00	40,719,030.00 (550,521,285)
デンマーククローネ	DENMARK - BULLET 1.5	5,000,000.00	5,482,500.00
	DENMARK - BULLET 1.75	5,000,000.00	5,586,950.00
	DENMARK - BULLET 3	10,000,000.00	11,707,300.00
	DENMARK - BULLET 4	5,000,000.00	5,343,000.00
	DENMARK - BULLET 4	8,000,000.00	9,234,320.00
	DENMARK - BULLET 4.5	14,000,000.00	23,973,600.00
	DENMARK - BULLET 7	3,080,000.00	4,855,312.00
デンマーククローネ 小計		50,080,000.00	66,182,982.00 (1,111,874,097)

ポーランドズロチ	POLAND GOVT BOND 2.5	5,000,000.00	5,092,500.00	
	POLAND GOVT BOND 3.25	2,000,000.00	2,047,860.00	
	POLAND GOVT BOND 4	2,000,000.00	2,160,000.00	
	POLAND GOVT BOND 5.25	5,000,000.00	5,280,000.00	
	POLAND GOVT BOND 5.25	2,000,000.00	2,272,000.00	
	POLAND GOVT BOND 5.5	4,000,000.00	4,496,000.00	
	POLAND GOVT BOND 5.75	4,000,000.00	4,672,000.00	
	POLAND GOVT BOND 5.75	4,200,000.00	4,996,026.00	
	POLAND GOVT BOND 5.75	2,000,000.00	2,506,660.00	
ポーランドズロチ 小計		30,200,000.00	33,523,046.00	(950,713,584)
オーストラリアドル	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,000,000.00	1,022,500.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	3,000,000.00	3,047,598.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,000,000.00	996,200.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,000,000.00	933,600.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	2,000,000.00	2,055,300.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	2,000,000.00	2,104,200.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	1,500,000.00	1,559,400.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.75	1,000,000.00	1,077,200.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25	2,000,000.00	2,052,200.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25	2,000,000.00	2,279,000.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	3,000,000.00	3,274,488.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	1,500,000.00	1,789,800.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.75	1,200,000.00	1,433,400.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.25	3,000,000.00	3,268,710.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	2,000,000.00	2,115,600.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	2,500,000.00	2,984,500.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	3,000,000.00	3,502,650.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	2,000,000.00	2,386,000.00	
オーストラリアドル 小計		34,700,000.00	37,882,346.00	(3,242,728,817)
シンガポールドル	SINGAPORE GOV'T 2.25	500,000.00	514,240.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	400,000.00	416,400.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.875	400,000.00	424,740.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.125	1,000,000.00	1,077,000.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.25	1,000,000.00	1,075,500.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.375	500,000.00	565,275.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.5	1,500,000.00	1,697,250.00	
	SINGAPORE GOV'T 4	2,100,000.00	2,243,850.00	
シンガポールドル 小計		7,400,000.00	8,014,255.00	(657,810,050)
マレーシアリングgit	MALAYSIA GOVT 3.418	8,000,000.00	7,875,224.00	
	MALAYSIA GOVT 3.502	9,000,000.00	8,488,161.00	

		MALAYSIA GOVT 3.814	2,000,000.00	2,014,504.00	
		MALAYSIA GOVT 4.24	5,000,000.00	5,108,945.00	
		MALAYSIA GOVT 4.262	3,000,000.00	3,021,369.00	
		MALAYSIA GOVT 4.378	5,000,000.00	5,160,775.00	
	マレーシアリングット 小計		32,000,000.00	31,668,978.00	(900,665,734)
	南アフリカランド	REP SOUTH AFRICA 6.5	40,000,000.00	26,784,000.00	
		REP SOUTH AFRICA 6.75	30,000,000.00	27,640,500.00	
		REP SOUTH AFRICA 7	40,000,000.00	31,688,000.00	
		REP SOUTH AFRICA 8	10,000,000.00	9,903,000.00	
		REP SOUTH AFRICA 8.25	8,000,000.00	8,004,160.00	
	南アフリカランド 小計		128,000,000.00	104,019,660.00	(799,911,185)
合計				176,600,324,596	(176,600,324,596)

(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 200銘柄	42.1%	42.7%
カナダドル	国債証券 25銘柄	2.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 7銘柄	0.9%	0.9%
ユーロ	国債証券 245銘柄	40.4%	40.9%
英ポンド	国債証券 36銘柄	7.8%	7.9%
スイスフラン	国債証券 6銘柄	0.3%	0.3%
スウェーデンクローナ	国債証券 7銘柄	0.5%	0.5%
ノルウェークローネ	国債証券 5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 9銘柄	0.5%	0.5%
オーストラリアドル	国債証券 18銘柄	1.8%	1.8%
シンガポールドル	国債証券 8銘柄	0.4%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 6銘柄	0.5%	0.5%
南アフリカランド	国債証券 5銘柄	0.4%	0.5%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

ヘッジ付き外国債券パッシブ・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(平成28年 4月26日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	395,557,524
金銭信託	737,135,744
コール・ローン	154,670,398
国債証券	37,470,353,819
派生商品評価勘定	558,523,360
未収入金	52,000,000
未収利息	251,663,741
前払費用	76,142,346
流動資産合計	39,696,046,932
資産合計	
39,696,046,932	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	13,006,850
未払解約金	95,000,000
未払利息	453
その他未払費用	15,581
流動負債合計	108,022,884
負債合計	
108,022,884	
純資産の部	
元本等	
元本	28,443,896,912
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	11,144,127,136
元本等合計	39,588,024,048
純資産合計	
39,588,024,048	
負債純資産合計	
39,696,046,932	

注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 平成27年 4月17日 至 平成28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>
	為替予約取引

項目	自 平成27年 4月17日 至 平成28年 4月26日
2.デリバティブの評価基準及び評価方法	個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。
3.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。

(貸借対照表に関する注記)

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

(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27年 4月17日 至 平成28年 4月26日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1)金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。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。 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。

項目	自 平成27年 4月17日 至 平成28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	(平成28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） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（デリバティブ取引に関する注記）

（平成28年 4月26日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

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

（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）

該当事項はありません。

(その他の注記)

(平成28年 4月26日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	18,788,550,964円
同期中における追加設定元本額	19,329,357,560円
同期中における一部解約元本額	9,674,011,612円
平成28年 4月26日現在における元本の内訳	
アセットアロケーション・ファンド(安定型)	4,699,301,222円
アセットアロケーション・ファンド(安定成長型)	3,800,933,413円
アセットアロケーション・ファンド(成長型)	2,824,867,699円
S M A M ・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	5,338,668,542円
S M A M ・バランスV A株40T<適格機関投資家限定>	188,811,848円
三井住友・7資産バランスファンド・V A S (適格機関投資家専用)	6,651,950,699円
S M A M ・ヘッジ付き年金外国債券パッシブファンド <適格機関投資家限定>	3,587,481,324円
S M A M ・グローバル・マルチアセット・グロース・ファンド(安定成長型)<適格機関投資家限定>	796,470円
S M A M ・年金Wリスクコントロールファンド<適格機関投資家限定>	2,266,011円
S M A M ・マルチアセットストラテジーファンド2016-01<適格機関投資家限定>	1,348,819,684円
合計	28,443,896,912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 0.5	500,000.00	498,789.06	
		US TREASURY N/B 0.625	500,000.00	499,843.75	
		US TREASURY N/B 0.625	500,000.00	499,726.56	
		US TREASURY N/B 0.625	1,000,000.00	999,140.63	
		US TREASURY N/B 0.625	300,000.00	299,578.12	

