

## 【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成25年3月14日

【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 前田 良治

【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】 三島 克哉

【電話番号】 03-5405-0228

【届出の対象とした募集内国投資信託受 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010  
益証券に係るファンドの名称】 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020  
三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030  
三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040

【届出の対象とした募集内国投資信託受 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010  
益証券の金額】 : 3,000億円を上限とします。  
三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020  
: 3,000億円を上限とします。  
三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030  
: 3,000億円を上限とします。  
三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040  
: 3,000億円を上限とします。  
合計1兆2,000億円を上限とします。

【縦覧に供する場所】 該当ありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010

三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020

三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030

三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040

以下上記ファンドを総称して、「当ファンド」ということがあり、また、それぞれを各ファンドということがあります。また、各ファンドをそれぞれ<2010>、<2020>、<2030>、<2040>と略称することがあります。

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

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

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

### （３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンドにつき3,000億円を上限とします（合計で1兆2,000億円を上限とします。）。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

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

基準価額は、組入有価証券の値動き等により日々変動します。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、それぞれ「TY2010」、

「TY2020」、「TY2030」、「TY2040」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

### （５）【申込手数料】

無手数料です。

### （６）【申込単位】

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

(7)【申込期間】

平成25年3月15日から平成26年3月19日まで

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

(8)【申込取扱場所】

販売会社において申込みを取り扱います。

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

(9)【払込期日】

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

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

(10)【払込取扱場所】

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

(11)【振替機関に関する事項】

当ファンドの振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12)【その他】

イ 申込証拠金

ありません。

ロ わが国以外の地域における募集

ありません。

ハ クーリング・オフ制度(金融商品取引法第37条の6)の適用

ありません。

ニ 振替受益権について

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

(参考：投資信託振替制度)

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

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

- イ 当ファンドは、他の投資信託への投資を通じて、実質的に日本を含む世界各国の株式および公社債に投資し、信託財産の成長を目指して運用を行います。
- ロ 各ファンドにつき定めるターゲット・イヤー 到達後は、流動性を重視した安定的な運用を行います。
- 各ファンドのターゲット・イヤーは次の通りです。
- < 2 0 1 0 >・・・西暦2010年、< 2 0 2 0 >・・・西暦2020年  
< 2 0 3 0 >・・・西暦2030年、< 2 0 4 0 >・・・西暦2040年
- ハ 委託会社は、受託会社と合意の上、各ファンドとも金3,000億円を限度として信託金を追加することができます。この限度額は、委託会社、受託会社の合意により変更できます。
- ニ 当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

##### (イ) 当ファンドが該当する商品分類

項目	該当する商品分類	内容
単位型・追加型	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	内外	目論見書または信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産 (収益の源泉)	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）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および債券であり、ファンドの収益は株式市場、債券市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「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	為替ヘッジなし	目論見書または信託約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。

## 《商品分類表》

単位型・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
		債 券
	海 外	不 動 産 投 信
<b>追 加 型</b>		そ の 他 資 産
	<b>内 外</b>	( )
		<b>資 産 複 合</b>

(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	<b>年 1 回</b>	<b>グ ロー バ ル</b>		
一 般		(日本を含む)		
大 型 株	年 2 回	日 本		
中 小 型 株	年 4 回	北 米	ファミリーファンド	あ り
債 券	年6回(隔月)	欧 州		
一 般	年12回(毎月)	ア ジ ア		
公 債	日 々	オ セ ア ニ ア		
社 債	そ の 他	中 南 米	<b>ファンドオブファンズ</b>	<b>な し</b>
その他債券	( )	ア フ リ カ		
クレジット属性		中 近 東 (中 東)		
( )		エ マ ー ジ ン グ		
不動産投信				
<b>その他資産</b>				
(投資信託証券(資産複合(株式、債券 資産配分変異型))				
資産複合				
( )				
資産配分固定型				
資産配分変異型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

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13年3月13日

信託契約締結、設定、運用開始。

(設定時の委託会社はさくら投信投資顧問株式会社)

平成14年12月1日 三井住友アセットマネジメント株式会社が、合併によりファンドの委託会社としての業務を承継。「DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010」、「DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2020」、「DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2030」、「DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2040」から「三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010」、「三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2020」、「三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2030」、「三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2040」に名称を変更。

### (3) 【ファンドの仕組み】

#### イ 当ファンドの関係法人とその役割

##### (イ) 委託会社 「三井住友アセットマネジメント株式会社」

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

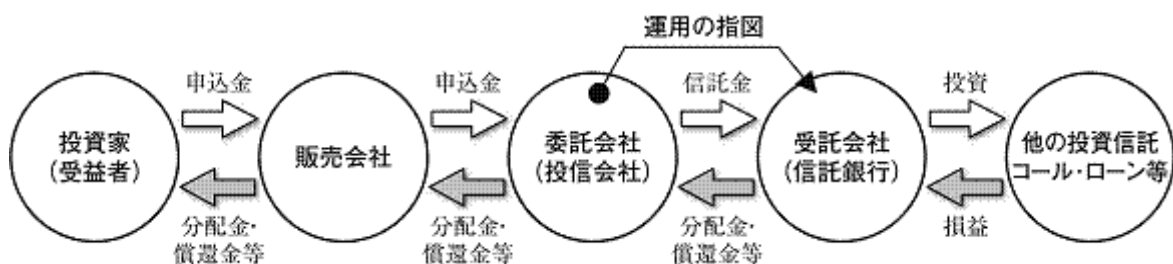
##### (ロ) 受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

証券投資信託契約に基づき、信託財産の保管・管理・計算等を行います。なお、信託事務の一部につき、日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することがあります。また、外国における資産の保管は、その業務を行うに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。

#### 運営の仕組み



#### ロ 委託会社の概況

##### (イ) 資本金の額

2,000百万円(平成25年1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

#### (八) 大株主の状況

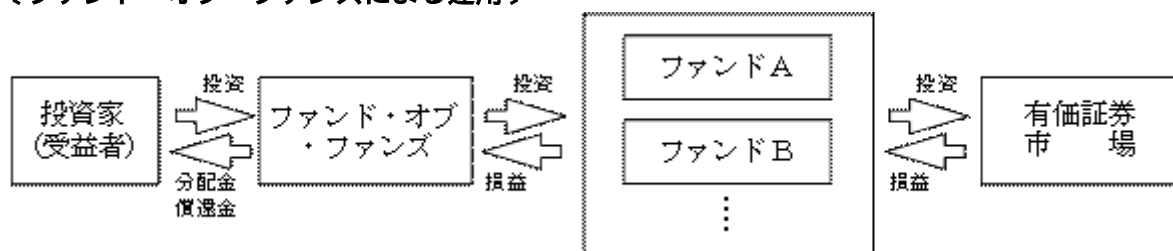
(平成25年1月31日現在)

名称	住所	所有 株式数	比率 (%)
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	7,056	40.0
三井住友海上火災保険株式会社	東京都中央区新川二丁目27番2号	4,851	27.5
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	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

#### 八 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

各ファンドのターゲット・イヤーに向けた信託財産の成長を目指して運用を行います。  
ターゲット・イヤー到達後は、流動性を重視した安定的な運用を行います。

#### ロ 投資態度

- (イ) 投資信託への投資を通じて、国内株式・国内債券・外国株式・外国債券への分散投資を行います（グローバル・バランス型ファンド）。
- (ロ) 投資資産配分（基本アロケーション）は、国内外の経済・金融市場動向見通し等の分析を基に、各資産クラスの期待収益率等を予測した結果、ターゲット・イヤーに向けた信託財産の成長に最適と考えられる比率とし、原則として1年（計算期間）毎に見直します。各ファンドのターゲット・イヤーに近づくにつれ、安定資産等の比率を引き上げていきます。概ね、ターゲット・イヤーまでの期間が長いほど、リターン（収益）の高い運用を目指しますが、それに伴いリスク（損益の変動幅）が大きくなる傾向があります。ターゲット・イヤー到達後の安定運用期間においても国内債券および短期金融資産の他、国内外の株式および外国債券への配分が予定されています。
- (ハ) 期中の基本アロケーションとの乖離については、原則として四半期毎に見直し、必要に応じてリバランスを実施します。
- (ニ) 主要投資対象とする投資信託は、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。

a．S M A M・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友アセットマネジメント株式会社
主要運用対象	国内株式
運用の基本方針	T O P I X（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。

b．S M A M・年金国内債券パッシブファンド＜適格機関投資家限定＞

運用会社	三井住友アセットマネジメント株式会社
主要運用対象	国内債券
運用の基本方針	N O M U R A - B P I（総合）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

c．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）

運用会社	三井住友アセットマネジメント株式会社
主要運用対象	外国株式
運用の基本方針	M S C I - K O K U S A I インデックス（円ベース）と連動する投資成果を目指して運用を行います。

d．S M A M・年金外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞

運用会社	三井住友アセットマネジメント株式会社
主要運用対象	外国債券
運用の基本方針	シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）と連動する投資成果を目指した運用を行います。

e．S M A M・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞

運用会社	三井住友アセットマネジメント株式会社
主要運用対象	円貨建の短期公社債および短期金融商品
運用の基本方針	安定した収益の確保を目指します。

上記ファンドの詳細に関しましては、後述の〔参考情報：投資対象とする投資信託の概要〕をご覧ください。



## ★ファンドの特色

- 1 他投資信託への投資を通じて、国内株式・国内債券・外国株式・外国債券への分散投資を行います（グローバル・バランス型ファンド）。
- 2 各ファンドのターゲット・イヤーに向けた信託財産の成長を目指して運用を行います。ターゲット・イヤー到達後は、流動性を重視した安定的な運用を行います。

※各ファンドのターゲット・イヤーは次の通りです。

<2010> ……西暦2010年、 <2020> ……西暦2020年

<2030> ……西暦2030年、 <2040> ……西暦2040年

投資資産配分（基本アロケーション）は、国内外の経済・金融市場動向見通し等の分析を基に、各資産クラスの期待収益率等を予測した結果、ターゲット・イヤーに向けた信託財産の成長に最適と考えられる比率とし、原則として1年（計算期間）毎に見直します。

※各ファンドのターゲット・イヤーに近づくと、安定資産等の比率を引き上げていきます。概ね、ターゲット・イヤーまでの期間が長いほど、リターン（収益）の高い運用を目指しますが、それに伴いリスク（損益の変動幅）が大きくなる傾向があります。

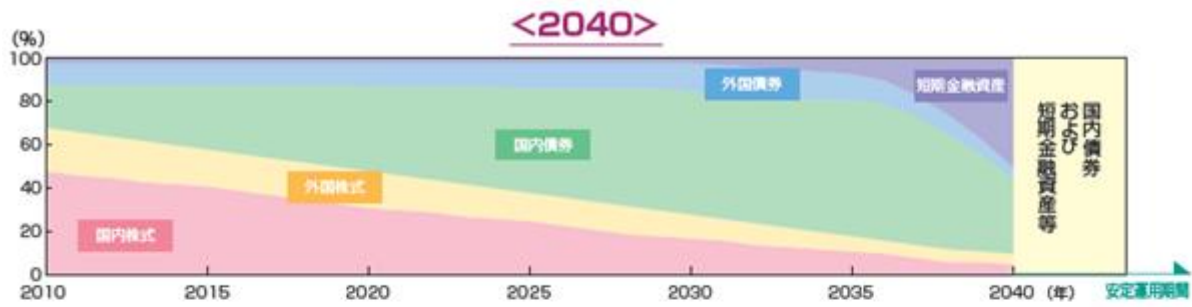
※ターゲット・イヤー到達後の安定運用期間においても国内債券および短期金融資産の他、国内外の株式および外国債券への配分が予定されています。

### 基本的な投資資産配分（基本アロケーション）

2013年1月末現在、各ファンドの基本アロケーションは以下の通りです。

	<2040>	<2030>	<2020>	<2010> 安定運用期間
国内株式	45%	29%	14%	5%
外国株式	19%	15%	10%	5%
国内債券	24%	43%	58%	35%
外国債券	10%	11%	14%	5%
短期金融資産	2%	2%	4%	50%

## 基本資産配分のイメージ図



長い ← ターゲット・イヤーまでの残存期間 → 短い

※上記の図は、各決算時点での基本資産配分を表しています。また、現時点で予定している基本資産配分をもとに作成したイメージ図であり、将来、実際に上記の通りの運用を行うことを保証するものではありません。

**<2010>**

## 安定運用期間

(国内債券および短期金融資産等による運用)  
※ターゲット・イヤー到達(2010年12月決算時)

### 3 ファンド・オブ・ファンズという形態で運用されます。

「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）。

種々の特徴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。

#### ファンドのしくみ



#### 投資対象とする投資信託のベンチマーク

	投資対象とする投資信託	ベンチマーク	委託会社
国内株式	SMAM・国内株式バッシブ・ファンド (適格機関投資家専用)	TOPIX (東証株価指数、配当込み)	三井住友アセットマネジメント株式会社
外国株式	SMAM・外国株式バッシブ・ファンド (適格機関投資家専用)	MSCI-KOKUSAI インデックス (円ベース)	
国内債券	SMAM・年金国内債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	NOMURA-BPI (総合)	
外国債券	SMAM・年金外国債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	シティグループ世界国債インデックス (除く日本、円ベース)	
短期金融資産	SMAM・マネー・インカムファンド<適格機関投資家限定>	-	

※投資対象とする投資信託は、運用状況等により、変更される場合があります。

※資金動向、市況動向等によっては上記の運用ができないことがあります。



## 投資対象とする投資信託の運用プロセス

**SMAM・国内株式バッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）**

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

**SMAM・年金国内債券バッシブファンド<適格機関投資家限定>**

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

**SMAM・外国株式バッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）**

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

**SMAM・年金外国債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>**

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

**SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>**

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

※実際の運用は、各投資信託がそれぞれ投資対象とするマザーファンドで行います。

- ・ TOPIX（東証株価指数、配当込み）、NOMURA－BPI（総合）、MSCI－KOKUSAIインデックス、シティグループ世界国債インデックスは、それぞれ東京証券取引所、野村證券株式会社、MSCIインク、シティグループ・グローバル・マーケット・インクが公表している指数で各社の知的財産です。
- ・ 指数を公表する各社は当ファンドの運用と何ら関係ありません。

**（２）【投資対象】****イ 投資対象とする資産の種類**

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）とします。

- 1．有価証券
- 2．金銭債権
- 3．約束手形

**ロ 投資対象とする有価証券**

委託会社は、信託金を、主として別に定める証券投資信託の受益証券ならびに次の有価証券（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。

#### ハ 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ファンドの名称、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。

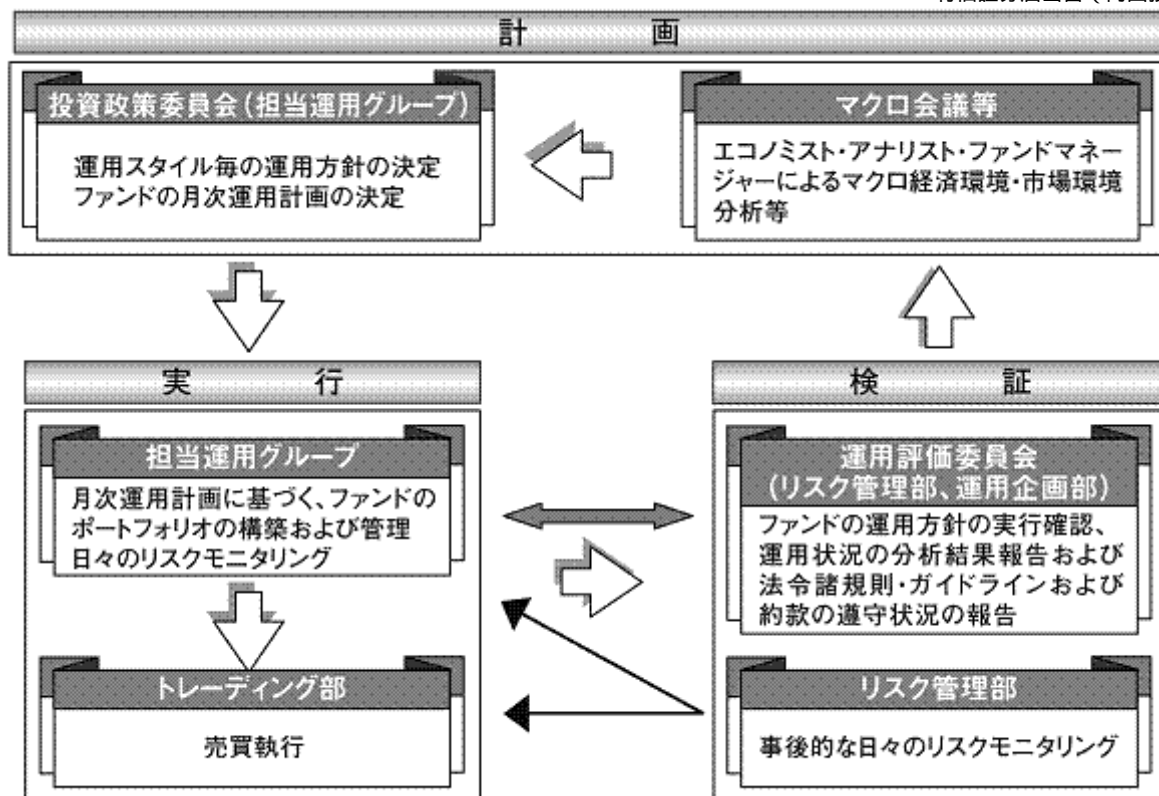
売買執行については、組織的に分離されたトレーディング部が、最良と思われる手法をもって売買を執行します。

##### （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8名程度、運用企画部は8名程度で構成されています。

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

□ 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

ファンドの受託会社に対しては、信託財産の日常の管理業務（保管・管理・計算等）を通じて、信託事務の正確性・迅速性の確認を行い、問題がある場合は適宜改善を求めています。

（４）【分配方針】

毎年1回（原則として12月20日、休業日の場合は翌営業日となります。）決算を行い、原則として次の通り収益分配を行う方針とします。

- イ 分配対象額は、繰越分を含めた利子・配当収入と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- 分配金額は委託会社が基準価額水準、市況動向を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合等は、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設けず、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。

（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。
- 投資信託証券への投資を除いては、ＣＰ、預金、指定金銭信託、コール・ローンおよび手形割引市場において売買される手形以外には投資を行いません。
- ハ 外貨建資産への直接投資は行いません。
- ニ 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より支弁します。

#### 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。

〔参考情報：投資対象とする投資信託の概要〕

〔S M A M ・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）〕

#### (1) 運用会社等

- イ 委託会社 三井住友アセットマネジメント株式会社
- ロ 受託会社 三井住友信託銀行株式会社

#### (2) 投資方針等

##### イ 基本方針

S M A M ・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）は、国内株式インデックス・マザーファンド（B号）（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券への投資を通じて、主としてわが国の株式に投資し、T O P I X（東証株価指数、配当込み）と連動する投資成果を目指して運用を行います。

##### ロ 投資態度

- (イ) 主としてマザーファンド受益証券への投資を通じて、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、T O P I X（東証株価指数、配当込み）と連動する投資成果を目指して運用を行います。

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

（ハ）株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。

マザーファンドにおいては、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、T O P I X（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。

東証株価指数（T O P I X）は、東京証券取引所の知的財産で、この指数の算出、数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利は東京証券取引所が有しています。東京証券取引所は、T O P I Xの算出もしくは公表の方法の変更、T O P I Xの算出もしくは公表の停止またはT O P I Xの商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。また、東京証券取引所は「S M A M・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）」および当ファンドとは何ら関係なく、その運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

## 八 主な投資制限

（イ）外貨建資産への投資は行いません。

（ロ）株式への実質投資割合には制限を設けません。

## （3）その他

イ 信託報酬	このファンドの信託財産の純資産総額に年0.07875%（税抜き0.075%）を乗じて得た額
ロ 手数料	取得申込時および換金時には手数料はかかりません。
ハ 信託財産留保額	取得申込時および解約請求時にそれぞれ受付日の翌営業日の基準価額に対して0.08%
ニ 決算日	毎年1回（原則として11月30日）

## 〔S M A M・年金国内債券パッシブファンド＜適格機関投資家限定＞〕

## （1）運用会社等

- イ 委託会社 三井住友アセットマネジメント株式会社
- ロ 受託会社 三井住友信託銀行株式会社

## （2）投資方針等

### イ 基本方針

S M A M・年金国内債券パッシブファンド＜適格機関投資家限定＞は、国内債券（N O M U R A - B P I）マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券への投資を通じて、N O M U R A - B P I（総合）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

### ロ 投資態度

（イ）主としてマザーファンド受益証券およびわが国の公社債に投資を行い、N O M U R A - B P I（総合）に連動する投資成果を目指します。

（ロ）マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、ファンド設定当初や解約・償還への対応などの事情により変更することもあります。

（ハ）運用の効率化を図るため、有価証券先物取引等を利用することもあります。

マザーファンドにおいては、主としてわが国の公社債および短期金融資産に投資し、安定した利子等収益および売買益の確保を目指すとともに、N O M U R A - B P I（総合）の動きに連動する投資成果を目指します。

N O M U R A - B P I（総合）は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社およびその許諾者に帰属します。なお、野村證券株式会社およびその許諾者は、N O M U R A - B P I（総合）を用いて行われる三井住友アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いま



せん。また、野村證券株式会社およびその許諾者は「S M A M・年金国内債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>」および当ファンドとは何ら関係なく、その運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

## 八 主な投資制限

- (イ) マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。
- (ロ) 株式への投資は、転換社債の転換および転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使による取得に限るものとし、かつ、その投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- (ハ) 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- (ニ) 同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- (ホ) 外貨建資産への投資は行いません。

## (3) その他

- イ 信託報酬                      このファンドの信託財産の純資産総額に年0.0525%（税抜き0.05%）を乗じて得た額
- ロ 手数料                        取得申込時および換金時には手数料はかかりません。
- ハ 信託財産留保額              取得申込時および解約請求時にそれぞれ受付日の基準価額に対して0.03%
- ニ 決算日                        毎年1回（原則として6月20日）

## 〔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）〕

## (1) 運用会社等

- イ 委託会社    三井住友アセットマネジメント株式会社
- ロ 受託会社    三井住友信託銀行株式会社

## (2) 投資方針等

### イ 基本方針

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）は、外国株式インデックス・マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券への投資を通じて、主として日本を除く世界各国の株式に投資し、M S C I - K O K U S A I インデックス（円ベース）と連動する投資成果を目指して運用を行います。

### ロ 投資態度

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

マザーファンドにおいては、主として日本を除く世界各国の株式に投資し、M S C I - K O K U S A I インデックス（円ベース）と連動する投資成果を目指して運用を行います。

M S C I - K O K U S A I インデックス（円ベース）はM S C I インクの知的財産であり、指数の算出、数値の公表、利用など指数に関するすべての権利は、M S C I インクが有しています。また、M S C I インクは「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）」および当ファンドとは何ら関係なく、その運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

## 八 主な投資制限

- (イ) 株式への実質投資割合には制限を設けません。
- (ロ) 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

## (3) その他

- イ 信託報酬 このファンドの信託財産の純資産総額に年0.07875%（税抜き0.075%）を乗じて得た額
- ロ 手数料 取得申込時および換金時には手数料はかかりません。
- ハ 信託財産留保額 取得申込時および解約請求時にそれぞれ受付日の翌営業日の基準価額に対して0.15%
- ニ 決算日 毎年1回（原則として11月30日）

〔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) 運用会社等

- イ 委託会社 三井住友アセットマネジメント株式会社
- ロ 受託会社 三井住友信託銀行株式会社

## (2) 投資方針等

## イ 基本方針

SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>は、外国債券パッシブ・マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券への投資を通じて、シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）と連動する投資成果を目指した運用を行います。

## ロ 投資態度

マザーファンド受益証券への投資を通じて、あるいは、直接、ベンチマーク採用国の国債等に投資することにより実質的に以下の運用を行います。

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

マザーファンドにおいては、シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、ベンチマークと連動する投資成果を目指した運用を行います。

シティグループ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)はシティグループ・グローバル・マーケット・インクの知的財産であり、指数の算出、数値の公表、利用など指数に関するすべての権利は、シティグループ・グローバル・マーケット・インクが有しています。シティグループ・グローバル・マーケット・インクは「SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>」および当ファンドとは何ら関係なく、その運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

## ハ 主な投資制限

- (イ) 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- (ロ) 投資信託証券（マザーファンド受益証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (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) 同一発行体の発行する債券への実質投資割合は、国債を除き、取得時において信託財産の

純資産総額の5%以内とします。

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

### (3) その他

- イ 信託報酬                      このファンドの信託財産の純資産総額に年0.063%（税抜き0.06%）を乗じて得た額
- ロ 手数料                        取得申込時および換金時には手数料はかかりません。
- ハ 信託財産留保額              取得申込時および解約請求時にそれぞれ受付日の翌営業日の基準価額に対して0.1%
- ニ 決算日                        毎年1回（原則として12月17日）

## 〔SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>〕

### (1) 運用会社等

- イ 委託会社    三井住友アセットマネジメント株式会社
- ロ 受託会社    三井住友信託銀行株式会社

### (2) 投資方針等

#### イ 基本方針

SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>は、マネーインカム・マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）を主要投資対象とし、安定した収益の確保を目指して運用を行います。また、市況動向によっては、円貨建の短期公社債および短期金融商品に直接投資を行うことがあります。

#### ロ 投資態度

主として、マザーファンドへの投資を通じて、実質的に以下の運用を行います。

- (イ) 主として、円貨建の短期公社債および短期金融商品に投資し、安定した収益の確保を目指します。
- (ロ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。  
マザーファンドにおいては、円貨建の短期公社債および短期金融商品に投資し、安定した収益の確保を目指して運用を行います。

#### ハ 主な投資制限

- (イ) 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- (ロ) 投資信託証券（マザーファンド受益証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- (ハ) 外貨建資産への投資は行いません。
- (ニ) 同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

### (3) その他

- イ 信託報酬 このファンドの信託財産の純資産総額に以下の率（信託報酬率）を乗じて得た額。なお、信託報酬率は月次で見直すものとし、各月の最終営業日の翌日から翌月の最終営業日までの信託報酬率は、当該各月の最終5営業日における無担保コール翌日物レート（年率）の平均値（当該平均率）に応じ、次に掲げる率とします。

当該平均率の水準	信託報酬率
当該平均値が0.25%未満の場合	当該平均値に0.42（税抜き0.4）を乗じた率（下限は0%）
当該平均値が0.25%以上0.50%未満の場合	年0.105%（税抜き0.1%）
当該平均値が0.50%以上1.00%未満の場合	年0.147%（税抜き0.14%）
当該平均値が1.00%以上の場合	年0.189%（税抜き0.18%）

- ロ 手数料 取得申込時および換金時には手数料はかかりません。
- ハ 信託財産留保額 解約請求受付日の基準価額に対して0.01%
- ニ 決算日 毎年1回（原則として4月13日）
- ホ ベンチマーク ありません。

### 3【投資リスク】

#### イ ファンドのもつリスクの特性

当ファンドは、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や債券を投資対象としており、その価格は、保有する株式や債券の値動き、当該発行者の経営・財務状況の変化、為替相場の変動等の影響により上下します。当ファンドが組み入れる投資信託の価格の変動により、当ファンドの基準価額も上下します。基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。運用の結果としてファンドに生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。したがって、当ファンドは預貯金とは異なり、投資元本が保証されているものではなく、一定の投資成果を保証するものでもありません。また、当ファンドは、預貯金や保険契約と異なり、預金保険、貯金保険、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。登録金融機関は、投資者保護基金には加入しておりません。

当ファンドが有するリスク等（他の投資信託の組入れを通じた実質的なリスク等となります。）のうち主要なものは、以下の通りです。

#### （イ）株式市場リスク

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

#### （ロ）債券市場リスク

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

#### （ハ）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。

（二）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）カントリーリスク

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

（ヘ）市場流動性リスク

大口の解約請求があった場合、解約資金を手当てするために保有資産を大量に売却しなければならないことがあります。その際、市場動向や取引量等の状況によっては、取引ができなかったり、通常よりも著しく不利な価格での取引を余儀なくされたりすることがあり、ファンドの基準価額が下落する要因となります。

（ト）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。

## 4 【手数料等及び税金】

（１）【申込手数料】

無手数料です。

（２）【換金（解約）手数料】

解約手数料はありません。

（３）【信託報酬等】

純資産総額に年0.5145%（税抜き0.49%）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。なお、各ファンドのターゲット・イヤーに属する決算日の翌日以降年0.42%（税抜き0.4%）となります。

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。

信託報酬の実質的配分は以下の通りです。

	委託会社	販売会社	受託会社
ターゲットイヤーの 決算日まで	年0.1575% (0.15%)	年0.315% (0.3%)	年0.042% (0.04%)
ターゲットイヤーの 決算翌日以降	年0.063% (0.06%)		

( )内は税抜き。

投資対象とする投資信託（「SMAM・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）」、「SMAM・年金国内債券パッシブファンド＜適格機関投資家限定＞」、「SMAM・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）」、「SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞」、「SMAM・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞」）の信託報酬を含めた総額は、各ファンドの基本アロケーション（平成25年1月末現在）に従った場合、以下の通りとなります。なお、SMAM・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞は、信託報酬が変動するため、その上限額である年0.189%（税抜き0.18%）で計算しております。

< 2010 > 年0.5439%（税抜き0.518%）程度

< 2020 > 年0.58023%（税抜き0.5526%）程度

< 2030 > 年0.582435%（税抜き0.5547%）程度

< 2040 > 年0.58758%（税抜き0.5596%）程度

#### (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0.00315%（税抜き0.003%）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場合があります。
- 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（それらにかかる消費税等相当額を含みます。）等は、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、計算方法を具体的に記載することはできません。

当ファンドが組み入れる他の投資信託は、その委託会社、受託会社の業務の対価として、信託報酬を支払います。また、その他、当該他の投資信託の諸経費は、その信託財産から支弁されます。この費用は、当該他の投資信託の基準価額に反映され、結果的に当ファンドがその持分に依りて負担することとなります。なお、現在、当ファンドが投資を行っている他の投資信託については、取得時、換金時に手数料はかかりません。

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

### ロ 一部解約時および償還時の課税について

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

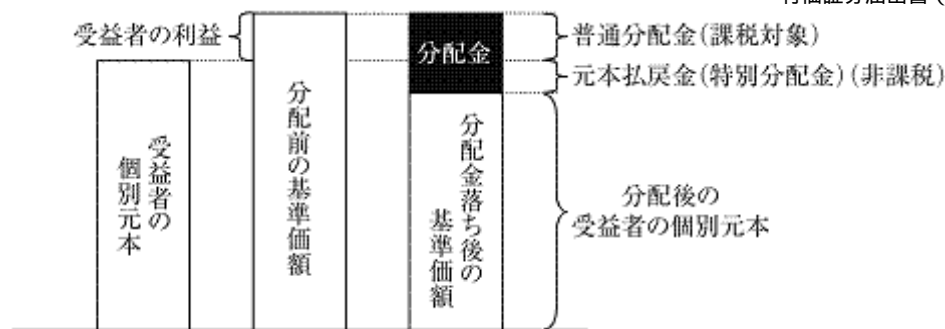
### ハ 収益分配金の課税について

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

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



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



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

## 二 個人、法人別の課税の取扱いについて

### (イ) 個人の受益者に対する課税

#### ・収益分配時

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、以下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。

時期	税率
平成25年12月31日まで	10.147%（所得税7.147%および地方税3%）
平成26年1月1日以降	20.315%（所得税15.315%および地方税5%）

#### ・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、以下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。

なお、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、上場株式等にかかる譲渡益との通算が可能です。

時期	税率
平成25年12月31日まで	10.147%（所得税7.147%および地方税3%）
平成26年1月1日以降	20.315%（所得税15.315%および地方税5%）

### (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、以下の税率で源泉徴収されます。

時期	税率
平成25年12月31日まで	7.147%（所得税のみ）
平成26年1月1日以降	15.315%（所得税のみ）

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。

当ファンドは、受取配当にかかる益金不算入制度、配当控除の適用はありません。

当ファンドの外貨建資産割合および非株式割合

外貨建資産への直接投資は行いません。

非株式割合に関する制限はありません（約款規定なし）。

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

上記「(5)課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、平成25年1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】

## a. 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010

平成25年1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	日本	355,864,617	99.76
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		867,059	0.24
合計（純資産総額）		356,731,676	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。

## b. 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020

平成25年1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	日本	638,326,008	99.77
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		1,444,724	0.23
合計（純資産総額）		639,770,732	100.00

## c. 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030

平成25年1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	日本	395,247,021	99.61
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		1,547,556	0.39
合計（純資産総額）		396,794,577	100.00

## d. 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040

平成25年1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	日本	313,490,307	99.02
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		3,111,727	0.98
合計（純資産総額）		316,602,034	100.00

## (2)【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ 主要投資銘柄

## a. 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010

平成25年1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	投資信託 受益証券	S M A M ・ マネーインカムファンド < 適格機関投資家限定 >	176,153,836	1.0077	177,527,811	1.0079	177,545,451	49.77
日本	投資信託 受益証券	S M A M ・ 年金国内債券パッシブファン ド < 適格機関投資家限定 >	106,647,629	1.1627	124,000,927	1.1638	124,116,510	34.79
日本	投資信託 受益証券	S M A M ・ 国内株式パッシブ・ファン ド ( 適格機関投資家専用 )	21,464,317	0.7599	16,312,494	0.8465	18,169,544	5.09
日本	投資信託 受益証券	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 )	13,889,717	1.1502	15,977,119	1.3044	18,117,746	5.08
日本	投資信託 受益証券	S M A M ・ 年金外国債券パッシブ・ファン ド < 適格機関投資家限定 >	13,131,545	1.2581	16,521,702	1.3643	17,915,366	5.02

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

#### b . 三井住友・D C 年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型) 2 0 2 0

平成25年1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	投資信託 受益証券	S M A M ・ 年金国内債券パッシブファン ド < 適格機関投資家限定 >	313,344,011	1.1627	364,351,119	1.1638	364,669,760	57.00
日本	投資信託 受益証券	S M A M ・ 国内株式パッシブ・ファン ド ( 適格機関投資家専用 )	109,383,809	0.7610	83,241,474	0.8465	92,593,394	14.47
日本	投資信託 受益証券	S M A M ・ 年金外国債券パッシブ・ファン ド < 適格機関投資家限定 >	66,424,988	1.2596	83,671,723	1.3643	90,623,611	14.17
日本	投資信託 受益証券	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 )	50,072,976	1.1516	57,665,667	1.3044	65,315,189	10.21
日本	投資信託 受益証券	S M A M ・ マネーインカムファンド < 適格機関投資家限定 >	24,927,130	1.0077	25,121,561	1.0079	25,124,054	3.93

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

#### c . 三井住友・D C 年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型) 2 0 3 0

平成25年1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	投資信託 受益証券	S M A M ・ 年金国内債券パッシブファン ド < 適格機関投資家限定 >	143,414,493	1.1628	166,765,012	1.1638	166,905,786	42.06
日本	投資信託 受益証券	S M A M ・ 国内株式パッシブ・ファン ド ( 適格機関投資家専用 )	137,802,847	0.7597	104,693,076	0.8465	116,650,109	29.40
日本	投資信託 受益証券	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 )	46,186,229	1.1503	53,128,913	1.3044	60,245,317	15.18
日本	投資信託 受益証券	S M A M ・ 年金外国債券パッシブ・ファン ド < 適格機関投資家限定 >	32,021,348	1.2586	40,302,623	1.3643	43,686,725	11.01
日本	投資信託 受益証券	S M A M ・ マネーインカムファンド < 適格機関投資家限定 >	7,698,268	1.0077	7,758,314	1.0079	7,759,084	1.96

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

#### d . 三井住友・D C 年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型) 2 0 4 0

平成25年1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	投資信託 受益証券	S M A M ・ 国内株式パッシブ・ファン ド ( 適格機関投資家専用 )	168,099,853	0.7594	127,661,752	0.8465	142,296,525	44.94
日本	投資信託 受益証券	S M A M ・ 年金国内債券パッシブファン ド < 適格機関投資家限定 >	64,069,589	1.1628	74,503,674	1.1638	74,564,187	23.55
日本	投資信託 受益証券	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 )	45,427,882	1.1501	52,249,060	1.3044	59,256,129	18.72
日本	投資信託 受益証券	S M A M ・ 年金外国債券パッシブ・ファン ド < 適格機関投資家限定 >	22,884,080	1.2590	28,812,589	1.3643	31,220,750	9.86
日本	投資信託 受益証券	S M A M ・ マネーインカムファンド < 適格機関投資家限定 >	6,104,491	1.0077	6,152,106	1.0079	6,152,716	1.94

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

a . 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010

平成25年1月31日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	99.76
合計	99.76

b . 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020

平成25年1月31日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	99.77
合計	99.77

c . 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030

平成25年1月31日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	99.61
合計	99.61

d . 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040

平成25年1月31日現在

種類	投資比率（％）
投資信託受益証券	99.02
合計	99.02

【投資不動産物件】

a . 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010

該当事項はありません。

b . 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020

該当事項はありません。

c . 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030

該当事項はありません。

d . 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

a . 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010

該当事項はありません。

b . 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020

該当事項はありません。

c . 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030

該当事項はありません。

d . 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040

該当事項はありません。

### （3）【運用実績】

#### 【純資産の推移】

a . 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010

年月日	純資産総額 (円)	1万口当たりの 純資産額(円)
第3期（平成15年12月22日）	35,391,890	10,088
（分配落）		
（分配付）	35,391,890	10,088
第4期（平成16年12月20日）	56,778,399	10,387
（分配落）		
（分配付）	56,778,399	10,387
第5期（平成17年12月20日）	118,527,624	10,782
（分配落）		
（分配付）	118,527,624	10,782
第6期（平成18年12月20日）	160,590,675	11,048
（分配落）		
（分配付）	160,590,675	11,048
第7期（平成19年12月20日）	217,158,042	11,245
（分配落）		
（分配付）	217,158,042	11,245
第8期（平成20年12月22日）	238,566,878	10,578
（分配落）		
（分配付）	238,566,878	10,578
第9期（平成21年12月21日）	301,495,735	10,921
（分配落）		
（分配付）	301,495,735	10,921
第10期（平成22年12月20日）	324,751,925	10,941
（分配落）		
（分配付）	324,751,925	10,941
第11期（平成23年12月20日）	329,392,588	10,818
（分配落）		
（分配付）	329,392,588	10,818
第12期（平成24年12月20日）	348,417,250	11,198
（分配落）		
（分配付）	348,417,250	11,198
平成24年 1月末日	334,673,593	10,888
2月末日	340,367,151	11,047
3月末日	340,453,689	11,081
4月末日	338,405,753	11,048
5月末日	335,626,687	10,918
6月末日	338,728,312	10,963
7月末日	341,320,710	10,972

8月末日	342,301,460	10,990
9月末日	342,980,260	11,024
10月末日	346,187,614	11,036
11月末日	345,107,348	11,120
12月末日	349,685,805	11,232
平成25年 1月末日	356,731,676	11,377

b. 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型) 2020

年月日	純資産総額 (円)	1万口当たりの 純資産額(円)
第3期(平成15年12月22日) (分配落)	23,886,277	9,725
(分配付)	23,886,277	9,725
第4期(平成16年12月20日) (分配落)	50,534,185	10,223
(分配付)	50,534,185	10,223
第5期(平成17年12月20日) (分配落)	116,847,054	11,660
(分配付)	116,847,054	11,660
第6期(平成18年12月20日) (分配落)	156,345,353	12,355
(分配付)	156,345,353	12,355
第7期(平成19年12月20日) (分配落)	244,051,631	12,244
(分配付)	244,051,631	12,244
第8期(平成20年12月22日) (分配落)	258,579,003	10,124
(分配付)	258,579,003	10,124
第9期(平成21年12月21日) (分配落)	364,838,536	10,782
(分配付)	364,838,536	10,782
第10期(平成22年12月20日) (分配落)	460,154,017	10,871
(分配付)	460,154,017	10,871
第11期(平成23年12月20日) (分配落)	503,354,494	10,466
(分配付)	503,354,494	10,466
第12期(平成24年12月20日) (分配落)	605,756,824	11,419
(分配付)	605,756,824	11,419
平成24年 1月末日	513,715,594	10,644
2月末日	535,841,083	11,055
3月末日	538,589,043	11,152
4月末日	538,095,950	11,038
5月末日	521,043,400	10,685
6月末日	533,751,203	10,807
7月末日	537,432,175	10,796
8月末日	549,079,424	10,857
9月末日	562,896,864	10,936
10月末日	569,748,541	10,962
11月末日	587,171,787	11,187
12月末日	611,212,153	11,518

平成25年 1月末日	639,770,732	11,885
------------	-------------	--------

## c. 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2030

年月日	純資産総額 (円)	1万口当たりの 純資産額(円)
第3期(平成15年12月22日)	14,059,509	9,390
(分配落)		
(分配付)	14,059,509	9,390
第4期(平成16年12月20日)	26,147,117	10,035
(分配落)		
(分配付)	26,147,117	10,035
第5期(平成17年12月20日)	55,989,814	12,178
(分配落)		
(分配付)	55,989,814	12,178
第6期(平成18年12月20日)	101,147,764	13,183
(分配落)		
(分配付)	101,147,764	13,183
第7期(平成19年12月20日)	149,262,430	12,809
(分配落)		
(分配付)	149,262,430	12,809
第8期(平成20年12月22日)	146,078,912	9,332
(分配落)		
(分配付)	146,078,912	9,332
第9期(平成21年12月21日)	214,049,126	10,168
(分配落)		
(分配付)	214,049,126	10,168
第10期(平成22年12月20日)	266,798,732	10,308
(分配落)		
(分配付)	266,798,732	10,308
第11期(平成23年12月20日)	273,003,638	9,525
(分配落)		
(分配付)	273,003,638	9,525
第12期(平成24年12月20日)	367,329,083	10,766
(分配落)		
(分配付)	367,329,083	10,766
平成24年 1月末日	284,555,472	9,803
2月末日	305,398,867	10,371
3月末日	312,675,717	10,524
4月末日	311,591,016	10,317
5月末日	297,654,406	9,773
6月末日	308,739,748	9,959
7月末日	313,707,655	9,917
8月末日	321,798,803	10,009
9月末日	326,724,459	10,111
10月末日	336,772,986	10,111
11月末日	350,645,284	10,417
12月末日	372,985,181	10,890
平成25年 1月末日	396,794,577	11,432

## d. 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2040

年月日	純資産総額 (円)	1万口当たりの 純資産額(円)
第3期(平成15年12月22日)	18,376,281	9,180
(分配落)		
(分配付)	18,376,281	9,180
第4期(平成16年12月20日)	30,736,176	9,865
(分配落)		
(分配付)	30,736,176	9,865
第5期(平成17年12月20日)	64,001,577	12,443
(分配落)		
(分配付)	64,001,577	12,443
第6期(平成18年12月20日)	113,160,193	13,668
(分配落)		
(分配付)	113,160,193	13,668
第7期(平成19年12月20日)	143,523,897	13,111
(分配落)		
(分配付)	143,523,897	13,111
第8期(平成20年12月22日)	134,815,396	8,596
(分配落)		
(分配付)	134,815,396	8,596
第9期(平成21年12月21日)	188,270,881	9,559
(分配落)		
(分配付)	188,270,881	9,559
第10期(平成22年12月20日)	231,956,041	9,713
(分配落)		
(分配付)	231,956,041	9,713
第11期(平成23年12月20日)	230,424,744	8,586
(分配落)		
(分配付)	230,424,744	8,586
第12期(平成24年12月20日)	287,659,579	10,038
(分配落)		
(分配付)	287,659,579	10,038
平成24年 1月末日	240,389,367	8,934
2月末日	262,829,728	9,639
3月末日	266,162,292	9,840
4月末日	258,058,959	9,545
5月末日	240,785,174	8,831
6月末日	250,570,170	9,076
7月末日	250,756,716	8,991
8月末日	256,868,525	9,109
9月末日	258,777,320	9,227
10月末日	261,878,367	9,202
11月末日	272,003,208	9,582
12月末日	292,047,149	10,189
平成25年 1月末日	316,602,034	10,887

## 【分配の推移】

## a. 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010

計算期間	1万口当たり分配金(円)
第3期(平成14年12月21日～平成15年12月22日)	0
第4期(平成15年12月23日～平成16年12月20日)	0

第5期（平成16年12月21日～平成17年12月20日）	0
第6期（平成17年12月21日～平成18年12月20日）	0
第7期（平成18年12月21日～平成19年12月20日）	0
第8期（平成19年12月21日～平成20年12月22日）	0
第9期（平成20年12月23日～平成21年12月21日）	0
第10期（平成21年12月22日～平成22年12月20日）	0
第11期（平成22年12月21日～平成23年12月20日）	0
第12期（平成23年12月21日～平成24年12月20日）	0