US TREASURY N/B 0.625	800,000.00	798,500.00	
US TREASURY N/B 0.625	1,000,000.00	997,421.88	
US TREASURY N/B 0.625	1,300,000.00	1,293,804.69	
US TREASURY N/B 0.75	1,000,000.00	1,001,015.63	
US TREASURY N/B 0.75	1,000,000.00	999,609.38	
US TREASURY N/B 0.75	1,000,000.00	999,140.63	
US TREASURY N/B 0.75	1,000,000.00	998,750.00	
US TREASURY N/B 0.75	700,000.00	698,960.94	
US TREASURY N/B 0.75	600,000.00	598,734.37	
US TREASURY N/B 0.75	1,300,000.00	1,291,468.75	
US TREASURY N/B 0.875	500,000.00	501,367.19	
US TREASURY N/B 0.875	1,000,000.00	1,002,539.06	
US TREASURY N/B 0.875	1,500,000.00	1,503,750.00	
US TREASURY N/B 0.875	500,000.00	501,250.00	
US TREASURY N/B 0.875	700,000.00	701,585.94	
US TREASURY N/B 0.875	500,000.00	501,093.75	
US TREASURY N/B 0.875	700,000.00	701,148.44	
US TREASURY N/B 0.875	400,000.00	400,593.75	
US TREASURY N/B 0.875	1,000,000.00	1,001,328.13	
US TREASURY N/B 0.875	1,000,000.00	1,000,937.50	
US TREASURY N/B 0.875	700,000.00	700,710.94	
US TREASURY N/B 0.875	800,000.00	799,562.50	
US TREASURY N/B 0.875	700,000.00	698,796.87	
US TREASURY N/B 0.875	1,300,000.00	1,291,773.44	
US TREASURY N/B 1	1,000,000.00	1,003,593.75	
US TREASURY N/B 1	500,000.00	501,562.50	
US TREASURY N/B 1	1,000,000.00	1,003,046.88	
US TREASURY N/B 1	800,000.00	801,937.50	
US TREASURY N/B 1	1,000,000.00	1,001,562.50	
US TREASURY N/B 1	500,000.00	499,140.62	
US TREASURY N/B 1	400,000.00	398,531.25	
US TREASURY N/B 1	700,000.00	696,171.87	
US TREASURY N/B 1.125	1,000,000.00	1,003,828.13	
US TREASURY N/B 1.125	300,000.00	300,843.75	
US TREASURY N/B 1.125	700,000.00	698,742.19	

US TREASURY N/B 1.125	1,000,000.00	995,234.38
US TREASURY N/B 1.25	500,000.00	503,671.87
US TREASURY N/B 1.25	800,000.00	806,062.50
US TREASURY N/B 1.25	400,000.00	402,937.50
US TREASURY N/B 1.25	900,000.00	906,187.50
US TREASURY N/B 1.25	1,000,000.00	1,001,796.88
US TREASURY N/B 1.25	800,000.00	800,937.50
US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	1,010,546.88
US TREASURY N/B 1.375	500,000.00	505,273.44
US TREASURY N/B 1.375	300,000.00	303,210.93
US TREASURY N/B 1.375	500,000.00	505,312.50
US TREASURY N/B 1.375	600,000.00	603,234.37
US TREASURY N/B 1.375	1,200,000.00	1,205,531.25
US TREASURY N/B 1.375	200,000.00	200,796.87
US TREASURY N/B 1.375	500,000.00	501,523.44
US TREASURY N/B 1.375	800,000.00	801,687.50
US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	1,001,796.88
US TREASURY N/B 1.375	1,000,000.00	1,000,625.00
US TREASURY N/B 1.5	500,000.00	506,757.81
US TREASURY N/B 1.5	600,000.00	608,484.37
US TREASURY N/B 1.5	500,000.00	507,031.25
US TREASURY N/B 1.5	800,000.00	811,250.00
US TREASURY N/B 1.5	1,000,000.00	1,014,062.50
US TREASURY N/B 1.5	1,100,000.00	1,113,578.12
US TREASURY N/B 1.5	1,000,000.00	1,009,062.50
US TREASURY N/B 1.5	1,200,000.00	1,197,937.49
US TREASURY N/B 1.5	1,000,000.00	988,437.50
US TREASURY N/B 1.625	500,000.00	508,828.12
US TREASURY N/B 1.625	800,000.00	814,250.00
US TREASURY N/B 1.625	500,000.00	508,710.94
US TREASURY N/B 1.625	800,000.00	813,937.50
US TREASURY N/B 1.625	1,300,000.00	1,320,718.75
US TREASURY N/B 1.625	800,000.00	811,000.00
US TREASURY N/B 1.625	500,000.00	506,757.81
US TREASURY N/B 1.625	1,100,000.00	1,114,523.44

US TREASURY N/B 1.625	300,000.00	300,539.06	
US TREASURY N/B 1.625	600,000.00	599,812.50	
US TREASURY N/B 1.625	1,200,000.00	1,170,093.75	
US TREASURY N/B 1.75	1,000,000.00	1,021,250.00	
US TREASURY N/B 1.75	400,000.00	407,187.50	
US TREASURY N/B 1.75	1,000,000.00	1,017,812.50	
US TREASURY N/B 1.75	500,000.00	505,546.87	
US TREASURY N/B 1.75	400,000.00	404,281.25	
US TREASURY N/B 1.75	500,000.00	505,078.12	
US TREASURY N/B 1.75	600,000.00	605,859.37	
US TREASURY N/B 1.75	1,500,000.00	1,507,265.62	
US TREASURY N/B 1.75	800,000.00	803,687.50	
US TREASURY N/B 1.875	1,500,000.00	1,523,203.12	
US TREASURY N/B 1.875	700,000.00	711,101.56	
US TREASURY N/B 1.875	1,000,000.00	1,016,640.63	
US TREASURY N/B 1.875	500,000.00	512,226.56	
US TREASURY N/B 1.875	600,000.00	612,234.37	
US TREASURY N/B 1.875	600,000.00	610,312.50	
US TREASURY N/B 1.875	1,000,000.00	1,015,234.38	
US TREASURY N/B 2	500,000.00	514,531.25	
US TREASURY N/B 2	800,000.00	823,187.50	
US TREASURY N/B 2	400,000.00	411,531.25	
US TREASURY N/B 2	400,000.00	411,531.25	
US TREASURY N/B 2	1,000,000.00	1,028,750.00	
US TREASURY N/B 2	800,000.00	822,000.00	
US TREASURY N/B 2	1,000,000.00	1,026,406.25	
US TREASURY N/B 2	600,000.00	616,312.50	
US TREASURY N/B 2	600,000.00	616,031.25	
US TREASURY N/B 2	700,000.00	716,187.50	
US TREASURY N/B 2	800,000.00	817,250.00	
US TREASURY N/B 2	700,000.00	715,093.75	
US TREASURY N/B 2	1,200,000.00	1,214,250.00	
US TREASURY N/B 2	1,600,000.00	1,615,749.99	
US TREASURY N/B 2.125	500,000.00	516,835.94	
US TREASURY N/B 2.125	500,000.00	517,500.00	

US TREASURY N/B 2.125	500,000.00	517,304.69	
US TREASURY N/B 2.125	500,000.00	517,148.44	
US TREASURY N/B 2.125	400,000.00	413,468.75	
US TREASURY N/B 2.125	500,000.00	516,523.44	
US TREASURY N/B 2.125	700,000.00	721,546.87	
US TREASURY N/B 2.125	1,000,000.00	1,029,453.13	
US TREASURY N/B 2.125	1,400,000.00	1,429,859.38	
US TREASURY N/B 2.25	300,000.00	309,046.87	
US TREASURY N/B 2.25	600,000.00	624,515.62	
US TREASURY N/B 2.25	500,000.00	520,546.87	
US TREASURY N/B 2.25	500,000.00	520,429.69	
US TREASURY N/B 2.25	1,400,000.00	1,446,156.24	
US TREASURY N/B 2.25	1,300,000.00	1,340,117.19	
US TREASURY N/B 2.375	1,000,000.00	1,021,171.88	
US TREASURY N/B 2.375	700,000.00	722,585.94	
US TREASURY N/B 2.375	500,000.00	523,007.81	
US TREASURY N/B 2.375	1,700,000.00	1,773,976.56	
US TREASURY N/B 2.5	900,000.00	919,195.31	
US TREASURY N/B 2.5	800,000.00	844,500.00	
US TREASURY N/B 2.5	1,500,000.00	1,580,859.37	
US TREASURY N/B 2.5	700,000.00	668,117.19	
US TREASURY N/B 2.5	900,000.00	858,796.87	
US TREASURY N/B 2.625	400,000.00	422,000.00	
US TREASURY N/B 2.625	800,000.00	845,000.00	
US TREASURY N/B 2.75	700,000.00	715,914.06	
US TREASURY N/B 2.75	700,000.00	734,945.31	
US TREASURY N/B 2.75	800,000.00	858,437.50	
US TREASURY N/B 2.75	1,300,000.00	1,394,656.25	
US TREASURY N/B 2.75	300,000.00	304,148.43	
US TREASURY N/B 2.75	700,000.00	708,093.75	
US TREASURY N/B 2.875	800,000.00	831,250.00	
US TREASURY N/B 2.875	700,000.00	723,515.62	
US TREASURY N/B 2.875	800,000.00	824,750.00	
US TREASURY N/B 3	400,000.00	425,875.00	
US TREASURY N/B 3	900,000.00	952,171.87	