## b．三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020

計算期間	1万口当たり分配金（円）
第3期（平成14年12月21日～平成15年12月22日）	0
第4期（平成15年12月23日～平成16年12月20日）	0
第5期（平成16年12月21日～平成17年12月20日）	0
第6期（平成17年12月21日～平成18年12月20日）	0
第7期（平成18年12月21日～平成19年12月20日）	0
第8期（平成19年12月21日～平成20年12月22日）	0
第9期（平成20年12月23日～平成21年12月21日）	0
第10期（平成21年12月22日～平成22年12月20日）	0
第11期（平成22年12月21日～平成23年12月20日）	0
第12期（平成23年12月21日～平成24年12月20日）	0

## c．三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030

計算期間	1万口当たり分配金（円）
第3期（平成14年12月21日～平成15年12月22日）	0
第4期（平成15年12月23日～平成16年12月20日）	0
第5期（平成16年12月21日～平成17年12月20日）	0
第6期（平成17年12月21日～平成18年12月20日）	0
第7期（平成18年12月21日～平成19年12月20日）	0
第8期（平成19年12月21日～平成20年12月22日）	0
第9期（平成20年12月23日～平成21年12月21日）	0
第10期（平成21年12月22日～平成22年12月20日）	0
第11期（平成22年12月21日～平成23年12月20日）	0
第12期（平成23年12月21日～平成24年12月20日）	0

## d．三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040

計算期間	1万口当たり分配金（円）
第3期（平成14年12月21日～平成15年12月22日）	0
第4期（平成15年12月23日～平成16年12月20日）	0
第5期（平成16年12月21日～平成17年12月20日）	0
第6期（平成17年12月21日～平成18年12月20日）	0



第7期（平成18年12月21日～平成19年12月20日）	0
第8期（平成19年12月21日～平成20年12月22日）	0
第9期（平成20年12月23日～平成21年12月21日）	0
第10期（平成21年12月22日～平成22年12月20日）	0
第11期（平成22年12月21日～平成23年12月20日）	0
第12期（平成23年12月21日～平成24年12月20日）	0

## 【収益率の推移】

## a．三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010

計算期間	収益率（％）
第3期	3.3
第4期	3.0
第5期	3.8
第6期	2.5
第7期	1.8
第8期	5.9
第9期	3.2
第10期	0.2
第11期	1.1
第12期	3.5

（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。以下同じ。

## b．三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020

計算期間	収益率（％）
第3期	8.1
第4期	5.1
第5期	14.1
第6期	6.0
第7期	0.9
第8期	17.3
第9期	6.5
第10期	0.8
第11期	3.7
第12期	9.1

## c．三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030

計算期間	収益率（％）
第3期	12.4
第4期	6.9
第5期	21.4
第6期	8.3

第7期	2.8
第8期	27.1
第9期	9.0
第10期	1.4
第11期	7.6
第12期	13.0

## d. 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2040

計算期間	収益率(%)
第3期	14.2
第4期	7.5
第5期	26.1
第6期	9.8
第7期	4.1
第8期	34.4
第9期	11.2
第10期	1.6
第11期	11.6
第12期	16.9

## (4) 【設定及び解約の実績】

## a. 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010

計算期間	設定口数(口)	解約口数(口)
第3期	31,104,873	10,751,901
第4期	21,071,041	1,494,879
第5期	58,009,119	2,742,491
第6期	55,018,651	19,583,375
第7期	68,363,183	20,609,878
第8期	56,897,891	24,476,235
第9期	64,237,153	13,713,349
第10期	56,241,790	35,487,520
第11期	50,688,810	43,023,358
第12期	33,162,080	26,499,660

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。以下同じ。

## b. 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2020

計算期間	設定口数(口)	解約口数(口)
第3期	23,365,670	10,813,485
第4期	25,287,983	418,069
第5期	56,755,832	5,972,212
第6期	45,933,217	19,605,145

第7期	83,458,432	10,678,494
第8期	83,157,158	27,059,755
第9期	95,242,920	12,283,196
第10期	111,793,677	26,894,086
第11期	87,891,359	30,227,601
第12期	85,709,743	36,186,583

## c. 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2030

計算期間	設定口数(口)	解約口数(口)
第3期	13,813,044	11,426,860
第4期	11,517,637	435,535
第5期	21,538,032	1,618,154
第6期	34,029,711	3,275,922
第7期	48,479,281	8,680,254
第8期	58,044,415	18,035,819
第9期	63,896,452	9,917,639
第10期	58,503,162	10,182,239
第11期	47,890,237	20,123,017
第12期	65,335,257	10,757,941

## d. 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2040

計算期間	設定口数(口)	解約口数(口)
第3期	19,928,524	10,920,638
第4期	11,907,838	767,723
第5期	38,175,773	17,899,095
第6期	51,096,621	19,739,396
第7期	50,628,800	23,956,246
第8期	65,487,055	18,108,518
第9期	57,723,829	17,613,224
第10期	52,737,375	10,883,373
第11期	49,611,557	20,043,137
第12期	48,930,836	30,725,942

〔参考情報〕

〔S M A M・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)〕

投資有価証券の主要銘柄

主要投資銘柄

平成25年1月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
----------	----	-----	----	-------------	-------------	------------------	------------	-----------------

日本	親投資信託 受益証券	国内株式インデックス・ マザーファンド(B号)	59,402,719,951	1.0744	63,825,613,525	1.2862	76,403,778,400	100.01
----	---------------	----------------------------	----------------	--------	----------------	--------	----------------	--------

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

「S M A M・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)」は「国内株式インデックス・マザーファンド(B号)」受益証券を主要対象としており、「国内株式インデックス・マザーファンド(B号)」の投資有価証券は以下の通りです。

<国内株式インデックス・マザーファンド(B号) 平成25年1月30日現在の上位30銘柄>

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	3,142,500	3,535.00	11,108,737,500	4,365.00	13,717,012,500	4.23
日本	株式	三菱UFJフィナンシャルグループ	銀行業	18,284,800	377.00	6,893,369,600	503.00	9,197,254,400	2.84
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	2,063,300	2,732.00	5,636,935,600	3,475.00	7,169,967,500	2.21
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,826,400	2,654.00	4,847,265,600	3,490.00	6,374,136,000	1.96
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	31,113,200	132.00	4,106,942,400	178.00	5,538,149,600	1.71
日本	株式	キヤノン	電気機器	1,520,100	2,883.00	4,382,448,300	3,385.00	5,145,538,500	1.59
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	959,900	3,770.00	3,618,823,000	4,695.00	4,506,730,500	1.39
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,016,600	3,685.00	3,746,171,000	3,770.00	3,832,582,000	1.18
日本	株式	三菱地所	不動産業	1,690,000	1,589.00	2,685,410,000	2,198.00	3,714,620,000	1.15
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,155,000	3,086.99	3,565,473,450	3,175.00	3,667,125,000	1.13
日本	株式	ファナック	電気機器	254,900	13,900.00	3,543,110,000	14,360.00	3,660,364,000	1.13
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,884,600	1,561.00	2,941,860,600	1,919.00	3,616,547,400	1.11
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	1,216,000	2,470.00	3,003,520,000	2,890.00	3,514,240,000	1.08
日本	株式	日立製作所	電気機器	5,723,000	476.00	2,724,148,000	546.00	3,124,758,000	0.96
日本	株式	小松製作所	機械	1,194,400	1,847.00	2,206,056,800	2,437.00	2,910,752,800	0.90
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	3,088,100	799.00	2,467,391,900	932.00	2,878,109,200	0.89
日本	株式	三井物産	卸売業	2,082,900	1,139.00	2,372,423,100	1,366.00	2,845,241,400	0.88
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	1,010,000	2,402.00	2,426,020,000	2,784.00	2,811,840,000	0.87
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	451,700	5,410.00	2,443,697,000	6,200.00	2,800,540,000	0.86
日本	株式	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	情報・通信業	19,863	118,900.00	2,361,710,700	134,900.00	2,679,518,700	0.83
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	568,800	4,170.00	2,371,896,000	4,700.00	2,673,360,000	0.82
日本	株式	新日鐵住金	鉄鋼	10,826,000	189.00	2,046,114,000	241.00	2,609,066,000	0.80
日本	株式	信越化学工業	化学	459,600	4,850.00	2,229,060,000	5,670.00	2,605,932,000	0.80
日本	株式	野村ホールディングス	証券・商品先物取引業	4,936,800	341.00	1,683,448,800	515.00	2,542,452,000	0.78
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	934,200	2,114.00	1,974,898,800	2,714.00	2,535,418,800	0.78
日本	株式	三井不動産	不動産業	1,138,000	1,719.00	1,956,222,000	2,096.00	2,385,248,000	0.74
日本	株式	KDDI	情報・通信業	340,700	6,100.00	2,078,270,000	6,730.00	2,292,911,000	0.71
日本	株式	ソニー	電気機器	1,537,700	801.00	1,231,697,700	1,383.00	2,126,639,100	0.66
日本	株式	デンソー	輸送用機器	603,500	2,709.00	1,634,881,500	3,365.00	2,030,777,500	0.63
日本	株式	三菱重工業	機械	4,101,000	383.00	1,570,683,000	492.00	2,017,692,000	0.62

{ S M A M・年金国内債券パッシブファンド<適格機関投資家限定> }

投資有価証券の主要銘柄

主要投資銘柄

平成25年1月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託 受益証券	国内債券(NOMURA- BPI)マザーファンド	45,379,767,824	1.2452	56,507,453,473	1.2528	56,851,773,129	100.01

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

「S M A M・年金国内債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>」は「国内債券(NOMURA-BPI)マザーファンド」受益証券を主要対象としており、「国内債券(NOMURA-BPI)マザーファンド」の投資有価証券は以下の通りです。

## &lt; 国内債券 ( NOMURA - B P I ) マザーファンド 平成25年1月30日現在の上位30銘柄 &gt;

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268回利付 国債(10年)	5,520,000,000	103.52	5,714,653,600	103.02	5,687,145,600	1.500	2015/03/20	3.29
日本	国債証券	第284回利付 国債(10年)	4,765,000,000	106.72	5,085,670,500	106.14	5,057,856,900	1.700	2016/12/20	2.93
日本	国債証券	第265回利付 国債(10年)	4,445,000,000	103.35	4,593,938,250	102.67	4,564,037,100	1.500	2014/12/20	2.64
日本	国債証券	第263回利付 国債(10年)	3,335,000,000	103.35	3,446,722,500	102.48	3,417,941,450	1.600	2014/09/20	1.98
日本	国債証券	第286回利付 国債(10年)	3,115,000,000	107.77	3,357,071,700	107.27	3,341,585,100	1.800	2017/06/20	1.93
日本	国債証券	第274回利付 国債(10年)	3,103,000,000	104.63	3,246,737,500	104.09	3,230,160,940	1.500	2015/12/20	1.87
日本	国債証券	第270回利付 国債(10年)	2,833,000,000	103.56	2,934,071,860	102.91	2,915,468,630	1.300	2015/06/20	1.69
日本	国債証券	第272回利付 国債(10年)	2,810,000,000	104.19	2,927,790,200	103.48	2,907,816,100	1.400	2015/09/20	1.68
日本	国債証券	第282回利付 国債(10年)	2,716,000,000	106.51	2,892,830,800	105.81	2,873,799,600	1.700	2016/09/20	1.66
日本	国債証券	第289回利付 国債(10年)	2,658,000,000	106.63	2,834,239,900	106.54	2,831,912,940	1.500	2017/12/20	1.64
日本	国債証券	第285回利付 国債(10年)	2,494,000,000	106.92	2,666,780,400	106.49	2,655,885,540	1.700	2017/03/20	1.54
日本	国債証券	第288回利付 国債(10年)	2,468,000,000	107.40	2,650,707,100	107.18	2,645,202,400	1.700	2017/09/20	1.53
日本	国債証券	第280回利付 国債(10年)	2,443,000,000	106.95	2,612,788,500	106.10	2,592,023,000	1.900	2016/06/20	1.50
日本	国債証券	第277回利付 国債(10年)	2,304,000,000	105.53	2,431,411,200	104.74	2,413,278,720	1.600	2016/03/20	1.40
日本	国債証券	第310回利付 国債(10年)	2,320,000,000	103.31	2,396,996,000	103.75	2,407,046,400	1.000	2020/09/20	1.39
日本	国債証券	第306回利付 国債(10年)	2,180,000,000	106.62	2,324,512,200	106.82	2,328,676,000	1.400	2020/03/20	1.35
日本	国債証券	第305回利付 国債(10年)	2,020,000,000	105.97	2,140,594,000	106.17	2,144,634,000	1.300	2019/12/20	1.24
日本	国債証券	第315回利付 国債(10年)	2,000,000,000	104.31	2,086,380,000	104.95	2,099,100,000	1.200	2021/06/20	1.21
日本	国債証券	第312回利付 国債(10年)	1,990,000,000	104.68	2,083,151,900	105.14	2,092,445,200	1.200	2020/12/20	1.21
日本	国債証券	第313回利付 国債(10年)	1,970,000,000	105.35	2,075,550,600	105.83	2,084,949,500	1.300	2021/03/20	1.21
日本	国債証券	第317回利付 国債(10年)	1,940,000,000	103.24	2,003,030,600	103.97	2,017,115,000	1.100	2021/09/20	1.17
日本	国債証券	第325回利付 国債(10年)	1,960,000,000	100.64	1,972,586,700	100.44	1,968,800,400	0.800	2022/09/20	1.14
日本	国債証券	第320回利付 国債(10年)	1,720,000,000	102.12	1,756,550,000	102.93	1,770,550,800	1.000	2021/12/20	1.02
日本	国債証券	第324回利付 国債(10年)	1,630,000,000	100.28	1,634,665,900	100.74	1,642,176,100	0.800	2022/06/20	0.95
日本	国債証券	第297回利付 国債(10年)	1,474,000,000	106.60	1,571,284,000	106.72	1,573,170,720	1.400	2018/12/20	0.91
日本	国債証券	第296回利付 国債(10年)	1,366,000,000	107.12	1,463,316,700	107.18	1,464,092,460	1.500	2018/09/20	0.85
日本	国債証券	第293回利付 国債(10年)	1,321,000,000	108.78	1,436,994,500	108.63	1,435,041,930	1.800	2018/06/20	0.83
日本	国債証券	第290回利付 国債(10年)	1,332,000,000	106.32	1,416,302,280	106.30	1,416,009,240	1.400	2018/03/20	0.82
日本	国債証券	第269回利付 国債(10年)	1,350,000,000	103.28	1,394,293,500	102.60	1,385,140,500	1.300	2015/03/20	0.80
日本	国債証券	第300回利付 国債(10年)	1,280,000,000	107.29	1,373,421,100	107.41	1,374,912,000	1.500	2019/03/20	0.80

〔 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 ) 〕

## 投資有価証券の主要銘柄

## 主要投資銘柄

平成25年1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	外国株式インデックス・ マザーファンド	29,680,821,993	1.4069	41,757,948,462	1.6768	49,768,802,317	100.01

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

「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）」は「外国株式インデックス・マザーファンド」受益証券を主要対象としており、「外国株式インデックス・マザーファンド」の投資有価証券は以下の通りです。

<外国株式インデックス・マザーファンド 平成25年1月31日現在の上位30銘柄>

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	98,784	53,714.27	5,306,110,487	41,635.48	4,112,919,868	1.71
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	486,196	8,031.25	3,904,764,931	8,263.66	4,017,760,284	1.67
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	1,112,545	1,925.78	2,142,526,032	2,026.04	2,254,063,119	0.94
アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION	エネルギー	206,635	9,641.70	1,992,312,803	10,613.25	2,193,069,533	0.91
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	339,690	6,104.87	2,073,766,687	6,395.11	2,172,355,595	0.90
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	114,316	17,456.04	1,995,505,148	18,548.81	2,120,426,084	0.88
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	795,065	2,456.22	1,952,856,939	2,538.24	2,018,072,941	0.84
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	1,929,261	908.45	1,752,638,505	1,042.48	2,011,229,068	0.84
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	290,545	6,334.22	1,840,378,855	6,842.79	1,988,138,769	0.83
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	787,201	2,264.82	1,782,875,653	2,507.26	1,973,718,681	0.82
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	290,364	6,308.71	1,831,822,502	6,752.56	1,960,701,086	0.82
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	607,724	3,092.38	1,879,313,664	3,142.50	1,909,777,045	0.80
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	27,591	63,061.58	1,739,932,296	68,704.06	1,895,613,890	0.79
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	399,985	3,756.79	1,502,659,968	4,295.42	1,718,106,848	0.72
アメリカ	株式	WELLS FARGO & COMPANY	銀行	528,769	3,022.20	1,598,046,940	3,187.16	1,685,274,472	0.70
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	242,258	5,769.61	1,397,734,663	6,219.97	1,506,837,976	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	74,045	18,234.57	1,350,179,179	19,875.88	1,471,710,126	0.61
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	427,874	3,460.58	1,480,694,688	3,417.74	1,462,366,363	0.61
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	食品・飲料・タバコ	177,550	8,232.67	1,461,711,659	7,988.42	1,418,344,148	0.59
イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	2,006,550	620.51	1,245,085,745	685.15	1,374,794,213	0.57
アメリカ	株式	ORACLE CORPORATION	ソフトウェア・サービス	411,547	2,901.89	1,194,267,251	3,224.53	1,327,046,964	0.55
イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	391,613	3,004.65	1,176,661,527	3,319.22	1,299,852,971	0.54
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	5,180,697	230.35	1,193,383,915	249.78	1,294,075,682	0.54
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	320,722	4,074.86	1,306,900,263	3,964.58	1,271,531,233	0.53
アメリカ	株式	WAL-MART STORES INC	食品・生活必需品小売り	195,958	6,455.44	1,264,996,326	6,357.01	1,245,707,945	0.52
オーストラリア	株式	BHP BILLITON LTD	素材	339,457	3,250.63	1,103,450,533	3,574.65	1,213,440,779	0.51
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	300,317	4,011.07	1,204,592,929	3,974.61	1,193,644,573	0.50
アメリカ	株式	CITIGROUP INC	各種金融	309,041	3,209.03	991,724,745	3,823.32	1,181,563,563	0.49
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	各種金融	1,135,218	895.90	1,017,048,844	1,037.17	1,177,417,685	0.49
フランス	株式	SANOFI	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	125,650	8,592.74	1,079,678,321	8,992.26	1,129,877,845	0.47

[ S M A M・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定> ]

## 投資有価証券の主要銘柄

## 主要投資銘柄

平成25年1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	外国債券パッシブ・ マザーファンド	2,798,792,428	1.2608	3,528,717,494	1.3721	3,840,223,090	100.01

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

「S M A M・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>」は「外国債券パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要対象としており、「外国債券パッシブ・マザーファンド」の投資有価証券は以下の通りです。

<外国債券パッシブ・マザーファンド 平成25年1月31日現在の上位30銘柄>

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 3.625	13,000,000	10,667.65	1,386,794,784	10,491.78	1,363,931,466	3.625	2020/02/15	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	13,500,000	10,016.28	1,352,198,610	9,822.47	1,326,033,603	2.625	2020/11/15	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 4.75	11,000,000	12,695.51	1,396,506,890	11,992.74	1,319,201,662	4.750	2041/02/15	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.25	14,000,000	9,099.04	1,273,866,634	9,092.63	1,272,969,468	0.250	2015/07/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.25	14,000,000	9,095.48	1,273,368,206	9,085.51	1,271,972,625	0.250	2015/09/15	0.48
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 4.25	11,000,000	11,762.04	1,293,824,869	11,099.85	1,220,984,072	4.250	2040/11/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.25	13,000,000	9,112.57	1,184,634,871	9,107.59	1,183,986,929	0.250	2015/01/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.25	13,000,000	9,102.60	1,183,338,975	9,099.04	1,182,876,160	0.250	2015/05/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.125	11,000,000	10,364.32	1,140,075,956	10,137.90	1,115,169,103	3.125	2021/05/15	0.42
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.25	7,400,000	14,784.66	1,094,065,261	14,407.04	1,066,120,969	4.250	2019/04/25	0.41
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3	8,000,000	13,574.35	1,085,948,724	13,206.13	1,056,490,713	3.000	2022/04/25	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	10,000,000	10,728.08	1,072,808,940	10,504.59	1,050,459,707	3.625	2021/02/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	11,000,000	9,606.01	1,056,661,500	9,388.84	1,032,772,846	2.125	2021/08/15	0.39
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.25	7,000,000	14,930.00	1,045,100,101	14,493.99	1,014,579,594	4.250	2023/10/25	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1	11,000,000	9,213.68	1,013,505,281	9,204.42	1,012,487,081	1.000	2014/05/15	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	10,500,000	9,447.23	991,959,215	9,424.44	989,566,790	2.125	2014/11/30	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.875	10,000,000	9,635.20	963,520,687	9,560.44	956,044,363	1.875	2017/09/30	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	10,000,000	9,588.92	958,892,488	9,559.73	955,973,156	2.500	2015/04/30	0.36
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3	7,200,000	13,370.88	962,704,008	13,175.21	948,615,222	3.000	2015/10/25	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	10,000,000	9,497.07	949,707,281	9,472.15	947,215,176	2.250	2015/01/31	0.36
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.25	7,000,000	13,892.61	972,482,939	13,525.25	946,767,788	3.250	2021/10/25	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	10,000,000	9,460.75	946,075,926	9,435.83	943,583,812	2.375	2014/09/30	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	9,000,000	10,632.05	956,884,556	10,478.25	943,042,668	3.625	2019/08/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.375	9,000,000	10,496.76	944,708,821	10,336.55	930,290,193	3.375	2019/11/15	0.35
フランス	国債証券	BTAN 2.5	7,200,000	12,998.33	935,880,099	12,863.76	926,190,720	2.500	2015/01/15	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.5	10,000,000	9,156.36	915,636,588	9,153.87	915,387,375	0.500	2014/10/15	0.35
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 5.5	5,500,000	17,184.25	945,133,843	16,629.25	914,609,006	5.500	2029/04/25	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 4.375	8,000,000	11,987.64	959,011,536	11,324.14	905,931,600	4.375	2040/05/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.625	10,000,000	9,104.74	910,474,363	9,047.06	904,706,906	0.625	2017/08/31	0.34

アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	9,000,000	10,104.43	909,399,196	9,976.26	897,864,290	2.750	2019/02/15	0.34
------	------	-------------------------	-----------	-----------	-------------	----------	-------------	-------	------------	------

## 〔SMAM・マネーインカムファンド&lt;適格機関投資家限定&gt;〕

## 投資有価証券の主要銘柄

## 主要投資銘柄

平成25年1月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託 受益証券	マネーインカム・マザー ファンド	257,438,916	1.0095	259,898,076	1.0105	260,142,024	100.01

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

「SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>」は「マネーインカム・マザーファンド」受益証券を主要対象としており、「マネーインカム・マザーファンド」の投資有価証券は以下の通りです。

## &lt;マネーインカム・マザーファンド 平成25年1月30日現在&gt;

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247回利付国債 (10年)	806,500,000	100.30	808,962,290	100.09	807,241,980	0.800	2013/03/20	48.59
日本	国債証券	第256回利付国債 (10年)	275,500,000	101.37	279,300,580	101.16	278,717,840	1.400	2013/12/20	16.78
日本	国債証券	第253回利付国債 (10年)	275,500,000	101.56	279,816,320	100.96	278,147,555	1.600	2013/09/20	16.74
日本	国債証券	第250回利付国債 (10年)	275,500,000	100.38	276,564,560	100.15	275,938,045	0.500	2013/06/20	16.61

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

## 〔参考情報〕

基準日2013年1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



基準価額	11,377円
純資産総額	4億円

## ★ 分配の推移

決算期	分配金
2012年12月	0円
2011年12月	0円
2010年12月	0円
2009年12月	0円
2008年12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。  
※直近5計算期間を記載しています。



## &lt; 2020 &gt;



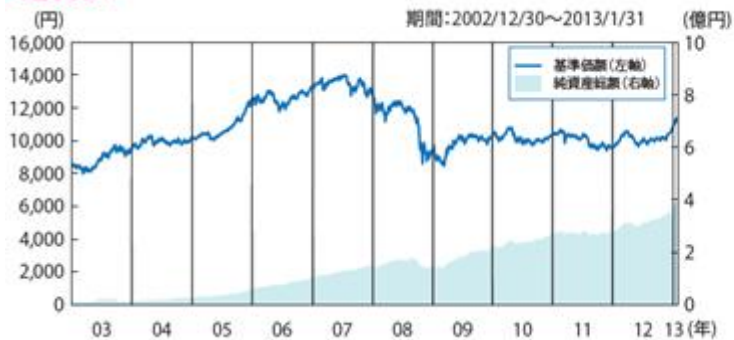
基準価額	11,885円
純資産総額	6億円

## ★ 分配の推移

決算期	分配金
2012年12月	0円
2011年12月	0円
2010年12月	0円
2009年12月	0円
2008年12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。  
※直近5計算期間を記載しています。

## &lt; 2030 &gt;



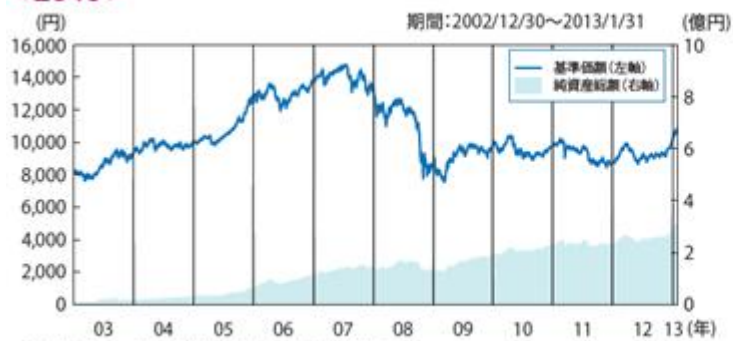
基準価額	11,432円
純資産総額	4億円

## ★ 分配の推移

決算期	分配金
2012年12月	0円
2011年12月	0円
2010年12月	0円
2009年12月	0円
2008年12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。  
※直近5計算期間を記載しています。

## &lt; 2040 &gt;



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

基準価額	10,887円
純資産総額	3億円

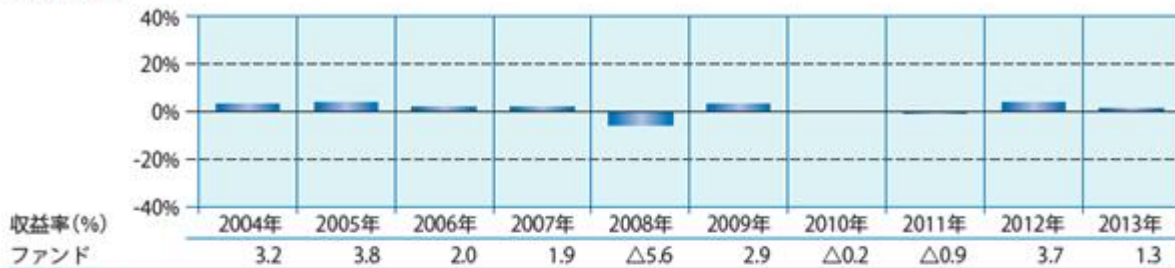
## ★ 分配の推移

決算期	分配金
2012年12月	0円
2011年12月	0円
2010年12月	0円
2009年12月	0円
2008年12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。  
※直近5計算期間を記載しています。

## ★ 年間収益率の推移（暦年ベース）

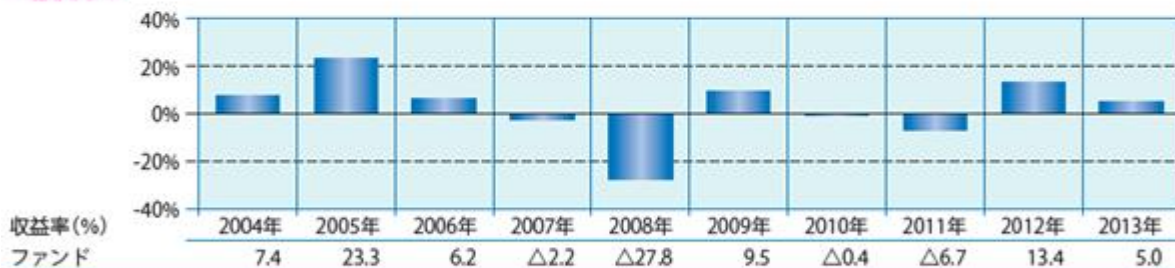
<2010>



<2020>



<2030>



<2040>



2013年のファンドの収益率は、年初から2013年1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）当ファンドの募集は、確定拠出年金および変額保険・変額年金の特別勘定による取得の申込みのみを対象とします。

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

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

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

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

消させていただく場合があります。

- (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。

#### ロ 申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。  
ただし、累積投資契約に基づく収益分配金の再投資の場合は、各計算期末の基準価額となります。

#### ハ 申込手数料

無手数料です。

#### ニ 申込単位

お申込単位の詳細は、取扱いの販売会社または委託会社にお問い合わせください。

#### ホ 照会先

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	<a href="http://www.smam-jp.com">http://www.smam-jp.com</a>

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

#### ヘ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

#### ト 払込期日

取得申込者は、申込金額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数）を、販売会社の指定の期日までに、指定の方法でお支払いください。  
各取得申込みにかかる発行価額の総額は、追加信託が行われる日に、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

## 2【換金（解約）手続等】

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

お買付けの販売会社にお申し出ください。

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

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

一部解約金は、解約請求受付日から起算して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の請求を取り消すことがあります。この場合、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けた

ものとして、上記に準じた取扱いとなります。

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

##### イ 基準価額の算出方法

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

##### 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、それぞれ「TY2010」、「TY2020」、「TY2030」、「TY2040」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13年3月13日から下記「(5)その他 イ 信託の終了」に記載された各事由が生じた場合における信託終了の日までとなります。

#### (4)【計算期間】

毎年12月21日から翌年12月20日までとすることを原則としますが、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始するものとします。なお、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

#### (5)【その他】

##### イ 信託の終了

##### (イ) 信託契約の解約

- a. 委託会社は、当ファンドの信託契約を解約することが受益者にとって有利であると認めるとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、上記aの事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を当ファンドの知られたる受益者に対して交付します。ただし、当ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- c. 上記bの公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。

- d. 上記cの一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、信託契約の解約をしません。
  - e. 委託会社は、当ファンドの信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
  - f. 上記c～eまでの取扱いは、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記cの一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。
- (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背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。
  - 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、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。
- ロ 収益分配金、償還金の支払い
- (イ) 収益分配金
- a. 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。分配対象額が少額の場合等には委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
  - b. 分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として決算日から起算して5営業日目まで)から、販売会社において、決算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、)に支払われます。
- ただし、分配金自動再投資コースにかかる収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、累積投資契約に基づいて、毎計算期間終了日の翌営業日に再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。
- (ロ) 償還金
- 償還金は、信託終了後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として償還日から起算して5営業日目まで)から、販売会社において、原則として、償還日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、)に支払われます。

## 八 信託約款の変更

- (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ができるものとし、あらかじめ、変更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)の変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を当ファンドの知られたる受益者に交付します。ただし、当ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- (ハ) 上記(ロ)の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- (ニ) 上記(ハ)の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、(イ)の信託約款の変更をしません。
- (ホ) 委託会社は、信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

## 二 反対者の買取請求権

当ファンドの信託契約の解約または重大な信託約款の変更が行われる場合において、それぞれの手続きにおいて設けられる異議申立期間内に委託会社に異議を述べた受益者は、自己に帰属する受益権を、受託会社に信託財産をもって買い取るよう請求をすることができます。

## ホ 販売会社との契約の更改等

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

## へ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

## ト 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

## 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」を作成します。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。

## 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て支払われます。

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

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

#### ロ 償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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を行おうとする場合において、当該解約または信託約款変更に関する異議のある受益者は、それぞれの手続きにおいて設けられる異議申立期間中に異議を申し立てることができます。異議を申し立てた受益者の受益権の口数が、受益権の総口数の過半数となる場合は、当該解約または信託約款変更は行われません。

当該解約または信託約款変更が行われる場合において、前述の異議を申し立てた受益者は、委託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買い取るべき旨の請求ができます。

#### 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12期（平成23年12月21日から平成24年12月20日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。





## 1【財務諸表】

【三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010】

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第11期 （平成23年12月20日現在）	第12期 （平成24年12月20日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	2,176,605	1,708,470
投資信託受益証券	327,923,116	347,763,826
未収利息	2	2
流動資産合計	330,099,723	349,472,298
資産合計	330,099,723	349,472,298
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金	-	330,000
未払受託者報酬	70,195	71,973
未払委託者報酬	631,731	647,740
その他未払費用	5,209	5,335
流動負債合計	707,135	1,055,048
負債合計	707,135	1,055,048
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	304,481,336	311,143,756
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	24,911,252	37,273,494
元本等合計	329,392,588	348,417,250
純資産合計	329,392,588	348,417,250
負債純資産合計	330,099,723	349,472,298

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期	第12期
	自 平成22年12月21日 至 平成23年12月20日	自 平成23年12月21日 至 平成24年12月20日
<b>営業収益</b>		
受取利息	670	472
有価証券売買等損益	2,445,894	13,199,710
営業収益合計	2,445,224	13,200,182
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	139,501	142,665
委託者報酬	1,255,366	1,283,901
その他費用	10,359	10,582
営業費用合計	1,405,226	1,437,148
営業利益又は営業損失（ ）	3,850,450	11,763,034
経常利益又は経常損失（ ）	3,850,450	11,763,034
当期純利益又は当期純損失（ ）	3,850,450	11,763,034
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（ ）	194,569	485,596
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	27,936,041	24,911,252
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,681,534	3,274,542
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,681,534	3,274,542
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,050,442	2,189,738
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,050,442	2,189,738
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	24,911,252	37,273,494

( 3 ) 【注記表】  
( 重要な会計方針の注記 )

項目	第12期
	自 平成23年12月21日 至 平成24年12月20日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

( 追加情報 )

第12期
自 平成23年12月21日 至 平成24年12月20日
<p>当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。</p>

( 貸借対照表に関する注記 )

項目	第11期	第12期
	( 平成23年12月20日現在 )	( 平成24年12月20日現在 )
1. 受益権総数	当計算期間の末日における受益権の総数 304,481,336口	当計算期間の末日における受益権の総数 311,143,756口
2. 1単位当たり純資産額	1.0818円 ( 1万口 = 10,818円 )	1.1198円 ( 1万口 = 11,198円 )

( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第11期	第12期
	自 平成22年12月21日 至 平成23年12月20日	自 平成23年12月21日 至 平成24年12月20日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（0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（25,635,379円）、および分配準備積立金（6,922,226円）より、分配対象収益は32,557,605円（1万口当たり1,069.28円）であります。分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（471円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（4,326,169円）、収益調整金（26,916,337円）、および分配準備積立金（6,353,698円）より、分配対象収益は37,596,675円（1万口当たり1,208.33円）であります。分配を行っておりません。</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	第12期 自 平成23年12月21日 至 平成24年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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	第12期 (平成24年12月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第11期（自平成22年12月21日至平成23年12月20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	2,242,142円
合計	2,242,142円

第12期（自平成23年12月21日至平成24年12月20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	11,574,249円
合計	11,574,249円

（デリバティブ取引に関する注記）

第11期（平成23年12月20日現在）

該当事項はありません。

第12期（平成24年12月20日現在）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第11期（自平成22年12月21日至平成23年12月20日）

該当事項はありません。

第12期（自平成23年12月21日至平成24年12月20日）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項目	第11期 (平成23年12月20日現在)	第12期 (平成24年12月20日現在)
期首元本額	296,815,884円	304,481,336円
期中追加設定元本額	50,688,810円	33,162,080円
期中一部解約元本額	43,023,358円	26,499,660円

## (4) 【附属明細表】

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託 受益証券	S M A M ・ 国内株式パッシブ・ファンド (適格機関投資家専用)	24,292,900	18,448,028	
	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)	15,496,367	17,814,623	
	S M A M ・ 年金外国債券パッシブ・ ファンド<適格機関投資家限定>	14,103,512	17,742,218	
	S M A M ・ 年金国内債券パッシブファンド <適格機関投資家限定>	103,793,729	120,680,968	
	S M A M ・ マネーインカムファンド <適格機関投資家限定>	171,738,430	173,077,989	
	投資信託受益証券 小計		329,424,938	347,763,826
合計		329,424,938	347,763,826	

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。

【三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020】  
（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第11期 （平成23年12月20日現在）	第12期 （平成24年12月20日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	3,202,529	5,128,349
投資信託受益証券	501,454,578	603,295,046
未収利息	4	7
流動資産合計	504,657,111	608,423,402
資産合計	504,657,111	608,423,402
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金	-	1,220,000
未払受託者報酬	105,700	117,384
未払委託者報酬	1,189,055	1,320,447
その他未払費用	7,862	8,747
流動負債合計	1,302,617	2,666,578
負債合計	1,302,617	2,666,578
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	480,944,044	530,467,204
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	22,410,450	75,289,620
元本等合計	503,354,494	605,756,824
純資産合計	503,354,494	605,756,824
負債純資産合計	504,657,111	608,423,402

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期	第12期
	自 平成22年12月21日 至 平成23年12月20日	自 平成23年12月21日 至 平成24年12月20日
<b>営業収益</b>		
受取利息	948	1,288
有価証券売買等損益	16,646,287	51,196,468
営業収益合計	16,645,339	51,197,756
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	208,000	227,626
委託者報酬	2,339,817	2,560,601
その他費用	15,463	16,955
営業費用合計	2,563,280	2,805,182
営業利益又は営業損失（ ）	19,208,619	48,392,574
経常利益又は経常損失（ ）	19,208,619	48,392,574
当期純利益又は当期純損失（ ）	19,208,619	48,392,574
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（ ）	378,771	1,366,839
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	36,873,731	22,410,450
剰余金増加額又は欠損金減少額	7,001,974	7,614,759
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	7,001,974	7,614,759
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,635,407	1,761,324
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,635,407	1,761,324
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	22,410,450	75,289,620



( 3 ) 【注記表】  
( 重要な会計方針の注記 )

項目	第12期 自 平成23年12月21日 至 平成24年12月20日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

( 追加情報 )

第12期 自 平成23年12月21日 至 平成24年12月20日
<p>当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。</p>

( 貸借対照表に関する注記 )

項目	第11期 ( 平成23年12月20日現在 )	第12期 ( 平成24年12月20日現在 )
1. 受益権総数	当計算期間の末日における受益権の総数 480,944,044口	当計算期間の末日における受益権の総数 530,467,204口
2. 1単位当たり純資産額	1.0466円 ( 1万口 = 10,466円 )	1.1419円 ( 1万口 = 11,419円 )

( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第11期 自 平成22年12月21日 至 平成23年12月20日	第12期 自 平成23年12月21日 至 平成24年12月20日
分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（0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（100,233,549円）、および分配準備積立金（13,574,975円）より、分配対象収益は113,808,524円（1万口当たり2,366.35円）であります。が、分配を行っておりません。</p>	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（1,284円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（8,164,646円）、収益調整金（112,916,188円）、および分配準備積立金（12,611,244円）より、分配対象収益は133,693,362円（1万口当たり2,520.29円）であります。が、分配を行っておりません。</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	第12期 自 平成23年12月21日 至 平成24年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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	第12期 (平成24年12月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第11期（自平成22年12月21日至平成23年12月20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	16,436,929円
合計	16,436,929円

第12期（自平成23年12月21日至平成24年12月20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	47,935,838円
合計	47,935,838円

（デリバティブ取引に関する注記）

第11期（平成23年12月20日現在）

該当事項はありません。

第12期（平成24年12月20日現在）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第11期（自平成22年12月21日至平成23年12月20日）

該当事項はありません。

第12期（自平成23年12月21日至平成24年12月20日）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項目	第11期 （平成23年12月20日現在）	第12期 （平成24年12月20日現在）
期首元本額	423,280,286円	480,944,044円
期中追加設定元本額	87,891,359円	85,709,743円
期中一部解約元本額	30,227,601円	36,186,583円

## (4) 【附属明細表】

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託 受益証券	S M A M ・ 国内株式パッシブ・ファンド （適格機関投資家専用）	135,954,036	103,243,494	
	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）	55,115,333	63,360,586	
	S M A M ・ 年金外国債券パッシブ・ ファンド＜適格機関投資家限定＞	68,504,202	86,178,286	
	S M A M ・ 年金国内債券パッシブファンド ＜適格機関投資家限定＞	287,082,755	333,791,119	
	S M A M ・ マネーインカムファンド ＜適格機関投資家限定＞	16,592,143	16,721,561	
	投資信託受益証券 小計		563,248,469	603,295,046
合計		563,248,469	603,295,046	

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。

【三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2030】  
(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第11期 (平成23年12月20日現在)	第12期 (平成24年12月20日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	1,712,845	4,953,818
投資信託受益証券	272,120,615	365,494,560
未収利息	2	6
流動資産合計	273,833,462	370,448,384
資産合計	273,833,462	370,448,384
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金	125,000	2,270,000
未払受託者報酬	57,196	68,914
未払委託者報酬	643,404	775,278
その他未払費用	4,224	5,109
流動負債合計	829,824	3,119,301
負債合計	829,824	3,119,301
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	286,603,183	341,180,499
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	13,599,545	26,148,584
元本等合計	273,003,638	367,329,083
純資産合計	273,003,638	367,329,083
負債純資産合計	273,833,462	370,448,384

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期	第12期
	自 平成22年12月21日 至 平成23年12月20日	自 平成23年12月21日 至 平成24年12月20日
<b>営業収益</b>		
受取利息	541	725
有価証券売買等損益	20,090,784	40,793,945
営業収益合計	20,090,243	40,794,670
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	114,283	131,406
委託者報酬	1,285,632	1,478,276
その他費用	8,455	9,727
営業費用合計	1,408,370	1,619,409
営業利益又は営業損失（ ）	21,498,613	39,175,261
経常利益又は経常損失（ ）	21,498,613	39,175,261
当期純利益又は当期純損失（ ）	21,498,613	39,175,261
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（ ）	282,606	603,814
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	7,962,769	13,599,545
剰余金増加額又は欠損金減少額	269,067	1,176,682
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	454,678
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	269,067	722,004
剰余金減少額又は欠損金増加額	615,374	-
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	615,374	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	13,599,545	26,148,584

## ( 3 ) 【注記表】

## ( 重要な会計方針の注記 )

項目	第12期
	自 平成23年12月21日 至 平成24年12月20日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

## ( 追加情報 )

第12期
自 平成23年12月21日 至 平成24年12月20日
<p>当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。</p>

## ( 貸借対照表に関する注記 )

項目	第11期	第12期
	( 平成23年12月20日現在 )	( 平成24年12月20日現在 )
1. 受益権総数	当計算期間の末日における受益権の総数 286,603,183口	当計算期間の末日における受益権の総数 341,180,499口
2. 元本の欠損	「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 13,599,545円	
3. 1単位当たり純資産額	0.9525円 ( 1万口 = 9,525円 )	1.0766円 ( 1万口 = 10,766円 )

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第11期	第12期
	自 平成22年12月21日 至 平成23年12月20日	自 平成23年12月21日 至 平成24年12月20日

分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0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(82,434,026円)、および分配準備積立金(10,712,802円)より、分配対象収益は93,146,828円(1万口当たり3,250.02円)であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(725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(100,534,919円)、および分配準備積立金(10,349,639円)より、分配対象収益は110,885,283円(1万口当たり3,250.04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12期 自 平成23年12月21日 至 平成24年12月20日	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。	
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>	



3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限値、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12期 (平成24年12月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（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11期（自平成22年12月21日 至 平成23年12月20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	19,978,754円
合計	19,978,754円

第12期（自平成23年12月21日 至 平成24年12月20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	39,283,652円
合計	39,283,652円

（デリバティブ取引に関する注記）

第11期（平成23年12月20日現在）

該当事項はありません。

第12期（平成24年12月20日現在）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第11期（自平成22年12月21日 至 平成23年12月20日）

該当事項はありません。

第12期（自平成23年12月21日 至 平成24年12月20日）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項目	第11期 （平成23年12月20日現在）	第12期 （平成24年12月20日現在）
期首元本額	258,835,963円	286,603,183円
期中追加設定元本額	47,890,237円	65,335,257円
期中一部解約元本額	20,123,017円	10,757,941円

（4）【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託 受益証券	S M A M・国内株式パッシブ・ファンド （適格機関投資家専用）	149,818,639	113,772,274	
	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）	52,145,754	59,946,758	
	S M A M・年金外国債券パッシブ・ ファンド<適格機関投資家限定>	31,837,999	40,052,202	
	S M A M・年金国内債券パッシブファンド <適格機関投資家限定>	124,748,441	145,045,012	

S M A M ・ マネーインカムファンド < 適格機関投資家限定 >	6,626,627	6,678,314	
投資信託受益証券 小計	365,177,460	365,494,560	
合 計	365,177,460	365,494,560	

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。

## 【三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040】

## （1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第11期 （平成23年12月20日現在）	第12期 （平成24年12月20日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	1,472,142	3,091,847
投資信託受益証券	229,552,944	286,976,450
未収入金	341,000	-
未収利息	2	4
流動資産合計	231,366,088	290,068,301
資産合計	231,366,088	290,068,301
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金	-	1,000,000
未払解約金	335,875	738,071
未払受託者報酬	49,138	54,429
未払委託者報酬	552,700	612,203
その他未払費用	3,631	4,019
流動負債合計	941,344	2,408,722
負債合計	941,344	2,408,722
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	268,375,847	286,580,741
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	37,951,103	1,078,838
元本等合計	230,424,744	287,659,579
純資産合計	230,424,744	287,659,579
負債純資産合計	231,366,088	290,068,301

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第11期	第12期
	自 平成22年12月21日 至 平成23年12月20日	自 平成23年12月21日 至 平成24年12月20日
<b>営業収益</b>		
受取利息	496	512
有価証券売買等損益	27,867,218	41,924,506
営業収益合計	27,866,722	41,925,018
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	98,504	106,882
委託者報酬	1,108,017	1,202,254
その他費用	7,281	7,890
営業費用合計	1,213,802	1,317,026
営業利益又は営業損失（ ）	29,080,524	40,607,992
経常利益又は経常損失（ ）	29,080,524	40,607,992
当期純利益又は当期純損失（ ）	29,080,524	40,607,992
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（ ）	1,013,324	1,912,845
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	6,851,386	37,951,103
剰余金増加額又は欠損金減少額	613,580	4,225,404
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	613,580	4,225,404
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,646,097	3,890,610
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,646,097	3,890,610
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	37,951,103	1,078,838

## ( 3 ) 【注記表】

## ( 重要な会計方針の注記 )

項目	第12期
	自 平成23年12月21日 至 平成24年12月20日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

## ( 追加情報 )

第12期
自 平成23年12月21日 至 平成24年12月20日
<p>当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。</p>

## ( 貸借対照表に関する注記 )

項目	第11期	第12期
	( 平成23年12月20日現在 )	( 平成24年12月20日現在 )
1. 受益権総数	当計算期間の末日における受益権の総数 268,375,847口	当計算期間の末日における受益権の総数 286,580,741口
2. 元本の欠損	「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 37,951,103円	
3. 1単位当たり純資産額	0.8586円 ( 1万口 = 8,586円 )	1.0038円 ( 1万口 = 10,038円 )

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項目	第11期	第12期
	自 平成22年12月21日 至 平成23年12月20日	自 平成23年12月21日 至 平成24年12月20日

分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(0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(79,705,398円)、および分配準備積立金(8,401,106円)より、分配対象収益は88,106,504円(1万口当たり3,282.95円)であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(508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(86,569,289円)、および分配準備積立金(7,513,734円)より、分配対象収益は94,083,531円(1万口当たり3,282.96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12期 自 平成23年12月21日 至 平成24年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限値、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12期 (平成24年12月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（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11期（自平成22年12月21日 至 平成23年12月20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	27,692,955円
合計	27,692,955円

第12期（自平成23年12月21日 至 平成24年12月20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	39,881,123円
合計	39,881,123円

（デリバティブ取引に関する注記）

第11期（平成23年12月20日現在）

該当事項はありません。

第12期（平成24年12月20日現在）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第11期（自平成22年12月21日 至 平成23年12月20日）

該当事項はありません。

第12期（自平成23年12月21日 至 平成24年12月20日）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項目	第11期 （平成23年12月20日現在）	第12期 （平成24年12月20日現在）
期首元本額	238,807,427円	268,375,847円
期中追加設定元本額	49,611,557円	48,930,836円
期中一部解約元本額	20,043,137円	30,725,942円

（４）【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託 受益証券	S M A M・国内株式パッシブ・ファンド （適格機関投資家専用）	177,792,214	135,015,407	
	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）	49,546,990	56,959,219	
	S M A M・年金外国債券パッシブ・ ファンド＜適格機関投資家限定＞	22,461,085	28,256,044	
	S M A M・年金国内債券パッシブファンド ＜適格機関投資家限定＞	52,776,877	61,363,674	

SMAM・マネーインカムファンド <適格機関投資家限定>	5,340,451	5,382,106	
投資信託受益証券 小計	307,917,617	286,976,450	
合計	307,917,617	286,976,450	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
該当事項はありません。

（参考情報）

[「SMAM・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）」の状況](#)

[「SMAM・年金国内債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>」の状況](#)

[「SMAM・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）」の状況](#)

[「SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>」の状況](#)

[「SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>」の状況](#)

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

## a. 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010

平成25年1月31日現在

資産総額	359,716,535 円
負債総額	2,984,859 円
純資産総額（ - ）	356,731,676 円
発行済口数	313,548,961 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1377 円
（ 1万口当たり純資産額	11,377 円）

## b. 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020

平成25年1月31日現在

資産総額	641,117,016 円
負債総額	1,346,284 円
純資産総額（ - ）	639,770,732 円
発行済口数	538,308,275 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1885 円
（ 1万口当たり純資産額	11,885 円）

## c. 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030

平成25年1月31日現在

資産総額	397,412,858 円
負債総額	618,281 円
純資産総額（ - ）	396,794,577 円
発行済口数	347,105,135 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1432 円
（ 1万口当たり純資産額	11,432 円）

## d. 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040

平成25年1月31日現在

資産総額	320,370,432 円
負債総額	3,768,398 円
純資産総額（ - ）	316,602,034 円
発行済口数	290,818,394 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0887 円
（ 1万口当たり純資産額	10,887 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。

該当事項はありません。

□ 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、
- 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、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、
- 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、

ヘ 償還金

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

ト 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### イ 資本金の額および株式数

	平成25年1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、

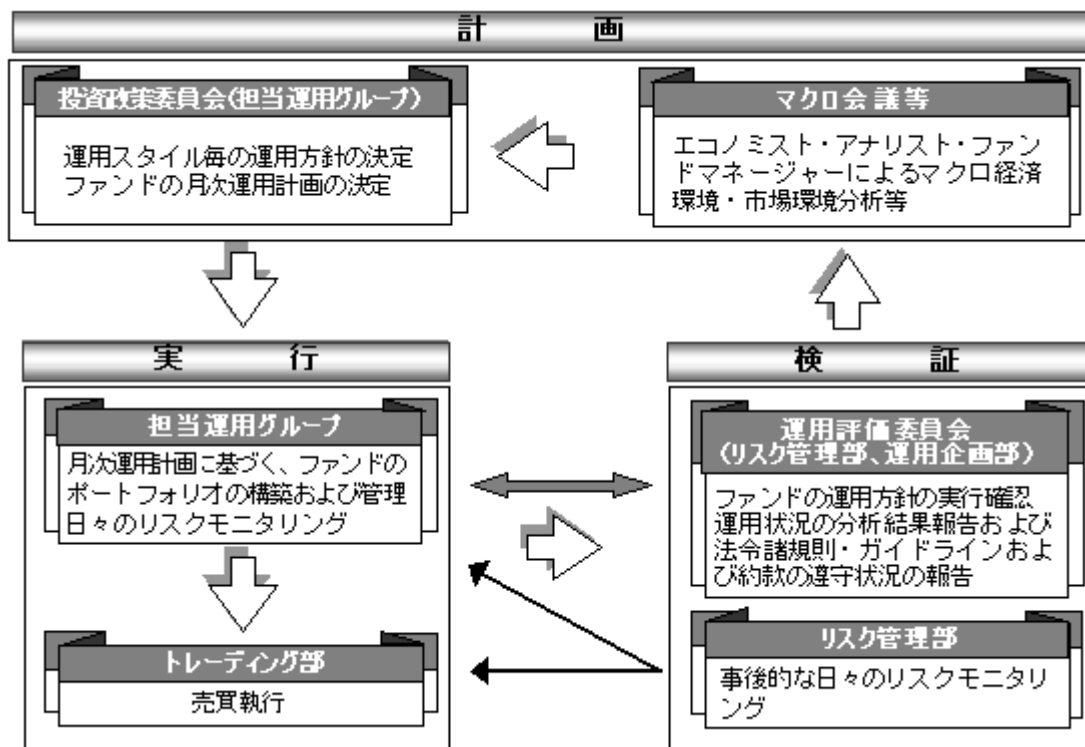
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

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。

##### ニ 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25年1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25年1月31日現在、単位：百万円）

		本数	純資産総額
株式投資信託	単位型	20 ( 4 )	31,859 ( 18,420 )
	追加型	320 ( 138 )	5,069,835 ( 3,328,831 )
	計	340 ( 142 )	5,101,694 ( 3,347,251 )
公社債投資信託	単位型	0 ( 0 )	0 ( 0 )
	追加型	0 ( 0 )	0 ( 0 )
	計	0 ( 0 )	0 ( 0 )
合計		340 ( 142 )	5,101,694 ( 3,347,251 )

( )内は、私募投資信託分であり、内書き表記しております。

### 3【委託会社等の経理状況】

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

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

2 当社は、第26期（平成22年4月1日から平成23年3月31日まで）及び第27期（平成23年4月1日から平成24年3月31日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の監査を受けており、第28期中間会計期間（平成24年4月1日から平成24年9月30日まで）の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の中間監査を受けております。

## (1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

		第 26 期 (平成23年3月31日)	第 27 期 (平成24年3月31日)
(資産の部)			
流動資産			
現金及び預金	2	17,127,600	15,970,870
有価証券		3,999,722	3,999,305
前払費用		264,910	259,411
未収入金		607,623	32,426
未収委託者報酬		3,712,698	3,392,765
未収運用受託報酬		326,523	305,910
未収投資助言報酬	2	412,606	452,618
未収収益		27,051	14,092
繰延税金資産		241,975	155,946
その他の流動資産		1,299	9,011
流動資産計		26,722,012	24,592,358
固定資産			
有形固定資産			
有形固定資産	1		
建物		148,698	130,525
器具備品		232,209	201,264
有形固定資産合計		380,907	331,789
無形固定資産			
無形固定資産	1		
ソフトウェア		-	241,251
ソフトウェア仮勘定		-	32,852
電話加入権		138	126
商標権		4,216	2,271
無形固定資産合計		4,354	276,502
投資その他の資産			
投資有価証券		4,980,828	6,720,330
関係会社株式		234,921	234,921
長期差入保証金		681,432	681,196
長期前払費用		10,561	16,958
会員権		20,113	9,480
繰延税金資産		606,449	589,332
投資その他の資産合計		6,534,307	8,252,219
固定資産計		6,919,569	8,860,511
資産合計		33,641,581	33,452,870



	第 26 期 (平成23年 3月31日)	第 27 期 (平成24年 3月31日)
( 負 債 の 部 )		
流動負債		
預り金	47,190	47,840
未払金		
未払収益分配金	681	403
未払償還金	21,638	106,771
未払手数料	2 1,971,626	1,893,658
その他未払金	64,551	86,141
未払費用	824,240	930,998
未払消費税等	126,666	35,683
未払法人税等	1,004,164	264,114
賞与引当金	327,914	279,981
その他の流動負債	-	10
流動負債計	4,388,674	3,645,603
固定負債		
退職給付引当金	1,310,821	1,489,315
固定負債計	1,310,821	1,489,315
負債合計	5,699,496	5,134,919
( 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	15,381,398	15,791,435
利益剰余金合計	17,202,602	17,612,639
株主資本計	27,831,586	28,241,623
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	110,498	76,327
評価・換算差額等計	110,498	76,327
純資産合計	27,942,085	28,317,951
負債・純資産合計	33,641,581	33,452,870

## （２）【損益計算書】

（単位：千円）

	第 26 期 （自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日）	第 27 期 （自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日）
営業収益		
委託者報酬	27,350,519	25,467,198
運用受託報酬	2,113,027	2,001,039
投資助言報酬	1,828,087	1,743,437
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	35,635	31,647
サービス支援手数料	234,885	99,134
その他	26,930	48,776
営業収益計	31,594,086	29,396,234
営業費用		
支払手数料	14,161,927	13,259,090
広告宣伝費	482,728	475,028
公告費	4,634	4,092
調査費		
調査費	537,254	503,839
委託調査費	2,115,042	2,285,064
営業雑経費		
通信費	34,433	35,155
印刷費	266,803	199,733
協会費	23,235	28,233
諸会費	11,346	12,025
情報機器関連費	2,066,205	1,855,475
販売促進費	27,670	28,021
その他	79,571	123,714
営業費用計	19,810,852	18,809,475
一般管理費		
給料		
役員報酬	155,867	154,738
給料・手当	4,342,937	4,427,312
賞与	983,434	937,970
賞与引当金繰入額	327,914	279,981
交際費	21,460	20,938
寄付金	31	10,026
事務委託費	220,738	245,311
旅費交通費	219,278	230,691
租税公課	87,674	80,136
不動産賃借料	677,468	683,098
退職給付費用	199,545	205,957
固定資産減価償却費	100,356	170,410
諸経費	250,817	268,760
一般管理費計	7,587,526	7,715,334

営業利益		4,195,707	2,871,423
営業外収益			
受取配当金		34,115	29,042
有価証券利息		3,603	3,731
受取利息	1	7,877	5,916
為替差益		4,753	-
時効成立分配金・償還金		3,076	3,563
原稿・講演料		3,485	2,745
還付加算金		1,645	-
雑収入		7,033	5,096
営業外収益計		65,590	50,095
営業外費用			
為替差損		-	15,834
時効成立後支払分配金・償還金		659	-
営業外費用計		659	15,834
経常利益		4,260,638	2,905,684
特別利益			
投資有価証券償還益		7	-
投資有価証券売却益		71,400	13,806
受取和解金		-	108,451
特別利益計		71,407	122,258
特別損失			
固定資産除却損	2	17,318	12,873
投資有価証券償還損		2,679	3,180
投資有価証券評価損		-	301
投資有価証券売却損		20,822	6,578
関係会社株式評価損		1,256	-
ゴルフ会員権評価損		-	10,633
特別損失計		42,077	33,566
税引前当期純利益		4,289,968	2,994,376
法人税、住民税及び事業税		1,852,053	1,195,768
法人税等調整額		93,549	136,130
法人税等合計		1,758,503	1,331,898
当期純利益		2,531,465	1,662,477

## (3)【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	第 26 期 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月 31日)	第 27 期 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月 31日)
株主資本		
資本金		
当期首残高	2,000,000	2,000,000
当期末残高	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金		
当期首残高	8,628,984	8,628,984
当期末残高	8,628,984	8,628,984
資本剰余金合計		
当期首残高	8,628,984	8,628,984
当期末残高	8,628,984	8,628,984
利益剰余金		
利益準備金		
当期首残高	284,245	284,245
当期末残高	284,245	284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金		
当期首残高	60,000	60,000
当期末残高	60,000	60,000
別途積立金		
当期首残高	1,476,959	1,476,959
当期末残高	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金		
当期首残高	14,172,932	15,381,398
当期変動額		
剰余金の配当	1,323,000	1,252,440
当期純利益	2,531,465	1,662,477
当期変動額合計	1,208,465	410,037
当期末残高	15,381,398	15,791,435
利益剰余金合計		
当期首残高	15,994,137	17,202,602
当期変動額		
剰余金の配当	1,323,000	1,252,440
当期純利益	2,531,465	1,662,477
当期変動額合計	1,208,465	410,037
当期末残高	17,202,602	17,612,639
株主資本合計		
当期首残高	26,623,121	27,831,586
当期変動額		
剰余金の配当	1,323,000	1,252,440
当期純利益	2,531,465	1,662,477

当期変動額合計	1,208,465	410,037
当期末残高	27,831,586	28,241,623
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	82,556	110,498
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	27,941	34,170
当期変動額合計	27,941	34,170
当期末残高	110,498	76,327
評価・換算差額合計		
当期首残高	82,556	110,498
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	27,941	34,170
当期変動額合計	27,941	34,170
当期末残高	110,498	76,327
純資産合計		
当期首残高	26,705,677	27,942,085
当期変動額		
剰余金の配当	1,323,000	1,252,440
当期純利益	2,531,465	1,662,477
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	27,941	34,170
当期変動額合計	1,236,407	375,866
当期末残高	27,942,085	28,317,951

## 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に基づき計上しております。

過去勤務債務については、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。

## 追加情報

当事業年度の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

## 注 記 事 項

## (貸借対照表関係)

第26期 (平成23年3月31日)	第27期 (平成24年3月31日)
<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建 物 191,415千円</p> <p>器具備品 774,482千円</p> <p>無形固定資産の減価償却累計額</p> <p>電話加入権 95千円</p> <p>商標権 15,226千円</p>	<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建 物 210,710千円</p> <p>器具備品 624,552千円</p> <p>無形固定資産の減価償却累計額</p> <p>ソフトウェア 127,910千円</p> <p>電話加入権 107千円</p> <p>商標権 17,170千円</p>
<p>2 関係会社に対する債権債務</p> <p>現金及び預金 11,201,422千円</p> <p>未収投資助言報酬 293,061千円</p> <p>未払手数料 469,104千円</p>	<p>2 関係会社に対する債権債務</p> <p>現金及び預金 10,360,214千円</p> <p>未収投資助言報酬 283,244千円</p> <p>未払手数料 436,830千円</p>
<p>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行と当座貸越契約を締結しております。</p> <p>当事業年度末における当座貸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。</p> <p>当座貸越極度額の総額 10,000,000千円</p> <p>借入実行残高 - 千円</p> <p>差引額 10,000,000千円</p>	<p>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行と当座貸越契約を締結しております。</p> <p>当事業年度末における当座貸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。</p> <p>当座貸越極度額の総額 10,000,000千円</p> <p>借入実行残高 - 千円</p> <p>差引額 10,000,000千円</p>
<p>4 当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York)Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成27年6月までの賃借料総額74,617千円の支払保証を行っております。</p>	<p>4 当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York)Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成27年6月までの賃借料総額56,653千円の支払保証を行っております。</p>

## (損益計算書関係)

第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
<p>1 関係会社との取引に係るもの</p> <p>受取利息 3,867千円</p>	<p>1 関係会社との取引に係るもの</p> <p>受取利息 2,455千円</p>
<p>2 固定資産除却損は、建物9,847千円、器具備品7,471千円であります。</p>	<p>2 固定資産除却損は、器具備品12,873千円であります。</p>

(株主資本等変動計算書関係)

第26期(自 平成22年4月1日 至 平成23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22年6月24日 定時株主総会	普通株式	1,323,000	75,000	平成22年 3月31日	平成22年 6月25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23年6月24日開催の第26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23年6月24日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	1,252,440	71,000	平成23年 3月31日	平成23年 6月27日

第27期(自 平成23年4月1日 至 平成24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23年6月24日 定時株主総会	普通株式	1,252,440	71,000	平成23年 3月31日	平成23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24年6月25日開催の第27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24年6月25日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	829,080	47,000	平成24年 3月31日	平成24年 6月26日



## (リース取引関係)

第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
1.オペレーティング・リース取引 (借主側) 未経過リース料(解約不能のもの)(単位:千円) 1年以内           672,700 1年超             958,593 合計               1,631,293	1.オペレーティング・リース取引 (借主側) 未経過リース料(解約不能のもの)(単位:千円) 1年以内           672,641 1年超             286,301 合計               958,942

## (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。

有価証券及び投資有価証券については、主に満期保有目的の債券及び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、全額出資の海外子会社の株式であり、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。

満期保有目的の債券は、余資運用規則に基づき、短期の国債のみを対象としているため、信用リスクは僅少であります。

有価証券、投資有価証券及び子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

有価証券及び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、総務人事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

第26期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

平成23年3月31日における貸借対照表計上額、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）。

(単位：千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	17,127,600	17,127,600	-
(2)未収委託者報酬	3,712,698	3,712,698	-
(3)未収運用受託報酬	326,523	326,523	-
(4)未収投資助言報酬	412,606	412,606	-
(5)有価証券及び投資有価証券			
満期保有目的の債券	3,999,722	3,999,600	122
その他有価証券	4,932,087	4,932,087	-
(6)長期差入保証金	681,432	681,432	-
資産計	31,192,671	31,192,549	122
(1)未払金			
未払手数料	1,971,626	1,971,626	-
負債計	1,971,626	1,971,626	-

(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)未収委託者報酬、(3)未収運用受託報酬及び(4)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。

(5)有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、債券については業界団体が公表する売買参考統計値等によって、投資信託等については取引所の価格、取引金融機関から提示された価格及び公表されている基準価格によっております。

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

(6)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)未払金

未払手数料

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

(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

(単位：千円)

	貸借対照表計上額
その他有価証券	
非上場株式	298
投資証券	48,443
合計	48,741
子会社株式	
非上場株式	234,921
合計	234,921

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、「(5) その他有価証券」には含めておりません。

子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。また、上記の表中にある「貸借対照表計上額」は、減損処理後の帳簿価額です。当事業年度における減損処理額は、1,256千円です。

(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

(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	17,127,600	-	-	-
未収委託者報酬	3,712,698	-	-	-
未収運用受託報酬	326,523	-	-	-
未収投資助言報酬	412,606	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券	4,000,000	-	-	-
その他有価証券のうち				
満期があるもの	-	-	-	-
長期差入保証金	13,841	667,590	-	-
合計	25,593,271	667,590	-	-

第27期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

平成24年3月31日における貸借対照表計上額、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）。

(単位：千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	15,970,870	15,970,870	-
(2)未収委託者報酬	3,392,765	3,392,765	-
(3)未収運用受託報酬	305,910	305,910	-
(4)未収投資助言報酬	452,618	452,618	-
(5)有価証券及び投資有価証券			
満期保有目的の債券	3,999,305	3,999,200	105
その他有価証券	6,671,589	6,671,589	-
(6)長期差入保証金	681,196	681,196	-
資産計	31,474,256	31,474,150	105
(1)未払金			
未払手数料	1,893,658	1,893,658	-
負債計	1,893,658	1,893,658	-

(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)未収委託者報酬、(3)未収運用受託報酬及び(4)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。

(5)有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、債券については業界団体が公表する売買参考統計値等によって、投資信託等については取引所の価格、取引金融機関から提示された価格及び公表されている基準価格によっております。

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

(6)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)未払金

未払手数料

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

(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

(単位：千円)

	貸借対照表計上額
その他有価証券	
非上場株式	298
投資証券	48,443
合計	48,741
子会社株式	
非上場株式	234,921
合計	234,921

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、「(5) その他有価証券」には含めておりません。

子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

(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	15,970,870	-	-	-
未収委託者報酬	3,392,765	-	-	-
未収運用受託報酬	305,910	-	-	-
未収投資助言報酬	452,618	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券	4,000,000	-	-	-
その他有価証券のうち				
満期があるもの	-	-	-	-
長期差入保証金	13,877	667,318	-	-
合計	24,136,043	667,318	-	-

(有価証券関係)

第26期(平成23年3月31日)

## 1. 満期保有目的の債券

(単位：千円)

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)貸借対照表日の時価が貸借対照表計上額を超えるもの	-	-	-
小計	-	-	-
(2)貸借対照表日の時価が貸借対照表計上額を超えないもの	3,999,722	3,999,600	122
小計	3,999,722	3,999,600	122
合計	3,999,722	3,999,600	122

## 2. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（貸借対照表計上額 関係会社株式234,921千円）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。また、上記「貸借対照表計上額」は、減損処理後の帳簿価額です。当事業年度における減損処理額は、1,256千円です。

## 3. その他有価証券

(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	3,047,395	2,801,036	246,358
小計	3,047,395	2,801,036	246,358
(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	1,884,692	1,950,168	65,476
小計	1,884,692	1,950,168	65,476
合計	4,932,087	4,751,205	180,882

(注) 非上場株式等（貸借対照表計上額 48,741千円）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。

## 4. 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
4,845,387	71,400	20,822

第27期(平成24年3月31日)

## 1.満期保有目的の債券

(単位：千円)

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)貸借対照表日の時価が貸借対照表計上額を超えるもの	-	-	-
小計	-	-	-
(2)貸借対照表日の時価が貸借対照表計上額を超えないもの	3,999,305	3,999,200	105
小計	3,999,305	3,999,200	105
合計	3,999,305	3,999,200	105

## 2.子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（貸借対照表計上額 関係会社株式234,921千円）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。

## 3.その他有価証券

(単位：千円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	4,635,097	4,387,713	247,384
小計	4,635,097	4,387,713	247,384
(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	2,036,491	2,170,148	133,657
小計	2,036,491	2,170,148	133,657
合計	6,671,589	6,557,862	113,727

(注)非上場株式等（貸借対照表計上額 48,741千円）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。また、上記「貸借対照表計上額」は、減損処理後の帳簿価額です。当事業年度における減損処理額は、301千円です。

## 4.当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
1,012,727	13,806	6,578

(デリバティブ取引関係)

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

(退職給付関係)

第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)																				
<p>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。</p>	<p>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。</p>																				
<p>2. 退職給付債務の額 (単位：千円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 60%;">退職給付債務</td> <td style="text-align: right;">1,310,821</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">1,310,821</td> </tr> </table>	退職給付債務	1,310,821	退職給付引当金	1,310,821	<p>2. 退職給付債務の額 (単位：千円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 60%;">退職給付債務</td> <td style="text-align: right;">1,489,315</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">1,489,315</td> </tr> </table>	退職給付債務	1,489,315	退職給付引当金	1,489,315												
退職給付債務	1,310,821																				
退職給付引当金	1,310,821																				
退職給付債務	1,489,315																				
退職給付引当金	1,489,315																				
<p>3. 退職給付費用の額 (単位：千円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 60%;">勤務費用</td> <td style="text-align: right;">160,751</td> </tr> <tr> <td>利息費用</td> <td style="text-align: right;">17,066</td> </tr> <tr> <td>数理計算上の差異の費用処理額</td> <td style="text-align: right;">6,439</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">15,287</td> </tr> <tr> <td>退職給付費用</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">199,545</td> </tr> </table> <p>(注)その他は、その他の関係会社からの出向者の年金掛金負担分と退職給付引当額相当額負担分になります。</p>	勤務費用	160,751	利息費用	17,066	数理計算上の差異の費用処理額	6,439	その他	15,287	退職給付費用	199,545	<p>3. 退職給付費用の額 (単位：千円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 60%;">勤務費用</td> <td style="text-align: right;">167,222</td> </tr> <tr> <td>利息費用</td> <td style="text-align: right;">19,662</td> </tr> <tr> <td>数理計算上の差異の費用処理額</td> <td style="text-align: right;">5,053</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">14,018</td> </tr> <tr> <td>退職給付費用</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">205,957</td> </tr> </table> <p>(注)その他は、その他の関係会社からの出向者の年金掛金負担分と退職給付引当額相当額負担分になります。</p>	勤務費用	167,222	利息費用	19,662	数理計算上の差異の費用処理額	5,053	その他	14,018	退職給付費用	205,957
勤務費用	160,751																				
利息費用	17,066																				
数理計算上の差異の費用処理額	6,439																				
その他	15,287																				
退職給付費用	199,545																				
勤務費用	167,222																				
利息費用	19,662																				
数理計算上の差異の費用処理額	5,053																				
その他	14,018																				
退職給付費用	205,957																				
<p>4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項</p> <p>退職給付見込額の期間配分方法 勤務期間を基準とする方法</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 60%;">割引率</td> <td style="text-align: right;">1.5%</td> </tr> </table> <p>過去勤務債務の額の処理年数 1年（発生時において費用処理する方法）</p> <p>数理計算上の差異の処理年数 1年（発生時において費用処理する方法）</p>	割引率	1.5%	<p>4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項</p> <p>退職給付見込額の期間配分方法 勤務期間を基準とする方法</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 60%;">割引率</td> <td style="text-align: right;">1.5%</td> </tr> </table> <p>過去勤務債務の額の処理年数 1年（発生時において費用処理する方法）</p> <p>数理計算上の差異の処理年数 1年（発生時において費用処理する方法）</p>	割引率	1.5%																
割引率	1.5%																				
割引率	1.5%																				



(税効果会計関係)

第26期 (平成23年3月31日)	第27期 (平成24年3月31日)
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	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)	(単位：千円)
(1) 流動の部	(1) 流動の部
繰延税金資産	繰延税金資産
賞与引当金	賞与引当金
133,428	106,421
未払社会保険料	未払社会保険料
14,807	12,691
未払事業税	未払事業税
83,126	27,381
未払事業所税	未払事業所税
6,378	5,808
その他	その他
4,235	3,644
繰延税金資産計	繰延税金資産計
241,975	155,946
評価性引当額	評価性引当額
-	-
繰延税金資産合計	繰延税金資産合計
241,975	155,946
繰延税金資産の純額	繰延税金資産の純額
241,975	155,946
(2) 固定の部	(2) 固定の部
繰延税金資産	繰延税金資産
退職給付引当金	退職給付引当金
533,373	530,792
ソフトウェア償却	ソフトウェア償却
141,119	95,129
投資有価証券評価損	投資有価証券評価損
71,023	61,204
特定外国子会社留保金額	特定外国子会社留保金額
247,489	222,604
その他	その他
4,925	7,328
繰延税金資産計	繰延税金資産計
997,931	917,059
評価性引当額	評価性引当額
321,097	290,326
繰延税金資産合計	繰延税金資産合計
676,833	626,732
繰延税金負債	繰延税金負債
その他有価証券評価差額金	その他有価証券評価差額金
70,383	37,399
繰延税金負債合計	繰延税金負債合計
70,383	37,399
繰延税金資産の純額	繰延税金資産の純額
606,449	589,332
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差異の原因となった主な項目別の内訳	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差異の原因となった主な項目別の内訳
	(%)
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の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、記載を省略しております。	法定実効税率
	40.6
	(調整)
	評価性引当額の増減
	1.0
	交際費等永久に損金に算入されない項目
	0.3
	住民税均等割等
	0.2
	外国税額控除
	0.5
	税率変更による期末繰延税金資産の減額修正
	4.5
	その他
	0.2
	税効果会計適用後の法人税等の負担率
	44.4

### 3. 法定実効税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の修正

平成23年12月2日に「経済社会の構造の変化に対応した税制の構築を図るための所得税法等の一部を改正する法律」(平成23年法律第114号)及び「東日本大震災からの復興のための施策を実施するために必要な財源の確保に関する特別措置法」(平成23年法律第117号)が公布され、平成24年4月1日以降開始する事業年度より法人税率が変更されることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用される法定実効税率は、前事業年度の40.6%から、一時差異等に係る解消時期に応じて以下のとおりとなります。

平成24年4月1日から平成27年3月31日 38.0%

平成27年4月1日以降 35.6%

この税率の変更により繰延税金資産の純額が88,362千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額の金額が93,662千円、その他有価証券評価差額金が5,299千円、それぞれ増加しております。

(資産除去債務関係)

該当事項はありません。

## (セグメント情報等)

第26期（自 平成22年 4月 1日 至 平成23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	27,350,519	2,113,027	1,828,087	302,451	31,594,086

## (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。

第27期(自 平成23年 4月 1日 至 平成24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	25,467,198	2,001,039	1,743,437	184,558	29,396,234

## (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。

## (関連当事者情報)

第26期(自 平成22年4月1日 至 平成23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	住友生命保険(相)	大阪府大阪市中央区	210,000,000	生命保険業	(被所有)% 直接 40	当社の主要顧客	投資助言報酬	1,130,782	未収投資助言報酬	293,061
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 27.5	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	4,558,604	未払手数料	374,320

(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)投資助言契約の受託については、一般取引条件を勘案した個別契約に基づき決定しております。

(2)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. 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	日興コーポリアル証券(株)	東京都千代田区	10,000,000	証券業	- %	投信の販売委託	委託販売手数料	2,174,385	未払手数料	110,182

(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。

第27期(自平成23年4月1日至平成24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	住友生命保険(相)	大阪府 大阪市 中央区	220,000,000	生命保険業	(被所有) % 直接 40	当社の 主要顧客	投資助言 報酬	1,082,284	未収投資 助言報酬	283,244
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 27.5	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	4,294,733	未払手数料	345,061

(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) 投資助言契約の受託については、一般取引条件を勘案した個別契約に基づき決定しております。
- (2) 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. 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	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	委託販売 手数料	1,765,986	未払手数料	264,970

(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)

第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
1株当たり純資産額 1,584,018円42銭 1株当たり当期純利益 143,507円12銭	1株当たり純資産額 1,605,326円06銭 1株当たり当期純利益 94,244円73銭
なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。
(1株当たり純資産額の算定上の基礎) 貸借対照表の純資産の部の合計額 27,942,085千円 普通株式に係る純資産額 27,942,085千円 普通株式の発行済株式数 17,640株 1株当たり純資産額の算定に用いられた普通株式の数 17,640株	(1株当たり純資産額の算定上の基礎) 貸借対照表の純資産の部の合計額 28,317,951千円 普通株式に係る純資産額 28,317,951千円 普通株式の発行済株式数 17,640株 1株当たり純資産額の算定に用いられた普通株式の数 17,640株
(1株当たり当期純利益の算定上の基礎) 損益計算書上の当期純利益 2,531,465千円 普通株式に係る当期純利益 2,531,465千円 普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。 普通株式の期中平均株式数 17,640株	(1株当たり当期純利益の算定上の基礎) 損益計算書上の当期純利益 1,662,477千円 普通株式に係る当期純利益 1,662,477千円 普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。 普通株式の期中平均株式数 17,640株

## (重要な後発事象)

該当事項はありません。

[次へ](#)

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

#### 5【その他】

- イ 定款の変更、その他の重要事項  
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  
当ファンドの委託会社である三井住友アセットマネジメント株式会社は、平成25年4月1日にトヨタアセットマネジメント株式会社と合併する予定です。

## 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24年9月末現在）
- (ハ) 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

#### 【参考情報：再信託受託会社の概要】

- ・ 名称 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社
- ・ 資本金の額 51,000百万円（平成24年9月末現在）
- ・ 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

ロ 販売会社

- (イ) 名称 株式会社三井住友銀行
- (ロ) 資本金の額 1,770,996百万円（平成24年9月末現在）
- (ハ) 事業の内容 銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。

### 2【関係業務の概要】

イ 受託会社

信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

ロ 販売会社

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

### 3【資本関係】

販売会社である株式会社三井住友銀行は、委託会社株式を4,851株（持株比率27.5%）保有しています。

## 第3【その他】

1. 目論見書の表紙にロゴ・マーク、図案およびキャッチコピーを採用すること、ファンドの形態、申込みにかかる事項、委託会社の金融商品取引業者登録番号、当該目論見書の使用開始日などを記載することがあります。
2. 目論見書は、目論見書の別称として「投資信託説明書」と称して使用する場合があります。
3. 目論見書に当ファンドの信託約款を掲載すること、および投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨を記載することがあります。
4. 目論見書は、電子媒体等として使用されるほか、インターネット等に掲載されることがあります。
5. 有価証券届出書の表紙記載情報を抜粋して、目論見書に記載することがあります。
6. 目論見書の冒頭または巻末に届出書記載内容に関連する用語集を掲載することがあります。
7. 評価機関等から当ファンドに対する評価を取得し、使用することがあります。



## 中間財務諸表

## (1)中間貸借対照表

(単位：千円)

		第28期中間会計期間 (平成24年9月30日)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
現金及び預金		16,703,596
有価証券		3,999,207
前払費用		257,951
未収委託者報酬		3,221,255
未収運用受託報酬		414,813
未収投資助言報酬		455,610
未収収益		18,523
繰延税金資産		166,931
その他		2,597
流動資産合計		25,240,487
<b>固定資産</b>		
有形固定資産	1	278,883
無形固定資産		387,892
<b>投資その他の資産</b>		
投資有価証券		5,955,910
その他		1,603,125
投資その他の資産合計		7,559,035
固定資産合計		8,225,811
資産合計		33,466,298
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金		46,700
未払金		1,967,237
未払費用		962,591
未払法人税等		527,043
前受収益		7,481
賞与引当金		264,855
その他	2	80,694
流動負債合計		3,856,605
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金		1,583,169
固定負債合計		1,583,169
負債合計		5,439,775
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金		2,000,000
資本剰余金		
資本準備金		8,628,984
資本剰余金合計		8,628,984
利益剰余金		
利益準備金		284,245

その他利益剰余金	
配当準備積立金	60,000
別途積立金	1,476,959
繰越利益剰余金	15,729,295
利益剰余金合計	17,550,500
株主資本合計	28,179,484
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	152,960
評価・換算差額等合計	152,960
純資産合計	28,026,523
負債純資産合計	33,466,298

## (2) 中間損益計算書

(単位：千円)

		第28期中間会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)
営業収益		
委託者報酬		12,101,664
運用受託報酬		947,312
投資助言報酬		834,061
その他の営業収益		62,525
営業収益計		13,945,563
営業費用		8,998,609
一般管理費	1	3,693,404
営業利益		1,253,548
営業外収益	2	24,695
営業外費用	3	5,196
経常利益		1,273,048
特別利益		336
特別損失	4	57,288
税引前中間純利益		1,216,096
法人税、住民税及び事業税		497,151
法人税等調整額		47,995
法人税等合計		449,155
中間純利益		766,940

## (3) 中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

		第28期中間会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)

株主資本	
資本金	
当期首残高	2,000,000
当中間期末残高	2,000,000
資本剰余金	
資本準備金	
当期首残高	8,628,984
当中間期末残高	8,628,984
資本剰余金合計	
当期首残高	8,628,984
当中間期末残高	8,628,984
利益剰余金	
利益準備金	
当期首残高	284,245
当中間期末残高	284,245
その他利益剰余金	
配当準備積立金	
当期首残高	60,000
当中間期末残高	60,000
別途積立金	
当期首残高	1,476,959
当中間期末残高	1,476,959
繰越利益剰余金	
当期首残高	15,791,435
当中間期変動額	
剰余金の配当	829,080
中間純利益	766,940
当中間期変動額合計	62,139
当中間期末残高	15,729,295
利益剰余金合計	
当期首残高	17,612,639
当中間期変動額	
剰余金の配当	829,080
中間純利益	766,940
当中間期変動額合計	62,139
当中間期末残高	17,550,500
株主資本合計	
当期首残高	28,241,623
当中間期変動額	
剰余金の配当	829,080
中間純利益	766,940
当中間期変動額合計	62,139
当中間期末残高	28,179,484
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
当期首残高	76,327
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	229,288
当中間期変動額合計	229,288
当中間期末残高	152,960

評価・換算差額等合計	
当期首残高	76,327
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	229,288
当中間期変動額合計	229,288
当中間期末残高	152,960
純資産合計	
当期首残高	28,317,951
当中間期変動額	
剰余金の配当	829,080
中間純利益	766,940
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	229,288
当中間期変動額合計	291,428
当中間期末残高	28,026,523

## 重要な会計方針

### 1. 資産の評価基準及び評価方法

#### (1) 有価証券

満期保有目的の債券

償却原価法

子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

その他有価証券

時価のあるもの

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

時価のないもの

移動平均法による原価法

### 2. 固定資産の減価償却の方法

#### (1) 有形固定資産

定率法によっております。但し、建物(建物附属設備を除く)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

（会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更）

当社は、法人税法の改正に伴い、当中間会計期間より、平成24年4月1日以後に取得した有形固定資産については、改正後の法人税法に基づく減価償却の方法に変更しております。これによる当中間会計期間の営業利益、経常利益及び税引前中間純利益に与える影響は軽微であります。

#### (2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

## 3. 引当金の計上基準

## (1) 賞与引当金

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

## (2) 退職給付引当金

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

過去勤務債務については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

## 4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

## 消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

## 注記事項

## ( 中間貸借対照表関係 )

第28期中間会計期間 (平成24年9月30日)	
1. 有形固定資産の減価償却累計額	885,491千円
2. 消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債のその他に含めて表示しております。
3. 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。	
	当中間会計期間末における当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。
	当座借越極度額の総額 10,000,000千円
	借入実行残高 <u>                    -</u>
	差引額 10,000,000千円
4. 当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York)Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成27年6月までの賃借料総額45,460千円の支払保証を行っております。	

## ( 中間損益計算書関係 )

第28期中間会計期間 (自平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)	
1. 減価償却実施額	
有形固定資産	54,001千円
無形固定資産	34,225千円
2. 営業外収益のうち主要なもの	
受取利息	3,069千円

受取配当金	15,103千円
3．営業外費用のうち主要なもの 為替差損	5,196千円
4．特別損失のうち主要なもの 投資有価証券売却損	36,226千円
投資有価証券評価損	17,803千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第28期中間会計期間（自 平成24年 4月 1日 至 平成24年 9月30日）

## 1．発行済株式数に関する事項

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

## 2．剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成24年6月25日 定時株主総会	普通株式	829,080	47,000	平成24年 3月31日	平成24年 6月26日

(リース取引関係)

第28期中間会計期間 (自 平成24年 4月 1日 至 平成24年 9月30日)	
1．オペレーティング・リース取引 (借主側) 未経過リース料(解約不能のもの)	
1年以内	583,720千円
1年超	1,469,547千円
合計	2,053,268千円

(金融商品関係)

## 1．金融商品の時価等に関する事項

第28期中間会計期間（平成24年 9月30日）

平成24年 9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次の通りです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません（（注2）参照）。

(単位：千円)

区分	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	16,703,596	16,703,596	-
(2)未収委託者報酬	3,221,255	3,221,255	-
(3)未収運用受託報酬	414,813	414,813	-
(4)未収投資助言報酬	455,610	455,610	-
(5)有価証券及び投資有価証券 満期保有目的の債券	3,999,207	3,998,800	407

その他有価証券	5,922,072	5,922,072	-
(6)投資その他の資産			
長期差入保証金	680,513	680,513	-
資産計	31,397,067	31,396,660	407
(1)未払金			
未払手数料	1,768,995	1,768,995	-
負債計	1,768,995	1,768,995	-

## (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) 未収委託者報酬、(3) 未収運用受託報酬 及び

(4) 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。

(5) 有価証券及び投資有価証券

これらの時価について、債券については取引金融機関から提示された価格及び業界団体が公表する売買参考統計値等によって、投資信託等については取引所の価格、取引金融機関から提示された価格及び公表されている基準価格によっております。

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

(6) 投資その他の資産

長期差入保証金

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

負債

(1) 未払金

未払手数料

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

## (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

(単位：千円)

	中間貸借対照表計上額
その他有価証券	
非上場株式	298
投資証券	33,540
合計	33,838
子会社株式	
非上場株式	234,921
合計	234,921

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、「(5) その他有価証券」には含めておりません。また、上記の表中にある「中間貸借対照表計上額」は、減損処理後の帳簿価額です。当中間会計期間における減損処理額は、14,903千円です。

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

（有価証券関係）

第28期中間会計期間（平成24年9月30日）

1．満期保有目的の債券

（単位：千円）

区分	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)中間貸借対照表日の時価が中間貸借対照表計上額を超えるもの	-	-	-
小計	-	-	-
(2)中間貸借対照表日の時価が中間貸借対照表計上額を超えないもの	3,999,207	3,998,800	407
小計	3,999,207	3,998,800	407
合計	3,999,207	3,998,800	407

2．子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額 234,921千円）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。

3．その他有価証券

（単位：千円）

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	2,793,142	2,705,290	87,851
小計	2,793,142	2,705,290	87,851
(2)中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	3,128,929	3,369,742	240,812
小計	3,128,929	3,369,742	240,812
合計	5,922,072	6,075,033	152,960

（注）非上場株式等（中間貸借対照表計上額 33,838千円）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。また、上記の表中にある「中間貸借対照表計上額」は、減損処理後の帳簿価額です。当中間会計期間における減損処理額は、2,900千円です。

（デリバティブ取引関係）

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

（資産除去債務等）

該当事項はありません。



## （セグメント情報等）

第28期中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

## 1. セグメント情報

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

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

## 2. 関連情報

## (1) 製品及びサービスごとの情報

（単位：千円）

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への売上高	12,101,664	947,312	834,061	62,525	13,945,563

## (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中間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中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

## (3) 主要な顧客ごとの情報

外部顧客への売上高のうち、中間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。

## （1株当たり情報）

第28期中間会計期間 （自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）	
1株当たり純資産額	1,588,805円19銭
1株当たり中間純利益	43,477円35銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載して おりません。	
(注) 1株当たり純資産額の算定上の基礎	
中間貸借対照表の純資産の部の合計額	28,026,523千円
普通株式に係る純資産額	28,026,523千円
普通株式の発行済株式数	17,640株
1株当たり純資産額の算定に用いられた普通株式の数	17,640株
1株当たり中間純利益の算定上の基礎	
中間損益計算書上の中間純利益	766,940千円

普通株式に係る中間純利益	766,940千円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳	
該当事項はありません。	
普通株式の期中平均株式数	17,640株

## （追加情報）

第28期中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

## 1. トヨタアセットマネジメント株式会社との経営統合

当社は、平成24年9月28日に、トヨタアセットマネジメント株式会社、トヨタファイナンシャルサービス株式会社、あいおいニッセイ同和損害保険株式会社、三井住友海上火災保険株式会社と、平成25年4月1日を効力発生日としてトヨタアセットマネジメント株式会社と経営統合する旨の合意書を締結致しました。

## (1)目的

当社とトヨタアセットマネジメント株式会社の経営統合により、地域性や商品性などの相互補完関係を活かすことで、国内における事業基盤の飛躍的な拡大と運用・商品開発力の強化、更に、経営におけるシナジー発揮などを通じ、お客様サービスのより一層の向上が行えるとの判断に至り、この度合意いたしました。