US TREASURY N/B 3	800,000.00	845,687.50	
US TREASURY N/B 3	800,000.00	845,874.99	
US TREASURY N/B 3.125	800,000.00	850,875.00	
US TREASURY N/B 3.125	800,000.00	867,437.50	
US TREASURY N/B 3.125	300,000.00	327,351.56	
US TREASURY N/B 3.125	300,000.00	327,187.50	
US TREASURY N/B 3.125	600,000.00	652,218.74	
US TREASURY N/B 3.125	1,300,000.00	1,409,789.06	
US TREASURY N/B 3.375	500,000.00	538,789.06	
US TREASURY N/B 3.375	500,000.00	568,203.12	
US TREASURY N/B 3.5	600,000.00	628,734.37	
US TREASURY N/B 3.5	800,000.00	871,000.00	
US TREASURY N/B 3.5	300,000.00	350,789.06	
US TREASURY N/B 3.625	1,000,000.00	1,091,171.88	
US TREASURY N/B 3.625	700,000.00	773,390.62	
US TREASURY N/B 3.625	900,000.00	1,071,492.19	
US TREASURY N/B 3.625	1,000,000.00	1,189,218.74	
US TREASURY N/B 3.75	800,000.00	857,250.00	
US TREASURY N/B 3.75	300,000.00	363,046.87	
US TREASURY N/B 3.75	700,000.00	852,304.69	
US TREASURY N/B 3.875	1,000,000.00	1,062,734.38	
US TREASURY N/B 3.875	300,000.00	369,328.12	
US TREASURY N/B 4	800,000.00	858,562.50	
US TREASURY N/B 4.25	700,000.00	737,570.31	
US TREASURY N/B 4.25	400,000.00	520,312.50	
US TREASURY N/B 4.375	300,000.00	396,773.43	
US TREASURY N/B 4.375	400,000.00	529,156.25	
US TREASURY N/B 4.375	1,000,000.00	1,327,031.25	
US TREASURY N/B 4.5	800,000.00	832,375.00	
US TREASURY N/B 4.5	300,000.00	404,859.37	
US TREASURY N/B 4.5	200,000.00	270,093.75	
US TREASURY N/B 4.5	300,000.00	403,593.75	
US TREASURY N/B 4.625	500,000.00	684,531.25	
US TREASURY N/B 4.75	600,000.00	631,359.37	
US TREASURY N/B 4.75	300,000.00	418,757.81	

	US TREASURY N/B 5	200,000.00	287,750.00	
	US TREASURY N/B 5.25	300,000.00	405,468.75	
	US TREASURY N/B 5.375	500,000.00	706,328.12	
	US TREASURY N/B 6	200,000.00	274,140.62	
	US TREASURY N/B 6.125	500,000.00	712,500.00	
	US TREASURY N/B 6.25	500,000.00	657,734.37	
	US TREASURY N/B 6.25	100,000.00	150,476.56	
	US TREASURY N/B 8	300,000.00	404,789.06	
	US TREASURY N/B 8.75	700,000.00	919,187.50	
	US TREASURY N/B 8.875	300,000.00	366,046.87	
	米ドル 小計	138,400,000.00	144,306,452.96	(16,013,687,084)
カナダドル	CANADA-GOV'T 0.25	200,000.00	198,700.00	
	CANADA-GOV'T 0.75	400,000.00	398,620.00	
	CANADA-GOV'T 1.25	200,000.00	201,418.00	
	CANADA-GOV'T 1.25	200,000.00	201,948.00	
	CANADA-GOV'T 1.25	400,000.00	404,080.00	
	CANADA-GOV'T 1.25	400,000.00	405,188.00	
	CANADA-GOV'T 1.5	300,000.00	302,181.00	
	CANADA-GOV'T 1.5	400,000.00	404,336.00	
	CANADA-GOV'T 1.5	300,000.00	307,671.00	
	CANADA-GOV'T 1.5	400,000.00	407,088.00	
	CANADA-GOV'T 1.5	300,000.00	297,270.00	
	CANADA-GOV'T 1.75	300,000.00	309,729.00	
	CANADA-GOV'T 2.25	300,000.00	320,208.00	
	CANADA-GOV'T 2.5	200,000.00	217,202.00	
	CANADA-GOV'T 2.75	300,000.00	329,220.00	
	CANADA-GOV'T 3.25	300,000.00	334,149.00	
	CANADA-GOV'T 3.5	300,000.00	331,863.00	
	CANADA-GOV'T 3.5	500,000.00	653,000.00	
	CANADA-GOV'T 3.75	200,000.00	218,260.00	
	CANADA-GOV'T 4	400,000.00	414,564.00	
	CANADA-GOV'T 4	400,000.00	545,156.00	
	CANADA-GOV'T 4.25	400,000.00	429,480.00	
	CANADA-GOV'T 5	400,000.00	596,820.00	

	CANADA-GOV'T 5.75	200,000.00	291,100.00
	CANADA-GOV'T 5.75	300,000.00	461,886.00
	カナダドル 小計	8,000,000.00	8,981,137.00 (786,298,544)
メキシコペソ	MEXICAN BONOS 10	11,000,000.00	14,127,696.00
	MEXICAN BONOS 4.75	2,000,000.00	2,010,954.00
	MEXICAN BONOS 6.5	4,000,000.00	4,206,352.00
	MEXICAN BONOS 7.25	2,000,000.00	2,041,820.00
	MEXICAN BONOS 7.75	6,000,000.00	6,350,436.00
	MEXICAN BONOS 7.75	1,000,000.00	1,135,111.00
	MEXICAN BONOS 7.75	1,000,000.00	1,138,224.00
	MEXICAN BONOS 8	7,000,000.00	7,744,464.00
	MEXICAN BONOS 8.5	6,000,000.00	6,571,596.00
	MEXICAN BONOS 8.5	6,000,000.00	7,224,762.00
	MEXICAN BONOS 8.5	6,000,000.00	7,337,874.00
	メキシコペソ 小計	52,000,000.00	59,889,289.00 (378,500,306)
ユーロ	BELGIAN 0326 4	200,000.00	282,726.00
	BELGIAN 0.8	200,000.00	205,616.00
	BELGIAN 0291 5.5	300,000.00	459,720.00
	BELGIAN 0300 5.5	300,000.00	325,590.00
	BELGIAN 0304 5	600,000.00	971,538.00
	BELGIAN 0308 4	400,000.00	496,672.00
	BELGIAN 0315 4	500,000.00	564,750.00
	BELGIAN 0318 3.75	300,000.00	353,280.00
	BELGIAN 0320 4.25	400,000.00	627,200.00
	BELGIAN 0321 4.25	300,000.00	371,349.00
	BELGIAN 0323 3.5	200,000.00	209,330.00
	BELGIAN 0324 4.5	300,000.00	415,059.00
	BELGIAN 0325 4.25	300,000.00	381,840.00
	BELGIAN 0327 3	200,000.00	222,996.00
	BELGIAN 0328 2.25	200,000.00	230,616.00
	BELGIAN 0329 1.25	600,000.00	621,900.00
	BELGIAN 0332 2.6	400,000.00	474,232.00
	BELGIAN 0333 3	100,000.00	127,533.00
	BELGIAN 3.75	300,000.00	447,114.00

BTAN 1	500,000.00	509,135.00	
BTPS 0.25	600,000.00	602,928.00	
BTPS 0.3	300,000.00	301,875.00	
BTPS 0.65	300,000.00	302,994.00	
BTPS 0.7	300,000.00	304,590.00	
BTPS 0.75	300,000.00	303,945.00	
BTPS 1.05	700,000.00	720,986.00	
BTPS 1.15	400,000.00	405,060.00	
BTPS 1.35	700,000.00	723,660.00	
BTPS 1.45	500,000.00	518,500.00	
BTPS 1.5	400,000.00	417,380.00	
BTPS 1.5	400,000.00	402,120.00	
BTPS 1.65	300,000.00	286,014.00	
BTPS 2	400,000.00	416,900.00	
BTPS 2.15	300,000.00	324,330.00	
BTPS 2.5	300,000.00	321,330.00	
BTPS 2.5	300,000.00	327,195.00	
BTPS 2.7	200,000.00	200,572.00	
BTPS 3.25	200,000.00	224,860.00	
BTPS 3.5	300,000.00	315,954.00	
BTPS 3.5	500,000.00	536,390.00	
BTPS 3.5	200,000.00	217,894.00	
BTPS 3.5	300,000.00	356,925.00	
BTPS 3.75	700,000.00	808,850.00	
BTPS 3.75	200,000.00	231,560.00	
BTPS 3.75	600,000.00	698,340.00	
BTPS 3.75	600,000.00	713,358.00	
BTPS 4	400,000.00	462,400.00	
BTPS 4	400,000.00	504,480.00	
BTPS 4.25	500,000.00	557,625.00	
BTPS 4.25	700,000.00	794,766.00	
BTPS 4.25	400,000.00	461,180.00	
BTPS 4.5	500,000.00	539,700.00	
BTPS 4.5	500,000.00	550,575.00	
BTPS 4.5	500,000.00	562,575.00	