## (2)合併する相手会社の名称

トヨタアセットマネジメント株式会社

## (3)合併の方法、合併後の会社名

当該合併は、当社がトヨタアセットマネジメント株式会社の全株式を取得した後に行い、当社を存続会社とする吸収合併方式であり、トヨタアセットマネジメント株式会社は解散いたします。合併後の名称に変更はありません。

## (4)合併比率、合併交付金の額、合併により発行する株式の種類及び数

当社は、トヨタアセットマネジメント株式会社の発行済株式の全てを所有する予定となっているため、合併に際しては新株の発行及び金銭等の交付はいたしません。

## (5)相手会社の主な事業の内容、規模（平成24年3月期）

名称	トヨタアセットマネジメント株式会社
事業の内容	投資運用業等
資本金	600,000千円
純資産	1,385,963千円
総資産	1,833,325千円
営業収益	1,980,544千円
当期純利益	5,635千円

## (6)合併の時期

平成25年4月1日（予定）

## （参考情報）

「三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010」、「三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020」、「三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030」および「三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040」は、「SMAM・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）」、「SMAM・年金国内債券パッシブファンド＜適格機関投資家限定＞」、「SMAM・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）」、「SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞」および「SMAM・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞」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「投資信託受益証券」はこれらの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。

## 「SMAM・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）」の状況

## （1）貸借対照表

（単位：円）

（平成24年12月19日現在）

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	23,841
親投資信託受益証券	73,579,325,350
未収入金	1,246,909,997
流動資産合計	74,826,259,188
資産合計	74,826,259,188
負債の部	
流動負債	
未払解約金	1,246,909,997
未払受託者報酬	1,544,708
未払委託者報酬	1,351,610
その他未払費用	31,388
流動負債合計	1,249,837,703
負債合計	1,249,837,703
純資産の部	
元本等	
元本	96,890,064,662
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	23,313,643,177
元本等合計	73,576,421,485
純資産合計	73,576,421,485
負債純資産合計	74,826,259,188

## （2）注記表

## （重要な会計方針の注記）

項目	自 平成24年12月 1日 至 平成24年12月19日
有価証券の評価基準及び評価方法	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>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
--	--

## （追加情報）

自 平成24年12月 1日 至 平成24年12月19日
当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

## （貸借対照表に関する注記）

項目	（平成24年12月19日現在）
1. 受益権総数	平成24年12月19日における受益権の総数 96,890,064,662口
2. 元本の欠損	「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 23,313,643,177円
3. 1単位当たり純資産額	0.7594円 (1万口 = 7,594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24年12月 1日 至 平成24年12月19日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p>

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

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成24年12月19日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

（平成24年12月19日現在）  
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

（自平成24年12月1日至平成24年12月19日）  
該当事項はありません。

（その他の注記）

（平成24年12月19日現在）	
期首（平成24年12月1日）における元本額	98,773,644,698円
期首より平成24年12月19日現在までの追加設定元本額	28,097,780円
期首より平成24年12月19日現在までの一部解約元本額	1,911,677,816円

（3）附属明細表  
有価証券明細表

(a) 株式  
該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託 受益証券	国内株式インデックス・マザーファ ンド（B号）	63,776,827,035	73,579,325,350	
	親投資信託受益証券 小計	63,776,827,035	73,579,325,350	
合計		63,776,827,035	73,579,325,350	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
該当事項はありません。

（参考情報）

S M A M・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）は、「国内株式インデックス・マ  
ザーファンド（B号）」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された  
「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。  
なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

「国内株式インデックス・マザーファンド（B号）」の状況

（1）貸借対照表

（単位：円）

（平成24年12月19日現在）

資産の部

流動資産

コール・ローン

9,748,921,866

株式	305,334,868,390
派生商品評価勘定	224,240,850
未収入金	9,884,900
未収配当金	34,171,212
未収利息	13,354
差入委託証拠金	115,630,000
流動資産合計	315,467,730,572
資産合計	315,467,730,572
負債の部	
流動負債	
前受金	224,580,000
未払解約金	5,243,603,865
流動負債合計	5,468,183,865
負債合計	5,468,183,865
純資産の部	
元本等	
元本	268,710,675,351
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	41,288,871,356
元本等合計	309,999,546,707
純資産合計	309,999,546,707
負債純資産合計	315,467,730,572

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針の注記 )

項目	自 平成24年12月 1日 至 平成24年12月19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 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>
----------------	---

## (追加情報)

<p>自 平成24年12月 1日</p> <p>至 平成24年12月19日</p> <p>当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。</p>
--

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(平成24年12月19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> <table border="1"> <tr> <td>担保資産</td> <td>金額</td> </tr> <tr> <td>株式</td> <td>6,930,000,000円</td> </tr> </table>	担保資産	金額	株式	6,930,000,000円
担保資産	金額				
株式	6,930,000,000円				
2. 受益権総数	<p>平成24年12月19日における受益権の総数</p> <p>268,710,675,351口</p>				
3. 1単位当たり純資産額	<p>1.1537円</p> <p>(1万口 = 11,537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24年12月 1日 至 平成24年12月19日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式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、上下限値、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24年12月19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24年12月19日現在)

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 株式関連

(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				
	東証株価指数先物	4,252,539,150		4,476,780,000	224,240,850
	小計	4,252,539,150		4,476,780,000	224,240,850
合計		4,252,539,150		4,476,780,000	224,240,850

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については以下のように評価しております。

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おります。

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おります。

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

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

(自平成24年12月1日至平成24年12月19日)

該当事項はありません。

(その他の注記)

(平成24年12月19日現在)

期首(平成24年12月1日)における元本額	274,717,617,579円
期首より平成24年12月19日現在までの追加設定元本額	10,897,291円
期首より平成24年12月19日現在までの一部解約元本額	6,017,839,519円
平成24年12月19日現在の元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,101,114,470円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	507,997,341円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,468,425,187円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,657,521,226円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	52,361,133円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	5,707,011円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	8,146,691円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	7,586,638円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	8,713,793円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	2,427,868円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	5,265,659円
国内株式指数ファンド(TOPIX)	896,985,024円
三井住友・DC日本株式インデックスファンドS	44,251,210円
SMA M・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	63,776,827,035円
バランスファンドVA(安定運用型) <適格機関投資家限定>	667,374,928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>	49,808,265,195円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	16,957,539,306円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	7,293,474,686円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	25,356,709,416円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	177,868,514円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	558,551,935円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	86,629,558円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	2,492,764,163円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	131,712,338円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,009,463,335円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	3,009,702,035円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	4,992,145,020円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	10,250,802,333円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,312,694,091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)	10,564,953,987円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	203,438,939円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	2,880,782,712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)	44,229,195,408円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A <適格機関投資家専用>	307,322,683円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A <適格機関投資家専用>	156,201,410円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A <適格機関投資家専用>	57,156,431円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L <適格機関投資家専用>	767,324,720円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L <適格機関投資家専用>	1,382,807,856円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T <適格機関投資家専用>	552,836,190円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2 <適格機関投資家専用>	363,203,469円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2 <適格機関投資家専用>	162,288,856円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2 <適格機関投資家専用>	31,711,268円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2 <適格機関投資家専用>	332,889,580円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2 <適格機関投資家専用>	3,384,922,310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)	527,972,903円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2 <適格機関投資家専用>	125,881,715円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定>	21,407,259円
SMAM・FGグローバルバランス25VA<適格機関投資家限定>	9,350,516円
合計	268,710,675,351円

(3) 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 単価	評価額 金額	備考
極洋	111,000	188.00	20,868,000	
日本水産	345,400	172.00	59,408,800	
マルハニチロホールディングス	560,000	146.00	81,760,000	
サカタのタネ	43,400	1,064.00	46,177,600	
ホクト	29,900	1,683.00	50,321,700	
住石ホールディングス	115,100	82.00	9,438,200	
日鉄鉱業	74,000	366.00	27,084,000	
三井松島産業	195,000	141.00	27,495,000	
国際石油開発帝石	3,598	466,000.00	1,676,668,000	
日本海洋掘削	8,500	2,379.00	20,221,500	
関東天然瓦斯開発	27,000	447.00	12,069,000	
石油資源開発	41,300	3,090.00	127,617,000	
ショーボンドホールディングス	26,800	3,060.00	82,008,000	
ミライト・ホールディングス	83,700	786.00	65,788,200	
ダイセキ環境ソリューション	22	139,000.00	3,058,000	
間組	103,800	270.00	28,026,000	
東急建設	110,280	237.00	26,136,360	
コムシスホールディングス	144,800	1,114.00	161,307,200	
ミサワホーム	32,900	1,208.00	39,743,200	
高松コンストラクショングループ	22,700	1,366.00	31,008,200	
東建コーポレーション	11,230	4,620.00	51,882,600	
ヤマウラ	16,000	250.00	4,000,000	
大成建設	1,506,000	274.00	412,644,000	
大林組	891,000	479.00	426,789,000	
清水建設	908,000	311.00	282,388,000	
長谷工コーポレーション	1,905,500	68.00	129,574,000	
松井建設	33,000	357.00	11,781,000	
鹿島建設	1,305,000	278.00	362,790,000	
不動テトラ	224,400	179.00	40,167,600	
鉄建建設	184,000	131.00	24,104,000	
安藤建設	114,000	139.00	15,846,000	
太平工業	54,000	351.00	18,954,000	
西松建設	374,000	183.00	68,442,000	
三井住友建設	400,900	98.00	39,288,200	
大豊建設	87,000	127.00	11,049,000	
前田建設工業	188,000	471.00	88,548,000	
佐田建設	133,000	86.00	11,438,000	
ナカノフドー建設	29,000	229.00	6,641,000	
奥村組	267,000	334.00	89,178,000	
大和小田急建設	18,000	191.00	3,438,000	
東鉄工業	39,000	1,258.00	49,062,000	

イチケン	41,000	160.00	6,560,000	
戸田建設	323,000	246.00	79,458,000	
熊谷組	236,000	101.00	23,836,000	
青木あすなろ建設	20,500	587.00	12,033,500	
北野建設	63,000	215.00	13,545,000	
植木組	42,000	193.00	8,106,000	
三井ホーム	35,000	455.00	15,925,000	
矢作建設工業	38,400	429.00	16,473,600	
ピーエス三菱	22,300	570.00	12,711,000	
大東建託	112,400	8,020.00	901,448,000	
新日本建設	39,600	209.00	8,276,400	
N I P P O	68,000	1,162.00	79,016,000	
東亜道路工業	61,000	274.00	16,714,000	
前田道路	84,000	1,331.00	111,804,000	
日本道路	90,000	379.00	34,110,000	
東亜建設工業	268,000	146.00	39,128,000	
若築建設	181,000	101.00	18,281,000	
東洋建設	98,800	314.00	31,023,200	
五洋建設	350,000	239.00	83,650,000	
大林道路	39,000	336.00	13,104,000	
福田組	50,000	390.00	19,500,000	
住友林業	201,000	801.00	161,001,000	
日本基礎技術	39,000	334.00	13,026,000	
日成ビルド工業	99,000	189.00	18,711,000	
エス・バイ・エル	161,000	145.00	23,345,000	
巴コーポレーション	40,400	280.00	11,312,000	
パナホーム	110,000	565.00	62,150,000	
大和ハウス工業	735,000	1,405.00	1,032,675,000	
ライト工業	63,400	493.00	31,256,200	
積水ハウス	887,000	909.00	806,283,000	
日特建設	22,700	367.00	8,330,900	
北陸電気工事	15,000	264.00	3,960,000	
ユアテック	43,000	307.00	13,201,000	
西部電気工業	21,000	365.00	7,665,000	
四電工	25,000	332.00	8,300,000	
中電工	39,400	800.00	31,520,000	
関電工	138,000	391.00	53,958,000	
きんでん	195,000	551.00	107,445,000	
東京エネシス	34,000	445.00	15,130,000	
トーエネック	43,000	475.00	20,425,000	
住友電設	20,500	962.00	19,721,000	
日本電設工業	53,000	811.00	42,983,000	
協和エクシオ	98,100	896.00	87,897,600	
新日本空調	22,400	497.00	11,132,800	
N D S	48,000	254.00	12,192,000	
九電工	51,000	430.00	21,930,000	
三機工業	67,000	411.00	27,537,000	
日揮	297,000	2,705.00	803,385,000	

中外炉工業	100,000	225.00	22,500,000	
ヤマト	27,000	293.00	7,911,000	
太平電業	41,000	548.00	22,468,000	
高砂熱学工業	83,900	675.00	56,632,500	
三晃金属工業	37,000	225.00	8,325,000	
朝日工業社	31,000	296.00	9,176,000	
大気社	43,400	1,683.00	73,042,200	
ダイダン	39,000	534.00	20,826,000	
日比谷総合設備	36,200	966.00	34,969,200	
東芝プラントシステム	50,000	1,260.00	63,000,000	
東洋エンジニアリング	164,000	402.00	65,928,000	
千代田化工建設	216,000	1,237.00	267,192,000	
新興プランテック	62,300	683.00	42,550,900	
日本製粉	169,000	348.00	58,812,000	
日清製粉グループ本社	262,000	1,066.00	279,292,000	
日東富士製粉	23,000	296.00	6,808,000	
昭和産業	100,000	280.00	28,000,000	
鳥越製粉	24,900	638.00	15,886,200	
協同飼料	126,000	98.00	12,348,000	
中部飼料	28,300	532.00	15,055,600	
日本配合飼料	110,000	102.00	11,220,000	
東洋精糖	67,000	90.00	6,030,000	
日本甜菜製糖	161,000	161.00	25,921,000	
三井製糖	111,000	256.00	28,416,000	
森永製菓	292,000	184.00	53,728,000	
中村屋	73,000	406.00	29,638,000	
江崎グリコ	105,000	909.00	95,445,000	
名糖産業	14,800	992.00	14,681,600	
不二家	182,000	200.00	36,400,000	
山崎製パン	218,000	970.00	211,460,000	
モロゾフ	48,000	287.00	13,776,000	
亀田製菓	17,000	1,973.00	33,541,000	
カルビー	27,000	6,130.00	165,510,000	
森永乳業	249,000	273.00	67,977,000	
ヤクルト本社	174,000	3,790.00	659,460,000	
明治ホールディングス	87,400	3,655.00	319,447,000	
雪印メグミルク	58,200	1,374.00	79,966,800	
プリマハム	178,000	145.00	25,810,000	
日本ハム	227,000	1,184.00	268,768,000	
伊藤ハム	168,000	375.00	63,000,000	
林兼産業	135,000	74.00	9,990,000	
丸大食品	140,000	281.00	39,340,000	
米久	26,800	708.00	18,974,400	
S Foods	19,500	773.00	15,073,500	
サッポロホールディングス	500,000	277.00	138,500,000	
アサヒグループホールディングス	594,700	1,879.00	1,117,441,300	
キリンホールディングス	1,267,000	1,019.00	1,291,073,000	
宝ホールディングス	236,000	642.00	151,512,000	

オエノンホールディングス	81,000	207.00	16,767,000	
養命酒製造	24,000	724.00	17,376,000	
三国コカ・コーラボトリング	20,100	800.00	16,080,000	
コカ・コーラウエスト	101,200	1,335.00	135,102,000	
コカ・コーラ セントラル ジャパン	33,100	1,051.00	34,788,100	
ダイドードリンコ	14,200	3,430.00	48,706,000	
伊藤園	81,300	1,579.00	128,372,700	
キーコーヒー	23,500	1,563.00	36,730,500	
日清オイリオグループ	116,000	316.00	36,656,000	
不二製油	73,000	1,255.00	91,615,000	
J - オイルミルズ	112,000	241.00	26,992,000	
キッコーマン	244,000	1,214.00	296,216,000	
味の素	782,000	1,176.00	919,632,000	
キューピー	151,700	1,205.00	182,798,500	
ハウス食品	102,100	1,296.00	132,321,600	
カゴメ	107,200	1,638.00	175,593,600	
焼津水産化学工業	15,400	740.00	11,396,000	
アリアケジャパン	27,700	1,596.00	44,209,200	
ニチレイ	332,000	450.00	149,400,000	
東洋水産	138,000	2,322.00	320,436,000	
日清食品ホールディングス	114,800	3,290.00	377,692,000	
永谷園	26,000	837.00	21,762,000	
フジッコ	28,000	1,021.00	28,588,000	
ロック・フィールド	14,900	1,430.00	21,307,000	
日本たばこ産業	1,313,400	2,393.00	3,142,966,200	
ケンコーマヨネーズ	12,000	786.00	9,432,000	
わらべや日洋	17,200	1,649.00	28,362,800	
なとり	13,200	848.00	11,193,600	
ミヨシ油脂	109,000	105.00	11,445,000	
片倉工業	35,300	711.00	25,098,300	
グンゼ	196,000	216.00	42,336,000	
東洋紡	1,172,000	120.00	140,640,000	
ユニチカ	755,000	46.00	34,730,000	
富士紡ホールディングス	125,000	306.00	38,250,000	
日清紡ホールディングス	180,000	685.00	123,300,000	
倉敷紡績	285,000	142.00	40,470,000	
シキボウ	175,000	106.00	18,550,000	
日本毛織	85,000	559.00	47,515,000	
トーア紡コーポレーション	145,000	62.00	8,990,000	
ダイドーリミテッド	35,100	542.00	19,024,200	
帝国繊維	30,000	652.00	19,560,000	
帝人	1,057,000	201.00	212,457,000	
東レ	2,141,000	514.00	1,100,474,000	
サカイオーベックス	95,000	126.00	11,970,000	
住江織物	78,000	170.00	13,260,000	
日本フェルト	12,400	402.00	4,984,800	
イチカワ	23,000	162.00	3,726,000	
日本バイリーン	39,000	345.00	13,455,000	

日東製網	32,000	124.00	3,968,000	
芦森工業	84,000	120.00	10,080,000	
アツギ	206,000	106.00	21,836,000	
ダイニック	58,000	161.00	9,338,000	
セーレン	70,700	522.00	36,905,400	
小松精練	44,000	390.00	17,160,000	
ワコールホールディングス	164,000	899.00	147,436,000	
ホギメディカル	17,600	4,100.00	72,160,000	
レナウン	78,100	111.00	8,669,100	
クラウドディア	3,800	1,059.00	4,024,200	
T S Iホールディングス	141,000	483.00	68,103,000	
三陽商会	146,000	242.00	35,332,000	
オンワードホールディングス	181,000	658.00	119,098,000	
ルック	52,000	379.00	19,708,000	
ゴールドウイン	64,000	524.00	33,536,000	
デサント	71,000	529.00	37,559,000	
ヤマトインターナショナル	19,400	369.00	7,158,600	
特種東海製紙	159,000	208.00	33,072,000	
王子ホールディングス	1,210,000	276.00	333,960,000	
三菱製紙	419,000	83.00	34,777,000	
北越紀州製紙	170,000	482.00	81,940,000	
中越パルプ工業	109,000	145.00	15,805,000	
巴川製紙所	52,000	154.00	8,008,000	
大王製紙	116,000	610.00	70,760,000	
日本製紙グループ本社	135,500	1,179.00	159,754,500	
レンゴー	228,000	423.00	96,444,000	
トーモク	77,000	236.00	18,172,000	
ザ・パックス	18,900	1,473.00	27,839,700	
クラレ	470,800	1,094.00	515,055,200	
旭化成	1,723,000	497.00	856,331,000	
共和レザー	18,500	263.00	4,865,500	
コープケミカル	58,000	99.00	5,742,000	
昭和電工	1,741,000	124.00	215,884,000	
住友化学	1,908,000	274.00	522,792,000	
日本化成	67,000	109.00	7,303,000	
住友精化	55,000	298.00	16,390,000	
日産化学工業	198,700	989.00	196,514,300	
クレハ	186,000	301.00	55,986,000	
テイカ	50,000	236.00	11,800,000	
石原産業	499,000	65.00	32,435,000	
片倉チッカリン	22,000	201.00	4,422,000	
日本曹達	169,000	380.00	64,220,000	
東ソー	751,000	195.00	146,445,000	
トクヤマ	435,000	171.00	74,385,000	
セントラル硝子	252,000	286.00	72,072,000	
東亜合成	322,000	340.00	109,480,000	
ダイソー	108,000	232.00	25,056,000	
関東電化工業	69,000	185.00	12,765,000	



電気化学工業	553,000	282.00	155,946,000	
信越化学工業	496,600	5,080.00	2,522,728,000	
日本カーバイド工業	100,000	240.00	24,000,000	
堺化学工業	88,000	245.00	21,560,000	
エア・ウォーター	227,000	1,086.00	246,522,000	
大陽日酸	369,000	493.00	181,917,000	
日本化学工業	116,000	113.00	13,108,000	
日本パーカライジング	66,000	1,223.00	80,718,000	
高压ガス工業	42,000	427.00	17,934,000	
チタン工業	40,000	221.00	8,840,000	
四国化成工業	42,000	489.00	20,538,000	
戸田工業	47,000	378.00	17,766,000	
ステラ ケミファ	14,100	1,538.00	21,685,800	
保土谷化学工業	67,000	164.00	10,988,000	
日本触媒	204,000	848.00	172,992,000	
大日精化工業	97,000	350.00	33,950,000	
カネカ	339,000	422.00	143,058,000	
三菱瓦斯化学	440,000	518.00	227,920,000	
三井化学	1,188,000	210.00	249,480,000	
J S R	273,700	1,600.00	437,920,000	
東京応化工業	50,500	1,660.00	83,830,000	
三菱ケミカルホールディングス	1,726,500	400.00	690,600,000	
日本合成化学工業	58,000	661.00	38,338,000	
ダイセル	330,000	537.00	177,210,000	
住友ベークライト	225,000	345.00	77,625,000	
積水化学工業	567,000	742.00	420,714,000	
日本ゼオン	241,000	697.00	167,977,000	
アイカ工業	72,700	1,427.00	103,742,900	
宇部興産	1,308,000	185.00	241,980,000	
積水樹脂	37,000	862.00	31,894,000	
タキロン	66,000	299.00	19,734,000	
旭有機材工業	89,000	202.00	17,978,000	
日立化成工業	118,900	1,190.00	141,491,000	
ニチバン	27,000	259.00	6,993,000	
リケンテクノス	42,000	231.00	9,702,000	
大倉工業	72,000	268.00	19,296,000	
積水化成成品工業	73,000	214.00	15,622,000	
群栄化学工業	77,000	196.00	15,092,000	
タイガースポリマー	17,300	290.00	5,017,000	
日本カーリット	20,900	434.00	9,070,600	
日本化薬	190,000	924.00	175,560,000	
日本精化	22,500	572.00	12,870,000	
A D E K A	120,300	732.00	88,059,600	
日油	209,000	380.00	79,420,000	
ハリマ化成グループ	25,100	392.00	9,839,200	
花王	734,000	2,255.00	1,655,170,000	
第一工業製薬	53,000	210.00	11,130,000	
三洋化成工業	86,000	473.00	40,678,000	

大日本塗料	190,000	100.00	19,000,000	
日本ペイント	241,000	690.00	166,290,000	
関西ペイント	313,000	888.00	277,944,000	
中国塗料	88,000	505.00	44,440,000	
日本特殊塗料	23,700	340.00	8,058,000	
藤倉化成	36,800	342.00	12,585,600	
太陽ホールディングス	22,800	2,457.00	56,019,600	
D I C	992,000	152.00	150,784,000	
サカタインクス	51,000	433.00	22,083,000	
東洋インキS Cホールディングス	246,000	357.00	87,822,000	
富士フイルムホールディングス	590,500	1,714.00	1,012,117,000	
資生堂	495,700	1,191.00	590,378,700	
ライオン	313,000	440.00	137,720,000	
高砂香料工業	93,000	432.00	40,176,000	
マンダム	28,100	2,268.00	63,730,800	
ミルボン	12,500	2,776.00	34,700,000	
ファンケル	70,300	892.00	62,707,600	
コーセー	45,600	1,801.00	82,125,600	
ドクターシーラボ	194	264,000.00	51,216,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	33,400	2,458.00	82,097,200	
ノエビアホールディングス	15,000	1,254.00	18,810,000	
エステー	18,700	909.00	16,998,300	
コニシ	20,000	1,443.00	28,860,000	
長谷川香料	33,900	1,143.00	38,747,700	
小林製薬	41,900	4,105.00	171,999,500	
荒川化学工業	22,200	670.00	14,874,000	
メック	24,800	292.00	7,241,600	
日本高純度化学	73	197,700.00	14,432,100	
J C U	4,300	3,245.00	13,953,500	
アース製薬	18,700	2,988.00	55,875,600	
イハラケミカル工業	49,000	401.00	19,649,000	
北興化学工業	30,000	220.00	6,600,000	
大成ラミック	7,300	2,347.00	17,133,100	
クミアイ化学工業	56,000	401.00	22,456,000	
日本農薬	64,000	464.00	29,696,000	
アキレス	222,000	113.00	25,086,000	
有沢製作所	49,200	307.00	15,104,400	
日東電工	228,300	4,155.00	948,586,500	
レック	9,600	963.00	9,244,800	
きもと	28,900	690.00	19,941,000	
藤森工業	20,300	2,314.00	46,974,200	
前澤化成工業	20,200	888.00	17,937,600	
J S P	15,400	1,160.00	17,864,000	
エフピコ	12,500	5,770.00	72,125,000	
天馬	23,500	860.00	20,210,000	
信越ポリマー	57,000	327.00	18,639,000	
東リ	76,000	179.00	13,604,000	
ニフコ	62,300	1,835.00	114,320,500	

日本バルカー工業	109,000	214.00	23,326,000	
ユニ・チャーム	152,900	4,410.00	674,289,000	
協和発酵キリン	329,000	861.00	283,269,000	
武田薬品工業	1,035,400	3,870.00	4,006,998,000	
アステラス製薬	614,500	4,060.00	2,494,870,000	
大日本住友製薬	194,700	1,026.00	199,762,200	
塩野義製薬	405,700	1,462.00	593,133,400	
田辺三菱製薬	228,300	1,135.00	259,120,500	
わかもと製薬	39,000	230.00	8,970,000	
あすか製薬	34,000	468.00	15,912,000	
日本新薬	59,000	972.00	57,348,000	
中外製薬	319,100	1,675.00	534,492,500	
科研製薬	108,000	1,294.00	139,752,000	
エーザイ	341,400	3,530.00	1,205,142,000	
ロート製薬	118,000	1,010.00	119,180,000	
小野薬品工業	134,500	4,505.00	605,922,500	
久光製薬	84,700	4,340.00	367,598,000	
有機合成薬品工業	28,000	227.00	6,356,000	
持田製薬	104,000	1,058.00	110,032,000	
参天製薬	100,100	3,435.00	343,843,500	
扶桑薬品工業	98,000	304.00	29,792,000	
日本ケミファ	42,000	500.00	21,000,000	
ツムラ	76,500	2,692.00	205,938,000	
日医工	41,000	1,672.00	68,552,000	
キッセイ薬品工業	51,300	1,541.00	79,053,300	
生化学工業	51,600	903.00	46,594,800	
栄研化学	21,400	1,112.00	23,796,800	
日水製薬	9,400	854.00	8,027,600	
鳥居薬品	16,400	1,924.00	31,553,600	
東和薬品	14,600	4,530.00	66,138,000	
沢井製薬	18,600	8,850.00	164,610,000	
ゼリア新薬工業	40,000	1,428.00	57,120,000	
第一三共	873,100	1,322.00	1,154,238,200	
キョーリン製薬ホールディングス	74,000	1,653.00	122,322,000	
大幸薬品	14,900	808.00	12,039,200	
ダイト	9,700	1,413.00	13,706,100	
大塚ホールディングス	549,300	2,429.00	1,334,249,700	
大正製薬ホールディングス	66,200	6,100.00	403,820,000	
日本コークス工業	241,500	108.00	26,082,000	
昭和シェル石油	248,400	508.00	126,187,200	
コスモ石油	775,000	188.00	145,700,000	
ニチレキ	38,000	440.00	16,720,000	
東燃ゼネラル石油	414,000	776.00	321,264,000	
ユシロ化学工業	16,600	865.00	14,359,000	
AOCホールディングス	66,700	344.00	22,944,800	
MORESCO	7,200	791.00	5,695,200	
出光興産	32,500	7,310.00	237,575,000	
JXホールディングス	3,068,400	471.00	1,445,216,400	

横浜ゴム	309,000	595.00	183,855,000	
東洋ゴム工業	218,000	259.00	56,462,000	
ブリヂストン	864,900	2,138.00	1,849,156,200	
住友ゴム工業	215,800	1,047.00	225,942,600	
藤倉ゴム工業	17,900	256.00	4,582,400	
オカモト	99,000	306.00	30,294,000	
フコク	12,000	760.00	9,120,000	
ニッタ	28,600	1,338.00	38,266,800	
東海ゴム工業	53,300	838.00	44,665,400	
三ツ星ベルト	73,000	498.00	36,354,000	
バンドー化学	96,000	289.00	27,744,000	
日東紡績	200,000	322.00	64,400,000	
旭硝子	1,361,000	654.00	890,094,000	
日本板硝子	1,224,000	96.00	117,504,000	
石塚硝子	35,000	140.00	4,900,000	
日本山村硝子	106,000	185.00	19,610,000	
日本電気硝子	490,000	499.00	244,510,000	
オハラ	11,500	649.00	7,463,500	
住友大阪セメント	499,000	293.00	146,207,000	
太平洋セメント	1,528,000	217.00	331,576,000	
デイ・シイ	30,400	323.00	9,819,200	
日本ヒューム	24,000	430.00	10,320,000	
日本コンクリート工業	48,000	292.00	14,016,000	
東海カーボン	245,000	314.00	76,930,000	
日本カーボン	138,000	164.00	22,632,000	
東洋炭素	14,300	1,655.00	23,666,500	
ノリタケカンパニーリミテド	136,000	206.00	28,016,000	
TOTO	424,000	639.00	270,936,000	
日本碍子	361,000	956.00	345,116,000	
日本特殊陶業	238,000	1,107.00	263,466,000	
MARUWA	7,200	2,813.00	20,253,600	
品川リフラクトリーズ	62,000	189.00	11,718,000	
黒崎播磨	66,000	210.00	13,860,000	
東京窯業	37,000	162.00	5,994,000	
ニッカトー	10,200	450.00	4,590,000	
フジインコーポレーテッド	25,500	1,565.00	39,907,500	
エーアンドエーマテリアル	65,000	80.00	5,200,000	
ニチアス	126,000	449.00	56,574,000	
ニチハ	32,300	967.00	31,234,100	
新日鐵住金	11,692,000	208.00	2,431,936,000	
神戸製鋼所	3,834,000	103.00	394,902,000	
合同製鐵	166,000	155.00	25,730,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	705,200	1,520.00	1,071,904,000	
日新製鋼ホールディングス	116,100	711.00	82,547,100	
東京製鐵	145,600	365.00	53,144,000	
共英製鋼	27,400	1,514.00	41,483,600	
大和工業	56,700	2,458.00	139,368,600	
東京鐵鋼	62,000	284.00	17,608,000	

大阪製鐵	14,000	1,458.00	20,412,000	
淀川製鋼所	185,000	288.00	53,280,000	
東洋鋼鈑	62,000	286.00	17,732,000	
住友鋼管	17,800	653.00	11,623,400	
丸一鋼管	88,700	1,910.00	169,417,000	
モリ工業	47,000	240.00	11,280,000	
大同特殊鋼	427,000	427.00	182,329,000	
日本高周波鋼業	136,000	82.00	11,152,000	
日本冶金工業	185,000	91.00	16,835,000	
山陽特殊製鋼	142,000	299.00	42,458,000	
愛知製鋼	144,000	390.00	56,160,000	
日立金属	198,000	728.00	144,144,000	
日本金属	86,000	121.00	10,406,000	
大平洋金属	175,000	370.00	64,750,000	
日本電工	105,000	236.00	24,780,000	
栗本鐵工所	128,000	311.00	39,808,000	
日本鑄鉄管	39,000	240.00	9,360,000	
三菱製鋼	174,000	165.00	28,710,000	
日亜鋼業	44,000	219.00	9,636,000	
日本精線	22,000	306.00	6,732,000	
シンニッタン	27,400	352.00	9,644,800	
新家工業	71,000	121.00	8,591,000	
大紀アルミニウム工業所	59,000	208.00	12,272,000	
日本軽金属ホールディングス	557,300	90.00	50,157,000	
三井金属鉱業	710,000	213.00	151,230,000	
東邦亜鉛	155,000	356.00	55,180,000	
三菱マテリアル	1,615,000	281.00	453,815,000	
住友金属鉱山	715,000	1,213.00	867,295,000	
DOWAホールディングス	308,000	542.00	166,936,000	
古河機械金属	476,000	81.00	38,556,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	28,600	1,827.00	52,252,200	
東邦チタニウム	47,800	823.00	39,339,400	
住友軽金属工業	696,000	78.00	54,288,000	
古河スカイ	93,000	231.00	21,483,000	
古河電気工業	874,000	179.00	156,446,000	
住友電気工業	974,900	986.00	961,251,400	
フジクラ	422,000	253.00	106,766,000	
昭和電線ホールディングス	365,000	70.00	25,550,000	
タツタ電線	53,000	814.00	43,142,000	
日立電線	227,000	135.00	30,645,000	
沖電線	50,000	129.00	6,450,000	
カナレ電気	3,000	1,349.00	4,047,000	
平河ヒューテック	5,800	659.00	3,822,200	
リョービ	158,000	225.00	35,550,000	
アサヒホールディングス	39,600	1,443.00	57,142,800	
稲葉製作所	12,800	1,073.00	13,734,400	
宮地エンジニアリンググループ	103,000	166.00	17,098,000	
トーカロ	17,200	1,462.00	25,146,400	

アルファＣｏ	11,500	897.00	10,315,500	
SUMCO	148,200	737.00	109,223,400	
川田テクノロジーズ	7,400	1,194.00	8,835,600	
東洋製罐	192,000	1,098.00	210,816,000	
ホッカンホールディングス	72,000	242.00	17,424,000	
コロナ	14,400	1,037.00	14,932,800	
横河ブリッジホールディングス	56,000	742.00	41,552,000	
日本橋梁	26,400	388.00	10,243,200	
駒井ハルテック	62,000	257.00	15,934,000	
高田機工	33,000	207.00	6,831,000	
三和ホールディングス	256,000	373.00	95,488,000	
文化シャッター	75,000	392.00	29,400,000	
三協立山	37,800	1,586.00	59,950,800	
LIXILグループ	386,200	1,859.00	717,945,800	
日本フィルコン	25,000	379.00	9,475,000	
ノーリツ	54,300	1,461.00	79,332,300	
長府製作所	23,700	1,866.00	44,224,200	
リンナイ	44,400	5,880.00	261,072,000	
ダイニチ工業	16,000	866.00	13,856,000	
日東精工	41,000	264.00	10,824,000	
三洋工業	46,000	163.00	7,498,000	
岡部	57,000	600.00	34,200,000	
東プレ	53,800	794.00	42,717,200	
高周波熱錬	38,700	543.00	21,014,100	
東京製綱	184,000	123.00	22,632,000	
パイオラックス	11,400	2,000.00	22,800,000	
日本発條	201,000	672.00	135,072,000	
中央発條	40,000	294.00	11,760,000	
三益半導体工業	25,400	716.00	18,186,400	
アタカ大機	18,000	340.00	6,120,000	
日本製鋼所	431,000	520.00	224,120,000	
三浦工業	40,000	2,269.00	90,760,000	
タクマ	100,000	481.00	48,100,000	
ツガミ	77,000	574.00	44,198,000	
オークマ	176,000	560.00	98,560,000	
東芝機械	142,000	431.00	61,202,000	
アマダ	422,000	536.00	226,192,000	
アイダエンジニアリング	68,000	686.00	46,648,000	
牧野フライス製作所	134,000	503.00	67,402,000	
オーエスジー	114,500	1,199.00	137,285,500	
ダイジェット工業	41,000	155.00	6,355,000	
旭ダイヤモンド工業	70,300	800.00	56,240,000	
森精機製作所	149,000	671.00	99,979,000	
ディスコ	29,900	4,350.00	130,065,000	
日東工器	14,000	1,836.00	25,704,000	
豊和工業	167,000	84.00	14,028,000	
大阪機工	125,000	109.00	13,625,000	
島精機製作所	36,900	1,386.00	51,143,400	

日阪製作所	36,000	716.00	25,776,000	
やまびこ	11,800	1,221.00	14,407,800	
ペガサスミシン製造	34,200	188.00	6,429,600	
ナブテスコ	136,400	1,882.00	256,704,800	
三井海洋開発	24,000	1,877.00	45,048,000	
レオン自動機	28,000	191.00	5,348,000	
S M C	82,400	15,220.00	1,254,128,000	
新川	24,500	408.00	9,996,000	
ホソカワミクロン	50,000	529.00	26,450,000	
ユニオンツール	13,700	1,347.00	18,453,900	
オイレス工業	29,300	1,728.00	50,630,400	
サトーホールディングス	29,700	1,340.00	39,798,000	
日本エアータック	10,000	370.00	3,700,000	
日精樹脂工業	25,400	401.00	10,185,400	
ワイエイシイ	13,300	478.00	6,357,400	
小松製作所	1,290,200	2,106.00	2,717,161,200	
住友重機械工業	759,000	389.00	295,251,000	
日立建機	140,800	1,688.00	237,670,400	
日工	41,000	355.00	14,555,000	
巴工業	10,300	1,521.00	15,666,300	
井関農機	264,000	229.00	60,456,000	
T O W A	27,200	533.00	14,497,600	
丸山製作所	69,000	162.00	11,178,000	
北川鉄工所	137,000	141.00	19,317,000	
クボタ	1,473,000	977.00	1,439,121,000	
荏原実業	5,900	1,257.00	7,416,300	
三菱化工機	88,000	150.00	13,200,000	
月島機械	42,000	760.00	31,920,000	
帝国電機製作所	9,800	1,286.00	12,602,800	
新東工業	58,500	670.00	39,195,000	
澁谷工業	18,600	898.00	16,702,800	
アイチ コーポレーション	48,900	385.00	18,826,500	
小森コーポレーション	72,700	711.00	51,689,700	
鶴見製作所	21,000	668.00	14,028,000	
住友精密工業	44,000	419.00	18,436,000	
酒井重工業	57,000	286.00	16,302,000	
荏原製作所	514,000	363.00	186,582,000	
石井鐵工所	45,000	145.00	6,525,000	
西島製作所	33,000	640.00	21,120,000	
ダイキン工業	361,500	2,952.00	1,067,148,000	
オルガノ	48,000	503.00	24,144,000	
トーヨーカネツ	158,000	181.00	28,598,000	
栗田工業	152,000	1,892.00	287,584,000	
椿本チエイン	141,000	477.00	67,257,000	
大同工業	61,000	139.00	8,479,000	
日本コンベヤ	106,000	77.00	8,162,000	
木村化工機	29,700	351.00	10,424,700	
アネスト岩田	45,000	346.00	15,570,000	

ダイフク	124,500	543.00	67,603,500	
加藤製作所	65,000	255.00	16,575,000	
油研工業	56,000	146.00	8,176,000	
タダノ	132,000	676.00	89,232,000	
フジテック	79,000	637.00	50,323,000	
C K D	76,300	530.00	40,439,000	
キトー	151	75,200.00	11,355,200	
平和	55,000	1,296.00	71,280,000	
理想科学工業	19,900	1,593.00	31,700,700	
S A N K Y O	80,200	3,390.00	271,878,000	
日本金銭機械	25,300	718.00	18,165,400	
マースエンジニアリング	15,200	1,730.00	26,296,000	
福島工業	7,800	1,861.00	14,515,800	
ダイコク電機	12,800	1,764.00	22,579,200	
アマノ	76,300	734.00	56,004,200	
サンデン	145,000	352.00	51,040,000	
蛇の目ミシン工業	281,000	70.00	19,670,000	
マックス	40,000	1,026.00	41,040,000	
グローリー	78,400	1,954.00	153,193,600	
大和冷機工業	46,000	436.00	20,056,000	
セガサミーホールディングス	284,500	1,478.00	420,491,000	
日本ピストンリング	105,000	155.00	16,275,000	
リケン	98,000	311.00	30,478,000	
T P R	30,300	1,095.00	33,178,500	
ホシザキ電機	54,400	2,338.00	127,187,200	
大豊工業	19,800	940.00	18,612,000	
日本精工	585,000	590.00	345,150,000	
N T N	579,000	224.00	129,696,000	
ジェイテクト	278,900	778.00	216,984,200	
不二越	252,000	318.00	80,136,000	
日本トムソン	87,000	368.00	32,016,000	
T H K	177,700	1,556.00	276,501,200	
ユーシン精機	13,600	1,591.00	21,637,600	
前澤給装工業	10,000	1,058.00	10,580,000	
イーグル工業	35,000	687.00	24,045,000	
日本ピラー工業	29,000	555.00	16,095,000	
キッツ	112,200	407.00	45,665,400	
日立工機	67,700	682.00	46,171,400	
マキタ	160,900	3,870.00	622,683,000	
日立造船	1,056,000	116.00	122,496,000	
三菱重工業	4,423,000	404.00	1,786,892,000	
I H I	1,802,000	213.00	383,826,000	
イビデン	164,000	1,279.00	209,756,000	
コニカミノルタホールディングス	701,500	632.00	443,348,000	
ブラザー工業	342,800	902.00	309,205,600	
ミネベア	364,000	296.00	107,744,000	
日立製作所	6,177,000	496.00	3,063,792,000	
東芝	5,217,000	312.00	1,627,704,000	



三菱電機	2,641,000	744.00	1,964,904,000	
富士電機	805,000	199.00	160,195,000	
東洋電機製造	56,000	237.00	13,272,000	
安川電機	294,000	758.00	222,852,000	
シンフォニアテクノロジー	169,000	159.00	26,871,000	
明電舎	264,000	283.00	74,712,000	
オリジン電気	44,000	434.00	19,096,000	
デンヨー	24,500	984.00	24,108,000	
東芝テック	170,000	429.00	72,930,000	
芝浦メカトロニクス	53,000	171.00	9,063,000	
マブチモーター	38,800	3,690.00	143,172,000	
日本電産	143,400	4,845.00	694,773,000	
東光高岳ホールディングス	12,500	1,320.00	16,500,000	
ダイヘン	157,000	262.00	41,134,000	
ヤーマン	3,500	1,123.00	3,930,500	
JVCケンウッド	168,700	319.00	53,815,300	
第一精工	9,300	1,277.00	11,876,100	
日新電機	56,000	465.00	26,040,000	
大崎電気工業	39,000	466.00	18,174,000	
オムロン	294,500	1,983.00	583,993,500	
日東工業	40,300	1,163.00	46,868,900	
I D E C	35,600	790.00	28,124,000	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	514,000	330.00	169,620,000	
サクサホールディングス	79,000	154.00	12,166,000	
メルコホールディングス	15,400	1,577.00	24,285,800	
日本電気	3,436,000	167.00	573,812,000	
富士通	2,550,000	344.00	877,200,000	
沖電気工業	1,008,000	93.00	93,744,000	
岩崎通信機	132,000	70.00	9,240,000	
電気興業	79,000	358.00	28,282,000	
サンケン電気	142,000	323.00	45,866,000	
ナカヨ通信機	28,000	257.00	7,196,000	
アイホン	16,600	1,442.00	23,937,200	
ルネサスエレクトロニクス	68,000	300.00	20,400,000	
セイコーエプソン	185,500	598.00	110,929,000	
ワコム	504	229,200.00	115,516,800	
アルバック	54,700	741.00	40,532,700	
アクセル	12,700	1,966.00	24,968,200	
ナナオ	23,200	1,344.00	31,180,800	
日本信号	63,900	576.00	36,806,400	
京三製作所	58,000	283.00	16,414,000	
能美防災	34,000	585.00	19,890,000	
ホーチキ	25,000	447.00	11,175,000	
日本無線	69,000	238.00	16,422,000	
パナソニック	3,026,600	501.00	1,516,326,600	
シャープ	1,029,000	307.00	315,903,000	
アンリツ	141,000	1,077.00	151,857,000	
富士通ゼネラル	64,000	758.00	48,512,000	