BTPS 4.5	300,000.00	347,859.00	
BTPS 4.5	200,000.00	247,390.00	
BTPS 4.5	300,000.00	372,885.00	
BTPS 4.5	400,000.00	507,408.00	
BTPS 4.75	200,000.00	209,720.00	
BTPS 4.75	300,000.00	315,765.00	
BTPS 4.75	500,000.00	608,890.00	
BTPS 4.75	600,000.00	755,220.00	
BTPS 4.75	300,000.00	395,754.00	
BTPS 4.75	600,000.00	853,170.00	
BTPS 5	400,000.00	497,160.00	
BTPS 5	600,000.00	777,738.00	
BTPS 5	400,000.00	565,192.00	
BTPS 5	300,000.00	432,489.00	
BTPS 5	500,000.00	719,650.00	
BTPS 5.25	600,000.00	640,068.00	
BTPS 5.25	700,000.00	975,975.00	
BTPS 5.5	400,000.00	514,532.00	
BTPS 5.5	300,000.00	386,919.00	
BTPS 5.75	500,000.00	752,325.00	
BTPS 6	700,000.00	1,056,090.00	
BTPS 6.5	800,000.00	1,190,504.00	
BTPS 7.25	100,000.00	154,043.00	
BTPS 9	400,000.00	625,572.00	
BUNDESABL-163 0.5	200,000.00	201,910.00	
BUNDESABL-164 0.5	700,000.00	710,290.00	
BUNDESABL-165 0.5	400,000.00	407,320.00	
BUNDESABL-166 0.25	600,000.00	608,940.00	
BUNDESABL-167 1	300,000.00	311,160.00	
BUNDESABL-168 1	500,000.00	521,240.00	
BUNDESABL-169 0.5	300,000.00	308,799.00	
BUNDESABL-170 0.25	300,000.00	307,431.00	
BUNDESABL-171 0	200,000.00	203,356.00	
BUNDESABL-172 0.25	300,000.00	308,385.00	
BUNDESSCHATZANW 0	300,000.00	301,329.00	

BUNDESSCHATZANW 0	400,000.00	402,288.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	400,000.00	413,112.00	
DEUTSCHLAND REP 0.5	500,000.00	511,450.00	
DEUTSCHLAND REP 1	300,000.00	323,709.00	
DEUTSCHLAND REP 1	300,000.00	322,290.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	400,000.00	443,668.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	300,000.00	333,804.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	800,000.00	892,024.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	300,000.00	336,084.00	
DEUTSCHLAND REP 1.75	500,000.00	561,375.00	
DEUTSCHLAND REP 1.75	400,000.00	455,428.00	
DEUTSCHLAND REP 2	600,000.00	677,910.00	
DEUTSCHLAND REP 2	200,000.00	230,720.00	
DEUTSCHLAND REP 2.25	400,000.00	446,668.00	
DEUTSCHLAND REP 2.25	500,000.00	569,165.00	
DEUTSCHLAND REP 2.5	600,000.00	681,180.00	
DEUTSCHLAND REP 2.5	300,000.00	413,370.00	
DEUTSCHLAND REP 2.5	200,000.00	278,366.00	
DEUTSCHLAND REP 3	500,000.00	571,900.00	
DEUTSCHLAND REP 3.25	500,000.00	568,875.00	
DEUTSCHLAND REP 3.25	400,000.00	474,660.00	
DEUTSCHLAND REP 3.25	400,000.00	614,112.00	
DEUTSCHLAND REP 3.5	500,000.00	563,740.00	
DEUTSCHLAND REP 3.75	500,000.00	557,440.00	
DEUTSCHLAND REP 4	500,000.00	538,325.00	
DEUTSCHLAND REP 4	400,000.00	640,920.00	
DEUTSCHLAND REP 4.25	200,000.00	211,320.00	
DEUTSCHLAND REP 4.25	400,000.00	441,820.00	
DEUTSCHLAND REP 4.25	400,000.00	681,160.00	
DEUTSCHLAND REP 4.75	200,000.00	304,150.00	
DEUTSCHLAND REP 4.75	400,000.00	673,960.00	
DEUTSCHLAND REP 4.75	300,000.00	550,299.00	
DEUTSCHLAND REP 5.5	300,000.00	507,744.00	
DEUTSCHLAND REP 5.625	310,000.00	497,745.30	
DEUTSCHLAND REP 6.25	400,000.00	594,732.00	

DEUTSCHLAND REP 6.25	300,000.00	530,595.00	
DEUTSCHLAND REP 6.5	400,000.00	673,440.00	
FINNISH GOV'T 1.625	300,000.00	331,014.00	
FINNISH GOV'T 2	300,000.00	341,304.00	
FINNISH GOV'T 2.625	200,000.00	265,516.00	
FINNISH GOV'T 2.75	100,000.00	123,513.00	
FINNISH GOV'T 3.375	200,000.00	229,390.00	
FINNISH GOV'T 3.5	200,000.00	236,746.00	
FINNISH GOV'T 3.875	300,000.00	318,255.00	
FRANCE O.A.T. 0	400,000.00	403,280.00	
FRANCE O.A.T. 0	300,000.00	303,234.00	
FRANCE O.A.T. 0	400,000.00	404,092.00	
FRANCE O.A.T. 0.25	400,000.00	408,048.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	400,000.00	411,620.00	
FRANCE O.A.T. 0.5	700,000.00	703,605.00	
FRANCE O.A.T. 1	500,000.00	514,950.00	
FRANCE O.A.T. 1	400,000.00	414,548.00	
FRANCE O.A.T. 1	600,000.00	625,182.00	
FRANCE O.A.T. 1	700,000.00	731,206.00	
FRANCE O.A.T. 1.5	200,000.00	211,340.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	700,000.00	780,990.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	800,000.00	894,744.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	600,000.00	686,112.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	700,000.00	811,811.00	
FRANCE O.A.T. 2.5	700,000.00	785,680.00	
FRANCE O.A.T. 2.5	600,000.00	718,218.00	
FRANCE O.A.T. 2.75	800,000.00	975,640.00	
FRANCE O.A.T. 3	800,000.00	945,784.00	
FRANCE O.A.T. 3.25	800,000.00	947,560.00	
FRANCE O.A.T. 3.25	300,000.00	414,489.00	
FRANCE O.A.T. 3.5	900,000.00	1,036,215.00	
FRANCE O.A.T. 3.5	700,000.00	900,781.00	
FRANCE O.A.T. 3.75	700,000.00	729,505.00	
FRANCE O.A.T. 3.75	1,100,000.00	1,257,542.00	
FRANCE O.A.T. 3.75	1,100,000.00	1,315,413.00	

FRANCE O.A.T. 4	800,000.00	871,200.00	
FRANCE O.A.T. 4	600,000.00	895,590.00	
FRANCE O.A.T. 4	300,000.00	488,619.00	
FRANCE O.A.T. 4	200,000.00	330,260.00	
FRANCE O.A.T. 4.25	700,000.00	749,595.00	
FRANCE O.A.T. 4.25	600,000.00	670,182.00	
FRANCE O.A.T. 4.25	600,000.00	683,460.00	
FRANCE O.A.T. 4.25	800,000.00	1,044,904.00	
FRANCE O.A.T. 4.5	700,000.00	1,140,986.00	
FRANCE O.A.T. 4.75	700,000.00	1,110,956.00	
FRANCE O.A.T. 5.5	600,000.00	940,980.00	
FRANCE O.A.T. 5.75	600,000.00	1,019,700.00	
FRANCE O.A.T. 6	400,000.00	607,640.00	
FRANCE O.A.T. 8.5	200,000.00	262,120.00	
FRANCE O.A.T. 8.5	200,000.00	317,776.00	
IRISH GOVT 2	200,000.00	202,946.00	
IRISH GOVT 2.4	300,000.00	340,014.00	
IRISH GOVT 3.4	100,000.00	120,850.00	
IRISH GOVT 3.9	200,000.00	246,836.00	
IRISH GOVT 4.4	200,000.00	229,096.00	
IRISH GOVT 4.5	100,000.00	111,988.00	
IRISH GOVT 4.5	200,000.00	236,326.00	
IRISH GOVT 5	200,000.00	244,636.00	
IRISH GOVT 5.4	300,000.00	416,364.00	
IRISH GOVT 5.9	200,000.00	241,996.00	
NETHERLANDS GOVT 0	300,000.00	302,769.00	
NETHERLANDS GOVT 0.25	400,000.00	409,420.00	
NETHERLANDS GOVT 0.25	300,000.00	297,474.00	
NETHERLANDS GOVT 0.5	200,000.00	200,550.00	
NETHERLANDS GOVT 1.25	300,000.00	308,985.00	
NETHERLANDS GOVT 1.25	300,000.00	313,869.00	
NETHERLANDS GOVT 1.75	500,000.00	561,340.00	
NETHERLANDS GOVT 2	400,000.00	458,892.00	
NETHERLANDS GOVT 2.25	200,000.00	229,186.00	
NETHERLANDS GOVT 2.5	300,000.00	306,564.00	

NETHERLANDS GOVT 2.5	200,000.00	251,470.00	
NETHERLANDS GOVT 2.75	200,000.00	282,986.00	
NETHERLANDS GOVT 3.25	300,000.00	354,690.00	
NETHERLANDS GOVT 3.5	600,000.00	697,860.00	
NETHERLANDS GOVT 3.75	300,000.00	376,350.00	
NETHERLANDS GOVT 3.75	400,000.00	644,460.00	
NETHERLANDS GOVT 4	200,000.00	219,866.00	
NETHERLANDS GOVT 4	200,000.00	228,640.00	
NETHERLANDS GOVT 4	200,000.00	315,070.00	
NETHERLANDS GOVT 4.5	500,000.00	530,535.00	
NETHERLANDS GOVT 5.5	200,000.00	312,500.00	
REP OF AUSTRIA 0.25	200,000.00	204,186.00	
REP OF AUSTRIA 1.15	200,000.00	207,846.00	
REP OF AUSTRIA 1.2	200,000.00	213,986.00	
REP OF AUSTRIA 1.65	200,000.00	223,190.00	
REP OF AUSTRIA 1.75	300,000.00	337,305.00	
REP OF AUSTRIA 1.95	200,000.00	214,626.00	
REP OF AUSTRIA 2.4	300,000.00	364,680.00	
REP OF AUSTRIA 3.15	200,000.00	283,466.00	
REP OF AUSTRIA 3.4	200,000.00	244,964.00	
REP OF AUSTRIA 3.5	200,000.00	239,666.00	
REP OF AUSTRIA 3.65	100,000.00	122,390.00	
REP OF AUSTRIA 3.9	300,000.00	353,475.00	
REP OF AUSTRIA 4.15	400,000.00	618,312.00	
REP OF AUSTRIA 4.3	300,000.00	319,935.00	
REP OF AUSTRIA 4.35	100,000.00	113,727.00	
REP OF AUSTRIA 4.65	200,000.00	217,680.00	
REP OF AUSTRIA 4.85	200,000.00	284,630.00	
REP OF AUSTRIA 6.25	200,000.00	323,390.00	
SPANISH GOV'T 0.25	200,000.00	201,136.00	
SPANISH GOV'T 0.5	300,000.00	302,544.00	
SPANISH GOV'T 1.15	400,000.00	412,112.00	
SPANISH GOV'T 1.4	500,000.00	520,390.00	
SPANISH GOV'T 1.6	300,000.00	303,129.00	
SPANISH GOV'T 1.95	300,000.00	308,619.90	

	SPANISH GOV'T 1.95	200,000.00	197,076.00	
	SPANISH GOV'T 2.1	300,000.00	306,720.00	
	SPANISH GOV'T 2.15	500,000.00	525,890.00	
	SPANISH GOV'T 2.75	300,000.00	323,556.00	
	SPANISH GOV'T 2.75	400,000.00	442,032.00	
	SPANISH GOV'T 3.75	500,000.00	546,840.00	
	SPANISH GOV'T 3.8	600,000.00	711,630.00	
	SPANISH GOV'T 4	400,000.00	457,548.00	
	SPANISH GOV'T 4.1	600,000.00	655,638.00	
	SPANISH GOV'T 4.2	370,000.00	469,308.00	
	SPANISH GOV'T 4.3	700,000.00	799,470.00	
	SPANISH GOV'T 4.4	300,000.00	369,540.00	
	SPANISH GOV'T 4.5	500,000.00	539,915.00	
	SPANISH GOV'T 4.6	400,000.00	457,172.00	
	SPANISH GOV'T 4.65	500,000.00	634,100.00	
	SPANISH GOV'T 4.7	400,000.00	546,192.00	
	SPANISH GOV'T 4.8	500,000.00	631,890.00	
	SPANISH GOV'T 4.85	500,000.00	597,315.00	
	SPANISH GOV'T 4.9	200,000.00	279,140.00	
	SPANISH GOV'T 5.15	400,000.00	541,512.00	
	SPANISH GOV'T 5.15	200,000.00	293,220.00	
	SPANISH GOV'T 5.4	500,000.00	645,150.00	
	SPANISH GOV'T 5.5	700,000.00	749,301.00	
	SPANISH GOV'T 5.5	800,000.00	995,040.00	
	SPANISH GOV'T 5.75	300,000.00	446,139.00	
	SPANISH GOV'T 5.85	300,000.00	386,931.00	
	SPANISH GOV'T 5.9	200,000.00	279,280.00	
	SPANISH GOV'T 6	400,000.00	582,552.00	
	ユーロ 小計	102,380,000.00	122,949,338.20	(15,368,667,275)
英bond	TREASURY 1	700,000.00	705,019.00	
	TREASURY 1.25	600,000.00	609,648.00	
	TREASURY 1.5	300,000.00	307,245.00	
	TREASURY 1.75	700,000.00	723,355.50	
	TREASURY 1.75	600,000.00	621,414.60	

	TREASURY 2	600,000.00	627,930.00	
	TREASURY 2.25	400,000.00	425,028.00	
	TREASURY 2.75	300,000.00	329,670.00	
	TREASURY 3.25	500,000.00	584,697.50	
	TREASURY 3.5	800,000.00	976,944.00	
	TREASURY 3.5	200,000.00	277,627.40	
	TREASURY 3.75	400,000.00	441,796.00	
	TREASURY 3.75	500,000.00	563,215.00	
	TREASURY 3.75	400,000.00	457,524.00	
	TREASURY 3.75	300,000.00	407,913.00	
	TREASURY 4	200,000.00	233,775.00	
	TREASURY 4	400,000.00	597,316.80	
	TREASURY 4.25	300,000.00	377,976.00	
	TREASURY 4.25	400,000.00	516,800.00	
	TREASURY 4.25	500,000.00	655,380.00	
	TREASURY 4.25	600,000.00	800,766.00	
	TREASURY 4.25	300,000.00	405,504.00	
	TREASURY 4.25	400,000.00	562,828.00	
	TREASURY 4.25	300,000.00	432,873.00	
	TREASURY 4.25	400,000.00	610,844.00	
	TREASURY 4.5	300,000.00	333,876.00	
	TREASURY 4.5	400,000.00	535,528.00	
	TREASURY 4.5	500,000.00	706,595.00	
	TREASURY 4.75	300,000.00	345,843.00	
	TREASURY 4.75	200,000.00	269,265.00	
	TREASURY 4.75	300,000.00	427,422.00	
	TREASURY 5	500,000.00	542,960.00	
	TREASURY 5	500,000.00	645,277.50	
	TREASURY 6	200,000.00	295,112.00	
	TREASURY 8	300,000.00	405,243.00	
	UNITED KINGDOM G 2	600,000.00	620,581.80	
	英債券 小計	15,200,000.00	18,380,793.10	(2,955,631,530)
スイスフラン	SWISS (GOVT) 3	200,000.00	224,100.00	
	SWISS (GOVT) 4	100,000.00	131,560.00	
	SWISS (GOVT) 4	100,000.00	149,870.00	

	SWISS (GOVT) 4.25	200,000.00	211,280.00	
スイスフラン 小計		600,000.00	716,810.00	(81,601,650)
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVRNMNT 1	500,000.00	502,890.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 1.5	1,500,000.00	1,611,120.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 2.5	1,500,000.00	1,740,045.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3	1,000,000.00	1,007,600.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	1,500,000.00	1,792,860.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	1,000,000.00	1,290,770.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.75	1,000,000.00	1,056,400.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 4.25	2,000,000.00	2,268,540.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 5	700,000.00	862,330.00	
スウェーデンクローナ 小計		10,700,000.00	12,132,555.00	(165,366,724)
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOV'T 2	3,000,000.00	3,190,200.00	
	NORWEGIAN GOV'T 3	2,000,000.00	2,276,200.00	
	NORWEGIAN GOV'T 3.75	1,000,000.00	1,143,850.00	
	NORWEGIAN GOV'T 4.25	1,000,000.00	1,039,180.00	
	NORWEGIAN GOV'T 4.5	1,000,000.00	1,119,200.00	
ノルウェークローネ 小計		8,000,000.00	8,768,630.00	(118,551,877)
デンマーククローネ	DENMARK - BULLET 1.75	3,000,000.00	3,352,170.00	
	DENMARK - BULLET 3	1,500,000.00	1,756,095.00	
	DENMARK - BULLET 4	1,500,000.00	1,602,900.00	
	DENMARK - BULLET 4	2,000,000.00	2,308,580.00	
	DENMARK - BULLET 4.5	2,400,000.00	4,109,760.00	
	DENMARK - BULLET 7	820,000.00	1,292,648.00	
デンマーククローネ 小計		11,220,000.00	14,422,153.00	(242,292,170)
ポーランドズロチ	POLAND GOVT BOND 2.5	1,700,000.00	1,731,450.00	
	POLAND GOVT BOND 2.5	400,000.00	379,600.00	
	POLAND GOVT BOND 3.25	600,000.00	614,358.00	
	POLAND GOVT BOND 4	600,000.00	648,000.00	
	POLAND GOVT BOND 4.75	300,000.00	304,650.00	
	POLAND GOVT BOND 5.25	200,000.00	211,200.00	