日立国際電気	62,000	605.00	37,510,000	
ソニー	1,658,900	936.00	1,552,730,400	
T D K	149,700	3,160.00	473,052,000	
帝国通信工業	75,000	146.00	10,950,000	
ミツミ電機	96,900	458.00	44,380,200	
タムラ製作所	91,000	195.00	17,745,000	
アルプス電気	200,200	526.00	105,305,200	
パイオニア	338,300	230.00	77,809,000	
日本電波工業	22,300	978.00	21,809,400	
日本トリム	2,950	2,412.00	7,115,400	
ローランド ディー . ジー .	12,000	1,025.00	12,300,000	
フォスター電機	26,000	1,341.00	34,866,000	
クラリオン	53,000	155.00	8,215,000	
S M K	88,000	218.00	19,184,000	
ヨコオ	22,300	397.00	8,853,100	
東光	133,000	208.00	27,664,000	
ホシデン	73,200	512.00	37,478,400	
ヒロセ電機	45,900	10,230.00	469,557,000	
日本航空電子工業	63,000	608.00	38,304,000	
T O A	30,000	593.00	17,790,000	
ユニデン	83,000	193.00	16,019,000	
アルパイン	52,800	769.00	40,603,200	
スミダコーポレーション	19,600	484.00	9,486,400	
アイコム	14,200	1,822.00	25,872,400	
船井電機	25,000	1,141.00	28,525,000	
横河電機	267,400	928.00	248,147,200	
新電元工業	99,000	243.00	24,057,000	
アズビル	68,800	1,750.00	120,400,000	
日本光電工業	53,800	2,532.00	136,221,600	
チノー	50,000	201.00	10,050,000	
共和電業	29,000	258.00	7,482,000	
日本電子材料	8,800	384.00	3,379,200	
堀場製作所	54,000	2,448.00	132,192,000	
アドバンテスト	183,600	1,202.00	220,687,200	
小野測器	36,000	410.00	14,760,000	
エスベック	28,300	638.00	18,055,400	
パナソニック デバイス S U N X	25,700	342.00	8,789,400	
キーエンス	64,900	23,270.00	1,510,223,000	
日置電機	13,200	1,401.00	18,493,200	
シスメックス	93,600	3,880.00	363,168,000	
メガチップス	22,700	1,779.00	40,383,300	
O B A R A G R O U P	20,500	972.00	19,926,000	
日本電産コパル電子	27,600	424.00	11,702,400	
ミヤチテクノス	13,500	588.00	7,938,000	
コーセル	38,400	1,083.00	41,587,200	
日立メディコ	20,000	977.00	19,540,000	
オブテックス	18,900	1,040.00	19,656,000	
千代田インテグレ	13,500	853.00	11,515,500	

スタンレー電気	204,900	1,240.00	254,076,000	
岩崎電気	107,000	181.00	19,367,000	
ウシオ電機	161,600	983.00	158,852,800	
岡谷電機産業	7,000	321.00	2,247,000	
ヘリオス テクノ ホールディング	32,200	180.00	5,796,000	
日本セラミック	17,800	1,160.00	20,648,000	
日本デジタル研究所	23,400	929.00	21,738,600	
古河電池	21,000	513.00	10,773,000	
双信電機	15,600	320.00	4,992,000	
山一電機	32,800	155.00	5,084,000	
図研	17,400	581.00	10,109,400	
日本電子	107,000	218.00	23,326,000	
カシオ計算機	256,900	807.00	207,318,300	
ファナック	275,000	15,400.00	4,235,000,000	
日本シイエムケイ	62,300	329.00	20,496,700	
エンプラス	12,400	3,750.00	46,500,000	
ローム	140,500	2,744.00	385,532,000	
浜松ホトニクス	102,700	3,005.00	308,613,500	
三井ハイテック	37,500	605.00	22,687,500	
新光電気工業	93,000	613.00	57,009,000	
京セラ	219,300	7,640.00	1,675,452,000	
太陽誘電	125,300	728.00	91,218,400	
村田製作所	277,400	4,845.00	1,344,003,000	
ユーシン	39,100	453.00	17,712,300	
双葉電子工業	45,600	954.00	43,502,400	
北陸電気工業	127,000	100.00	12,700,000	
ニチコン	85,800	711.00	61,003,800	
日本ケミコン	161,000	164.00	26,404,000	
K O A	32,400	690.00	22,356,000	
市光工業	72,000	136.00	9,792,000	
小糸製作所	131,000	1,212.00	158,772,000	
ミツバ	50,000	642.00	32,100,000	
スター精密	43,700	875.00	38,237,500	
大日本スクリーン製造	268,000	525.00	140,700,000	
キャノン電子	23,400	1,878.00	43,945,200	
キャノン	1,640,700	3,455.00	5,668,618,500	
リコー	799,000	971.00	775,829,000	
M U T O Hホールディングス	42,000	213.00	8,946,000	
東京エレクトロン	222,900	3,850.00	858,165,000	
トヨタ紡織	94,100	879.00	82,713,900	
鬼怒川ゴム工業	53,000	536.00	28,408,000	
ユニプレス	46,400	1,952.00	90,572,800	
豊田自動織機	236,600	2,617.00	619,182,200	
モリタホールディングス	42,000	738.00	30,996,000	
三櫻工業	38,700	540.00	20,898,000	
デンソー	650,700	2,930.00	1,906,551,000	
東海理化電機製作所	63,400	1,100.00	69,740,000	
三井造船	1,044,000	128.00	133,632,000	

佐世保重工業	202,000	89.00	17,978,000	
川崎重工業	2,056,000	219.00	450,264,000	
日本車輛製造	95,000	334.00	31,730,000	
日本輸送機	41,000	301.00	12,341,000	
近畿車輛	51,000	282.00	14,382,000	
日産自動車	3,336,200	844.00	2,815,752,800	
いすゞ自動車	1,534,000	490.00	751,660,000	
トヨタ自動車	3,394,100	3,850.00	13,067,285,000	代用有価証券で 1,800,000株 担保差入
日野自動車	331,000	734.00	242,954,000	
三菱自動車工業	6,094,000	91.00	554,554,000	
エフテック	10,400	1,170.00	12,168,000	
武蔵精密工業	26,600	1,753.00	46,629,800	
日産車体	86,000	1,022.00	87,892,000	
新明和工業	112,000	548.00	61,376,000	
極東開発工業	46,700	839.00	39,181,300	
日信工業	49,900	1,308.00	65,269,200	
トピー工業	201,000	189.00	37,989,000	
ティラド	99,000	209.00	20,691,000	
曙ブレーキ工業	130,800	393.00	51,404,400	
タチエス	34,800	1,452.00	50,529,600	
NOK	129,400	1,309.00	169,384,600	
フタバ産業	78,200	350.00	27,370,000	
カヤバ工業	192,000	336.00	64,512,000	
シロキ工業	62,000	201.00	12,462,000	
大同メタル工業	41,000	699.00	28,659,000	
プレス工業	122,000	363.00	44,286,000	
カルソニックカンセイ	173,000	374.00	64,702,000	
太平洋工業	55,000	498.00	27,390,000	
ケーヒン	56,100	1,268.00	71,134,800	
河西工業	35,000	398.00	13,930,000	
アイシン精機	240,300	2,613.00	627,903,900	
富士機工	36,000	267.00	9,612,000	
マツダ	4,216,000	150.00	632,400,000	
ダイハツ工業	280,000	1,645.00	460,600,000	
今仙電機製作所	21,000	1,020.00	21,420,000	
本田技研工業	2,226,600	3,070.00	6,835,662,000	
スズキ	553,100	2,132.00	1,179,209,200	
富士重工業	835,000	1,037.00	865,895,000	
ヤマハ発動機	406,100	917.00	372,393,700	
ショーワ	59,500	862.00	51,289,000	
T B K	28,000	421.00	11,788,000	
エクセディ	36,600	1,853.00	67,819,800	
豊田合成	75,000	1,723.00	129,225,000	
愛三工業	30,200	714.00	21,562,800	
ヨロズ	16,100	1,210.00	19,481,000	
エフ・シー・シー	43,700	1,759.00	76,868,300	

シマノ	106,600	5,660.00	603,356,000	
タカタ	47,600	1,708.00	81,300,800	
テイ・エス テック	56,100	1,574.00	88,301,400	
日本電産トーソク	13,600	621.00	8,445,600	
テルモ	202,200	3,580.00	723,876,000	
クリエートメディック	7,800	824.00	6,427,200	
日機装	92,000	945.00	86,940,000	
島津製作所	317,000	526.00	166,742,000	
JMS	36,000	301.00	10,836,000	
長野計器	17,900	705.00	12,619,500	
ブイ・テクノロジー	57	197,800.00	11,274,600	
東京計器	85,000	147.00	12,495,000	
愛知時計電機	29,000	290.00	8,410,000	
東京精密	48,100	1,369.00	65,848,900	
マニー	7,700	3,295.00	25,371,500	
ニコン	493,200	2,523.00	1,244,343,600	
トプコン	53,000	637.00	33,761,000	
オリンパス	312,300	1,532.00	478,443,600	
理研計器	22,600	522.00	11,797,200	
タムロン	20,800	2,430.00	50,544,000	
HOYA	642,000	1,648.00	1,058,016,000	
ノーリツ鋼機	24,200	322.00	7,792,400	
エー・アンド・デイ	25,600	303.00	7,756,800	
日本電産コパル	21,800	695.00	15,151,000	
シチズンホールディングス	314,400	446.00	140,222,400	
リズム時計工業	127,000	158.00	20,066,000	
大研医器	3,300	1,809.00	5,969,700	
松風	13,500	814.00	10,989,000	
セイコーホールディングス	165,000	201.00	33,165,000	
ニプロ	142,400	610.00	86,864,000	
パラマウントベッドホールディングス	23,000	2,585.00	59,455,000	
永大産業	38,000	358.00	13,604,000	
ダンロップスポーツ	15,400	1,056.00	16,262,400	
バンダイナムコホールディングス	274,100	1,100.00	301,510,000	
共立印刷	41,300	222.00	9,168,600	
フランスベッドホールディングス	181,000	171.00	30,951,000	
パイロットコーポレーション	222	165,000.00	36,630,000	
トッパン・フォームズ	48,400	776.00	37,558,400	
フジシールインターナショナル	30,700	1,699.00	52,159,300	
タカラトミー	88,400	459.00	40,575,600	
廣済堂	27,100	302.00	8,184,200	
アーク	95,800	172.00	16,477,600	
タカノ	10,100	410.00	4,141,000	
プロネクサス	29,600	470.00	13,912,000	
ホクシン	28,900	180.00	5,202,000	
ウッドワン	51,000	259.00	13,209,000	
大建工業	115,000	233.00	26,795,000	
凸版印刷	743,000	520.00	386,360,000	

大日本印刷	805,000	642.00	516,810,000	
図書印刷	59,000	131.00	7,729,000	
共同印刷	93,000	219.00	20,367,000	
日本写真印刷	35,300	920.00	32,476,000	
光村印刷	24,000	249.00	5,976,000	
宝印刷	10,400	574.00	5,969,600	
アシックス	247,000	1,291.00	318,877,000	
ツツミ	13,200	2,229.00	29,422,800	
ローランド	30,000	634.00	19,020,000	
小松ウオール工業	10,300	1,179.00	12,143,700	
ヤマハ	193,600	829.00	160,494,400	
河合楽器製作所	107,000	161.00	17,227,000	
クリナップ	28,000	599.00	16,772,000	
ピジョン	20,100	4,020.00	80,802,000	
兼松日産農林	51,000	145.00	7,395,000	
キングジム	23,000	646.00	14,858,000	
リンテック	51,100	1,575.00	80,482,500	
イトーキ	60,400	425.00	25,670,000	
任天堂	151,200	8,970.00	1,356,264,000	
三菱鉛筆	20,900	1,438.00	30,054,200	
タカラスタンド	117,000	628.00	73,476,000	
コクヨ	134,600	630.00	84,798,000	
ナカバヤシ	62,000	178.00	11,036,000	
グローブライド	153,000	98.00	14,994,000	
岡村製作所	97,000	613.00	59,461,000	
美津濃	127,000	390.00	49,530,000	
アデランス	33,800	1,127.00	38,092,600	
東京電力	1,832,600	230.00	421,498,000	
中部電力	812,500	1,159.00	941,687,500	
関西電力	1,086,600	904.00	982,286,400	
中国電力	367,600	1,342.00	493,319,200	
北陸電力	266,300	989.00	263,370,700	
東北電力	666,300	818.00	545,033,400	
四国電力	243,200	1,287.00	312,998,400	
九州電力	591,900	912.00	539,812,800	
北海道電力	254,400	960.00	244,224,000	
沖縄電力	17,500	2,679.00	46,882,500	
電源開発	166,000	2,107.00	349,762,000	
東京瓦斯	3,176,000	407.00	1,292,632,000	
大阪瓦斯	2,564,000	321.00	823,044,000	
東邦瓦斯	672,000	475.00	319,200,000	
北海道瓦斯	57,000	228.00	12,996,000	
西部瓦斯	298,000	222.00	66,156,000	
静岡瓦斯	72,000	602.00	43,344,000	
東武鉄道	1,505,000	447.00	672,735,000	
相鉄ホールディングス	414,000	278.00	115,092,000	
東京急行電鉄	1,550,000	460.00	713,000,000	
京浜急行電鉄	681,000	748.00	509,388,000	

小田急電鉄	843,000	859.00	724,137,000	
京王電鉄	737,000	618.00	455,466,000	
京成電鉄	398,000	719.00	286,162,000	
富士急行	77,000	505.00	38,885,000	
新京成電鉄	37,000	357.00	13,209,000	
東日本旅客鉄道	492,400	5,510.00	2,713,124,000	
西日本旅客鉄道	230,300	3,400.00	783,020,000	
東海旅客鉄道	219,600	6,870.00	1,508,652,000	
西日本鉄道	335,000	343.00	114,905,000	
ハマキョウレックス	8,300	2,625.00	21,787,500	
サカイ引越センター	5,400	1,740.00	9,396,000	
近畿日本鉄道	2,393,000	343.00	820,799,000	
阪急阪神ホールディングス	1,666,000	447.00	744,702,000	
南海電気鉄道	547,000	387.00	211,689,000	
京阪電気鉄道	587,000	390.00	228,930,000	
名糖運輸	12,600	601.00	7,572,600	
名古屋鉄道	917,000	226.00	207,242,000	
日本通運	1,047,000	320.00	335,040,000	
ヤマトホールディングス	498,400	1,278.00	636,955,200	
山九	328,000	320.00	104,960,000	
丸運	19,400	202.00	3,918,800	
丸全昭和運輸	81,000	249.00	20,169,000	
センコー	110,000	360.00	39,600,000	
トナミホールディングス	62,000	186.00	11,532,000	
日本梱包運輸倉庫	81,500	961.00	78,321,500	
日本石油輸送	33,000	194.00	6,402,000	
福山通運	155,000	431.00	66,805,000	
セイノーホールディングス	201,000	539.00	108,339,000	
神奈川中央交通	33,000	472.00	15,576,000	
日立物流	45,400	1,178.00	53,481,200	
日本郵船	2,091,000	188.00	393,108,000	
商船三井	1,295,000	229.00	296,555,000	
川崎汽船	1,112,000	124.00	137,888,000	
NSユナイテッド海運	142,000	109.00	15,478,000	
乾汽船	40,800	223.00	9,098,400	
飯野海運	123,100	268.00	32,990,800	
共栄タンカー	36,000	191.00	6,876,000	
第一中央汽船	166,000	64.00	10,624,000	
日本航空	223,100	3,695.00	824,354,500	
全日本空輸	5,185,000	177.00	917,745,000	
パスコ	32,000	262.00	8,384,000	
日新	99,000	207.00	20,493,000	
三菱倉庫	186,000	1,174.00	218,364,000	
三井倉庫	127,000	310.00	39,370,000	
住友倉庫	176,000	394.00	69,344,000	
澁澤倉庫	68,000	254.00	17,272,000	
東陽倉庫	42,000	192.00	8,064,000	
日本トランスシティ	59,000	307.00	18,113,000	

ケイヒン	61,000	102.00	6,222,000	
安田倉庫	21,600	573.00	12,376,800	
東洋埠頭	84,000	136.00	11,424,000	
宇徳	25,700	246.00	6,322,200	
上組	293,000	673.00	197,189,000	
サンリツ	8,900	510.00	4,539,000	
キューソー流通システム	7,300	916.00	6,686,800	
郵船ロジスティクス	22,200	804.00	17,848,800	
近鉄エクスプレス	24,100	2,782.00	67,046,200	
東海運	21,300	221.00	4,707,300	
N E C ネットエスアイ	25,200	1,598.00	40,269,600	
システナ	294	73,500.00	21,609,000	
新日鉄住金ソリューションズ	18,300	1,571.00	28,749,300	
コア	9,800	753.00	7,379,400	
I T ホールディングス	88,900	1,000.00	88,900,000	
ネオス	52	61,300.00	3,187,600	
グリーン	136,400	1,371.00	187,004,400	
コーエーテックホールディングス	54,100	750.00	40,575,000	
三菱総合研究所	11,000	1,868.00	20,548,000	
ボルテージ	5,400	863.00	4,660,200	
K L a b	11,800	534.00	6,301,200	
ネクソン	217,700	886.00	192,882,200	
ドワンゴ	147	181,900.00	26,739,300	
マクロミル	27,500	950.00	26,125,000	
ティーガイア	32,200	812.00	26,146,400	
G M O ペイメントゲートウェイ	9,800	1,369.00	13,416,200	
ザッパラス	163	81,700.00	13,317,100	
インターネットイニシアティブ	32,400	1,980.00	64,152,000	
S R A ホールディングス	12,100	920.00	11,132,000	
朝日ネット	19,000	408.00	7,752,000	
パナソニック インフォメーション システムズ	4,900	1,920.00	9,408,000	
フェイス	901	8,870.00	7,991,870	
野村総合研究所	149,100	1,712.00	255,259,200	
インテージ	8,000	1,823.00	14,584,000	
シンプレクス・ホールディングス	532	23,540.00	12,523,280	
クレスコ	7,100	579.00	4,110,900	
フジ・メディア・ホールディングス	2,545	125,100.00	318,379,500	
オービック	9,120	17,400.00	158,688,000	
T D C ソフトウェアエンジニアリング	5,600	774.00	4,334,400	
ヤフー	19,219	28,340.00	544,666,460	
トレンドマイクロ	103,900	2,440.00	253,516,000	
日本オラクル	52,900	3,490.00	184,621,000	
アルファシステムズ	9,800	1,082.00	10,603,600	
フューチャーアーキテクト	313	34,600.00	10,829,800	
シーエーシー	15,800	696.00	10,996,800	
オービックビジネスコンサルタント	8,000	4,680.00	37,440,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	31,800	3,655.00	116,229,000	
アイティフォー	31,300	318.00	9,953,400	



大塚商会	23,700	6,580.00	155,946,000	
サイボウズ	433	24,600.00	10,651,800	
電通国際情報サービス	18,600	795.00	14,787,000	
ウェザーニューズ	6,800	2,626.00	17,856,800	
C I J	27,400	330.00	9,042,000	
WOWOW	86	184,900.00	15,901,400	
ネットワンシステムズ	96,700	817.00	79,003,900	
アルゴグラフィックス	8,500	1,116.00	9,486,000	
エイベックス・グループ・ホールディングス	51,400	1,791.00	92,057,400	
日本ユニシス	66,200	566.00	37,469,200	
兼松エレクトロニクス	13,000	990.00	12,870,000	
東京放送ホールディングス	141,600	826.00	116,961,600	
日本テレビホールディングス	239,000	1,110.00	265,290,000	
テレビ朝日	66,400	1,142.00	75,828,800	
スカパーJ S A Tホールディングス	2,330	35,250.00	82,132,500	
テレビ東京ホールディングス	17,600	909.00	15,998,400	
アイ・ティー・シーネットワーク	22,600	659.00	14,893,400	
イー・アクセス	2,814	62,600.00	176,156,400	
NECモバイルリング	9,400	3,500.00	32,900,000	
日本電信電話	1,097,200	3,630.00	3,982,836,000	
K D D I	367,900	6,080.00	2,236,832,000	
光通信	29,300	3,605.00	105,626,500	
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	21,446	123,100.00	2,640,002,600	
GMOインターネット	83,200	498.00	41,433,600	
学研ホールディングス	89,000	222.00	19,758,000	
ゼンリン	38,100	1,108.00	42,214,800	
昭文社	13,400	548.00	7,343,200	
角川グループホールディングス	24,000	2,285.00	54,840,000	
インプレスホールディングス	36,100	129.00	4,656,900	
アイネット	13,400	620.00	8,308,000	
松竹	176,000	875.00	154,000,000	
東宝	185,000	1,430.00	264,550,000	
東映	112,000	458.00	51,296,000	
A O I P r o .	12,500	556.00	6,950,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	1,612	260,200.00	419,442,400	
D T S	27,800	1,098.00	30,524,400	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	95,200	1,104.00	105,100,800	
シーイーシー	15,400	494.00	7,607,600	
カブコン	52,200	1,476.00	77,047,200	
ジャステック	14,100	509.00	7,176,900	
S C S K	64,400	1,376.00	88,614,400	
アイネス	33,900	542.00	18,373,800	
T K C	23,500	1,466.00	34,451,000	
富士ソフト	38,400	1,670.00	64,128,000	
N S D	49,000	750.00	36,750,000	
コナミ	118,800	2,095.00	248,886,000	
J B C C ホールディングス	21,500	633.00	13,609,500	

ソフトバンク	1,188,800	3,115.00	3,703,112,000	
高千穂交易	10,300	884.00	9,105,200	
伊藤忠食品	6,500	2,935.00	19,077,500	
エレマテック	14,600	1,101.00	16,074,600	
JALUX	9,200	839.00	7,718,800	
あらた	63,000	340.00	21,420,000	
トーメンデバイス	3,600	1,736.00	6,249,600	
双日	1,654,800	120.00	198,576,000	
アルフレッサ ホールディングス	67,800	3,415.00	231,537,000	
横浜冷凍	64,900	596.00	38,680,400	
アルコニックス	7,700	1,383.00	10,649,100	
あい ホールディングス	42,500	593.00	25,202,500	
ダイワボウホールディングス	253,000	167.00	42,251,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	49,900	876.00	43,712,400	
UKCホールディングス	16,900	1,698.00	28,696,200	
TOKAIホールディングス	111,200	274.00	30,468,800	
ミタチ産業	8,800	398.00	3,502,400	
シップヘルスケアホールディングス	35,800	2,360.00	84,488,000	
協栄産業	42,000	146.00	6,132,000	
小野建	22,500	743.00	16,717,500	
佐鳥電機	20,200	436.00	8,807,200	
伯東	14,300	783.00	11,196,900	
コンドーテック	21,200	445.00	9,434,000	
ナガイレーベン	34,600	1,145.00	39,617,000	
三菱食品	27,400	2,219.00	60,800,600	
松田産業	19,800	1,052.00	20,829,600	
メディパルホールディングス	262,900	946.00	248,703,400	
アドヴァン	17,600	928.00	16,332,800	
SPK	5,400	1,417.00	7,651,800	
アズワン	17,500	1,767.00	30,922,500	
スズデン	7,700	459.00	3,534,300	
尾家産業	8,900	853.00	7,591,700	
シモジマ	16,900	941.00	15,902,900	
ドウシシャ	12,600	2,303.00	29,017,800	
高速	16,800	719.00	12,079,200	
黒田電気	33,200	1,044.00	34,660,800	
丸文	23,000	378.00	8,694,000	
ハピネット	15,300	676.00	10,342,800	
トーメンエレクトロニクス	12,700	1,053.00	13,373,100	
エクセル	12,000	715.00	8,580,000	
マルカキカイ	9,500	952.00	9,044,000	
ガリバーインターナショナル	8,630	3,080.00	26,580,400	
日本エム・ディ・エム	30,100	252.00	7,585,200	
進和	17,600	955.00	16,808,000	
ダイトエレクトロン	17,300	360.00	6,228,000	
シークス	18,000	1,011.00	18,198,000	
田中商事	11,000	454.00	4,994,000	
オーハシテクニカ	16,700	590.00	9,853,000	

マクニカ	14,200	1,670.00	23,714,000	
白銅	10,400	795.00	8,268,000	
伊藤忠商事	2,076,500	902.00	1,873,003,000	
丸紅	2,134,000	609.00	1,299,606,000	
高島	57,000	269.00	15,333,000	
F & A アクアホールディングス	20,500	882.00	18,081,000	
長瀬産業	144,100	938.00	135,165,800	
蝶理	18,200	926.00	16,853,200	
豊田通商	288,600	2,046.00	590,475,600	
三共生興	47,600	286.00	13,613,600	
兼松	582,000	111.00	64,602,000	
ツカモトコーポレーション	61,000	133.00	8,113,000	
三井物産	2,249,400	1,240.00	2,789,256,000	
日本紙パルプ商事	136,000	286.00	38,896,000	
日立ハイテクノロジーズ	79,500	1,741.00	138,409,500	
カメイ	34,000	732.00	24,888,000	
東都水産	55,000	130.00	7,150,000	
スターゼン	82,000	242.00	19,844,000	
山善	101,700	619.00	62,952,300	
椿本興業	30,000	243.00	7,290,000	
住友商事	1,535,500	1,090.00	1,673,695,000	
内田洋行	65,000	230.00	14,950,000	
三菱商事	2,033,100	1,630.00	3,313,953,000	
第一実業	58,000	402.00	23,316,000	
キャノンマーケティングジャパン	87,700	1,233.00	108,134,100	
西華産業	96,000	241.00	23,136,000	
佐藤商事	24,900	565.00	14,068,500	
菱洋エレクトロ	27,000	773.00	20,871,000	
東京産業	25,500	279.00	7,114,500	
ユアサ商事	279,000	152.00	42,408,000	
神鋼商事	70,000	160.00	11,200,000	
阪和興業	267,000	297.00	79,299,000	
カナデン	28,000	535.00	14,980,000	
菱電商事	36,000	488.00	17,568,000	
フルサト工業	16,500	758.00	12,507,000	
岩谷産業	289,000	305.00	88,145,000	
すてきナイスグループ	121,000	208.00	25,168,000	
昭光通商	105,000	134.00	14,070,000	
ニチモウ	45,000	184.00	8,280,000	
極東貿易	43,000	141.00	6,063,000	
イワキ	41,000	169.00	6,929,000	
三愛石油	60,000	373.00	22,380,000	
稲畑産業	64,600	572.00	36,951,200	
G S I クレオス	76,000	116.00	8,816,000	
明和産業	24,600	380.00	9,348,000	
東邦ホールディングス	84,600	1,502.00	127,069,200	
サンゲツ	44,400	2,080.00	92,352,000	
ミツウロコグループホールディングス	44,200	482.00	21,304,400	

シナネン	43,000	354.00	15,222,000	
伊藤忠エネクス	54,100	447.00	24,182,700	
サンリオ	67,100	2,723.00	182,713,300	
サンワテクノス	14,400	600.00	8,640,000	
リョーサン	43,000	1,446.00	62,178,000	
新光商事	28,900	718.00	20,750,200	
トーホー	50,000	316.00	15,800,000	
三信電気	38,800	589.00	22,853,200	
東陽テクニカ	37,700	955.00	36,003,500	
モスフードサービス	32,400	1,582.00	51,256,800	
加賀電子	28,400	748.00	21,243,200	
ソーダニッカ	26,000	372.00	9,672,000	
立花エレテック	16,700	705.00	11,773,500	
P a l t a c	29,000	973.00	28,217,000	
太平洋興発	114,000	81.00	9,234,000	
ヤマタネ	148,000	117.00	17,316,000	
丸紅建材リース	39,000	152.00	5,928,000	
日鐵商事	65,000	217.00	14,105,000	
トラスコ中山	30,400	1,563.00	47,515,200	
オートバックスセブン	31,700	3,460.00	109,682,000	
加藤産業	35,000	1,534.00	53,690,000	
イノテック	23,700	403.00	9,551,100	
イエローハット	25,400	1,317.00	33,451,800	
富士エレクトロニクス	14,500	1,114.00	16,153,000	
J Kホールディングス	25,000	472.00	11,800,000	
日伝	11,300	2,149.00	24,283,700	
北沢産業	32,000	159.00	5,088,000	
杉本商事	13,600	781.00	10,621,600	
因幡電機産業	31,000	2,430.00	75,330,000	
住金物産	129,000	226.00	29,154,000	
ミスミグループ本社	96,900	2,286.00	221,513,400	
タキヒヨー	42,000	440.00	18,480,000	
スズケン	101,300	2,464.00	249,603,200	
ジェコス	20,600	582.00	11,989,200	
ローソン	99,200	5,730.00	568,416,000	
サンエー	8,700	3,200.00	27,840,000	
キリン堂	14,200	591.00	8,392,200	
カワチ薬品	18,700	1,665.00	31,135,500	
エービーシー・マート	31,000	3,720.00	115,320,000	
ハードオフコーポレーション	16,500	562.00	9,273,000	
アスクル	20,500	1,119.00	22,939,500	
ゲオホールディングス	424	88,200.00	37,396,800	
ポイント	23,820	3,055.00	72,770,100	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	48,000	86.00	4,128,000	
くらコーポレーション	16,600	1,185.00	19,671,000	
キャンドゥ	164	104,000.00	17,056,000	
パル	8,050	3,825.00	30,791,250	
エディオン	108,800	345.00	37,536,000	

サーラコーポレーション	26,000	494.00	12,844,000	
あみやき亭	45	201,000.00	9,045,000	
ひらまつ	102	97,000.00	9,894,000	
ゲンキー	3,500	1,945.00	6,807,500	
大黒天物産	4,500	2,604.00	11,718,000	
ハニーズ	24,550	1,119.00	27,471,450	
アルペン	19,600	1,534.00	30,066,400	
ビックカメラ	990	41,200.00	40,788,000	
DCMホールディングス	138,400	549.00	75,981,600	
MonotaRO	17,900	2,874.00	51,444,600	
J.フロントリテイリング	619,000	438.00	271,122,000	
ドトール・日レスホールディングス	42,500	1,075.00	45,687,500	
マツモトキヨシホールディングス	43,600	2,024.00	88,246,400	
スタートトゥデイ	54,100	800.00	43,280,000	
物語コーポレーション	3,300	2,320.00	7,656,000	
ココカラファイン	27,700	2,661.00	73,709,700	
三越伊勢丹ホールディングス	518,200	775.00	401,605,000	
ウエルシアホールディングス	9,900	2,934.00	29,046,600	
クリエイトSDホールディングス	9,200	2,418.00	22,245,600	
ブックオフコーポレーション	16,000	671.00	10,736,000	
あさひ	15,800	1,190.00	18,802,000	
日本調剤	4,200	2,049.00	8,605,800	
コスモス薬品	11,600	8,660.00	100,456,000	
セブン&アイ・ホールディングス	1,090,800	2,408.00	2,626,646,400	
ツルハホールディングス	21,900	6,750.00	147,825,000	
サンマルクホールディングス	7,600	3,000.00	22,800,000	
フェリシモ	8,100	1,108.00	8,974,800	
トリドール	23,500	918.00	21,573,000	
クスリのアオキ	4,100	4,710.00	19,311,000	
メディカルシステムネットワーク	17,800	439.00	7,814,200	
総合メディカル	7,300	2,872.00	20,965,600	
はるやま商事	18,400	481.00	8,850,400	
カップ・クリエイトホールディングス	18,950	1,820.00	34,489,000	
ライトオン	23,400	665.00	15,561,000	
良品計画	27,400	4,895.00	134,123,000	
三城ホールディングス	36,500	452.00	16,498,000	
コナカ	32,800	587.00	19,253,600	
イオン北海道	9,600	403.00	3,868,800	
コジマ	45,800	263.00	12,045,400	
コーナン商事	29,800	1,023.00	30,485,400	
エコス	11,500	525.00	6,037,500	
ワタミ	31,500	1,699.00	53,518,500	
ドン・キホーテ	70,500	3,135.00	221,017,500	
メガネトップ	44,700	1,020.00	45,594,000	
西松屋チェーン	52,100	705.00	36,730,500	
ゼンショーホールディングス	100,000	981.00	98,100,000	
幸楽苑	14,000	1,222.00	17,108,000	
サイゼリヤ	38,600	1,169.00	45,123,400	

ユナイテッドアローズ	31,500	2,001.00	63,031,500	
ハイデイ日高	12,500	1,456.00	18,200,000	
京都きもの友禅	17,100	992.00	16,963,200	
コロワイド	86,500	739.00	63,923,500	
壱番屋	9,000	2,608.00	23,472,000	
スギホールディングス	42,500	2,923.00	124,227,500	
スクロール	40,700	266.00	10,826,200	
ファミリーマート	81,000	3,560.00	288,360,000	
木曽路	29,600	1,697.00	50,231,200	
千趣会	45,600	539.00	24,578,400	
タカキュー	30,000	299.00	8,970,000	
ケーヨー	44,900	468.00	21,013,200	
上新電機	54,000	874.00	47,196,000	
日本瓦斯	31,900	1,179.00	37,610,100	
ベスト電器	101,000	138.00	13,938,000	
マルエツ	57,000	277.00	15,789,000	
ロイヤルホールディングス	41,700	1,047.00	43,659,900	
東天紅	27,000	206.00	5,562,000	
いなげや	24,300	995.00	24,178,500	
島忠	58,500	1,808.00	105,768,000	
チヨダ	31,800	2,175.00	69,165,000	
ライフコーポレーション	17,900	1,258.00	22,518,200	
カスミ	47,200	535.00	25,252,000	
リンガーハット	24,400	1,064.00	25,961,600	
テンアライド	28,900	282.00	8,149,800	
A O K Iホールディングス	24,400	1,955.00	47,702,000	
オークワ	39,000	1,095.00	42,705,000	
コメリ	40,600	2,185.00	88,711,000	
青山商事	73,900	1,536.00	113,510,400	
しまむら	30,300	8,410.00	254,823,000	
C F Sコーポレーション	20,900	367.00	7,670,300	
高島屋	355,000	556.00	197,380,000	
松屋	56,500	807.00	45,595,500	
エイチ・ツー・オー リテイリング	170,000	746.00	126,820,000	
ニッセンホールディングス	55,000	322.00	17,710,000	
パルコ	49,800	872.00	43,425,600	
丸井グループ	342,400	649.00	222,217,600	
原信ナルスホールディングス	13,100	1,520.00	19,912,000	
井筒屋	188,000	56.00	10,528,000	
ダイエー	167,450	190.00	31,815,500	
イズミヤ	96,000	456.00	43,776,000	
イオン	917,100	964.00	884,084,400	
ユニー	248,800	636.00	158,236,800	
イズミ	66,200	1,842.00	121,940,400	
東武ストア	36,000	266.00	9,576,000	
平和堂	49,000	1,225.00	60,025,000	
フジ	29,100	1,772.00	51,565,200	
ヤオコー	11,800	3,325.00	39,235,000	

ゼビオ	34,100	1,673.00	57,049,300	
ケーズホールディングス	65,700	2,147.00	141,057,900	
Olympic	18,400	809.00	14,885,600	
日産東京販売ホールディングス	45,000	328.00	14,760,000	
アインファーマシーズ	14,800	4,475.00	66,230,000	
元気寿司	10,100	1,054.00	10,645,400	
ヤマダ電機	120,320	3,185.00	383,219,200	
アークランドサカモト	17,900	1,342.00	24,021,800	
ニトリホールディングス	51,800	6,160.00	319,088,000	
グルメ杵屋	22,000	536.00	11,792,000	
愛眼	28,400	304.00	8,633,600	
吉野家ホールディングス	715	105,600.00	75,504,000	
松屋フーズ	9,600	1,506.00	14,457,600	
サガミチェーン	33,000	663.00	21,879,000	
プレナス	29,800	1,370.00	40,826,000	
ミニストップ	19,000	1,440.00	27,360,000	
アークス	43,900	1,789.00	78,537,100	
パロー	53,600	1,318.00	70,644,800	
ベルク	11,400	1,235.00	14,079,000	
大庄	13,600	1,070.00	14,552,000	
ファーストリテイリング	52,200	21,230.00	1,108,206,000	
サンドラッグ	49,300	2,928.00	144,350,400	
東京デリカ	9,700	970.00	9,409,000	
ヤマザワ	7,000	1,495.00	10,465,000	
やまや	5,000	1,158.00	5,790,000	
ベルーナ	32,900	620.00	20,398,000	
島根銀行	7,100	1,117.00	7,930,700	
新生銀行	2,255,000	148.00	333,740,000	
あおぞら銀行	956,000	267.00	255,252,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	19,740,200	435.00	8,586,987,000	
りそなホールディングス	2,686,600	372.00	999,415,200	
三井住友トラスト・ホールディングス	5,456,000	294.00	1,604,064,000	
三井住友フィナンシャルグループ	1,971,700	3,010.00	5,934,817,000	
第四銀行	334,000	282.00	94,188,000	
北越銀行	260,000	172.00	44,720,000	
西日本シティ銀行	912,000	201.00	183,312,000	
千葉銀行	1,010,000	505.00	510,050,000	
横浜銀行	1,664,000	405.00	673,920,000	
常陽銀行	983,000	411.00	404,013,000	
群馬銀行	595,000	419.00	249,305,000	
武蔵野銀行	42,700	2,713.00	115,845,100	
千葉興業銀行	52,300	479.00	25,051,700	
筑波銀行	113,300	303.00	34,329,900	
東京都民銀行	51,100	772.00	39,449,200	
七十七銀行	414,000	337.00	139,518,000	
青森銀行	200,000	244.00	48,800,000	
秋田銀行	180,000	235.00	42,300,000	
山形銀行	161,000	388.00	62,468,000	

岩手銀行	18,200	3,625.00	65,975,000	
東邦銀行	224,000	277.00	62,048,000	
東北銀行	145,000	134.00	19,430,000	
みちのく銀行	138,000	172.00	23,736,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	1,060,000	334.00	354,040,000	
静岡銀行	765,000	842.00	644,130,000	
十六銀行	325,000	289.00	93,925,000	
スルガ銀行	257,000	1,044.00	268,308,000	
八十二銀行	478,000	427.00	204,106,000	
山梨中央銀行	162,000	360.00	58,320,000	
大垣共立銀行	345,000	295.00	101,775,000	
福井銀行	231,000	163.00	37,653,000	
北國銀行	304,000	305.00	92,720,000	
清水銀行	9,200	2,538.00	23,349,600	
滋賀銀行	243,000	536.00	130,248,000	
南都銀行	251,000	390.00	97,890,000	
百五銀行	235,000	390.00	91,650,000	
京都銀行	467,000	720.00	336,240,000	
三重銀行	104,000	184.00	19,136,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	1,851,000	123.00	227,673,000	
広島銀行	779,000	355.00	276,545,000	
山陰合同銀行	152,000	599.00	91,048,000	
中国銀行	200,000	1,199.00	239,800,000	
鳥取銀行	85,000	168.00	14,280,000	
伊予銀行	281,000	674.00	189,394,000	
百十四銀行	281,000	318.00	89,358,000	
四国銀行	191,000	228.00	43,548,000	
阿波銀行	210,000	491.00	103,110,000	
鹿児島銀行	166,000	544.00	90,304,000	
大分銀行	161,000	288.00	46,368,000	
宮崎銀行	178,000	206.00	36,668,000	
肥後銀行	204,000	481.00	98,124,000	
佐賀銀行	162,000	192.00	31,104,000	
十八銀行	168,000	221.00	37,128,000	
沖縄銀行	19,800	3,370.00	66,726,000	
琉球銀行	56,700	1,001.00	56,756,700	
八千代銀行	14,000	1,790.00	25,060,000	
セブン銀行	895,700	208.00	186,305,600	
みずほフィナンシャルグループ	33,549,900	147.00	4,931,835,300	
紀陽ホールディングス	1,037,000	120.00	124,440,000	
山口フィナンシャルグループ	260,000	739.00	192,140,000	
長野銀行	90,000	151.00	13,590,000	
名古屋銀行	243,000	308.00	74,844,000	
北洋銀行	391,600	234.00	91,634,400	
愛知銀行	9,500	4,675.00	44,412,500	
第三銀行	151,000	158.00	23,858,000	
中京銀行	113,000	181.00	20,453,000	
東日本銀行	116,000	186.00	21,576,000	



大光銀行	98,000	208.00	20,384,000	
愛媛銀行	154,000	220.00	33,880,000	
トマト銀行	108,000	159.00	17,172,000	
みなと銀行	244,000	150.00	36,600,000	
京葉銀行	209,000	382.00	79,838,000	
関西アーバン銀行	371,000	108.00	40,068,000	
栃木銀行	132,000	294.00	38,808,000	
北日本銀行	7,800	2,428.00	18,938,400	
東和銀行	280,000	91.00	25,480,000	
福島銀行	347,000	70.00	24,290,000	
大東銀行	183,000	86.00	15,738,000	
トモニホールディングス	205,100	374.00	76,707,400	
フィデアホールディングス	157,500	180.00	28,350,000	
池田泉州ホールディングス	221,400	504.00	111,585,600	
SBIホールディングス	332,600	701.00	233,152,600	
ジャフコ	34,700	2,453.00	85,119,100	
大和証券グループ本社	2,586,000	443.00	1,145,598,000	
野村ホールディングス	5,333,400	420.00	2,240,028,000	
岡三証券グループ	227,000	396.00	89,892,000	
丸三証券	82,900	397.00	32,911,300	
東洋証券	107,000	212.00	22,684,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	303,000	375.00	113,625,000	
光世証券	80,000	107.00	8,560,000	
水戸証券	76,000	222.00	16,872,000	
いちよし証券	62,800	560.00	35,168,000	
松井証券	156,000	692.00	107,952,000	
だいこう証券ビジネス	17,900	350.00	6,265,000	
マネックスグループ	2,856	18,760.00	53,578,560	
カブドットコム証券	109,300	335.00	36,615,500	
極東証券	37,200	817.00	30,392,400	
岩井コスモホールディングス	27,000	404.00	10,908,000	
NKSJホールディングス	580,000	1,863.00	1,080,540,000	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	779,700	1,651.00	1,287,284,700	
ソニーフィナンシャルホールディングス	249,700	1,507.00	376,297,900	
第一生命保険	13,958	113,200.00	1,580,045,600	
東京海上ホールディングス	1,009,100	2,337.00	2,358,266,700	
T&Dホールディングス	893,900	991.00	885,854,900	
クレディセゾン	230,500	1,955.00	450,627,500	
芙蓉総合リース	26,700	2,643.00	70,568,100	
興銀リース	39,000	2,289.00	89,271,000	
東京センチュリーリース	65,100	1,732.00	112,753,200	
日本証券金融	119,100	488.00	58,120,800	
大阪証券金融	53,000	214.00	11,342,000	
ポケットカード	38,000	388.00	14,744,000	
リコーリース	21,800	2,013.00	43,883,400	
イオンクレジットサービス	99,500	1,663.00	165,468,500	

アコム	52,120	2,375.00	123,785,000	
ジャックス	163,000	396.00	64,548,000	
オリエントコーポレーション	542,000	215.00	116,530,000	
日立キャピタル	54,900	1,777.00	97,557,300	
オリックス	137,510	9,280.00	1,276,092,800	
三菱UFJリース	68,990	3,600.00	248,364,000	
NECキャピタルソリューション	12,900	1,226.00	15,815,400	
日本駐車場開発	3,720	4,350.00	16,182,000	
ヒューリック	317,900	492.00	156,406,800	
野村不動産ホールディングス	127,000	1,552.00	197,104,000	
常和ホールディングス	6,000	1,699.00	10,194,000	
パーク24	140,200	1,316.00	184,503,200	
三井不動産	1,230,000	1,964.00	2,415,720,000	
三菱地所	1,827,000	1,815.00	3,316,005,000	
平和不動産	51,300	1,061.00	54,429,300	
東京建物	514,000	386.00	198,404,000	
ダイビル	70,200	735.00	51,597,000	
東急不動産	578,000	573.00	331,194,000	
京阪神ビルディング	34,600	410.00	14,186,000	
住友不動産	626,000	2,567.00	1,606,942,000	
東宝不動産	28,800	516.00	14,860,800	
大京	419,000	219.00	91,761,000	
テーオーシー	99,000	466.00	46,134,000	
東京楽天地	46,000	311.00	14,306,000	
レオパレス21	156,100	315.00	49,171,500	
フジ住宅	38,500	459.00	17,671,500	
空港施設	30,500	394.00	12,017,000	
住友不動産販売	10,030	3,855.00	38,665,650	
ゴールドクレスト	24,100	1,304.00	31,426,400	
東栄住宅	18,900	995.00	18,805,500	
日本エスリード	11,800	807.00	9,522,600	
東急リバブル	26,400	1,331.00	35,138,400	
飯田産業	26,400	827.00	21,832,800	
日神不動産	18,300	461.00	8,436,300	
アーネストワン	41,400	1,206.00	49,928,400	
タカラレーベン	32,000	910.00	29,120,000	
サンヨーハウジング名古屋	142	88,800.00	12,609,600	
イオンモール	120,500	2,275.00	274,137,500	
フージャースコーポレーション	105	62,500.00	6,562,500	
タクトホーム	160	87,400.00	13,984,000	
トーセイ	394	45,100.00	17,769,400	
エヌ・ティ・ティ都市開発	1,690	78,500.00	132,665,000	
日本空港ビルデング	91,300	897.00	81,896,100	
日本工営	95,000	289.00	27,455,000	
ネクスト	14,900	784.00	11,681,600	
日本M&Aセンター	13,900	3,005.00	41,769,500	
アコーディア・ゴルフ	1,207	76,800.00	92,697,600	
タケエイ	4,600	1,938.00	8,914,800	

パソナグループ	274	48,650.00	13,330,100	
リンクアンドモチベーション	111	32,750.00	3,635,250	
G C Aサヴィアングループ	127	100,600.00	12,776,200	
エス・エム・エス	79	175,700.00	13,880,300	
テンプホールディングス	38,100	1,083.00	41,262,300	
クックパッド	6,400	2,449.00	15,673,600	
学情	12,200	282.00	3,440,400	
スタジオアリス	13,900	1,277.00	17,750,300	
シミックホールディングス	11,400	1,220.00	13,908,000	
N E Cフィールドディング	20,500	1,029.00	21,094,500	
総合警備保障	101,600	1,058.00	107,492,800	
カカクコム	37,500	2,835.00	106,312,500	
ルネサンス	16,300	633.00	10,317,900	
ツクイ	12,800	1,660.00	21,248,000	
エムスリー	678	141,400.00	95,869,200	
ベストプライダル	82	84,200.00	6,904,400	
ディー・エヌ・エー	137,700	2,875.00	395,887,500	
博報堂D Yホールディングス	38,340	5,490.00	210,486,600	
ぐるなび	21,600	915.00	19,764,000	
ジェイコムホールディングス	6,800	690.00	4,692,000	
P G Mホールディングス	422	73,400.00	30,974,800	
J Pホールディングス	8,900	955.00	8,499,500	
イーピーエス	172	227,100.00	39,061,200	
アミューズ	9,500	1,667.00	15,836,500	
ケネディクス	2,948	17,210.00	50,735,080	
電通	251,600	2,153.00	541,694,800	
テイクアンドギヴ・ニーズ	1,356	8,190.00	11,105,640	
ぴあ	9,800	1,114.00	10,917,200	
イオンファンタジー	10,400	1,128.00	11,731,200	
みらかホールディングス	72,900	3,435.00	250,411,500	
アルプス技研	13,400	666.00	8,924,400	
サニックス	46,600	259.00	12,069,400	
オリエンタルランド	82,000	10,530.00	863,460,000	
ダスキン	72,500	1,554.00	112,665,000	
明光ネットワークジャパン	26,300	935.00	24,590,500	
ファルコS Dホールディングス	15,600	991.00	15,459,600	
ラウンドワン	92,000	493.00	45,356,000	
リゾートトラスト	44,300	1,639.00	72,607,700	
ビー・エム・エル	16,800	2,121.00	35,632,800	
ワタベウエディング	9,200	619.00	5,694,800	
もしもしホットライン	47,300	1,026.00	48,529,800	
東急コミュニティー	5,400	3,010.00	16,254,000	
リソー教育	3,119	6,710.00	20,928,490	
ユー・エス・エス	31,120	9,030.00	281,013,600	
セントラルスポーツ	8,400	1,256.00	10,550,400	
フルキャストホールディングス	365	16,010.00	5,843,650	
リゾートソリューション	36,000	167.00	6,012,000	
リロ・ホールディング	9,000	3,165.00	28,485,000	

エイチ・アイ・エス	23,200	2,937.00	68,138,400	
共立メンテナンス	13,100	1,798.00	23,553,800	
イチネンホールディングス	30,600	489.00	14,963,400	
建設技術研究所	16,600	615.00	10,209,000	
燦ホールディングス	6,300	1,228.00	7,736,400	
東京テアトル	127,000	111.00	14,097,000	
よみうりランド	61,000	286.00	17,446,000	
東京都競馬	225,000	135.00	30,375,000	
常磐興産	112,000	132.00	14,784,000	
カナモト	35,000	1,232.00	43,120,000	
東京ドーム	221,000	291.00	64,311,000	
トランス・コスモス	37,800	919.00	34,738,200	
乃村工藝社	60,000	340.00	20,400,000	
藤田観光	78,000	295.00	23,010,000	
日本管財	10,600	1,530.00	16,218,000	
トーカイ	11,500	2,170.00	24,955,000	
白洋舎	36,000	210.00	7,560,000	
セコム	286,600	4,255.00	1,219,483,000	
セントラル警備保障	15,000	811.00	12,165,000	
丹青社	33,000	317.00	10,461,000	
メイテック	44,400	1,871.00	83,072,400	
アサツー ディ・ケイ	46,100	1,964.00	90,540,400	
応用地質	30,500	1,002.00	30,561,000	
船井総合研究所	32,500	552.00	17,940,000	
進学会	13,900	300.00	4,170,000	
ベネッセホールディングス	84,900	3,515.00	298,423,500	
イオンディライト	27,000	1,649.00	44,523,000	
ナック	6,900	2,049.00	14,138,100	
ニチイ学館	55,800	661.00	36,883,800	
ダイセキ	43,700	1,178.00	51,478,600	
合計	407,407,573		305,334,868,390	

(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

「（デリバティブ取引に関する注記）」に同様の内容が記載されているため、省略しておりません。

## 「S M A M ・年金国内債券パッシブファンド＜適格機関投資家限定＞」の状況

## ( 1 ) 貸借対照表

( 単位：円 )

( 平成24年12月19日現在 )

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,183
親投資信託受益証券	56,748,853,735
流動資産合計	56,748,854,918
資産合計	56,748,854,918
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	7,430,257
未払委託者報酬	7,430,182
流動負債合計	14,860,439
負債合計	14,860,439
純資産の部	
元本等	
元本	48,794,578,512
剰余金	
剰余金又は欠損金 ( )	7,939,415,967
元本等合計	56,733,994,479
純資産合計	56,733,994,479
負債純資産合計	56,748,854,918

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針の注記 )

項目	自 平成24年 6月21日 至 平成24年12月19日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

## ( 追加情報 )

自 平成24年 6月21日 至 平成24年12月19日
当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」(企業会計基準第24号 平成21年12月4日)および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日)を適用しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項 目	(平成24年12月19日現在)
1. 受益権総数	平成24年12月19日における受益権の総数 48,794,578,512口
2. 1単位当たり純資産額	1.1627円 (1万口 = 11,627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24年 6月21日 至 平成24年12月19日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該評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24年12月19日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（デリバティブ取引に関する注記）

（平成24年12月19日現在）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

（自 平成24年6月21日 至 平成24年12月19日）

該当事項はありません。

（その他の注記）

（平成24年12月19日現在）

期首（平成24年 6月21日）における元本額	49,909,287,476円
期首より平成24年12月19日現在までの追加設定元本額	350,374,710円
期首より平成24年12月19日現在までの一部解約元本額	1,465,083,674円

（3）附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託 受益証券	国内債券（NOMURA - BPI）マザーファンド	45,344,669,385	56,748,853,735	
	親投資信託受益証券 小計	45,344,669,385	56,748,853,735	
合計		45,344,669,385	56,748,853,735	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考情報）

S M A M ・年金国内債券パッシブファンド＜適格機関投資家限定＞は、「国内債券（NOMURA - B P I）マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

「国内債券（NOMURA - B P I）マザーファンド」の状況

（1）貸借対照表

（単位：円）

（平成24年12月19日現在）

資産の部

流動資産

コール・ローン	811,038,303
国債証券	122,343,227,590
地方債証券	10,670,661,795
特殊債券	16,890,669,541
社債券	10,383,737,400



未収入金	1,184,615,580
未収利息	815,843,246
前払費用	32,389,275
流動資産合計	163,132,182,730
資産合計	163,132,182,730
負債の部	
流動負債	
未払金	1,663,423,600
未払解約金	49,378,062
流動負債合計	1,712,801,662
負債合計	1,712,801,662
純資産の部	
元本等	
元本	128,979,897,393
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	32,439,483,675
元本等合計	161,419,381,068
純資産合計	161,419,381,068
負債純資産合計	163,132,182,730

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針の注記 )

項目	自 平成24年 6月21日 至 平成24年12月19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>

## ( 追加情報 )

自 平成24年 6月21日 至 平成24年12月19日
当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

## ( 貸借対照表に関する注記 )

項目	(平成24年12月19日現在)
1. 受益権総数	平成24年12月19日における受益権の総数 128,979,897,393口
2. 1単位当たり純資産額	1.2515円 (1万口 = 12,515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24年6月21日 至平成24年12月19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、上下限値、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24年12月19日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成24年12月19日現在)

該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

（自 平成24年6月21日 至 平成24年12月19日）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

（平成24年12月19日現在）	
期首（平成24年 6月21日）における元本額	129,162,384,427円
期首より平成24年12月19日現在までの追加設定元本額	2,442,259,185円
期首より平成24年12月19日現在までの一部解約元本額	2,624,746,219円
平成24年12月19日現在の元本の内訳	
三井住友・DC年金日本債券インデックス・ファンド	19,734,242,571円
S M A M・国内債券インデックス・ファンド	62,986,897,506円
国内債券インデックスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	914,087,931円
S M A M・年金国内債券パッシブファンド＜適格機関投資家限定＞	45,344,669,385円
合計	128,979,897,393円

## （3）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回利付国債（40年）	110,000,000	119,465,500	
	第2回利付国債（40年）	252,000,000	260,399,160	
	第3回利付国債（40年）	280,000,000	287,957,600	
	第4回利付国債（40年）	365,000,000	373,533,700	
	第5回利付国債（40年）	275,000,000	265,652,750	
	第263回利付国債（10年）	3,335,000,000	3,422,577,100	
	第265回利付国債（10年）	3,645,000,000	3,747,060,000	
	第268回利付国債（10年）	3,520,000,000	3,630,704,000	
	第269回利付国債（10年）	1,350,000,000	1,386,423,000	
	第270回利付国債（10年）	2,833,000,000	2,917,990,000	
	第272回利付国債（10年）	2,810,000,000	2,910,485,600	
	第274回利付国債（10年）	2,198,000,000	2,290,294,020	
	第277回利付国債（10年）	2,404,000,000	2,520,594,000	
	第280回利付国債（10年）	3,143,000,000	3,338,903,190	
	第282回利付国債（10年）	2,716,000,000	2,875,565,000	
	第283回利付国債（10年）	730,000,000	775,610,400	
	第284回利付国債（10年）	4,375,000,000	4,646,293,750	
	第285回利付国債（10年）	1,894,000,000	2,017,791,840	
	第286回利付国債（10年）	3,115,000,000	3,343,018,000	

第288回利付国債(10年)	1,768,000,000	1,895,402,080
第289回利付国債(10年)	2,098,000,000	2,235,146,260
第290回利付国債(10年)	1,332,000,000	1,415,303,280
第292回利付国債(10年)	130,000,000	140,155,600
第293回利付国債(10年)	1,321,000,000	1,434,724,890
第296回利付国債(10年)	1,116,000,000	1,195,715,880
第297回利付国債(10年)	1,474,000,000	1,572,286,320
第299回利付国債(10年)	230,000,000	244,096,700
第300回利付国債(10年)	790,000,000	848,096,600
第301回利付国債(10年)	858,000,000	921,543,480
第303回利付国債(10年)	930,000,000	993,388,800
第305回利付国債(10年)	2,110,000,000	2,239,258,600
第306回利付国債(10年)	2,180,000,000	2,328,545,200
第308回利付国債(10年)	760,000,000	806,253,600
第309回利付国債(10年)	980,000,000	1,025,070,200
第310回利付国債(10年)	2,020,000,000	2,096,113,600
第312回利付国債(10年)	1,990,000,000	2,093,082,000
第313回利付国債(10年)	1,880,000,000	1,990,393,600
第315回利付国債(10年)	2,000,000,000	2,098,700,000
第317回利付国債(10年)	1,940,000,000	2,016,416,600
第319回利付国債(10年)	610,000,000	633,058,000
第320回利付国債(10年)	1,720,000,000	1,770,413,200
第321回利付国債(10年)	1,320,000,000	1,355,547,600
第322回利付国債(10年)	770,000,000	784,044,800
第323回利付国債(10年)	430,000,000	436,875,700
第324回利付国債(10年)	1,230,000,000	1,238,191,800
第325回利付国債(10年)	1,960,000,000	1,967,996,800
第2回利付国債(30年)	150,000,000	169,006,500
第4回利付国債(30年)	160,000,000	191,764,800
第5回利付国債(30年)	110,000,000	119,555,700
第7回利付国債(30年)	180,000,000	197,490,600
第10回利付国債(30年)	230,000,000	204,591,900
第11回利付国債(30年)	150,000,000	148,420,500
第12回利付国債(30年)	240,000,000	253,557,600
第14回利付国債(30年)	250,000,000	276,665,000
第15回利付国債(30年)	230,000,000	258,356,700
第16回利付国債(30年)	270,000,000	303,091,200
第18回利付国債(30年)	240,000,000	260,508,000
第19回利付国債(30年)	220,000,000	238,950,800
第21回利付国債(30年)	212,000,000	229,988,200
第22回利付国債(30年)	219,000,000	245,731,140
第23回利付国債(30年)	151,000,000	169,432,570
第24回利付国債(30年)	250,000,000	280,277,500
第25回利付国債(30年)	255,000,000	276,134,400
第26回利付国債(30年)	389,000,000	428,755,800
第27回利付国債(30年)	356,000,000	399,346,560
第28回利付国債(30年)	411,000,000	460,932,390
第29回利付国債(30年)	465,000,000	512,281,200
第30回利付国債(30年)	450,000,000	485,770,500
第31回利付国債(30年)	560,000,000	592,418,400
第32回利付国債(30年)	530,000,000	571,647,400
第33回利付国債(30年)	640,000,000	648,678,400

第34回利付国債(30年)	565,000,000	595,606,050	
第35回利付国債(30年)	700,000,000	706,447,000	
第36回利付国債(30年)	525,000,000	529,394,250	
第37回利付国債(30年)	345,000,000	339,197,100	
第28回利付国債(20年)	350,000,000	388,437,000	
第30回利付国債(20年)	450,000,000	494,505,000	
第32回利付国債(20年)	150,000,000	167,446,500	
第33回利付国債(20年)	230,000,000	261,579,000	
第35回利付国債(20年)	315,000,000	356,841,450	
第37回利付国債(20年)	230,000,000	261,740,000	
第39回利付国債(20年)	223,000,000	250,901,760	
第40回利付国債(20年)	492,000,000	549,618,120	
第42回利付国債(20年)	400,000,000	456,804,000	
第43回利付国債(20年)	710,000,000	829,351,000	
第46回利付国債(20年)	289,000,000	325,463,130	
第48回利付国債(20年)	368,000,000	424,451,200	
第50回利付国債(20年)	223,000,000	246,852,080	
第52回利付国債(20年)	210,000,000	236,090,400	
第54回利付国債(20年)	275,000,000	311,894,000	
第56回利付国債(20年)	320,000,000	357,040,000	
第58回利付国債(20年)	300,000,000	331,941,000	
第59回利付国債(20年)	280,000,000	304,595,200	
第61回利付国債(20年)	140,000,000	142,583,000	
第63回利付国債(20年)	216,000,000	236,798,640	
第64回利付国債(20年)	290,000,000	320,774,800	
第65回利付国債(20年)	330,000,000	364,663,200	
第70回利付国債(20年)	510,000,000	590,309,700	
第72回利付国債(20年)	630,000,000	708,435,000	
第74回利付国債(20年)	428,000,000	481,007,800	
第75回利付国債(20年)	480,000,000	539,064,000	
第78回利付国債(20年)	390,000,000	428,512,500	
第82回利付国債(20年)	493,000,000	552,441,010	
第84回利付国債(20年)	604,000,000	668,470,960	
第85回利付国債(20年)	587,000,000	655,608,560	
第88回利付国債(20年)	889,000,000	1,013,166,630	
第90回利付国債(20年)	588,000,000	661,682,280	
第92回利付国債(20年)	575,000,000	638,928,500	
第93回利付国債(20年)	577,000,000	632,761,280	
第95回利付国債(20年)	546,000,000	618,628,920	
第97回利付国債(20年)	540,000,000	603,876,600	
第99回利付国債(20年)	624,000,000	688,378,080	
第100回利付国債(20年)	613,000,000	683,623,730	
第102回利付国債(20年)	620,000,000	707,500,600	
第105回利付国債(20年)	627,000,000	687,624,630	
第107回利付国債(20年)	653,000,000	714,610,550	
第109回利付国債(20年)	550,000,000	584,457,500	
第111回利付国債(20年)	983,000,000	1,084,750,330	
第113回利付国債(20年)	890,000,000	966,646,800	
第114回利付国債(20年)	913,000,000	988,532,490	
第116回利付国債(20年)	880,000,000	964,392,000	
第118回利付国債(20年)	280,000,000	297,749,200	
第119回利付国債(20年)	455,000,000	470,005,900	

	第121回利付国債(20年)	390,000,000	407,862,000
	第122回利付国債(20年)	400,000,000	412,196,000
	第123回利付国債(20年)	80,000,000	85,949,600
	第124回利付国債(20年)	780,000,000	825,903,000
	第125回利付国債(20年)	330,000,000	358,974,000
	第126回利付国債(20年)	250,000,000	264,120,000
	第127回利付国債(20年)	350,000,000	364,311,500
	第128回利付国債(20年)	370,000,000	384,196,900
	第129回利付国債(20年)	420,000,000	429,534,000
	第130回利付国債(20年)	520,000,000	530,405,200
	第131回利付国債(20年)	470,000,000	471,673,200
	第132回利付国債(20年)	260,000,000	260,371,800
	第133回利付国債(20年)	690,000,000	702,426,900
	第134回利付国債(20年)	135,000,000	137,155,950
	第135回利付国債(20年)	130,000,000	129,905,100
	第136回利付国債(20年)	350,000,000	344,176,000
	第137回利付国債(20年)	375,000,000	373,901,250
	第138回利付国債(20年)	190,000,000	183,226,500
	第139回利付国債(20年)	530,000,000	519,951,200
	第140回利付国債(20年)	910,000,000	905,313,500
	国債証券 小計	115,396,000,000	122,343,227,590
地方債証券	第1回東京都公募公債(20年)	200,000,000	212,694,000
	第7回東京都公募公債(20年)	100,000,000	111,858,000
	第8回東京都公募公債(30年)	100,000,000	103,298,000
	第13回東京都公募公債(30年)	200,000,000	191,240,000
	第597回東京都公募公債	200,000,000	200,388,000
	第598回東京都公募公債	100,000,000	100,182,000
	第599回東京都公募公債	100,000,000	100,573,000
	第603回東京都公募公債	100,000,000	101,265,000
	第629回東京都公募公債	100,000,000	103,894,000
	第656回東京都公募公債	300,000,000	319,749,000
	第660回東京都公募公債	200,000,000	214,316,000
	第668回東京都公募公債	200,000,000	214,620,000
	第681回東京都公募公債	200,000,000	212,962,000
	平成16年度第11回北海道公募公債	100,000,000	102,405,000
	平成19年度第9回北海道公募公債	200,000,000	213,806,000
	第7回神奈川県公募公債(20年)	200,000,000	222,804,000
	第120回神奈川県公募公債	100,000,000	100,201,000
	第147回神奈川県公募公債	200,000,000	215,736,000
	第44回大阪府公募公債(5年)	200,000,000	202,202,000
	第263回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,323,000
	第273回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,433,000
	第297回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	106,214,000
	第311回大阪府公募公債(10年)	250,000,000	267,780,000
	平成15年度第3回京都府公募公債	100,000,000	101,372,000
	第9回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	108,583,000
	平成16年度第13回兵庫県公募公債	100,000,000	102,447,000
	平成16年度第5回兵庫県公募公債	100,000,000	102,148,000
	平成17年度第4回兵庫県公募公債	200,000,000	205,606,000
	平成19年度第18回兵庫県公募公債	100,000,000	106,697,000
	平成15年度第3回静岡県公募公債	100,000,000	101,075,000
	平成19年度第7回静岡県公募公債	100,000,000	107,720,000

平成20年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	111,957,000	
平成21年度第7回愛知県公募公債 (10年)	200,000,000	214,764,000	
平成16年度第2回広島県公募公債	100,000,000	103,033,000	
平成17年度第4回埼玉県公募公債	200,000,000	206,712,000	
平成19年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	107,684,000	
平成21年度第2回埼玉県公募公債	146,000,000	156,973,360	
平成17年度第5回福岡県公募公債	100,000,000	104,174,000	
平成21年度第13回福岡県公募公債	200,000,000	201,566,000	
平成17年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	102,796,000	
平成18年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	106,557,000	
第1回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,191,000	
第4回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,570,000	
第14回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,926,000	
第17回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,554,000	
第20回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,206,000	
第23回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,517,000	
第30回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,183,000	
第31回共同発行市場公募地方債	100,500,000	104,356,185	
第36回共同発行市場公募地方債	200,000,000	209,416,000	
第38回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,275,000	
第40回共同発行市場公募地方債	200,000,000	213,798,000	
第47回共同発行市場公募地方債	300,000,000	319,848,000	
第51回共同発行市場公募地方債	200,000,000	215,052,000	
第66回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,146,000	
第75回共同発行市場公募地方債	300,000,000	323,919,000	
平成17年度第10回大阪市公募公債	192,500,000	200,219,250	
平成19年度第7回大阪市公募公債	100,000,000	107,273,000	
平成21年度第4回大阪市公募公債	200,000,000	215,070,000	
第12回あ号名古屋市公募公債	100,000,000	100,177,000	
第464回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	107,469,000	
平成21年度第1回京都市公募公債	100,000,000	107,307,000	
平成15年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	101,368,000	
第16回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	111,974,000	
平成17年度第4回横浜市公募公債	300,000,000	312,342,000	
平成14年度第7回札幌市公募公債	100,000,000	100,187,000	
平成16年度第2回札幌市公募公債	100,000,000	102,061,000	
平成15年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	101,352,000	
平成16年度第6回福岡市公募公債	100,000,000	102,480,000	
平成18年度第4回福岡市公募公債	100,000,000	106,140,000	
平成16年度第1回広島市公募公債	100,000,000	102,478,000	
地方債証券 小計	10,189,000,000	10,670,661,795	
特殊債券			
第2回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	500,000,000	532,380,000	
第7回政府保証日本政策投資銀行債券	103,000,000	104,433,760	
第7回日本政策投資銀行債券	100,000,000	100,140,000	
第15回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	111,258,000	
第16回日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,267,000	
第22回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	113,240,000	
第39回日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,845,000	
第4回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,604,000	



第5回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,668,000	
第6回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	220,728,000	
第10回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	319,521,000	
第14回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	190,000,000	201,629,900	
第16回道路債券	200,000,000	200,384,000	
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,398,000	
第27回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	213,442,000	
第27回道路債券	100,000,000	114,016,000	
第30回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	319,260,000	
第32回道路債券	100,000,000	114,246,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,647,000	
第38回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,261,000	
第42回道路債券	100,000,000	111,553,000	
第48回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	323,466,000	
第52回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,059,000	
第58回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	323,532,000	
第79回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,304,000	
第91回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,685,000	
第92回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,787,000	
第323回政府保証道路債券	100,000,000	101,372,000	
第326回政府保証道路債券	100,000,000	101,611,000	
第327回政府保証道路債券	150,000,000	152,775,000	
第328回政府保証道路債券	100,000,000	101,973,000	
第331回政府保証道路債券	200,000,000	205,642,000	
第337回政府保証道路債券	100,000,000	102,568,000	
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券	700,000,000	750,624,000	
第4回公営企業債券(20年)	200,000,000	222,682,000	
第9回公営企業債券	100,000,000	101,728,000	
第18回公営企業債券(20年)	100,000,000	115,964,000	
第19回公営企業債券	100,000,000	105,929,000	
第22回公営企業債券(20年)	200,000,000	224,204,000	
第28回公営企業債券	100,000,000	107,779,000	
第824回政府保証公営企業債券	200,000,000	200,260,000	
第828回政府保証公営企業債券	100,000,000	100,188,000	
第831回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,127,000	
第840回政府保証公営企業債券	200,000,000	204,404,000	
第851回政府保証公営企業債券	400,000,000	411,336,000	
第858回政府保証公営企業債券	100,000,000	104,132,000	
第860回政府保証公営企業債券	300,000,000	313,920,000	

第861回政府保証公営企業債券	100,000,000	104,744,000	
第863回政府保証公営企業債券	400,000,000	425,360,000	
第875回政府保証公営企業債券	300,000,000	319,794,000	
第876回政府保証公営企業債券	101,000,000	108,684,080	
第882回政府保証公営企業債券	100,000,000	107,053,000	
第7回首都高速道路債券	100,000,000	101,004,000	
第193回政府保証首都高速道路債券	200,000,000	204,820,000	
第195回政府保証首都高速道路債券	200,000,000	205,308,000	
第4回阪神高速道路債券	100,000,000	100,172,000	
第136回政府保証阪神高速道路債券	100,000,000	101,383,000	
第12回中小企業債券	100,000,000	104,638,000	
第176回政府保証中小企業債券	100,000,000	101,091,000	
第184回政府保証中小企業債券	100,000,000	102,550,000	
第12回国際協力銀行債券	100,000,000	101,725,000	
第29回国際協力銀行債券	100,000,000	106,985,000	
第341回東京交通債券	100,000,000	102,145,000	
第13回関西国際空港株式会社債	100,000,000	106,852,000	
第6回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	110,247,000	
第1回貸付債権担保住宅金融公庫債券	40,404,000	42,315,917	
第1回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	30,686,000	31,963,151	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	37,739,000	40,134,671	
第2回貸付債権担保住宅金融公庫債券	19,847,000	20,787,549	
第2回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	31,760,000	33,223,818	
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	31,575,000	33,345,094	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	32,851,000	34,549,396	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	34,070,000	36,594,927	
第7回貸付債権担保住宅金融公庫債券	23,370,000	24,415,807	
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	34,593,000	37,148,038	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	35,742,000	38,218,563	
第9回貸付債権担保住宅金融公庫債券	25,050,000	25,967,331	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	35,509,000	38,011,674	
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券	27,856,000	28,769,676	
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	36,500,000	38,999,520	
第12回貸付債権担保住宅金融公庫債券	34,932,000	36,418,356	
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	57,678,000	60,654,761	
第18回貸付債権担保住宅金融公庫債券	38,190,000	40,176,261	
第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,213,000	78,246,476	
第30回貸付債権担保住宅金融公庫債券	50,234,000	52,292,589	
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	56,040,000	58,319,146	
第32回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,401,000	81,059,745	
第35回貸付債権担保住宅金融公庫債券	56,319,000	58,936,707	
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券	53,788,000	56,576,369	
第37回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,156,000	88,687,419	
第40回貸付債権担保住宅金融公庫債券	54,099,000	57,015,477	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	51,957,000	55,991,980	
第43回貸付債権担保住宅金融公庫債券	50,599,000	54,359,517	
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,913,000	94,180,413	
第44回貸付債権担保住宅金融公庫債券	48,350,000	52,014,930	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,246,000	95,732,565	
第48回貸付債権担保住宅金融公庫債券	52,026,000	56,016,394	

第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,826,000	97,171,185	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,733,000	97,310,788	
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,780,000	97,715,713	
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,203,000	98,338,706	
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,968,000	99,079,963	
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,153,000	
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,035,000	57,758,551	
第3回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	39,418,000	41,947,058	
第12回政府保証国民生活債券	137,000,000	139,164,600	
第5回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	102,563,000	
い第697号商工債	100,000,000	100,702,000	
い第698号商工債	200,000,000	201,630,000	
い第707号商工債	100,000,000	101,566,000	
い第723号商工債	100,000,000	100,801,000	
い第733号商工債	200,000,000	202,372,000	
い第698号農林債	100,000,000	100,794,000	
い第704号農林債	100,000,000	101,193,000	
い第707号農林債	200,000,000	203,036,000	
い第709号農林債	100,000,000	101,408,000	
い第712号農林債	100,000,000	101,189,000	
い第720号農林債	200,000,000	202,034,000	
い第728号農林債	100,000,000	101,002,000	
い第735号農林債	100,000,000	100,729,000	
第243回信金中金債(5年)	100,000,000	101,091,000	
第225回信金中金債(5年)	200,000,000	201,572,000	
第230回信金中金債(5年)	100,000,000	101,171,000	
第236回信金中金債(5年)	200,000,000	202,260,000	
第237回信金中金債(5年)	100,000,000	101,362,000	
第149号商工債(3年)	100,000,000	100,125,000	
第16回政府保証東日本高速道路債券	200,000,000	211,774,000	
第1回中日本高速道路株式会社債	200,000,000	203,250,000	
第46回中日本高速道路株式会社債	100,000,000	99,864,000	
第5回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	205,890,000	
特殊債券 小計	16,150,656,000	16,890,669,541	
社債券			
第12回ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポ	100,000,000	102,291,000	
第2回ジェー・ピー・モルガン・チェース・アンド・カ	100,000,000	103,222,000	
第11回シティグループ・インク円貨社債(2003)	100,000,000	100,150,000	
第16回シティグループ・インク円貨債券	100,000,000	101,960,000	
第4回パークレイズ・バンク・ピーエルシー円貨社債(2010)	100,000,000	100,304,000	
第5回オーストラリア・コモンウェルス銀行円貨社債(2011)	100,000,000	101,449,000	
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	100,000,000	101,900,000	
第10回コーペラティブ・セントラル・ライフアイゼン・ボエレン	200,000,000	201,338,000	
第18回コーペラティブ・セントラル・ライフアイゼン・ボエレン	200,000,000	200,386,000	
第4回ウォルマート・ストアーズ・インク円貨社債(2010)	100,000,000	101,781,000	

HSBC銀行 PLC 第1回円貨社債	100,000,000	101,828,000	
第3回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,954,000	
第9回キリンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	103,226,000	
第33回三菱化学株式会社無担保社債	100,000,000	105,223,000	
第11回武田薬品工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,341,000	
第30回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	111,835,000	
第46回株式会社神戸製鋼所無担保社債	100,000,000	101,044,000	
第50回株式会社東芝無担保社債	100,000,000	100,884,000	
第10回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	193,076,000	
第20回三洋電機株式会社無担保社債	100,000,000	101,190,000	
第22回三菱重工工業株式会社無担保社債	100,000,000	107,741,000	
第1回日本生命2011基金特定目的会社特定社債 第1回 - B	100,000,000	101,945,000	
第54回日産自動車株式会社無担保社債	100,000,000	101,511,000	
第1回トヨタ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	113,686,000	
第49回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	109,837,000	
第66回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,886,000	
第33回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	105,923,000	
第64回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	106,350,000	
第69回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	108,336,000	
第38回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	101,259,000	
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	107,951,000	
第14回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	101,288,000	
第15回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	200,000,000	202,586,000	
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	102,984,000	
第57回株式会社東京三菱銀行無担保社債	100,000,000	112,553,000	
第72回株式会社東京三菱銀行無担保社債	100,000,000	101,154,000	
第104回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	300,000,000	304,572,000	
第6回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	102,803,000	
第4回株式会社りそな銀行無担保社債	100,000,000	111,015,000	
第2回株式会社ふくおかフィナンシャルグループ無担保社債	100,000,000	101,507,000	
第9回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	105,462,000	
第4回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	102,727,000	
第6回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	100,364,000	
第8回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	102,929,000	
第20回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	109,342,000	
第42回株式会社三井住友銀行無担保社債	200,000,000	200,146,000	
第47回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	101,120,000	
第8回株式会社みずほ銀行無担保社債	200,000,000	211,744,000	
第16回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	100,000,000	101,097,000	
第19回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,049,000	

第27回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	106,320,000	
第41回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	101,028,000	
第113回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	106,325,000	
第10回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	104,152,000	
第15回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,037,000	
第22回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,438,000	
第27回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	106,129,000	
第65回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	100,066,000	
第29回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	107,840,000	
第22回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	113,027,000	
第7回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	113,948,000	
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	113,663,000	
第24回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	107,658,000	
第32回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	112,569,000	
第69回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	104,552,000	
第10回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	110,419,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	112,183,000	
第13回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	110,060,000	
第40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	104,653,000	
第48回日本電信電話株式会社電信電話債券	200,000,000	204,848,000	
第53回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	106,111,000	
第19回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	103,159,000	
第457回東京電力株式会社社債	100,000,000	87,101,000	
第528回東京電力株式会社社債	200,000,000	169,642,000	
第536回東京電力株式会社社債	100,000,000	87,232,000	
第541回東京電力株式会社社債	200,000,000	198,820,000	
第547回東京電力株式会社社債	100,000,000	82,102,000	
第448回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,969,000	
第306回中国電力株式会社社債	100,000,000	111,371,000	
第279回北陸電力株式会社社債	270,000,000	278,132,400	
第383回東北電力株式会社社債	200,000,000	215,628,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	96,237,000	
第343回九州電力株式会社社債	100,000,000	108,699,000	
第388回九州電力株式会社社債	100,000,000	104,098,000	
第292回北海道電力株式会社社債	100,000,000	105,608,000	
第20回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	104,705,000	
第19回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	108,959,000	
社債券 小計	10,070,000,000	10,383,737,400	
合計	151,805,656,000	160,288,296,326	

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。

## 「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）」の状況

## ( 1 ) 貸借対照表

( 単位：円 )

( 平成24年12月20日現在 )

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	205,392
親投資信託受益証券	46,856,012,383
未収入金	37,130,000
流動資産合計	46,893,347,775
資産合計	46,893,347,775
負債の部	
流動負債	
未払解約金	37,130,000
未払受託者報酬	1,470,222
未払委託者報酬	534,616
その他未払費用	34,720
流動負債合計	39,169,558
負債合計	39,169,558
純資産の部	
元本等	
元本	40,757,699,847
剰余金	
剰余金又は欠損金 ( )	6,096,478,370
元本等合計	46,854,178,217
純資産合計	46,854,178,217
負債純資産合計	46,893,347,775

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針の注記 )

項目	自 平成24年12月 1日 至 平成24年12月20日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

## （追加情報）

自 平成24年12月 1日 至 平成24年12月20日
当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

## （貸借対照表に関する注記）

項 目	（平成24年12月20日現在）
1. 受益権総数	平成24年12月20日における受益権の総数 40,757,699,847口
2. 1単位当たり純資産額	1.1496円 (1万口 = 11,496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24年12月 1日 至 平成24年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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24年12月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（デリバティブ取引に関する注記）

（平成24年12月20日現在）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）



（自 平成24年12月1日 至 平成24年12月20日）  
該当事項はありません。

（その他の注記）

（平成24年12月20日現在）	
期首（平成24年12月 1日）における元本額	41,991,745,956円
期首より平成24年12月20日現在までの追加設定元本額	35,833円
期首より平成24年12月20日現在までの一部解約元本額	1,234,081,942円

（3）附属明細表  
有価証券明細表

(a) 株式  
該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託 受益証券	外国株式インデックス・マザーファン ド	31,710,890,893	46,856,012,383	
	親投資信託受益証券 小計	31,710,890,893	46,856,012,383	
合計		31,710,890,893	46,856,012,383	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
該当事項はありません。

（参考情報）

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）は、「外国株式インデックス・マ  
ザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資  
信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。  
なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

「外国株式インデックス・マザーファンド」の状況

（1）貸借対照表

（単位：円）

（平成24年12月20日現在）

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,404,191,745
株式	219,775,852,151
投資証券	5,218,953,144
派生商品評価勘定	1,892,555
未収入金	4,042,298,784

未収配当金	445,748,446
未収利息	4,663
差入委託証拠金	865,977,473
流動資産合計	233,754,918,961
資産合計	233,754,918,961
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	17,122,833
未払金	929,380,857
未払解約金	3,097,423,529
流動負債合計	4,043,927,219
負債合計	4,043,927,219
純資産の部	
元本等	
元本	155,465,128,719
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	74,245,863,023
元本等合計	229,710,991,742
純資産合計	229,710,991,742
負債純資産合計	233,754,918,961

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	自 平成24年12月 1日 至 平成24年12月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>

3. 収益及び費用の計上基準	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)

自 平成24年12月 1日 至 平成24年12月20日
当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(平成24年12月20日現在)
1. 受益権総数	平成24年12月20日における受益権の総数 155,465,128,719口
2. 1単位当たり純資産額	1.4776円 (1万口 = 14,776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24年12月 1日 至 平成24年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(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。

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24年12月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<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24年12月20日現在)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引  
株式関連

(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				
	SP500 13/03	3,065,412,519		3,048,289,686	17,122,833
	FTSE 13/03	558,966,564		560,052,945	1,086,381
	DJ EUR 13/03	1,067,374,376		1,068,180,550	806,174
	小計	4,691,753,459		4,676,523,181	15,230,278
合計		4,691,753,459		4,676,523,181	15,230,278

## (注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については以下のように評価しております。

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おります。

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おります。

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

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

## (自 平成24年12月1日 至 平成24年12月20日)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

(平成24年12月20日現在)

期首(平成24年12月1日)における元本額	160,022,839,752円
期首より平成24年12月20日現在までの追加設定元本額	5,702,771円
期首より平成24年12月20日現在までの一部解約元本額	4,563,413,804円
平成24年12月20日現在の元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	4,962,115,932円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	192,996,348円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	803,887,516円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	503,910,857円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	22,864,167円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	2,103,638円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	3,372,448円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	3,877,249円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	4,778,169円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	1,382,050円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	3,326,541円
外国株式指数ファンド	227,504,363円
三井住友・DC全海外株式インデックスファンド	611,970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)	31,710,890,893円
バランスファンドV A(安定運用型) <適格機関投資家限定>	253,623,148円
S M A M・バランスファンドV A 安定成長型 <適格機関投資家限定>	19,367,257,904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>	8,603,659,749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>	4,881,165,871円

SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	19,318,977,701円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	67,567,295円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	282,951,938円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	49,364,610円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	2,165,135,086円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	150,224,959円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	506,483,517円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,287,021,713円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	3,794,282,335円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	5,875,851,374円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,003,737,036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)	2,657,259,404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)	8,031,744,566円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	483,329,404円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	2,189,552,310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)	33,812,978,659円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A <適格機関投資家専用>	77,848,501円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A <適格機関投資家専用>	47,481,649円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A <適格機関投資家専用>	18,614,750円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L <適格機関投資家専用>	194,391,935円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L <適格機関投資家専用>	450,376,776円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T <適格機関投資家専用>	420,044,763円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定>	16,338,324円
SMAM・FGグローバルバランス25VA<適格機関投資家限定>	14,241,301円
合計	155,465,128,719円

## (3) 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

銘柄	株数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル				
REGENERON PHARMACEUTICALS	8,470	175.65	1,487,755.50	
ANADARKO PETROLEUM CORP	56,663	74.45	4,218,560.35	
APACHE CORPORATION	44,151	79.88	3,526,781.88	
BAKER HUGHES INC	49,452	41.12	2,033,466.24	
CABOT OIL & GAS CORPORATION	23,500	49.62	1,166,070.00	
CAMERON INTERNATIONAL CORP	28,053	56.60	1,587,799.80	
CHESAPEAKE ENERGY CORPORATION	76,523	17.20	1,316,195.60	
CHEVRON CORPORATION	222,135	109.89	24,410,415.15	
CIMAREX ENERGY CO	10,130	58.23	589,869.90	
COBALT INTERNATIONAL ENERGY	20,600	25.26	520,356.00	

CONCHO RESOURCES INC	11,332	81.69	925,711.08
CONOCOPHILLIPS	130,681	59.20	7,736,315.20
CONSOL ENERGY INC	25,862	34.03	880,083.86
CONTINENTAL RESOURCES, INC.	5,100	74.94	382,194.00
CORE LABORATORIES N.V.	5,490	108.54	595,884.60
DENBURY RESOURCES INC	43,546	16.25	707,622.50
DEVON ENERGY CORPORATION	43,545	53.77	2,341,414.65
DIAMOND OFFSHORE DRILLING, INC.	8,356	69.59	581,494.04
ENSCO PLC-CL A	25,700	59.42	1,527,094.00
EOG RESOURCES INC	30,335	122.45	3,714,520.75
EXXON MOBIL CORPORATION	522,496	88.38	46,178,196.48
FMC TECHNOLOGIES INC	26,690	41.97	1,120,179.30
HALLIBURTON CO	105,038	34.61	3,635,365.18
HELMERICH & PAYNE INC	12,500	56.25	703,125.00
HESS CORPORATION	34,815	53.04	1,846,587.60
HOLLYFRONTIER CORP	21,600	46.32	1,000,512.00
KINDER MORGAN INC	72,734	35.24	2,563,146.16
KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	11,826	75.20	889,315.20
MARATHON OIL CORP	80,081	31.23	2,500,929.63
MARATHON PETROLEUM CORPORATION	38,486	62.22	2,394,598.92
MURPHY OIL CORPORATION	20,647	60.44	1,247,904.68
NABORS INDUSTRIES LTD	31,184	14.71	458,716.64
NATIONAL-OILWELL VARCO INC.	48,722	68.69	3,346,714.18
NEWFIELD EXPLORATION CO	14,787	26.97	398,805.39
NOBLE CORPORATION	29,318	35.80	1,049,584.40
NOBLE ENERGY INC	20,499	101.71	2,084,953.29
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	91,603	78.24	7,167,018.72
OCEANEERING INTL INC	12,000	53.22	638,640.00
PEABODY ENERGY CORP	30,153	27.07	816,241.71
PHILLIPS 66	67,195	52.50	3,527,737.50
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	13,075	107.22	1,401,901.50
PLAINS EXPLORATION & PRODUCTION COMPANY	14,100	46.45	654,945.00
RANGE RESOURCES CORPORATION	18,782	63.32	1,189,276.24
ROWAN COMPANIES PLC	13,345	32.39	432,244.55
SCHLUMBERGER LTD	150,151	70.64	10,606,666.64
SOUTHWESTERN ENERGY COMPANY	40,675	33.74	1,372,374.50
SPECTRA ENERGY CORPORATION	73,463	27.59	2,026,844.17
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	16,400	21.34	349,976.00
ULTRA PETROLEUM CORP	16,448	19.47	320,242.56
VALERO ENERGY CORP	62,442	34.03	2,124,901.26
WEATHERFORD INTL LTD	89,118	11.01	981,189.18
WHITING PETROLEUM CORP	13,200	43.11	569,052.00
WILLIAMS COS INC	75,743	32.53	2,463,919.79
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	24,399	83.77	2,043,904.23
AIRGAS INC	7,160	90.81	650,199.60
ALBEMARLE CORPORATION	10,500	62.02	651,210.00
ALCOA INC	122,699	8.64	1,060,119.36
ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	12,080	29.62	357,809.60

BALL CORPORATION	17,306	44.57	771,328.42
CELANESE CORPORATION	17,623	45.08	794,444.84
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	7,238	205.66	1,488,567.08
CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	16,155	35.85	579,156.75
CROWN HOLDINGS INC	16,900	37.47	633,243.00
DOW CHEMICAL	135,756	32.43	4,402,567.08
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	105,060	44.85	4,711,941.00
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	17,554	65.73	1,153,824.42
ECOLAB INC	33,524	71.80	2,407,023.20
FMC CORPORATION	15,800	58.02	916,716.00
FREEMONT-MCMORAN COPPER-B	108,354	33.95	3,678,618.30
INTERNATIONAL PAPER CO	46,847	38.90	1,822,348.30
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	9,242	66.83	617,642.86
LYONDELLBASELL INDU-CL A	35,472	54.85	1,945,639.20
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,993	95.16	475,133.88
MEADWESTVACO CORP	18,515	31.11	576,001.65
MONSANTO CO	60,236	91.68	5,522,436.48
MOSAIC CO/THE	34,488	55.45	1,912,359.60
NEWMONT MINING CORP	55,323	43.75	2,420,381.25
NUCOR CORP	35,763	43.43	1,553,187.09
OWENS-ILLINOIS INC	16,039	20.97	336,337.83
PPG INDUSTRIES INC	17,286	131.21	2,268,096.06
PRAXAIR INC	33,641	108.40	3,646,684.40
ROCK-TENN COMPANY CL A	8,500	69.55	591,175.00
SEALED AIR CORP	21,938	17.23	377,991.74
SIGMA-ALDRICH	13,606	73.19	995,823.14
UNITED STATES STEEL CORPORATION	17,409	24.43	425,301.87
VULCAN MATERIALS CO	14,053	53.10	746,214.30
WEYERHAEUSER CO	59,643	27.85	1,661,057.55
3M COMPANY	74,378	93.02	6,918,641.56
AGCO CORP	10,654	48.88	520,767.52
AMETEK INC	27,160	37.54	1,019,586.40
BOEING CO	80,783	75.51	6,099,924.33
CATERPILLAR INC	73,960	90.79	6,714,828.40
CUMMINS INC	20,712	107.95	2,235,860.40
DANAHER CORP	66,875	55.67	3,722,931.25
DEERE & CO	42,103	86.09	3,624,647.27
DOVER CORP	20,891	64.92	1,356,243.72
EATON CORP PLC	51,634	54.12	2,794,432.08
EMERSON ELECTRIC CO	82,487	53.18	4,386,658.66
FASTENAL COMPANY	31,836	44.49	1,416,383.64
FLOWERVE CORP	5,769	144.95	836,216.55
FLUOR CORP	18,681	58.79	1,098,255.99
GENERAL DYNAMICS CORP	34,317	69.52	2,385,717.84
GENERAL ELECTRIC CO	1,195,445	21.01	25,116,299.45
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	83,844	63.77	5,346,731.88
ILLINOIS TOOL WORKS	47,698	61.39	2,928,180.22
INGERSOLL-RAND PLC	34,664	48.48	1,680,510.72