	POLAND GOVT BOND 5.5	1,400,000.00	1,573,600.00	
	POLAND GOVT BOND 5.75	600,000.00	700,800.00	
	POLAND GOVT BOND 5.75	1,100,000.00	1,308,483.00	
	POLAND GOVT BOND 5.75	300,000.00	375,999.00	
	ポーランドズロチ 小計	7,200,000.00	7,848,140.00	(222,573,250)
オーストラリアドル	AUSTRALIAN GOVT. 1.75	300,000.00	294,150.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	300,000.00	306,750.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	500,000.00	507,933.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	300,000.00	308,295.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	700,000.00	736,470.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	200,000.00	207,920.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	200,000.00	196,060.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.75	200,000.00	215,440.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25	300,000.00	307,830.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25	500,000.00	569,750.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	400,000.00	436,598.40	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	300,000.00	357,960.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.75	600,000.00	716,700.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.25	400,000.00	435,828.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	400,000.00	423,120.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	400,000.00	477,520.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	500,000.00	583,775.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	500,000.00	596,500.00	
	オーストラリアドル 小計	7,000,000.00	7,678,599.40	(657,288,108)
シンガポールドル	SINGAPORE GOV'T 2	200,000.00	204,804.80	
	SINGAPORE GOV'T 2.25	300,000.00	308,544.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.5	200,000.00	207,840.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	300,000.00	315,600.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.875	200,000.00	212,370.00	
	SINGAPORE GOV'T 3	500,000.00	538,500.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.125	700,000.00	753,900.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.25	200,000.00	215,100.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.5	600,000.00	678,900.00	
	SINGAPORE GOV'T 4	300,000.00	320,550.00	

シンガポールドル 小計		3,500,000.00	3,756,108.80 (308,301,410)
南アフリカランド	REP SOUTH AFRICA 6.5	7,000,000.00	4,687,200.00
	REP SOUTH AFRICA 7	16,000,000.00	12,675,200.00
	REP SOUTH AFRICA 8	5,000,000.00	4,951,500.00
南アフリカランド 小計		28,000,000.00	22,313,900.00 (171,593,891)
合計			37,470,353,819 (37,470,353,819)

(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 190銘柄	40.5%	42.7%
カナダドル	国債証券 25銘柄	2.0%	2.1%
メキシコペソ	国債証券 11銘柄	1.0%	1.0%
ユーロ	国債証券 257銘柄	38.8%	41.0%
英ポンド	国債証券 36銘柄	7.5%	7.9%
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 9銘柄	0.4%	0.4%
ノルウェークローネ	国債証券 5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 10銘柄	0.6%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 18銘柄	1.7%	1.8%
シンガポールドル	国債証券 10銘柄	0.8%	0.8%
南アフリカランド	国債証券 3銘柄	0.4%	0.5%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

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	2015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	500,693

（1口当たり情報）

（2015年10月31日現在）	
1口当たり純資産額	
（一般投資家クラス） 75.81米ドル	

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

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

SPDR バークレイズ・ハイ・イールド債券ETF

（純資産計算書）

区分	2015年6月30日現在
	金額（千米ドル）
債券	9,567,578
短期金融資産	557,342
投資総額	10,124,921
その他資産及び負債	327,795
純資産額	9,797,125

（1口当たり情報）

（2015年6月30日現在）	
1口当たり純資産額	
（一般投資家クラス） 38.34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）

平成28年 5月31日現在

資産総額	15,620,902,027円
負債総額	95,756,175円
純資産総額（ - ）	15,525,145,852円
発行済口数	16,180,856,523口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9595円
（1万口当たり純資産額）	（9,595円）

アセットアロケーション・ファンド（安定成長型）

平成28年 5月31日現在

資産総額	13,929,810,489円
負債総額	136,178,313円
純資産総額（ - ）	13,793,632,176円
発行済口数	14,738,627,811口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9359円
（1万口当たり純資産額）	（9,359円）

アセットアロケーション・ファンド（成長型）

平成28年 5月31日現在

資産総額	14,196,006,392円
負債総額	183,901,972円
純資産総額（ - ）	14,012,104,420円
発行済口数	15,209,610,914口
1口当たり純資産額（ / ）	0.9213円
（1万口当たり純資産額）	（9,213円）

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

- イ 名義書換
該当事項はありません。
- ロ 受益者名簿
作成しません。
- ハ 受益者に対する特典
ありません。
- ニ 受益権の譲渡および譲渡制限等
- (イ) 受益権の譲渡
- a . 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。
- b . 上記 a の申請のある場合には、上記 a の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記 a の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定に従い、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。
- c . 上記 a の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。
- (ロ) 受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件
譲渡制限はありません。ただし、受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。
- ホ 受益権の再分割
委託会社は、受託会社と協議の上、社振法に定めるところに従い、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。
- ヘ 償還金
償還金は、原則として、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者に支払います。
- ト 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて
振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等に従って取り扱われます。

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

イ 資本金の額および株式数

	平成28年 5月31日現在
資本金の額	2,000百万円
会社が発行する株式の総数	60,000株
発行済株式総数	17,640株

ロ 最近5年間における資本金の額の増減 該当ありません。

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。

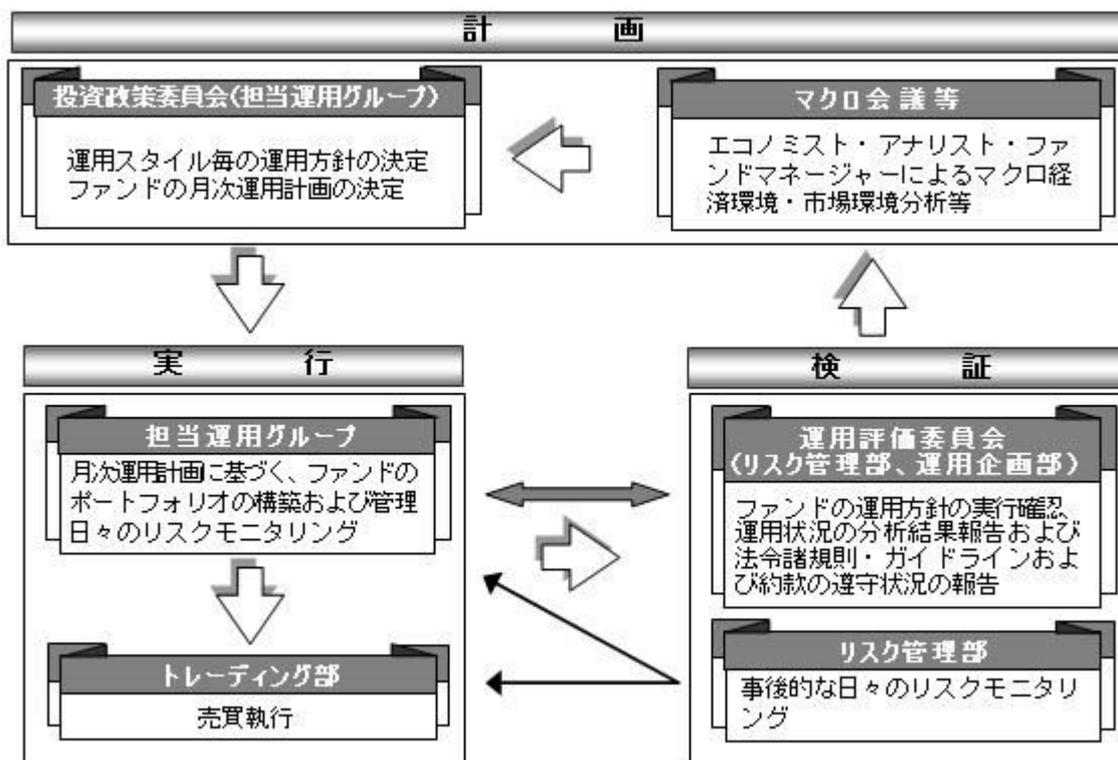
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