JACOBS ENGINEERING GROUP INC	14,290	42.57	608,325.30
JOY GLOBAL INC	11,860	62.57	742,080.20
KBR, INC.	16,285	31.00	504,835.00
L-3 COMMUNICATIONS HLDGS INC	10,670	76.33	814,441.10
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	31,233	92.91	2,901,858.03
MASCO CORP	39,966	16.35	653,444.10
NORTHROP GRUMMAN CORP	26,133	68.70	1,795,337.10
PACCAR INC	38,184	44.92	1,715,225.28
PALL CORPORATION	13,476	60.69	817,858.44
PARKER HANNIFIN CORPORATIOM	16,586	86.21	1,429,879.06
PENTAIR LTD-REGISTERED	23,379	48.80	1,140,895.20
PRECISION CASTPARTS CORP	16,294	187.56	3,056,102.64
QUANTA SERVICES INC	23,059	27.27	628,818.93
RAYTHEON COMPANY	37,627	58.75	2,210,586.25
ROCKWELL AUTOMATION INC	15,898	83.59	1,328,913.82
ROCKWELL COLLINS INC.	15,644	58.47	914,704.68
ROPER INDUSTRIES INC	10,990	109.45	1,202,855.50
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	10,000	32.12	321,200.00
SPX CORP	6,068	64.10	388,958.80
TEXTRON INC	32,768	24.62	806,748.16
THE ADT CORPORATION	25,959	44.96	1,167,116.64
TRANSDIGM GROUP INC	5,800	133.89	776,562.00
TYCO INTERNATIONAL LTD	51,881	29.24	1,517,000.44
UNITED TECHNOLOGIES CORP	97,989	83.03	8,136,026.67
WW GRAINGER INC	6,910	197.95	1,367,834.50
XYLEM INC	21,566	27.57	594,574.62
AVERY DENNISON CORP	11,162	34.73	387,656.26
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3,469	288.89	1,002,159.41
CINTAS CORP	12,913	42.45	548,156.85
DUN & BRADSTREET CORP	4,801	82.93	398,146.93
EQUIFAX INC	14,242	54.33	773,767.86
IHS INC-CLASS A	6,140	94.43	579,800.20
IRON MOUNTAIN INC	16,247	31.11	505,444.17
MANPOWERGROUP	9,392	42.45	398,690.40
NETFLIX INC	5,698	94.04	535,839.92
NIELSEN HOLDINGS NV	14,600	30.54	445,884.00
PITNEY BOWES INC	25,773	10.95	282,214.35
REPUBLIC SERVICES INC	36,894	29.96	1,105,344.24
ROBERT HALF INTL INC	15,091	30.99	467,670.09
STERICYCLE, INC.	10,121	92.47	935,888.87
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	16,300	51.05	832,115.00
WASTE MANAGEMENT INC	50,529	33.80	1,707,880.20
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	15,500	52.44	812,820.00
C.H.ROBINSON WORLDWIDE, INC.	18,302	63.63	1,164,556.26
CSX CORPORATION	117,108	20.01	2,343,331.08
DELTA AIR LINES INC	21,520	11.83	254,581.60
EXPEDITORS INTL WASH INC	23,378	39.58	925,301.24
FEDEX CORP	34,261	93.20	3,193,125.20

HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	30,375	16.60	504,225.00
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	10,300	58.33	600,799.00
KANSAS CITY SOUTHERN	12,300	81.82	1,006,386.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	36,770	62.15	2,285,255.50
SOUTHWEST AIRLINES	24,000	10.56	253,440.00
UNION PACIFIC CORP	53,571	125.77	6,737,624.67
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	11,000	23.96	263,560.00
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	82,238	75.60	6,217,192.80
AUTOLIV INC	11,200	65.16	729,792.00
BORGWARNER INC	13,000	67.96	883,480.00
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	35,800	35.65	1,276,270.00
FORD MOTOR COMPANY	401,619	11.73	4,710,990.87
GENERAL MOTORS CO	90,073	27.18	2,448,184.14
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	26,234	13.30	348,912.20
HARLEY-DAVIDSON INC	26,486	48.73	1,290,662.78
JOHNSON CONTROLS INC	76,917	29.76	2,289,049.92
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	12,350	52.18	644,423.00
BEAM INC	16,002	61.16	978,682.32
COACH INC	32,065	59.16	1,896,965.40
D.R.HORTON INC	32,448	19.95	647,337.60
FOSSIL INC	5,500	94.10	517,550.00
GARMIN LTD	13,416	42.09	564,679.44
HASBRO INC	12,914	36.56	472,135.84
LEGGETT & PLATT INC	14,915	27.31	407,328.65
LULULEMON ATHLETICA INC	11,580	76.19	882,280.20
MATTEL INC	38,703	37.38	1,446,718.14
MOHAWK INDUSTRIES INC	6,403	84.27	539,580.81
NEWELL RUBBERMAID INC	32,044	21.67	694,393.48
NIKE INC -CL B	41,207	97.78	4,029,220.46
POLARIS INDUSTRIES INC	7,000	83.61	585,270.00
PULTE GROUP INC	37,000	18.46	683,020.00
PVH CORP	7,930	112.47	891,887.10
RALPH LAUREN CORPORATION	7,058	153.30	1,081,991.40
STANLEY BLACK & DECKER INC	17,941	73.95	1,326,736.95
TOLL BROTHERS INC	17,339	32.08	556,235.12
UNDER ARMOUR INC	8,300	49.01	406,783.00
VF CORP	10,075	151.22	1,523,541.50
WHIRLPOOL CORP	9,084	102.15	927,930.60
CARNIVAL CORP	50,077	39.04	1,955,006.08
DARDEN RESTAURANTS INC	15,240	46.81	713,384.40
H&R BLOCK INC	32,792	19.04	624,359.68
INTL GAME TECHNOLOGY	33,160	14.24	472,198.40
LAS VEGAS SANDS CORP	46,439	47.38	2,200,279.82
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	29,647	37.22	1,103,461.34
MCDONALD'S CORPORATION	114,210	89.70	10,244,637.00
MGM MIRAGE	43,400	11.54	500,836.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	15,571	35.14	547,164.94
STARBUCKS CORP	86,046	54.27	4,669,716.42

STARWOOD HOTELS & RESORTS	21,580	56.39	1,216,896.20
WYNN RESORTS LTD	9,414	113.64	1,069,806.96
YUM! BRANDS INC	51,622	67.16	3,466,933.52
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	23,920	14.94	357,364.80
CBS CORP-CL B	67,929	36.43	2,474,653.47
CHARTER COMMUNICATION-A	4,300	74.05	318,415.00
COMCAST CORP-CL A	239,605	38.00	9,104,990.00
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	65,371	36.65	2,395,847.15
DIRECTV	70,855	51.20	3,627,776.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-A	16,730	62.79	1,050,476.70
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-C	10,630	58.46	621,429.80
DISH NETWORK CORP.	23,664	35.61	842,675.04
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	50,125	11.21	561,901.25
LIBERTY GLOBAL INC-A	15,040	62.94	946,617.60
LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	12,063	58.85	709,907.55
LIBERTY MEDIA CORP-CAPITAL	12,100	115.28	1,394,888.00
MCGRAW-HILL COMPANIES INC	28,327	54.57	1,545,804.39
NEWS CORP-CL A	177,505	25.23	4,478,451.15
NEWS CORPORATION-CLASS B	49,331	25.93	1,279,152.83
OMNICOM GROUP	30,149	50.61	1,525,840.89
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	10,000	58.97	589,700.00
SIRIUS XM RADIO INC	436,000	2.96	1,290,560.00
THE WALT DISNEY CO.	192,838	49.94	9,630,329.72
TIME WARNER CABLE, INC.	34,377	95.65	3,288,160.05
TIME WARNER INC	107,223	47.64	5,108,103.72
VIACOM INC-CLASS B	52,259	53.42	2,791,675.78
VIRGIN MEDIA INC	28,477	36.22	1,031,436.94
ADVANCE AUTO PARTS	8,238	72.03	593,383.14
AMAZON.COM INC	40,923	257.99	10,557,724.77
AUTOZONE INC	3,802	359.48	1,366,742.96
BED BATH & BEYOND INC	26,307	60.25	1,584,996.75
BEST BUY COMPANY INC	30,816	11.88	366,094.08
CARMAX INC	26,222	34.84	913,574.48
DICK'S SPORTING GOODS INC	11,000	45.87	504,570.00
DOLLAR GENERAL CORP	29,500	43.28	1,276,760.00
DOLLAR TREE INC	26,470	39.54	1,046,623.80
EXPEDIA INC	10,691	60.78	649,798.98
FAMILY DOLLAR STORES	11,336	64.34	729,358.24
GAMESTOP CORP-CL A	14,547	27.55	400,769.85
GAP INC/THE	35,605	32.16	1,145,056.80
GENUINE PARTS CO	17,484	64.00	1,118,976.00
HOME DEPOT INC	170,673	61.77	10,542,471.21
J.C.PENNEY CO INC (HLDG CO)	19,297	20.88	402,921.36
KOHL'S CORP	26,071	44.75	1,166,677.25
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION-A	59,372	19.61	1,164,284.92
LIMITED BRANDS	27,753	48.23	1,338,527.19
LKQ CORPORATION	32,000	20.80	665,600.00
LOWE'S COMPANIES INC	133,273	35.11	4,679,215.03

MACY'S INC	45,622	38.77	1,768,764.94	
NORDSTROM INC	17,535	52.79	925,672.65	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC NEW	13,870	91.39	1,267,579.30	
PETSMART INC	12,691	71.08	902,076.28	
PRICELINE.COM INC	5,635	627.23	3,534,441.05	
ROSS STORES INC	25,326	53.80	1,362,538.80	
SEARS HOLDINGS CORP	3,910	44.25	173,017.50	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	9,660	149.93	1,448,323.80	
STAPLES INC	77,576	12.10	938,669.60	
TARGET CORP	70,233	61.52	4,320,734.16	
TIFFANY & CO	15,007	58.99	885,262.93	
TJX COMPANIES INC	83,049	43.25	3,591,869.25	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	7,630	88.83	677,772.90	
ULTA SALON COSMETICS & FRAGRANCE INC	6,820	96.34	657,038.80	
URBAN OUTFITTERS, INC.	14,100	40.17	566,397.00	
COSTCO WHOLESALE CORP	48,857	98.67	4,820,720.19	
CVS CAREMARK CORPORATION	143,931	48.75	7,016,636.25	
KROGER CO	57,787	26.50	1,531,355.50	
SAFEWAY INC	27,549	18.14	499,738.86	
SYSCO CORP	66,599	31.99	2,130,502.01	
WALGREEN CO	101,021	37.25	3,763,032.25	
WAL-MART STORES INC	210,558	68.52	14,427,434.16	
WHOLE FOODS MARKET INC	19,780	91.20	1,803,936.00	
ALTRIA GROUP INC	230,273	32.39	7,458,542.47	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	73,303	27.89	2,044,420.67	
BROWN-FORMAN CORPORATION	14,292	63.21	903,397.32	
BUNGE LIMITED	17,020	73.54	1,251,650.80	
CAMPBELL SOUP CO	21,179	35.98	762,020.42	
COCA-COLA CO/THE	459,674	36.78	16,906,809.72	
COCA-COLA ENTERPRISES INC	34,104	31.75	1,082,802.00	
CONAGRA FOODS INC	44,833	29.96	1,343,196.68	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	16,723	35.44	592,663.12	
DR.PEPPER SNAPPLE GROUP, INC	24,370	44.48	1,083,977.60	
GENERAL MILLS INC	73,176	41.27	3,019,973.52	
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTERS, INC.	15,150	41.80	633,270.00	
HJ HEINZ CO	36,253	59.04	2,140,377.12	
HORMEL FOODS CORPORATION	17,200	31.33	538,876.00	
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	12,100	85.96	1,040,116.00	
KELLOGG CO	28,628	56.15	1,607,462.20	
KRAFT FOODS GROUP INC	63,388	46.38	2,939,935.44	
LORILLARD INC	14,760	117.46	1,733,709.60	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	13,800	64.56	890,928.00	
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	22,952	65.83	1,510,930.16	
MOLSON COORS BREWING COMPANY	16,425	43.45	713,666.25	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	190,916	25.93	4,950,451.88	
MONSTER BEVERAGE CORPORATION	16,800	53.02	890,736.00	
PEPSICO INC	176,197	69.88	12,312,646.36	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	190,850	84.65	16,155,452.50	

RALCORP HOLDINGS INC	6,350	89.20	566,420.00
REYNOLDS AMERICAN INC	38,513	42.04	1,619,086.52
THE HERSHEY COMPANY	18,210	73.66	1,341,348.60
TYSON FOODS INC-CL A	32,800	19.60	642,880.00
AVON PRODUCTS INC	47,990	14.69	704,973.10
CHURCH & DWIGHT CO INC	15,470	53.24	823,622.80
CLOROX COMPANY	14,141	75.51	1,067,786.91
COLGATE-PALMOLIVE CO	53,694	106.03	5,693,174.82
ENERGIZER HOLDINGS INC	7,367	80.41	592,380.47
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	27,119	60.34	1,636,360.46
HERBALIFE LTD	12,650	37.34	472,351.00
KIMBERLY-CLARK CORP	44,745	85.00	3,803,325.00
PROCTER & GAMBLE CO	312,195	69.34	21,647,601.30
AETNA INC	37,239	46.00	1,712,994.00
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	21,504	95.05	2,043,955.20
AMERISOURCEBERGEN CORP	27,718	43.65	1,209,890.70
BARD(C.R.) INC	9,140	97.93	895,080.20
BAXTER INTERNATIONAL INC	61,966	66.40	4,114,542.40
BECTON DICKINSON & CO	22,118	78.53	1,736,926.54
BOSTON SCIENTIFIC CORP	166,125	5.74	953,557.50
CARDINAL HEALTH INC	38,697	42.01	1,625,660.97
CAREFUSION CORPORATION	24,345	28.48	693,345.60
CERNER CORP	16,610	79.33	1,317,671.30
CIGNA CORP	32,852	53.67	1,763,166.84
COVENTRY HEALTH CARE INC	15,913	44.44	707,173.72
COVIDIEN PLC	53,757	57.52	3,092,102.64
DAVITA HEALTH PARTNERS INC	11,178	110.87	1,239,304.86
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	16,809	40.38	678,747.42
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	13,350	92.00	1,228,200.00
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	91,846	54.17	4,975,297.82
HCA HOLDINGS, INC.	24,300	31.71	770,553.00
HENRY SCHEIN INC	10,250	81.61	836,502.50
HOLOGIC INC	28,280	20.39	576,629.20
HOSPIRA INC	19,733	32.06	632,639.98
HUMANA INC.	19,173	67.81	1,300,121.13
INTUITIVE SURGICAL INC	4,554	515.45	2,347,359.30
LABORATORY CRP OF AMR HLDGS	10,423	87.87	915,869.01
MCKESSON CORP	26,854	97.97	2,630,886.38
MEDTRONIC INC	115,740	42.44	4,912,005.60
OMNICARE INC	13,095	36.15	473,384.25
PATTERSON COS INC	10,732	33.96	364,458.72
QUEST DIAGNOSTICS	17,516	60.18	1,054,112.88
RESMED INC	15,500	42.12	652,860.00
ST JUDE MEDICAL INC	36,950	36.15	1,335,742.50
STRYKER CORP	34,911	55.96	1,953,619.56
UNITEDHEALTH GROUP INC	116,801	54.49	6,364,486.49
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	12,567	70.94	891,502.98
WELLPOINT INC	36,846	59.97	2,209,654.62

ZIMMER HOLDINGS INC	20,093	68.24	1,371,146.32
ABBOTT LABORATORIES	177,682	65.28	11,599,080.96
ALLERGAN INC	34,830	92.58	3,224,561.40
AMGEN INC	87,119	88.37	7,698,706.03
BIOGEN IDEC INC	25,349	151.26	3,834,289.74
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	190,153	32.57	6,193,283.21
CELGENE CORP	48,682	79.70	3,879,955.40
ELI LILLY & CO	118,161	48.92	5,780,436.12
FOREST LABORATORIES, INC.	29,330	35.54	1,042,388.20
GILEAD SCIENCES INC	85,738	74.66	6,401,199.08
ILLUMINA INC	14,289	52.11	744,599.79
JOHNSON & JOHNSON	311,964	70.63	22,034,017.32
LIFE TECHNOLOGIES CORPORATION	20,377	51.18	1,042,894.86
MERCK & CO. INC.	344,622	43.64	15,039,304.08
MYLAN INC	46,400	27.72	1,286,208.00
PERRIGO CO	9,850	102.92	1,013,762.00
PFIZER INC	845,801	25.35	21,441,055.35
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	41,155	64.75	2,664,786.25
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	24,108	43.02	1,037,126.16
WARNER CHILCOTT PLC	21,500	11.50	247,250.00
WATERS CORP	9,721	88.39	859,239.19
WATSON PHARMACEUTICALS INC	14,800	88.90	1,315,720.00
BB & T CORPORATION	79,807	29.51	2,355,104.57
COMERICA INC	21,050	30.16	634,868.00
FIFTH THIRD BANCORP	102,538	14.95	1,532,943.10
FIRST REPUBLIC BANK/CA	11,000	33.31	366,410.00
HUDSON CITY BANCORP INC	51,969	8.21	426,665.49
KEYCORP	106,915	8.45	903,431.75
M & T BANK CORP	12,828	100.62	1,290,753.36
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	52,068	13.18	686,256.24
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	39,400	12.32	485,408.00
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	59,745	58.64	3,503,446.80
REGIONS FINANCIAL CORPORATION	158,522	7.05	1,117,580.10
SUNTRUST BANKS INC	60,909	28.56	1,739,561.04
US BANCORP	214,643	32.20	6,911,504.60
WELLS FARGO & COMPANY	568,019	34.62	19,664,817.78
AFFILIATED MANAGERS GROUP	5,780	131.03	757,353.40
AMERICAN EXPRESS COMPANY	115,558	56.79	6,562,538.82
AMERIPRISE FINANCIAL INC	24,167	62.91	1,520,345.97
BANK OF AMERICA CORP	1,219,718	11.19	13,648,644.42
BANK OF NEW YORK MELLON CORP(THE)	134,097	25.87	3,469,089.39
BLACKROCK INC	15,080	205.81	3,103,614.80
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	65,822	58.72	3,865,067.84
CIT GROUP INC	21,800	38.17	832,106.00
CITIGROUP INC	332,141	39.45	13,102,962.45
CME GROUP INC.	35,140	52.60	1,848,364.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	57,430	39.77	2,283,991.10
EATON VANCE CORP	12,400	32.17	398,908.00

FRANKLIN RESOURCES INC	16,924	128.81	2,179,980.44
GOLDMAN SACHS GROUP INC	51,508	127.19	6,551,302.52
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	8,108	128.31	1,040,337.48
INVESCO LIMITED	49,239	26.08	1,284,153.12
JPMORGAN CHASE & CO	430,085	43.53	18,721,600.05
LEGG MASON INC	12,803	26.34	337,231.02
LEUCADIA NATIONAL CORPORATION	24,984	23.97	598,866.48
MOODY'S CORP	22,368	51.54	1,152,846.72
MORGAN STANLEY	166,654	19.09	3,181,424.86
NASDAQ STOCK MARKET INC	13,480	25.22	339,965.60
NORTHERN TRUST CORP	24,405	49.61	1,210,732.05
NYSE EURONEXT	29,029	24.05	698,147.45
SCHWAB (CHARLES) CORP	121,236	14.47	1,754,284.92
SEI INVESTMENTS COMPANY	17,324	22.78	394,640.72
SLM CORPORATION	54,461	16.87	918,757.07
STATE STREET CORP	54,921	46.50	2,553,826.50
T ROWE PRICE GROUP INC	28,724	65.99	1,895,496.76
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	25,294	16.89	427,215.66
ACE LIMITED	38,476	80.99	3,116,171.24
AFLAC INC	52,815	54.38	2,872,079.70
ALLEGHANY CORPORATION	1,360	329.21	447,725.60
ALLSTATE CORP	55,346	40.81	2,258,670.26
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	159,749	34.89	5,573,642.61
AON PLC	35,251	56.59	1,994,854.09
ARCH CAPITAL GROUP LTD.	15,100	44.14	666,514.00
ASSURANT INC	8,889	35.43	314,937.27
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	12,503	35.92	449,107.76
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	104,463	90.10	9,412,116.30
CHUBB CORP	30,677	75.49	2,315,806.73
CINCINNATI FINANCIAL CORP	17,926	39.93	715,785.18
EVEREST RE GROUP LTD	5,643	108.36	611,475.48
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL INC-CL A	24,361	23.03	561,033.83
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	47,686	22.52	1,073,888.72
LINCOLN NATIONAL CORP	33,427	25.94	867,096.38
LOEWS CORPORATION	35,638	41.17	1,467,216.46
MARSH & MCLENNAN COS	61,807	34.76	2,148,411.32
METLIFE INC	95,863	33.22	3,184,568.86
PARTNERRE LTD	7,143	81.86	584,725.98
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	34,828	28.13	979,711.64
PROGRESSIVE CORP	65,583	21.39	1,402,820.37
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	52,329	53.25	2,786,519.25
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	5,763	79.89	460,406.07
TORCHMARK CORPORATION	10,608	51.87	550,236.96
TRAVELERS COS INC(THE)	43,288	73.43	3,178,637.84
UNUM GROUP	31,370	20.97	657,828.90
W.R.BERKLEY CORPORATION	12,784	39.06	499,343.04
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	20,098	33.74	678,106.52
XL GROUP PLC	35,800	24.80	887,840.00

CBRE GROUP INC-A	36,200	19.96	722,552.00
LENNAR CORP-CL A	17,000	39.27	667,590.00
ACCENTURE PLC-CL A	71,914	70.40	5,062,745.60
ACTIVISION BLIZZARD INC	50,020	10.85	542,717.00
ADOBE SYSTEMS INC	55,917	38.07	2,128,760.19
AKAMAI TECHNOLOGIES	20,306	41.41	840,871.46
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	5,490	146.98	806,920.20
ANSYS INC	9,900	68.58	678,942.00
AUTODESK INC	24,534	36.00	883,224.00
AUTOMATIC DATA PROCESSING	54,360	58.12	3,159,403.20
BMC SOFTWARE INC	18,578	41.91	778,603.98
CA INC	36,313	22.44	814,863.72
CITRIX SYSTEMS INC	21,238	66.41	1,410,415.58
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATION	33,351	73.22	2,441,960.22
COMPUTER SCIENCES CORP	17,862	40.05	715,373.10
EBAY INC	131,164	51.29	6,727,401.56
ELECTRONIC ARTS INC	33,781	14.41	486,784.21
EQUINIX INC	5,500	202.48	1,113,640.00
F5 NETWORKS INC	9,111	96.43	878,573.73
FACEBOOK INC-A	113,400	27.41	3,108,294.00
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	26,812	35.06	940,028.72
FISERV INC	15,085	79.69	1,202,123.65
GOOGLE INC-CL A	29,651	719.78	21,342,196.78
INTL BUSINESS MACHINES CORP	122,876	195.08	23,970,650.08
INTUIT INC	31,333	62.08	1,945,152.64
LINKEDIN CORP-A	9,200	114.78	1,055,976.00
MASTERCARD INC-CL A	12,199	489.39	5,970,068.61
MICROSOFT CORP	854,265	27.31	23,329,977.15
NUANCE COMMUNICATIONS INC	28,400	22.87	649,508.00
ORACLE CORPORATION	442,347	34.09	15,079,609.23
PAYCHEX INC	37,344	33.05	1,234,219.20
RACKSPACE HOSTING INC	12,500	71.93	899,125.00
RED HAT INC	21,520	52.20	1,123,344.00
SAIC INC	31,400	11.66	366,124.00
SALESFORCE.COM, INC.	15,041	169.86	2,554,864.26
SYMANTEC CORPORATION	80,537	18.61	1,498,793.57
SYNOPSYS INC	16,584	32.00	530,688.00
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	19,119	21.93	419,279.67
VERIFONE SYSTEMS INC	12,500	29.46	368,250.00
VERISIGN INC	18,418	38.29	705,225.22
VISA INC	59,750	149.16	8,912,310.00
VMWARE INC	9,400	96.82	910,108.00
WESTERN UNION COMPANY	69,004	13.70	945,354.80
YAHOO! INC	127,708	19.59	2,501,799.72
AGILENT TECHNOLOGIES INC	39,437	40.59	1,600,747.83
AMPHENOL CORPORATION -CL A	18,678	64.85	1,211,268.30
APPLE INC	106,124	526.10	55,831,836.40



ARROW ELECTRONICS INC	12,290	38.71	475,745.90
AVAGO TECHNOLOGIES LTD.	27,400	31.99	876,526.00
AVNET INC	16,800	31.49	529,032.00
CISCO SYSTEMS INC	606,615	20.25	12,283,953.75
CORNING INC	170,250	12.77	2,174,092.50
DELL INC	165,651	10.49	1,737,678.99
DOLBY LABORATORIES INC-CL A	5,800	31.21	181,018.00
EMC CORP/MASS	237,367	25.91	6,150,178.97
FLEXTRONICS INTL LTD	79,131	6.10	482,699.10
FLIR SYSTEMS INC	18,640	21.56	401,878.40
HARRIS CORP	12,050	50.10	603,705.00
HEWLETT-PACKARD CO	222,334	14.38	3,197,162.92
JUNIPER NETWORKS INC	58,856	20.16	1,186,536.96
MOTOROLA SOLUTIONS INC	28,645	54.33	1,556,282.85
NETAPP INC	40,383	34.29	1,384,733.07
QUALCOMM INC	192,765	62.54	12,055,523.10
SANDISK CORP	27,377	43.82	1,199,660.14
SEAGATE TECHNOLOGY	41,368	30.28	1,252,623.04
TE CONNECTIVITY LTD	48,541	37.27	1,809,123.07
TERADATA CORP	18,624	62.50	1,164,000.00
TRIMBLE NAVIGATION LTD	13,700	59.02	808,574.00
WESTERN DIGITAL CORP	25,723	41.17	1,059,015.91
XEROX CORP	150,663	7.06	1,063,680.78
AT&T INC	652,924	33.91	22,140,652.84
CENTURYLINK INC	69,555	39.75	2,764,811.25
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	33,367	70.64	2,357,044.88
FRONTIER COMMUNICATIONS CORPORATION	117,153	4.48	524,845.44
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	15,366	23.03	353,878.98
METROPCS COMMUNICATIONS INC.	34,131	9.96	339,944.76
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	13,600	69.80	949,280.00
SPRINT NEXTEL CORP	342,323	5.46	1,869,083.58
VERIZON COMMUNICATIONS INC	322,617	43.38	13,995,125.46
WINDSTREAM CORPORATION	72,600	8.89	645,414.00
AES CORPORATION	70,166	10.91	765,511.06
ALLIANT ENERGY CORP	12,648	44.72	565,618.56
AMEREN CORPORATION	27,524	30.05	827,096.20
AMERICAN ELECTRIC POWER	54,287	43.51	2,362,027.37
AMERICAN WATER WORKS CO INC	20,200	37.28	753,056.00
CALPINE CORP	34,600	17.90	619,340.00
CENTERPOINT ENERGY INC	45,309	19.72	893,493.48
CMS ENERGY CORPORATION	31,000	24.56	761,360.00
CONSOLIDATED EDISON INC	33,732	56.40	1,902,484.80
DOMINION RESOURCES INC/VA	65,093	51.80	3,371,817.40
DTE ENERGY COMPANY	19,773	60.90	1,204,175.70
DUKE ENERGY CORP	79,546	64.75	5,150,603.50
EDISON INTERNATIONAL	35,785	45.54	1,629,648.90
ENERGEN CORPORATION	8,800	46.00	404,800.00
ENERGY CORP	20,271	64.26	1,302,614.46

EQT CORPORATION	16,580	57.01	945,225.80	
EXELON CORP	95,517	30.12	2,876,972.04	
FIRSTENERGY CORP	47,776	41.50	1,982,704.00	
INTEGRYS ENERGY GROUP, INC.	9,400	53.64	504,216.00	
MDU RESOURCES GROUP INC	20,500	21.66	444,030.00	
NEXTERA ENERGY INC	45,315	70.57	3,197,879.55	
NISOURCE INC	33,692	24.69	831,855.48	
NORTHEAST UTILITIES	36,012	39.45	1,420,673.40	
NRG ENERGY INC	25,425	22.78	579,181.50	
OGE ENERGY CORP	11,300	56.73	641,049.00	
ONEOK INC	21,600	43.45	938,520.00	
P G & E CORPORATION	47,581	41.47	1,973,184.07	
PEPCO HOLDINGS INC	24,434	19.72	481,838.48	
PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	11,844	51.86	614,229.84	
PPL CORPORATION	66,562	29.14	1,939,616.68	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	57,597	30.74	1,770,531.78	
QEP RESOURCES INC	19,966	30.34	605,768.44	
SCANA CORP	13,363	46.32	618,974.16	
SEMPRA ENERGY	25,503	72.26	1,842,846.78	
SOUTHERN CO	98,763	43.32	4,278,413.16	
WISCONSIN ENERGY CORP	26,432	37.59	993,578.88	
XCEL ENERGY INC	55,060	27.37	1,506,992.20	
ALTERA CORPORATION	37,208	34.55	1,285,536.40	
ANALOG DEVICES INC	33,801	42.28	1,429,106.28	
APPLIED MATERIALS INC	137,674	11.32	1,558,469.68	
BROADCOM CORP-CL A	56,436	33.15	1,870,853.40	
CREE INC	12,400	34.65	429,660.00	
INTEL CORP	566,339	21.09	11,944,089.51	
KLA-TENCOR CORPORATION	18,124	47.92	868,502.08	
LAM RESEARCH CORP	21,264	36.50	776,136.00	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	26,854	34.14	916,795.56	
LSI CORPORATION	57,857	7.10	410,784.70	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	55,474	8.71	483,178.54	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	33,400	30.06	1,004,004.00	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	22,608	32.46	733,855.68	
MICRON TECHNOLOGY INC	110,482	6.82	753,487.24	
NVIDIA CORP	69,494	12.65	879,099.10	
TEXAS INSTRUMENTS INC	128,421	31.25	4,013,156.25	
XILINX INC	30,053	36.05	1,083,410.65	
米ドル小計	34,319,206		1,491,014,252.33	
(邦貨換算額：円)			(125,603,040,616)	
カナダドル				
ARC RESOURCES LTD	34,900	23.70	827,130.00	
ATHABASCA OIL CORP	36,100	10.96	395,656.00	
BAYTEX ENERGY CORPORATION	13,107	42.56	557,833.92	
BONAVISTA ENERGY CORPORATION	17,500	14.37	251,475.00	
CAMECO CORP	45,343	20.51	929,984.93	

CANADIAN NATURAL RESOURCES	123,519	28.42	3,510,409.98
CANADIAN OIL SANDS LTD	54,242	20.10	1,090,264.20
CENOVUS ENERGY INC	84,533	33.35	2,819,175.55
CRESCENT POINT ENERGY CORP	39,445	37.80	1,491,021.00
ENBRIDGE INC	85,149	42.55	3,623,089.95
ENCANA CORP	84,344	20.02	1,688,566.88
ENERPLUS CORP	24,590	12.97	318,932.30
HUSKY ENERGY INC	38,742	29.13	1,128,554.46
IMPERIAL OIL LTD	34,051	42.89	1,460,447.39
MEG ENERGY CORPORATION	14,600	31.29	456,834.00
NEXEN INC	60,308	26.39	1,591,528.12
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORPORATION	33,100	23.34	772,554.00
PEMBINA PIPELINE CORP	32,400	28.68	929,232.00
PENGROWTH ENERGY CORPORATION	61,700	5.06	312,202.00
PENN WEST PETROLEUM LTD	56,253	11.54	649,159.62
SUNCOR ENERGY INC	174,701	32.69	5,710,975.69
TALISMAN ENERGY INC	113,607	11.25	1,278,078.75
TOURMALINE OIL CORP	14,700	30.31	445,557.00
TRANSCANADA CORP	79,792	46.79	3,733,467.68
VERMILION ENERGY INC	10,000	51.71	517,100.00
AGNICO-EAGLE MINES	19,550	50.90	995,095.00
AGRIUM INC	16,873	98.47	1,661,484.31
BARRICK GOLD CORP	112,908	33.45	3,776,772.60
CENTERRA GOLD INC	21,000	8.87	186,270.00
ELDORADO GOLD CORPORATION	75,231	12.55	944,149.05
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	54,710	21.55	1,179,000.50
FRANCO-NEVADA CORPORATION	16,400	56.20	921,680.00
GOLDCORP INC	92,011	35.94	3,306,875.34
IAMGOLD CORP	45,500	11.20	509,600.00
INMET MINING CORPORATION	5,382	73.59	396,061.38
KINROSS GOLD CORP	126,627	9.35	1,183,962.45
NEW GOLD INC	50,500	10.45	527,725.00
OSISKO MINING CORPORATION	42,630	7.61	324,414.30
PAN AMERICAN SILVER CORP	18,772	17.69	332,076.68
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	97,043	40.05	3,886,572.15
SILVER WHEATON CORPORATION	39,486	34.89	1,377,666.54
SINO-FOREST CORPORATION-CL A	30,871	0.01	308.71
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	65,705	35.99	2,364,722.95
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	48,466	7.34	355,740.44
YAMANA GOLD INC	84,390	16.79	1,416,908.10
BOMBARDIER INC 'B'	167,759	3.57	598,899.63
CAE INC	26,614	10.20	271,462.80
FINNING INTERNATIONAL INC	20,095	24.50	492,327.50
SNC-LAVALIN GROUP INC	17,081	40.26	687,681.06
RITCHIE BROS. AUCTIONEERS	9,000	21.42	192,780.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	49,194	90.42	4,448,121.48
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	19,851	99.75	1,980,137.25
MAGNA INTERNATIONAL INC	25,586	48.53	1,241,688.58

GILDAN ACTIVEWEAR INC	13,200	35.17	464,244.00	
TIM HORTONS INC	17,630	48.58	856,465.40	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	43,671	22.81	996,135.51	
THOMSON REUTERS CORP	40,978	28.80	1,180,166.40	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	8,838	69.06	610,352.28	
DOLLARAMA INC	7,800	56.90	443,820.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B	14,100	48.29	680,889.00	
EMPIRE CO LTD A	3,300	58.98	194,634.00	
LOBLAW COMPANIES LTD	12,553	40.77	511,785.81	
METRO INC	11,350	63.66	722,541.00	
SHOPPERS DRUG MART CORP	24,160	42.45	1,025,592.00	
WESTON (GEORGE) LTD	5,620	70.17	394,355.40	
SAPUTO INC	14,390	50.48	726,407.20	
CATAMARAN CORPORATION	23,200	49.12	1,139,584.00	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	32,184	59.19	1,904,970.96	
BANK OF MONTREAL	73,063	60.93	4,451,728.59	
BANK OF NOVA SCOTIA	129,810	57.97	7,525,085.70	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	45,953	82.26	3,780,093.78	
NATIONAL BANK OF CANADA	18,607	77.85	1,448,554.95	
ROYAL BANK OF CANADA	163,414	60.53	9,891,449.42	
TORONTO-DOMINION BANK	103,608	83.10	8,609,824.80	
CI FINANCIAL CORP	17,600	24.45	430,320.00	
IGM FINANCIAL INC	12,601	42.01	529,368.01	
ONEX CORPORATION	10,523	41.58	437,546.34	
GREAT-WEST LIFECO INC	31,404	24.27	762,175.08	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANC	9,000	30.54	274,860.00	
INTACT FINANCIAL CORPORATION	14,210	64.60	917,966.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	204,497	13.60	2,781,159.20	
POWER CORP OF CANADA	39,960	25.32	1,011,787.20	
POWER FINANCIAL CORP	27,830	27.57	767,273.10	
SUN LIFE FINANCIAL INC	67,133	26.53	1,781,038.49	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	63,090	36.21	2,284,488.90	
BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES	31,463	16.93	532,668.59	
CGI GROUP INC - CL A	24,487	24.26	594,054.62	
OPEN TEXT CORPORATION	6,300	55.82	351,666.00	
RESEARCH IN MOTION	51,455	13.49	694,127.95	
BCE INC	28,970	42.75	1,238,467.50	
BELL ALIANT INC.	7,550	26.80	202,340.00	
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	44,000	44.64	1,964,160.00	
TELUS CORPORATION -NON VOTE	17,087	65.08	1,112,021.96	
CANADIAN UTILITIES LIMITED	7,140	70.84	505,797.60	
FORTIS INC	21,380	34.16	730,340.80	
TRANSALTA CORP	23,868	14.79	353,007.72	
カナダドル小計	4,334,938		139,864,729.48	
(邦貨換算額：円)			(11,913,677,657)	
オーストラリアドル				
CALTEX AUSTRALIA LIMITED	14,400	19.04	274,176.00	

ORIGIN ENERGY LIMITED	122,859	11.67	1,433,764.53
SANTOS LTD	107,311	10.88	1,167,543.68
WHITEHAVEN COAL LTD	56,000	3.47	194,320.00
WOODSIDE PETROLEUM LTD	74,948	33.90	2,540,737.20
WORLEY PARSONS LIMITED	23,750	23.59	560,262.50
ALUMINA LTD	276,977	0.95	263,128.15
AMCOR LIMITED	135,877	7.89	1,072,069.53
BHP BILLITON LTD	365,257	37.06	13,536,424.42
BORAL LIMITED	94,596	4.39	415,276.44
FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	156,000	4.66	726,960.00
ILUKA RESOURCES LIMITED	50,400	8.65	435,960.00
INCITEC PIVOT LTD	178,000	3.27	582,060.00
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	48,403	9.19	444,823.57
NEWCREST MINING LIMITED	86,679	22.56	1,955,478.24
ORICA LIMITED	41,073	24.70	1,014,503.10
OZ MINERALS LIMITED	30,546	6.71	204,963.66
RIO TINTO LIMITED	49,211	65.71	3,233,654.81
SIMS METAL MANAGEMENT LTD	18,995	9.00	170,955.00
LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	16,305	17.55	286,152.75
ALS LTD	41,500	10.27	426,205.00
BRAMBLES LIMITED	182,732	7.35	1,343,080.20
FLIGHT CENTRE LIMITED	5,800	26.50	153,700.00
ASCIANO LTD	107,966	4.61	497,723.26
AURIZON HOLDINGS LTD	191,000	3.65	697,150.00
QANTAS AIRWAYS LIMITED	133,138	1.45	193,050.10
TOLL HOLDINGS LIMITED	83,620	4.54	379,634.80
CROWN LTD	45,265	10.30	466,229.50
ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD	94,745	3.44	325,922.80
TABCORP HOLDINGS LIMITED	77,545	2.99	231,859.55
TATTS GROUP LTD	152,000	2.93	445,360.00
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	57,850	1.87	108,468.75
METCASH LTD	92,000	3.29	302,680.00
WESFARMERS LIMITED	114,246	36.13	4,127,707.98
WOOLWORTHS LIMITED	139,848	29.39	4,110,132.72
COCA-COLA AMATIL LIMITED	64,617	13.39	865,221.63
TREASURY WINE ESTATES LTD	72,000	4.75	342,000.00
COCHLEAR LIMITED	6,213	77.70	482,750.10
RAMSAY HEALTH CARE LTD	15,000	26.39	395,850.00
SONIC HEALTHCARE LTD	43,326	13.22	572,769.72
CSL LIMITED	57,014	53.60	3,055,950.40
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	307,253	24.64	7,570,713.92
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	47,400	8.47	401,478.00
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	180,216	61.33	11,052,647.28
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	257,523	24.80	6,386,570.40
WESTPAC BANKING CORPORATION	348,784	25.80	8,998,627.20
ASX LTD	19,610	30.91	606,145.10
MACQUARIE GROUP LTD	37,221	34.82	1,296,035.22
AMP LIMITED	334,825	4.80	1,607,160.00

INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	237,006	4.67	1,106,818.02	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	130,381	10.62	1,384,646.22	
SUNCORP GROUP LTD	148,581	10.06	1,494,724.86	
COMPUTERSHARE LIMITED	55,229	8.87	489,881.23	
TELSTRA CORPORATION LIMITED	493,987	4.34	2,143,903.58	
AGL ENERGY LIMITED	61,969	14.98	928,295.62	
オーストラリアドル小計	6,384,997		95,504,306.74	
(邦貨換算額:円)			(8,426,344,983)	
英債券				
AMEC PLC	36,735	10.23	375,799.05	
BG GROUP PLC	384,786	10.23	3,936,360.78	
BP PLC	2,155,550	4.31	9,296,887.15	
PETROFAC LIMITED	29,400	16.62	488,628.00	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	420,713	21.40	9,003,258.20	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	297,766	22.00	6,550,852.00	
TULLOW OIL PLC	101,094	12.28	1,241,434.32	
ANGLO AMERICAN PLC	157,166	18.93	2,975,152.38	
ANTOFAGASTA PLC	42,870	13.66	585,604.20	
BHP BILLITON PLC	239,131	21.45	5,130,555.60	
CRODA INTERNATIONAL PLC	15,700	23.82	373,974.00	
EURASIAN NATURAL RESOURCES CORPORATION	28,187	2.81	79,205.47	
EVRAZ PLC	38,000	2.78	105,792.00	
FRESNILLO PLC	20,000	19.11	382,200.00	
GLENCORE INTERNATIONAL PLC	437,100	3.52	1,541,433.15	
JOHNSON MATTHEY PLC	23,878	24.09	575,221.02	
KAZAKHMYS PLC	25,600	7.72	197,760.00	
MELROSE INDUSTRIES PLC	145,000	2.34	339,445.00	
RANDGOLD RESOURCES LTD	10,082	61.05	615,506.10	
REXAM PLC	97,649	4.45	434,538.05	
RIO TINTO PLC	151,667	35.06	5,318,203.35	
VEDANTA RESOURCES PLC	9,900	11.55	114,345.00	
XSTRATA PLC	236,439	10.50	2,482,609.50	
BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	38,300	9.87	378,212.50	
BAE SYSTEMS PLC	369,792	3.41	1,264,318.84	
BALFOUR BEATTY PLC	69,839	2.68	187,447.87	
BUNZL PLC	37,608	10.20	383,601.60	
COBHAM PLC	122,074	2.21	270,393.91	
IMI PLC	38,000	11.07	420,660.00	
INVENSYS PLC	85,258	3.25	277,855.82	
MEGGITT PLC	89,500	3.94	353,435.50	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	211,203	8.83	1,865,978.50	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-C ENTITLEMENT	16,940,628	0.00	16,940.62	
SMITHS GROUP PLC	45,866	11.84	543,053.44	
WEIR GROUP PLC/THE	23,300	18.12	422,196.00	
WOLSELEY PLC	31,476	28.80	906,508.80	
AGGREKO PLC	30,193	17.00	513,281.00	

CAPITA PLC	70,899	7.76	550,530.73
EXPERIAN PLC	117,394	10.06	1,180,983.64
G4S PLC	162,927	2.60	424,913.61
INTERTEK GROUP PLC	18,100	31.28	566,168.00
SERCO GROUP PLC	59,528	5.44	323,832.32
GKN PLC	177,000	2.27	401,967.00
BURBERRY GROUP PLC	52,837	12.49	659,934.13
CARNIVAL PLC	21,347	25.45	543,281.15
COMPASS GROUP PLC	207,745	7.34	1,524,848.30
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	31,499	16.59	522,568.41
TUI TRAVEL PLC	44,000	2.86	126,060.00
WHITBREAD PLC	19,856	24.82	492,825.92
BRITISH SKY BROADCASTING PLC	124,421	7.72	960,530.12
ITV PLC	436,592	1.03	453,182.49
PEARSON PLC	90,553	11.99	1,085,730.47
REED ELSEVIER PLC	139,148	6.42	893,330.16
WPP PLC	142,450	8.83	1,257,833.50
KINGFISHER PLC	276,225	2.78	769,286.62
MARKS & SPENCER GROUP PLC	179,699	3.98	716,639.61
NEXT PLC	18,194	37.70	685,913.80
SAINSBURY (J) PLC	135,638	3.53	479,073.41
TESCO PLC	911,101	3.40	3,100,021.15
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	259,042	2.65	687,238.42
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	41,000	15.67	642,470.00
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	219,891	30.95	6,805,626.45
DIAGEO PLC	283,757	18.38	5,216,872.44
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	111,996	23.97	2,684,544.12
SABMILLER PLC	108,074	28.33	3,061,736.42
TATE & LYLE PLC	52,800	7.73	408,408.00
UNILEVER PLC	145,107	24.25	3,518,844.75
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	74,418	39.65	2,950,673.70
SMITH & NEPHEW PLC	98,523	6.85	675,375.16
ASTRAZENECA PLC	140,941	29.43	4,147,893.63
GLAXOSMITHKLINE PLC	563,233	13.54	7,628,990.98
SHIRE PLC	64,563	19.20	1,239,609.60
BARCLAYS PLC	1,317,018	2.66	3,510,511.47
HSBC HOLDINGS PLC	2,073,261	6.53	13,538,394.33
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,765,412	0.49	2,344,582.70
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	238,067	3.15	750,863.31
STANDARD CHARTERED PLC	270,582	15.68	4,242,725.76
3I GROUP PLC	118,000	2.20	259,718.00
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	98,000	3.58	351,232.00
HARGREAVES LANSDOWN PLC	24,000	6.96	167,040.00
ICAP PLC	57,716	3.12	180,073.92
INVESTEC PLC	65,000	4.15	269,815.00
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	18,902	11.06	209,056.12
SCHRODERS PLC	14,200	17.01	241,542.00
ADMIRAL GROUP PLC	22,600	11.99	270,974.00