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、代表取締役を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、必要に応じて取締役会長1名のほか、取締役副社長、専務取締役、常務取締役を若干名選定することができます。

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その運用（投資運用業）を行っています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行っています。

平成28年5月31日現在、委託会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

（平成28年 5月31日現在）

		本 数(本)	純資産総額(百万円)
株式投資信託	単位型	56 (15)	150,916 (57,282)
	追加型	468 (193)	5,020,484 (2,796,120)
	計	524 (208)	5,171,401 (2,853,402)
公社債投資信託	単位型	64 (64)	332,648 (332,648)
	追加型	1 (0)	27,092 (0)
	計	65 (64)	359,741 (332,648)
合 計		589 (272)	5,531,141 (3,186,050)

()内は、私募投資信託分であり、内書き表記しております。

3【委託会社等の経理状況】

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

2 当社は、当事業年度（平成27年4月1日から平成28年3月31日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

		前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
資産の部			
流動資産			
現金及び預金	2	25,021,336	10,857,507
顧客分別金信託		-	20,006
前払費用		291,119	324,934
未収入金		41,860	81,347
未収委託者報酬		4,897,032	5,418,116
未収運用受託報酬		1,000,744	1,635,461
未収投資助言報酬		455,390	382,911
未収収益		13,030	28,813

繰延税金資産		475,859	494,032
その他の流動資産		52,473	6,226
流動資産合計		32,248,847	19,249,357
固定資産			
有形固定資産	1		
建物		120,234	154,246
器具備品		230,712	240,748
有形固定資産合計		350,947	394,995
無形固定資産			
ソフトウェア		497,668	449,034
ソフトウェア仮勘定		77,155	146,452
電話加入権		91	79
商標権		222	60
無形固定資産合計		575,137	595,627
投資その他の資産			
投資有価証券		7,151,933	13,115,106
関係会社株式		509,146	10,412,523
長期差入保証金		600,480	603,625
長期前払費用		36,031	32,533
会員権		17,299	17,299
繰延税金資産		665,425	750,481
投資その他の資産合計		8,980,317	24,931,569
固定資産合計		9,906,402	25,922,192
資産合計		42,155,249	45,171,549

(単位：千円)

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
負債の部		
流動負債		
顧客からの預り金	-	0
その他の預り金	82,723	73,103
未払金		
未払収益分配金	711	154
未払償還金	143,201	141,808
未払手数料	2,338,432	2,479,778
その他未払金	1,075,587	58,453
未払費用	2,095,111	2,092,669
未払消費税等	478,421	317,444
未払法人税等	454,520	992,491
賞与引当金	906,623	982,654
その他の流動負債	808	-
流動負債合計	7,576,142	7,138,557
固定負債		
退職給付引当金	2,633,080	3,028,212
賞与引当金	-	51,310
その他の固定負債	-	693
固定負債合計	2,633,080	3,080,216
負債合計	10,209,222	10,218,774

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	18,861,359	21,984,811
利益剰余金合計	20,682,564	23,806,015
株主資本計	31,311,548	34,434,999
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	634,478	517,775
評価・換算差額等合計	634,478	517,775
純資産合計	31,946,027	34,952,774
負債・純資産合計	42,155,249	45,171,549

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	30,094,858	32,339,255
運用受託報酬	3,862,895	7,401,835
投資助言報酬	2,106,161	1,909,892
その他営業収益		
情報提供コンサルタント		
業務報酬	5,000	5,000
投資法人運用受託報酬	27,345	8,546
サービス支援手数料	18,274	74,038
その他	52,255	55,319
営業収益計	36,166,790	41,793,887
営業費用		
支払手数料	15,123,724	16,006,652
広告宣伝費	407,991	615,596
公告費	4,737	4,507
調査費		
調査費	1,319,743	1,624,477
委託調査費	3,550,675	4,106,366
営業雑経費		
通信費	38,911	43,662
印刷費	294,002	399,236
協会費	26,955	23,328
諸会費	18,577	22,650
情報機器関連費	2,403,857	2,557,200
販売促進費	28,281	31,271
その他	144,250	161,974
営業費用合計	23,361,707	25,596,925

一般管理費			
給料			
役員報酬		190,241	181,739
給料・手当		5,186,853	5,824,767
賞与		569,685	609,597
賞与引当金繰入額		906,623	1,033,964
交際費		22,609	26,912
寄付金		-	23
事務委託費		366,661	540,251
旅費交通費		226,254	277,212
租税公課		108,953	161,628
不動産賃借料		552,589	595,051
退職給付費用		387,799	701,070
固定資産減価償却費		287,833	334,024
諸経費		283,156	354,884
一般管理費合計		9,089,262	10,641,129
営業利益		3,715,820	5,555,832
営業外収益			
受取配当金		26,821	36,102
有価証券利息		1,187	-
受取利息	1	6,113	3,728
時効成立分配金・償還金		12	1,394
原稿・講演料		1,899	1,766
雑収入		7,324	19,472
営業外収益合計		43,357	62,465
営業外費用			
為替差損		14,361	51,385
営業外費用合計		14,361	51,385
経常利益		3,744,816	5,566,912
特別利益			
投資有価証券償還益		4,181	13,036
投資有価証券売却益		893,251	38,823
投資有価証券清算益		-	29,214
特別利益合計		897,432	81,075
特別損失			
固定資産除却損	2	1,076	5,300
投資有価証券償還損		-	2,313
投資有価証券売却損		1,091	8,184
その他の特別損失	3	973,862	-
特別損失合計		976,030	15,798
税引前当期純利益		3,666,218	5,632,188
法人税、住民税及び事業税		1,574,213	1,598,176
法人税等調整額		166,505	41,999
法人税等合計		1,740,718	1,556,177
当期純利益		1,925,499	4,076,011

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27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	19,227,103	21,048,308	31,677,292
会計方針の変更による 累積的影響額							439,043	439,043	439,043
会計方針の変更を反映した 当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	18,788,060	20,609,264	31,238,248
当期変動額									
剰余金の配当							1,852,200	1,852,200	1,852,200
当期純利益							1,925,499	1,925,499	1,925,499
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	73,299	73,299	73,299
当期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	18,861,359	20,682,564	31,311,548

	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	657,238	657,238	32,334,530
会計方針の変更による 累積的影響額			439,043
会計方針の変更を反映した 当期首残高	657,238	657,238	31,895,486
当期変動額			
剰余金の配当			1,852,200
当期純利益			1,925,499
株主資本以外の項目 の当期変動額（純 額）	22,759	22,759	22,759
当期変動額合計	22,759	22,759	50,540
当期末残高	634,478	634,478	31,946,027

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

（単位：千円）

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

	評価・換算差額等

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

[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)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27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
建物	258,412千円	281,421千円
器具備品	783,602千円	758,541千円

2 関係会社に対する資産及び負債

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
現金及び預金	18,853,119千円	4,716,352千円

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

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
当座借越極度額の総額	10,000,000千円	10,000,000千円
借入実行残高	- 千円	- 千円
差引額	10,000,000千円	10,000,000千円

4 保証債務

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

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
Sumitomo Mitsui Asset Management (New York) Inc.	355,376千円	296,815千円

(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26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
受取利息	2,463千円	1,423千円

2 固定資産除却損

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
器具備品	1,076千円	5,300千円

3 その他の特別損失

その他の特別損失は、中国において同国国家税務総局が平成26年11月17日付で公布した財税[2014]79号通達に基づき、当社が委託者として運用する証券投資信託に関し、適格国外機関投資家として

課される平成21年11月17日から平成26年11月16日までに行われた中国A株投資のキャピタル・ゲインに対して遡及的に徴される源泉所得税等について納付すべきと見込まれる金額を計上したものであります。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(自 平成26年4月1日 至 平成27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26年6月26日 定時株主総会	普通株式	1,852,200	105,000	平成26年 3月31日	平成26年 6月27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27年6月30日開催の第30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27年6月30日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	952,560	54,000	平成27年 3月31日	平成27年 7月1日

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1. 発行済株式数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額等

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

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

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

(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27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
1年以内	572,402	579,592
1年超	1,340,637	756,470
合計	1,913,040	1,336,063

(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%出資した海外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27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	25,021,336	25,021,336	-
(2) 顧客分別金信託	-	-	-

(3)未収委託者報酬	4,897,032	4,897,032	-
(4)未収運用受託報酬	1,000,744	1,000,744	-
(5)未収投資助言報酬	455,390	455,390	-
(6)投資有価証券			
その他有価証券	7,131,075	7,131,075	-
(7)長期差入保証金	600,480	600,480	-
資産計	39,106,059	39,106,059	-
(1)顧客からの預り金	-	-	-
(2)未払手数料	2,338,432	2,338,432	-
負債計	2,338,432	2,338,432	-

当事業年度(平成28年3月31日)

(単位:千円)

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

(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27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
その他有価証券		
非上場株式	298	298
投資証券	20,560	-

合計	20,858	298
子会社株式及び関連会社株式 非上場株式	509,146	10,412,523
合計	509,146	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27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	25,021,336	-	-	-
顧客分別金信託	-	-	-	-
未収委託者報酬	4,897,032	-	-	-
未収運用受託報酬	1,000,744	-	-	-
未収投資助言報酬	455,390	-	-	-
長期差入保証金	4,148	596,332	-	-
合計	31,378,651	596,332	-	-

当事業年度(平成28年3月31日)

(単位:千円)

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

(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27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509,146千円)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28年3月31日)

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

2. その他有価証券

前事業年度(平成27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	5,826,531	4,894,554	931,977
小計	5,826,531	4,894,554	931,977
(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	1,304,543	1,312,300	7,756
小計	1,304,543	1,312,300	7,756

合計	7,131,075	6,206,854	924,220
----	-----------	-----------	---------

(注)非上場株式等(貸借対照表計上額 20,858千円)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28年3月31日)

(単位:千円)

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

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

3. 当事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自平成26年4月1日至平成27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
3,892,685	893,251	1,091

当事業年度(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)

(単位:千円)

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

(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26年4月1日 至平成27年3月31日)	当事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
退職給付債務の期首残高	1,802,340	2,633,080
会計方針の変更による累積的影響額	682,168	-
会計方針の変更を反映した期首残高	2,484,508	2,633,080
勤務費用	217,881	225,881
利息費用	18,161	19,247
数理計算上の差異の発生額	276	285,510
退職給付の支払額	87,196	135,507
退職給付債務の期末残高	2,633,080	3,028,212

(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27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
--	-----------------------	-----------------------

非積立型制度の退職給付債務	2,633,080	3,028,212
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	2,633,080	3,028,212

(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26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)	当事業年度 (自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)
勤務費用	217,881	225,881
利息費用	18,161	19,247
数理計算上の差異の費用処理額	276	285,510
その他	152,031	170,430
確定給付制度に係る退職給付費用	387,799	701,070

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

(4)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎(加重平均で表わしております。)

	前事業年度 (自 平成26年 4月 1日 至 平成27年 3月31日)	当事業年度 (自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)
割引率	0.731%	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105,357千円、当事業年度125,210千円であります。

(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27年 3月31日)	当事業年度 (平成28年 3月31日)
流動の部		
繰延税金資産		
賞与引当金	299,729	303,247
調査費	77,863	74,734
未払金	321,602	44,028
未払事業税	49,504	67,598
その他	48,762	7,369
繰延税金資産小計	797,462	496,977
評価性引当額	321,602	2,945
繰延税金資産合計	475,859	494,032
固定の部		
繰延税金資産		
退職給付引当金	849,431	927,238
特定外国子会社留保金額	211,024	205,413
ソフトウェア償却	62,560	35,707
賞与引当金	-	15,834
投資有価証券評価損	43,051	95
その他	6,291	5,971
繰延税金資産小計	1,172,360	1,190,261

評価性引当額	217,192	211,267
繰延税金資産合計	955,168	978,994
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	289,742	228,513
繰延税金負債合計	289,742	228,513
繰延税金資産の純額	1,141,285	1,244,513

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27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
法定実効税率	35.6%	33.0%
(調整)		
評価性引当額の増減	9.6	5.5
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.2	0.1
受取配当等永久に益金に算入されない項目	0.5	0.0
住民税均等割等	0.2	0.1
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	3.7	1.3
所得税額控除による税額控除	1.3	1.5
その他	0.1	0.0
税効果会計適用後の法人税等の負担率	47.5	27.6

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」(平成28年法律第15号)及び「地方税法等の一部を改正する等の法律」(平成28年法律第13号)が平成28年3月29日に成立し、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産および繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の32.2%から平成28年4月1日に開始する事業年度及び平成29年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については30.8%、平成30年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については、30.6%となります。

この税率変更により、繰延税金資産の金額(繰延税金負債の金額を控除した金額)は62,206千円減少し、法人税等調整額が74,445千円、その他有価証券評価差額金が12,239千円、それぞれ増加しております。

(セグメント情報等)

前事業年度(自平成26年4月1日 至平成27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
外部顧客への売上高	30,094,858	3,862,895	2,106,161	102,874	36,166,790

(2) 地域ごとの情報

売上高

本邦の外部顧客への売上高に区分した金額が損益計算書の売上高の90%を超えるため、地域ごとの売上高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

外部顧客への売上高のうち、損益計算書の売上高の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27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1. セグメント情報

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

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

2. 関連情報**(1)製品及びサービスごとの情報**

(単位：千円)

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

(2)地域ごとの情報**売上高**

本邦の外部顧客への売上高に区分した金額が損益計算書の売上高の90%を超えるため、地域ごとの売上高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

外部顧客への売上高のうち、損益計算書の売上高の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26年4月1日 至 平成27年3月31日)

1. 親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の関係会社	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	(被所有) 直接 40 %	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	2,527,962	未払手数料	289,954

(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

(1)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. 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	ソーラーエナジー投資合同会社	東京都港区	20,000	投資運用業	(所有) 直接100 %	投資事業有限責任組合の運営及び管理	出資の引受	20,000	-	-
関連会社	UOB-SM Asset Management Pte. Ltd.	Singapore	6,000,000 (シンガポールドル)	投資運用業	(所有) 直接50 %	投信の販売委託 役員の兼任	増資の引受	136,110	-	-

(注) 1. ソーラーエナジー投資合同会社の出資の引受は、新規法人設立のため行ったものであります。

2. UOB-SM Asset Management Pte. Ltd.の増資の引受については、当社とUOBアセットマネジメント社がそれぞれ1,500,000(シンガポールドル)出資しました。

3. その他の関係会社の子会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の関係会社の子会社	SMB C 日興証券(株)	東京都千代田区	10,000,000	証券業	- %	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	4,705,879	未払手数料	697,658

(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

(1)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。

当事業年度(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

1. 親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の関係会社	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	(被所有) 直接 40 %	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	2,740,552	未払手数料	471,118

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(1)投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2. 兄弟会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の関係会社の子会社	S M B C 日興証券(株)	東京都千代田区	10,000,000	証券業	-	投信の販売委託 役員の兼任	子会社株式の取得	9,877,717	-	-
							委託販売手数料	5,483,224	未払手数料	912,899

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(1) 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。

(1株当たり情報)

	前事業年度 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
1株当たり純資産額	1,810,999.27円	1,981,449.82円
1株当たり当期純利益金額	109,155.30円	231,066.40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26年4月1日 至 平成27年3月31日)	当事業年度 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
1株当たり当期純利益金額		
当期純利益(千円)	1,925,499	4,076,011
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)	1,925,499	4,076,011
期中平均株式数(株)	17,640	17,640

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

ハ 通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)または子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。

ニ 委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方

針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

- ホ 上記八、二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
該当ありません。
- ロ 訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実
該当ありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

イ 受託会社

- (イ) 名称 三井住友信託銀行株式会社
- (ロ) 資本金の額 342,037百万円(平成28年3月末現在)
- (ハ) 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

[参考情報：再信託受託会社の概要]

- ・ 名称 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社
- ・ 資本金の額 51,000百万円(平成28年3月末現在)
- ・ 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

ロ 販売会社

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	47,937百万円	
カブドットコム証券株式会社	7,196百万円	
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、平成28年3月末現在。

2【関係業務の概要】

イ 受託会社

信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

ロ 販売会社

委託会社との間で締結された販売契約に基づき、日本における当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書(目論見書)の提供、一部解約の実行の請求の受付、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【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
平成28年 1月15日	有価証券届出書の訂正届出書
平成28年 1月15日	半期報告書
平成28年 4月 8日	有価証券届出書の訂正届出書

独立監査人の監査報告書

平成28年 6月17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27年4月1日から平成28年3月31日までの第31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28年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

平成28年6月7日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 小澤 陽一 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているアセットアロケーション・ファンド（安定型）の平成27年4月17日から平成28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28年4月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

独立監査人の監査報告書

平成28年6月7日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士 小澤 陽一 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているアセットアロケーション・ファンド（安定成長型）の平成27年4月17日から平成28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28年4月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

平成28年6月7日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

小澤 陽 一 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているアセットアロケーション・ファンド（成長型）の平成27年4月17日から平成28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28年4月26日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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