AVIVA PLC	333,709	3.80	1,270,763.87	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	671,945	1.46	981,711.64	
OLD MUTUAL PLC	540,057	1.79	969,402.31	
PRUDENTIAL PLC	288,661	8.90	2,569,082.90	
RESOLUTION LTD	149,468	2.55	381,741.27	
RSA INSURANCE GROUP PLC	383,885	1.26	486,766.18	
STANDARD LIFE PLC	272,048	3.40	925,235.24	
SAGE GROUP PLC (THE)	140,463	2.94	413,663.53	
ARM HOLDINGS PLC	157,500	7.75	1,220,625.00	
BT GROUP PLC	893,771	2.41	2,154,881.88	
INMARSAT PLC	47,300	5.96	281,908.00	
VODAFONE GROUP PLC	5,562,697	1.56	8,713,964.85	
CENTRICA PLC	581,581	3.40	1,979,701.72	
NATIONAL GRID PLC	410,767	7.11	2,920,553.37	
SEVERN TRENT PLC	27,394	15.76	431,729.44	
SSE PLC	107,408	14.48	1,555,267.84	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	82,091	6.88	564,786.08	
英債券小計	48,571,451		171,494,700.66	
(邦貨換算額：円)			(23,479,339,467)	
スイスフラン				
TRANSOCEAN LTD	40,655	42.35	1,721,739.25	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	700	216.00	151,200.00	
GIVAUDAN-REG	992	975.00	967,200.00	
HOLCIM LTD-REG	26,255	66.85	1,755,146.75	
SIKA AG	245	2,153.00	527,485.00	
SYNGENTA AG	10,528	376.50	3,963,792.00	
ABB LTD	248,519	18.97	4,714,405.43	
GEBERIT AG-REG	4,190	200.50	840,095.00	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,540	130.30	330,962.00	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	5,300	132.00	699,600.00	
SULZER AG	2,850	146.00	416,100.00	
ADECCO SA-REG	15,234	48.65	741,134.10	
SGS SA	631	2,064.00	1,302,384.00	
KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	6,002	110.20	661,420.40	
CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-BR A	59,133	72.15	4,266,445.95	
THE SWATCH GROUP AG-B	3,541	466.00	1,650,106.00	
THE SWATCH GROUP AG-REG	4,600	79.95	367,770.00	
ARYZTA AG	9,900	47.20	467,280.00	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	230	898.00	206,540.00	
LINDT & SPRUENGLI AG	95	2,994.00	284,430.00	
LINDT & SPRUENGLI AG-REG	11	34,770.00	382,470.00	
NESTLE SA-REGISTERED	365,090	60.15	21,960,163.50	
SONOVA HOLDING AG	5,392	103.80	559,689.60	
ACTELION LTD	13,316	45.18	601,616.88	
LONZA GROUP AG-REG	5,587	49.53	276,724.11	
NOVARTIS AG-REG SHS	260,258	58.45	15,212,080.10	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	79,485	187.10	14,871,643.50	



BANQUE CANTONALE VAUDOISE	340	491.75	167,195.00	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	142,135	22.96	3,263,419.60	
JULIUS BAER GROUP LTD	24,969	33.75	842,703.75	
PARGESA HOLDING SA-BR	3,100	63.85	197,935.00	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,700	207.40	352,580.00	
UBS AG-REGISTERED	412,308	15.20	6,267,081.60	
BALOISE HOLDING AG	5,530	80.35	444,335.50	
SWISS LIFE HOLDING AG	3,540	124.20	439,668.00	
SWISS RE AG	40,007	66.95	2,678,468.65	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	16,723	244.30	4,085,428.90	
SWISS PRIME SITE-REG	5,800	76.45	443,410.00	
SWISSCOM AG-REG	2,601	397.20	1,033,117.20	
スイスフラン小計	1,830,032		100,114,966.77	
(邦貨換算額：円)			(9,230,599,936)	
香港ドル				
HUTCHISON WHAMPOA LTD	244,000	80.60	19,666,400.00	
NWS HOLDINGS LTD	160,500	13.34	2,141,070.00	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	243,000	29.75	7,229,250.00	
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	144,000	14.12	2,033,280.00	
MTR CORPORATION	164,500	30.75	5,058,375.00	
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	21,500	50.00	1,075,000.00	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	78,000	25.90	2,020,200.00	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	100,000	14.10	1,410,000.00	
SANDS CHINA LTD	280,000	34.10	9,548,000.00	
SHANGRI-LA ASIA LTD.	166,000	15.24	2,529,840.00	
SJM HOLDINGS LIMITED	223,000	17.98	4,009,540.00	
WYNN MACAU LTD	178,000	21.45	3,818,100.00	
LI & FUNG LTD	655,200	13.76	9,015,552.00	
BANK OF EAST ASIA	158,020	29.45	4,653,689.00	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	406,500	24.40	9,918,600.00	
HANG SENG BANK LTD	85,800	117.60	10,090,080.00	
WING HANG BANK LIMITED	22,000	80.00	1,760,000.00	
FIRST PACIFIC COMPANY	220,000	8.64	1,900,800.00	
HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	120,600	131.40	15,846,840.00	
AIA GROUP LTD	1,247,000	30.40	37,908,800.00	
CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	158,000	119.90	18,944,200.00	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	257,000	29.85	7,671,450.00	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	111,000	55.90	6,204,900.00	
HOPEWELL HOLDINGS LTD	57,000	31.55	1,798,350.00	
HYSAN DEVELOPMENT CO	74,000	37.20	2,752,800.00	
KERRY PROPERTIES LTD	76,500	40.25	3,079,125.00	
NEW WORLD DEVELOPMENT	409,000	12.28	5,022,520.00	
SINO LAND CO	356,200	14.08	5,015,296.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	177,000	116.80	20,673,600.00	
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	77,500	93.70	7,261,750.00	
SWIRE PROPERTIES LIMITED	130,000	25.70	3,341,000.00	
WHARF HOLDINGS LTD	168,000	60.10	10,096,800.00	

WHEELLOCK&COMPANY LTD	107,000	38.70	4,140,900.00	
PCCW LIMITED	510,000	3.41	1,739,100.00	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	61,000	48.15	2,937,150.00	
CLP HOLDINGS LTD	201,100	64.30	12,930,730.00	
HONG KONG & CHINA GAS	596,415	21.05	12,554,535.75	
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	154,500	65.00	10,042,500.00	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	20,000	90.50	1,810,000.00	
香港ドル小計	8,618,835		289,650,122.75	
(邦貨換算額：円)			(3,148,496,834)	
シンガポールドル				
FRASER & NEAVE LTD	106,000	9.66	1,023,960.00	
KEPPEL CORP LTD	159,400	10.88	1,734,272.00	
NOBLE GROUP LTD	409,400	1.18	483,092.00	
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	109,820	5.19	569,965.80	
SEMBCORP MARINE LTD	103,400	4.61	476,674.00	
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG	176,000	3.87	681,120.00	
YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	245,000	0.94	231,525.00	
COMFORTDELGRO CORP LTD	205,000	1.76	361,825.00	
SINGAPORE AIRLINES LTD	58,266	11.00	640,926.00	
GENTING SINGAPORE PLC	703,000	1.37	963,110.00	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	186,250	4.04	752,450.00	
CYCLE & CARRIAGE LTD	12,000	48.50	582,000.00	
OLAM INTERNATIONAL LTD	176,000	1.54	271,040.00	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	796,600	0.64	509,824.00	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	219,000	3.18	696,420.00	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	204,000	14.91	3,041,640.00	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	288,000	9.80	2,822,400.00	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	145,000	19.67	2,852,150.00	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	104,000	7.02	730,080.00	
CAPITALAND LTD	296,000	3.63	1,074,480.00	
CAPITAMALLS ASIA LTD	140,000	1.96	274,400.00	
CITY DEVELOPMENTS LTD	61,000	13.00	793,000.00	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LIMITED	221,000	2.80	618,800.00	
KEPPEL LAND LTD	90,000	3.99	359,100.00	
UOL GROUP LIMITED	48,000	5.92	284,160.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	901,015	3.35	3,018,400.25	
STARHUB LIMITED	57,000	3.87	220,590.00	
シンガポールドル小計	6,220,151		26,067,404.05	
(邦貨換算額：円)			(1,799,693,575)	
ニュージーランドドル				
FLETCHER BUILDING LTD	81,457	8.27	673,649.39	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	100,557	2.68	269,492.76	
SKYCITY ENTERTAINMENT GROUP	61,890	3.79	234,563.10	
TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	216,409	2.29	495,576.61	
CONTACT ENERGY LIMITED	36,256	5.18	187,806.08	
ニュージーランドドル小計	496,569		1,861,087.94	

(邦貨換算額：円)			(130,871,703)
スウェーデンクローナ			
LUNDIN PETROLEUM AB	26,200	153.80	4,029,560.00
BOLIDEN AB	30,500	123.50	3,766,750.00
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	64,067	139.80	8,956,566.60
ALFA LAVAL AB	38,552	135.00	5,204,520.00
ASSA ABLOY AB-B	38,416	238.00	9,143,008.00
ATLAS COPCO AB-A SHS	75,009	178.20	13,366,603.80
ATLAS COPCO AB-B SHS	45,196	157.90	7,136,448.40
HEXAGON AB-B SHS	25,800	169.00	4,360,200.00
SANDVIK AB	114,254	103.30	11,802,438.20
SCANIA AB-B SHS	34,932	136.10	4,754,245.20
SKANSKA AB-B SHS	41,190	110.10	4,535,019.00
SKF AB-B SHARES	45,238	162.80	7,364,746.40
VOLVO AB-B SHS	158,394	90.40	14,318,817.60
SECURITAS AB-B SHS	37,257	55.20	2,056,586.40
ELECTROLUX AB-SER B	27,283	175.40	4,785,438.20
HUSQVARNA AB-B SHS	39,983	39.90	1,595,321.70
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	107,544	225.90	24,294,189.60
SWEDISH MATCH AB	23,971	222.20	5,326,356.20
ELEKTA AB-B SHS	40,600	101.80	4,133,080.00
GETINGE AB-B SHS	23,838	218.60	5,210,986.80
NORDEA BANK AB	295,287	61.55	18,174,914.85
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A	161,023	55.45	8,928,725.35
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	55,626	232.80	12,949,732.80
SWEDBANK AB - A SHARES	89,664	125.70	11,270,764.80
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	12,800	106.00	1,356,800.00
INVESTOR AB-B SHS	52,349	165.90	8,684,699.10
KINNEVIK INVESTMENT AB-B	23,600	132.90	3,136,440.00
RATOS AB-B SHS	24,400	63.95	1,560,380.00
ERICSSON LM-B SHS	344,469	66.35	22,855,518.15
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	7,040	576.00	4,055,040.00
TELE2 AB -B SHS	36,898	118.30	4,365,033.40
TELIASONERA AB	246,371	44.38	10,933,944.98
スウェーデンクローナ小計	2,387,751		254,412,875.53
(邦貨換算額：円)			(3,269,205,450)
ノルウェークローネ			
AKER SOLUTIONS ASA	17,600	114.00	2,006,400.00
SEADRILL LID	40,281	209.60	8,442,897.60
STATOIL ASA	126,506	140.60	17,786,743.60
SUBSEA 7 SA	32,000	135.60	4,339,200.00
NORSK HYDRO ASA	97,297	27.86	2,710,694.42
YARA INTERNATIONAL ASA	21,512	278.70	5,995,394.40
ORKLA ASA	87,150	48.10	4,191,915.00
DNB ASA	108,819	70.10	7,628,211.90
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	24,200	81.80	1,979,560.00

TELENOR ASA	80,262	114.50	9,189,999.00
ノルウェークローネ小計	635,627		64,271,015.92
(邦貨換算額：円)			(970,492,340)
デンマーククローネ			
NOVOZYMES A/S-B SHARES	28,435	159.70	4,541,069.50
A P MOLLER - MAERSK A/S	155	43,280.00	6,708,400.00
A P MOLLER-MAERSK A/S-A	58	40,640.00	2,357,120.00
DSV A/S	20,180	140.80	2,841,344.00
CARLSBERG AS-B	12,386	548.00	6,787,528.00
COLOPLAST-B	2,681	271.60	728,159.60
COLOPLAST-B-NEW	10,724	271.60	2,912,638.40
WILLIAM DEMANT HOLDING	2,860	486.30	1,390,818.00
NOVO NORDISK A/S-B	46,058	908.50	41,843,693.00
DANSKE BANK A/S	77,238	96.75	7,472,776.50
TRYG A/S	2,368	422.50	1,000,480.00
TDC A/S	51,300	39.62	2,032,506.00
デンマーククローネ小計	254,443		80,616,533.00
(邦貨換算額：円)			(1,202,798,672)
イスラエルシュケル			
DELEK GROUP LTD	530	871.00	461,630.00
ISRAEL CHEMICALS LIMITED	49,000	46.95	2,300,550.00
ISRAEL CORPORATION LTD/THE	245	2,604.00	637,980.00
TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	106,453	146.20	15,563,428.60
BANK HAPOALIM BM	122,000	16.80	2,049,600.00
BANK LEUMI LE-ISRAEL	139,000	13.06	1,815,340.00
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	16,000	39.37	629,920.00
NICE SYSTEMS LTD	8,200	125.40	1,028,280.00
MELLANOX TECHNOLOGIES LTD	3,800	243.00	923,400.00
BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	203,000	4.40	893,809.00
イスラエルシュケル小計	648,228		26,303,937.60
(邦貨換算額：円)			(590,786,438)
ユーロ			
COMPAGNIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE-VERITA	18,650	23.15	431,840.75
ENI SPA	287,648	18.52	5,327,240.96
FUGRO NV-CVA	7,695	44.12	339,541.87
GALP ENERGIA SGPS S.A	25,700	11.85	304,673.50
NESTE OIL OYJ	16,085	9.84	158,276.40
OMV AG	16,599	27.88	462,863.11
REPSOL SA	91,868	16.50	1,515,822.00
SAIPEM	30,315	29.58	896,717.70
TECHNIP S.A.	11,449	86.86	994,460.14
TENARIS S.A.	54,774	15.57	852,831.18
TOTAL SA	240,827	39.20	9,440,418.40
AIR LIQUIDE	35,349	94.23	3,330,936.27

AKZO NOBEL	27,445	49.40	1,355,783.00
ARCELOR MITTAL	104,811	13.08	1,370,927.88
ARKEMA	6,980	82.40	575,152.00
BASF SE	104,059	73.09	7,605,672.31
CRH PLC	83,080	15.04	1,249,523.20
HEIDELBERGCEMENT AG	15,285	46.24	706,778.40
IMERYS SA	3,513	48.46	170,239.98
K+S AG	20,020	35.93	719,318.60
KONINKLIJKE DSM NV	17,581	46.29	813,824.49
LAFARGE SA	21,761	48.07	1,046,160.07
LANXESS	9,600	67.48	647,808.00
LINDE AG	20,894	133.90	2,797,706.60
SALZGITTER AG	4,539	40.34	183,103.26
SOLVAY SA	6,885	108.90	749,776.50
STORA ENSO OYJ-R SHS	59,712	5.30	316,772.16
THYSSENKRUPP AG	43,526	18.57	808,277.82
UMICORE	12,200	42.50	518,561.00
UPM-KYMMENE OYJ	61,116	8.98	549,127.26
VOESTALPINE AG	12,423	27.44	340,887.12
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	15,235	19.22	292,816.70
ALSTOM RGPT	23,513	30.95	727,844.91
ANDRITZ AG	8,500	49.45	420,367.50
BOSKALIS WESTMINSTER NV	8,900	33.91	301,843.50
BOUYGUES SA	20,431	22.12	451,933.72
BRENNTAG AG	5,620	99.58	559,639.60
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	45,124	32.28	1,456,828.34
EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	45,778	30.00	1,373,340.00
FINMECCANICA SPA	46,589	4.29	199,866.81
GEA GROUP AG	20,800	24.60	511,680.00
HOCHTIEF AG	3,937	44.60	175,590.20
KONE OYJ-B	17,855	56.90	1,015,949.50
LEGRAND SA	26,629	32.00	852,128.00
MAN SE	4,788	82.36	394,339.68
METSO OYJ	13,735	32.04	440,069.40
PHILIPS ELECTRONICS NV	117,141	20.05	2,348,677.05
PRYSMIAN SPA	22,100	14.68	324,428.00
REXEL SA	12,000	15.60	187,260.00
SAFRAN SA	26,819	32.64	875,372.16
SCHNEIDER ELECTRIC SA	59,582	56.02	3,337,783.64
SIEMENS AG-REG	93,071	82.99	7,723,962.29
THALES SA	10,375	27.29	283,185.62
VALLOUREC	11,647	40.95	477,002.88
VINCI S.A.	51,981	36.12	1,877,553.72
WARTSILA OYJ-B SHARES	18,702	32.93	615,856.86
WENDEL	3,900	75.16	293,124.00
ZARDOYA OTIS SA	15,500	11.11	172,205.00
ZODIAC AEROSPACE	4,000	85.15	340,600.00
BIC	3,350	92.44	309,674.00

BUREAU VERITAS SA	5,950	85.05	506,047.50
EDENRED	19,167	23.19	444,578.56
RANDSTAD HOLDING NV	14,498	27.32	396,085.36
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	40,610	12.50	507,625.00
AEROPORTS DE PARIS (ADP)	3,700	62.32	230,584.00
ATLANTIA SPA	36,810	13.68	503,560.80
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	26,979	14.43	389,441.86
DEUTSCHE POST AG-REG	102,284	16.58	1,696,380.14
FERROVIAL SA	47,668	11.16	531,974.88
FRAPORT AG	4,030	44.36	178,790.95
GROUPE EUROTUNNEL SA	66,800	5.74	383,498.80
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP	116,344	2.35	273,408.40
RYANAIR HOLDINGS PLC	1,656	4.77	7,905.74
TNT EXPRESS NV	39,093	8.30	324,510.99
VOPAK	7,700	53.60	412,720.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	38,027	72.02	2,738,704.54
BAYERISCHE MOTOREN WERKE(BMW)AG-PFD	5,340	48.43	258,642.90
CONTINENTAL AG	12,478	84.93	1,059,756.54
DAIMLER AG	102,653	41.24	4,233,409.72
FIAT INDUSTRIAL SPA	99,404	8.33	828,532.34
FIAT SPA	105,416	3.80	401,213.29
MICHELIN (CGDE)-B	20,955	71.16	1,491,157.80
NOKIAN RENKAAT OYJ	13,483	30.50	411,231.50
PIRELLI & C.	26,502	8.75	232,025.01
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PREF	17,465	56.93	994,282.45
PSA PEUGEOT CITROEN	28,455	5.59	159,177.27
RENAULT SA	21,905	41.62	911,795.62
VOLKSWAGEN AG	3,397	159.80	542,840.60
VOLKSWAGEN AG PFD	16,290	171.15	2,788,033.50
ADIDAS AG	23,299	67.58	1,574,546.42
CHRISTIAN DIOR SA	6,130	129.80	795,674.00
HUGO BOSS AG	3,050	81.68	249,124.00
LUXOTTICA GROUP SPA	18,330	31.67	580,511.10
LVMH MOET HENNESSY LOUI V SA	28,758	139.30	4,005,989.40
ACCOR SA	16,467	26.49	436,293.16
OPAP SA	23,406	5.60	131,073.60
SODEXO	10,806	64.49	696,878.94
AXEL SPRINGER AG	4,100	32.70	134,070.00
EUTELSAT COMMUNICATIONS	14,100	25.18	355,038.00
JC DECAUX S.A.	7,300	18.51	135,123.00
KABEL DEUTSCHLAND HOLDINGS AG	10,200	56.54	576,708.00
LAGARDERE S.C.A.	14,271	25.26	360,556.81
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-PFD	10,000	22.53	225,350.00
PUBLICIS GROUPE	19,700	45.79	902,063.00
REED ELSEVIER NV	78,046	11.14	869,822.67
SES	34,296	21.83	748,681.68
WOLTERS KLUWER-CVA	32,815	15.32	502,725.80
INDITEX	24,663	108.45	2,674,702.35

PPR	8,439	142.70	1,204,245.30
CARREFOUR SA	68,333	19.41	1,326,343.53
CASINO GUICHARD PERRACHON	6,060	73.46	445,167.60
COLRUYT NV	8,445	38.21	322,725.67
DELHAIZE GROUP	11,098	30.49	338,433.51
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	71,633	4.90	351,001.70
JERONIMO MARTINS SGPS S.A.	26,900	14.90	400,810.00
KESKO OYJ-B SHS	6,334	24.84	157,336.56
KONINKLIJKE AHOLD NV	116,433	10.28	1,197,513.40
METRO AG	13,448	21.71	291,956.08
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	90,844	67.04	6,090,181.76
COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	22,829	16.85	384,668.65
DANONE	65,575	49.57	3,250,552.75
DE MASTER BLENDERS 1753 NV-W/I	68,532	8.81	603,766.92
HEINEKEN HOLDING NV	10,689	41.73	446,105.41
HEINEKEN NV	26,380	49.95	1,317,812.90
KERRY GROUP PLC-A	16,698	40.72	679,942.56
PERNOD-RICARD SA	24,134	87.75	2,117,758.50
REMY COINTREAU	2,500	84.55	211,375.00
SUEDZUCKER AG	9,000	30.79	277,110.00
UNILEVER NV-CVA	184,134	29.26	5,387,760.84
BEIERSDORF AG	11,490	61.60	707,784.00
HENKEL AG & CO KGAA	15,270	52.30	798,621.00
HENKEL AG & CO KGAA	20,103	63.08	1,268,097.24
L'OREAL	27,254	104.95	2,860,307.30
CELESIO AG	8,204	12.90	105,831.60
ESSILOR INTERNATIONAL	22,803	76.34	1,740,781.02
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO. KGAA	23,880	52.13	1,244,864.40
FRESENIUS SE & CO KGAA	13,910	88.73	1,234,234.30
BAYER AG	93,517	71.43	6,679,919.31
ELAN CORPORATION PLC	60,166	8.05	484,336.30
GRIFOLS S.A.	16,750	24.35	407,862.50
MERCK KGAA	7,519	99.43	747,614.17
ORION OYJ	10,798	22.52	243,170.96
QIAGEN N.V.	27,800	14.06	391,007.00
SANOFI	135,050	71.14	9,607,457.00
UCB SA	11,797	44.21	521,604.35
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	803,414	0.22	178,920.29
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	631,615	6.99	4,418,146.92
BANCO DE SABADELL SA	362,836	2.21	805,133.08
BANCO ESPIRITO SANTO,S.A(BES)	232,900	0.91	211,939.00
BANCO POPOLARE SPA	173,182	1.25	216,823.86
BANCO POPULAR ESPANOL	610,047	0.61	373,958.81
BANCO SANTANDER SA	1,184,113	6.01	7,116,519.13
BNP PARIBAS	113,522	44.56	5,058,540.32
COMMERZBANK AG	412,990	1.50	621,962.94
CREDIT AGRICOLE SA	117,158	6.17	723,919.28
ERSTE GROUP BANK AG	23,983	24.30	582,786.90

INTESA SANPAOLO	1,122,840	1.31	1,473,166.08
INTESA SANPAOLO-RSP	108,503	1.07	116,532.22
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	96,000	0.00	96.00
KBC GROUPE SA	20,101	26.09	524,535.59
NATIXIS	98,051	2.62	256,991.67
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	5,550	31.56	175,158.00
SOCIETE GENERALE	78,548	29.75	2,336,803.00
UNICREDIT SPA	451,112	3.80	1,716,030.04
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	102,494	3.53	362,213.79
AGEAS	26,800	22.25	596,300.00
DEUTSCHE BANK AG -REG	105,233	33.70	3,546,352.10
DEUTSCHE BOERSE AG	21,517	46.00	989,889.58
EURAZEO	3,748	36.44	136,577.12
EXOR SPA	7,897	19.10	150,832.70
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	9,295	60.40	561,418.00
ING GROEP NV-CVA	433,581	7.20	3,122,216.78
MEDIOBANCA SPA	62,143	4.53	282,004.93
POHJOLA BANK PLC	13,403	11.23	150,515.69
AEGON NV	193,288	4.82	931,648.16
ALLIANZ SE-REG	51,555	105.15	5,421,008.25
ASSICURAZIONI GENERALI	133,173	13.53	1,801,830.69
AXA SA	199,673	13.13	2,621,706.49
CNP ASSURANCES	19,484	11.79	229,813.78
DELTA LLOYD NV	16,900	12.45	210,405.00
HANNOVER RUECKVERSICHERUNGS AG	7,300	59.81	436,613.00
MAPFRE SA	93,649	2.40	224,944.89
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	20,321	136.40	2,771,784.40
SAMPO OYJ-A SHS	46,754	24.41	1,141,265.14
SCOR SE	18,658	20.52	382,955.45
VIENNA INSURANCE GROUP AG WIENER VERSICH	4,800	39.52	189,696.00
IMMOFINANZ AG	107,200	3.41	366,195.20
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	34,650	19.01	658,696.50
ATOS	5,851	53.40	312,443.40
CAP GEMINI SA	16,904	34.48	582,849.92
DASSAULT SYSTEMES SA	7,283	85.42	622,113.86
SAP AG	104,133	61.02	6,354,195.66
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	12,300	16.37	201,351.00
GEMALTO	8,640	70.75	611,280.00
NOKIA OYJ	428,780	3.16	1,355,802.36
BELGACOM SA	17,881	22.41	400,802.61
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	317,860	8.58	2,727,556.66
ELISA OYJ	17,422	16.74	291,644.28
FRANCE TELECOM SA	208,001	8.28	1,723,496.28
ILIAD SA	2,490	134.95	336,025.50
KONINKLIJKE KPN NV	107,258	3.71	398,785.24
PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	75,052	3.85	289,250.40
TELECOM ITALIA SPA	1,030,901	0.69	718,022.54
TELECOM ITALIA-RNC	712,811	0.61	438,378.76



TELEFONICA S.A.	463,594	10.21	4,733,294.74	
TELEKOM AUSTRIA AG	25,354	5.71	144,948.81	
TELENET GROUP HOLDINGS NV	6,800	35.55	241,740.00	
VIVENDI SA	149,180	16.91	2,523,379.70	
ZIGGO NV	14,200	24.91	353,722.00	
ACCIONA S.A.	3,130	58.99	184,638.70	
E.ON SE	203,415	14.27	2,903,749.12	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	212,624	2.28	486,696.33	
ELECTRICITE DE FRANCE(EDF)	26,549	14.16	375,933.84	
ENAGAS	21,200	16.45	348,740.00	
ENEL GREEN POWER SPA	213,000	1.40	299,691.00	
ENEL SPA	740,395	3.12	2,314,474.77	
FORTUM OYJ	51,411	14.37	738,776.07	
GAS NATURAL SDG SA	40,746	13.66	556,794.09	
GDF SUEZ	144,098	15.44	2,225,593.61	
IBERDROLA SA	451,778	4.08	1,845,513.13	
RED ELECTRICA CORPORATION S.A.	11,800	37.52	442,736.00	
RWE AG	55,030	31.72	1,745,551.60	
RWE AG-NON VTG PFD	4,413	29.27	129,168.51	
SNAM SPA	197,376	3.46	684,499.96	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	33,900	9.19	311,710.50	
TERNA SPA	138,846	3.00	417,093.38	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	38,530	9.22	355,246.60	
VERBUND AG	7,470	18.65	139,315.50	
ASML HOLDING NV	35,285	48.58	1,714,321.72	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	122,949	6.26	770,152.53	
STMICROELECTRONICS NV	76,101	5.36	407,901.36	
ユーロ小計	19,962,258		269,515,082.90	
(邦貨換算額：円)			(30,010,504,480)	
合計	134,664,486		219,775,852,151	
(外貨建有価証券邦貨換算額合計：円)			(219,775,852,151)	

(注) 金額欄の( )内は、外貨建有価証券にかかるもので、内書きであります。

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	576銘柄	54.7%	57.2%
カナダドル	株式	96銘柄	5.2%	5.4%
オーストラリアドル	株式	55銘柄	3.7%	3.8%
英ポンド	株式	102銘柄	10.2%	10.7%
スイスフラン	株式	39銘柄	4.0%	4.2%
香港ドル	株式	39銘柄	1.4%	1.4%
シンガポールドル	株式	27銘柄	0.8%	0.8%
ニュージーランドドル	株式	5銘柄	0.1%	0.1%
スウェーデンクローナ	株式	32銘柄	1.4%	1.5%
ノルウェークローネ	株式	10銘柄	0.4%	0.4%
デンマーククローネ	株式	12銘柄	0.5%	0.5%
イスラエルシェケル	株式	10銘柄	0.3%	0.3%
ユーロ	株式	231銘柄	13.1%	13.7%

## (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	39,137	1,236,729.20	
		AMERICAN TOWER CORP	44,566	3,392,809.58	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	110,098	1,606,329.82	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	12,739	1,699,382.60	
		BOSTON PROPERTIES INC	17,466	1,837,423.20	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	9,000	598,320.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	13,700	927,764.00	
		DUKE REALTY CORP	31,773	440,056.05	
		EQUITY RESIDENTIAL	36,355	2,013,703.45	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	7,154	745,518.34	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	46,420	914,474.00	
		HCP, INC.	51,053	2,272,369.03	
		HEALTH CARE REIT INC	28,413	1,680,913.08	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	82,738	1,287,403.28	
		HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	592,000	458,800.00	
		KIMCO REALTY CORPORATION	46,232	895,051.52	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	12,565	444,047.10	
		MACERICH COMPANY/THE	15,039	868,201.47	
		PLUM CREEK TIMBER COMPANY	18,243	806,887.89	
		PROLOGIS INC	51,068	1,820,063.52	
		PUBLIC STORAGE	16,288	2,344,006.08	
		RAYONIER INC	14,100	715,716.00	
		REALTY INCOME CORPORATION	15,000	609,150.00	
		REGENCY CENTERS CORP	9,800	454,916.00	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	34,300	5,364,177.00	
		SL GREEN REALTY CORP	10,500	806,085.00	
	UDR INC	29,700	687,258.00		
	VENTAS INC	32,920	2,096,674.80		
	VORNADO REALTY TRUST	19,443	1,542,413.19		
		米ドル小計 (邦貨換算額：円)	1,447,810	40,566,643.20 (3,417,334,023)	
	カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	9,500	229,900.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	18,000	491,760.00	
		カナダドル小計 (邦貨換算額：円)	27,500	721,660.00 (61,470,998)	
オーストラリアドル	APA GROUP	91,000	523,250.00		
	CENTRO RETAIL AUSTRALIA	140,000	317,800.00		
	CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP	213,612	415,475.34		
	DEXUS PROPERTY GROUP	547,804	553,282.04		

	GOODMAN GROUP	191,000	830,850.00	
	GPT GROUP	161,994	581,558.46	
	LEND LEASE GROUP	57,572	525,056.64	
	MIRVAC GROUP	386,710	572,330.80	
	SP AUSNET	217,000	241,955.00	
	STOCKLAND	257,614	906,801.28	
	SYDNEY AIRPORT	12,800	44,672.00	
	TRANSURBAN GROUP	148,832	927,223.36	
	WESTFIELD GROUP	240,227	2,529,590.31	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	318,993	956,979.00	
	オーストラリアドル小計 (邦貨換算額：円)	2,985,158	9,926,824.23 (875,843,701)	
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	97,605	553,908.37	
	CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP PLC	64,855	234,126.55	
	HAMMERSON PLC	84,997	418,100.24	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	88,127	721,760.13	
	SEGRO PLC	86,434	211,936.16	
	英ポンド小計 (邦貨換算額：円)	422,018	2,139,831.45 (292,964,323)	
香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	250,000	1,872,500.00	
	LINK REIT	257,500	10,016,750.00	
	香港ドル小計 (邦貨換算額：円)	507,500	11,889,250.00 (129,236,147)	
シンガポール ドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	223,000	532,970.00	
	CAPITACOMMERCIAL TRUST	220,000	358,600.00	
	CAPITAMALL TRUST	280,000	585,200.00	
	シンガポールドル小計 (邦貨換算額：円)	723,000	1,476,770.00 (101,956,200)	
ユーロ	CORIO NV	6,966	240,327.00	
	FONCIERE DES REGIONS	3,150	199,993.50	
	GECINA SA	2,280	200,617.20	
	ICADE	2,770	189,717.30	
	KLEPIERRE	10,332	309,340.08	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	10,489	1,914,766.95	
	ユーロ小計 (邦貨換算額：円)	35,987	3,054,762.03 (340,147,752)	
	投資証券合計		5,218,953,144 (5,218,953,144)	
	合計		5,218,953,144	
	(外貨建有価証券邦貨換算額合計：円)		(5,218,953,144)	

(注) 金額欄の( )内は、外貨建有価証券にかかるもので、内書きであります。

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	29銘柄	1.5%	65.5%
カナダドル	投資証券	2銘柄	0.0%	1.2%
オーストラリアドル	投資証券	14銘柄	0.4%	16.8%

英ポンド	投資証券	5銘柄	0.1%	5.6%
香港ドル	投資証券	2銘柄	0.1%	2.5%
シンガポールドル	投資証券	3銘柄	0.0%	2.0%
ユーロ	投資証券	6銘柄	0.1%	6.5%

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

「(デリバティブ取引に関する注記)」に同様の内容が記載されているため、省略しております。

## 「S M A M ・年金外国債券パッシブ・ファンド&lt;適格機関投資家限定&gt;」の状況

## ( 1 ) 貸借対照表

( 単位：円 )

( 平成24年12月20日現在 )

資産の部		
流動資産		
コール・ローン		57
親投資信託受益証券		3,543,825,815
流動資産合計		3,543,825,872
資産合計		3,543,825,872
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		12,173
未払委託者報酬		6,085
流動負債合計		18,258
負債合計		18,258
純資産の部		
元本等		
元本		2,817,061,104
剰余金		
剰余金又は欠損金 ( )		726,746,510
元本等合計		3,543,807,614
純資産合計		3,543,807,614
負債純資産合計		3,543,825,872

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針の注記 )

項目	自 平成24年12月18日 至 平成24年12月20日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

## ( 追加情報 )

自 平成24年12月18日 至 平成24年12月20日
当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」(企業会計基準第24号 平成21年12月4日)および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日)を適用しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項 目	(平成24年12月20日現在)
1. 受益権総数	平成24年12月20日における受益権の総数 2,817,061,104口
2. 1単位当たり純資産額	1.2580円 (1万口 = 12,580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24年12月18日 至 平成24年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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24年12月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（デリバティブ取引に関する注記）

（平成24年12月20日現在）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

（自 平成24年12月18日 至 平成24年12月20日）  
該当事項はありません。

（その他の注記）

（平成24年12月20日現在）	
期首（平成24年12月18日）における元本額	2,806,676,058円
期首より平成24年12月20日現在までの追加設定元本額	10,385,046円
期首より平成24年12月20日現在までの一部解約元本額	円

（3）附属明細表  
有価証券明細表

(a) 株式  
該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託 受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	2,801,221,892	3,543,825,815	
	親投資信託受益証券 小計	2,801,221,892	3,543,825,815	
合計		2,801,221,892	3,543,825,815	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
該当事項はありません。

（参考情報）

S M A M ・年金外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞は、「外国債券パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。  
なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

「外国債券パッシブ・マザーファンド」の状況

（1）貸借対照表

（単位：円）

（平成24年12月20日現在）

資産の部

流動資産

コール・ローン	5,214,510,882
国債証券	251,392,427,395
派生商品評価勘定	2,515,558
未収入金	5,657,771,911
未収利息	2,714,413,957



前払費用	97,812,489
流動資産合計	265,079,452,192
資産合計	265,079,452,192
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	179,852
未払金	4,075,912,963
未払解約金	4,302,191,955
流動負債合計	8,378,284,770
負債合計	8,378,284,770
純資産の部	
元本等	
元本	202,902,176,536
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	53,798,990,886
元本等合計	256,701,167,422
純資産合計	256,701,167,422
負債純資産合計	265,079,452,192

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針の注記 )

項目	自 平成24年12月18日 至 平成24年12月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 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>

## ( 追加情報 )

自 平成24年12月18日 至 平成24年12月20日
--------------------------------

当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」(企業会計基準第24号 平成21年12月4日)および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日)を適用しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(平成24年12月20日現在)
1. 受益権総数	平成24年12月20日における受益権の総数 202,902,176,536口
2. 1単位当たり純資産額	1.2651円 (1万口 = 12,651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24年12月18日 至 平成24年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(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。

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24年12月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
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24年12月20日現在)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引  
通貨関連

(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			
	米ドル	367,376,109	366,743,897	632,212
	オーストラリアドル	91,224,390	90,644,050	580,340
	シンガポールドル	74,804,397	74,618,014	186,383
	スウェーデンクローナ	48,745,983	48,925,835	179,852
	ユーロ	416,363,145	415,246,522	1,116,623
	小計	998,514,024	996,178,318	2,335,706
合計	998,514,024	996,178,318	2,335,706	

## (注) 時価の算定方法

## 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います。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

(自 平成24年12月18日 至 平成24年12月20日)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

(平成24年12月20日現在)

期首（平成24年12月18日）における元本額	206,468,017,883円
期首より平成24年12月20日現在までの追加設定元本額	20,531,831円
期首より平成24年12月20日現在までの一部解約元本額	3,586,373,178円
平成24年12月20日現在の元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	3,312,760,489円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	223,533,172円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	620,728,694円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	291,815,013円
スミセイ・DCバランスファンド（機動的資産配分型）	31,061,282円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	4,565,494円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	6,517,761円

スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	4,854,782円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	5,032,581円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	1,335,598円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	2,633,496円
SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	2,801,221,892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>	10,788,632,751円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	34,877,156,236円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	10,422,163,011円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	22,291,139,503円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	78,262,726円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	163,845,262円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	38,113,032円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	1,253,802,578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>	173,980,773円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	2,041,978,727円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,648,562,425円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	6,573,663,440円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	13,503,349,856円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,155,350,823円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	22,916,432,905円
三井住友・外国債券インデックスファンド・VAS (適格機関投資家専用)	1,969,080,471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)	9,307,007,622円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	373,724,432円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	10,116,036,267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)	38,963,735,949円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A <適格機関投資家専用>	270,481,336円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A <適格機関投資家専用>	82,483,500円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A <適格機関投資家専用>	21,560,281円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L <適格機関投資家専用>	337,677,052円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L <適格機関投資家専用>	1,210,703,031円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T <適格機関投資家専用>	364,826,642円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2 <適格機関投資家専用>	319,677,891円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2 <適格機関投資家専用>	85,715,892円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2 <適格機関投資家専用>	11,960,165円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2 <適格機関投資家専用>	2,972,299,675円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2 <適格機関投資家専用>	83,052,494円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定>	112,804,495円

S M A M ・ F G グローバルバランス25V A < 適格機関投資家限定 >  
合 計

66,855,039円

202,902,176,536円

( 3 ) 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 T 0.25% 13/11/30	3,000,000	3,001,875.00	
		US T 0.25% 14/05/31	6,000,000	6,000,000.00	
		US T 0.25% 14/09/15	6,000,000	5,999,062.50	
		US T 0.25% 14/12/15	7,000,000	6,996,171.91	
		US T 0.25% 140228	5,000,000	5,002,343.75	
		US T 0.25% 140331	4,000,000	4,001,562.52	
		US T 0.25% 15/01/15	13,000,000	12,988,828.19	
		US T 0.25% 15/05/15	13,000,000	12,973,593.75	
		US T 0.25% 150215	7,000,000	6,992,890.66	
		US T 0.375 2015/06/15	8,000,000	8,005,625.04	
		US T 0.375% 14/11/15	9,000,000	9,016,875.00	
		US T 0.375% 15/03/15	4,000,000	4,006,250.00	
		US T 0.375% 150415	17,000,000	17,019,257.77	
		US T 0.5% 13/11/15	6,000,000	6,017,343.78	
		US T 0.5% 14/08/15	8,000,000	8,031,875.04	
		US T 0.5% 14/10/15	10,000,000	10,041,406.30	
		US T 0.625% 140715	7,000,000	7,040,195.33	
		US T 0.625% 17/05/31	5,000,000	4,994,531.25	
		US T 0.75% 13/12/15	7,000,000	7,038,828.16	
		US T 0.75% 140615	9,000,000	9,068,203.17	
		US T 0.875% 16/11/30	6,000,000	6,075,000.00	
		US T 0.875% 16/12/31	11,000,000	11,130,625.00	
		US T 0.875% 170131	10,000,000	10,115,625.00	
		US T 0.875% 170228	3,000,000	3,033,515.64	
		US T 1 14/01/15	3,000,000	3,025,781.25	
		US T 1% 14/05/15	11,000,000	11,116,875.00	
		US T 1% 16/08/31	8,000,000	8,141,250.00	
		US T 1% 16/09/30	5,000,000	5,087,500.00	
		US T 1% 16/10/31	4,000,000	4,070,312.52	
		US T 1% 170331	10,000,000	10,159,375.00	
		US T 1.125 2019/05/31	3,000,000	3,005,390.64	
		US T 1.25% 14/02/15	4,000,000	4,047,500.00	
		US T 1.25% 14/03/15	6,000,000	6,075,937.50	
		US T 1.25% 14/04/15	5,000,000	5,066,796.90	
US T 1.25% 15/08/31	8,000,000	8,190,625.04			
US T 1.25% 15/09/30	7,000,000	7,170,625.00			

US T 1.25% 15/10/31	5,000,000	5,123,437.50	
US T 1.25% 19/04/30	5,000,000	5,054,296.90	
US T 1.375% 15/11/30	5,000,000	5,143,359.40	
US T 1.375% 18/09/30	7,500,000	7,682,812.50	
US T 1.375% 18/11/30	5,000,000	5,116,015.65	
US T 1.375% 190228	8,000,000	8,165,625.04	
US T 1.5% 13/12/31	7,000,000	7,094,062.50	
US T 1.5% 16/07/31	8,000,000	8,285,625.04	
US T 1.5% 160630	7,000,000	7,248,281.25	
US T 1.5% 18/08/31	2,000,000	2,063,906.26	
US T 1.625 2022/08/15	8,000,000	7,906,875.04	
US T 1.75% 14/01/31	6,500,000	6,611,718.75	
US T 1.75% 14/03/31	8,000,000	8,155,000.00	
US T 1.75% 15/7/31	5,000,000	5,181,250.00	
US T 1.75% 160531	3,000,000	3,131,484.39	
US T 1.75% 18/10/31	3,000,000	3,135,937.50	
US T 1.75% 22/05/15	6,000,000	6,022,500.00	
US T 1.875% 14/02/28	6,000,000	6,118,593.78	
US T 1.875% 14/04/30	8,000,000	8,178,125.04	
US T 1.875% 17/08/31	3,000,000	3,162,187.50	
US T 1.875% 17/09/30	10,000,000	10,540,625.00	
US T 1.875% 17/10/31	6,000,000	6,326,250.00	
US T 1.875% 2015/06/30	7,000,000	7,271,796.91	
US T 11.25% 15/02/15	2,000,000	2,469,531.26	
US T 2% 13/11/30	7,000,000	7,119,765.66	
US T 2% 16/01/31	7,000,000	7,343,437.50	
US T 2% 21/11/15	3,000,000	3,099,140.64	
US T 2% 220215	6,600,000	6,794,390.65	
US T 2.125 15/12/31	3,000,000	3,155,625.00	
US T 2.125% 14/11/30	10,500,000	10,874,882.86	
US T 2.125% 16/02/29	3,000,000	3,162,656.25	
US T 2.125% 2015/05/31	8,000,000	8,346,250.00	
US T 2.125% 21/08/15	11,000,000	11,513,906.25	
US T 2.25% 14/05/31	7,000,000	7,201,796.91	
US T 2.25% 15/01/31	10,000,000	10,410,937.50	
US T 2.25% 17/11/30	4,000,000	4,290,625.00	
US T 2.25% 18/07/31	2,000,000	2,148,281.26	
US T 2.375% 14/08/31	8,000,000	8,285,000.00	
US T 2.375% 14/09/30	10,000,000	10,372,656.30	
US T 2.375% 14/10/31	8,000,000	8,311,250.00	
US T 2.375% 15/02/28	9,000,000	9,406,406.25	
US T 2.375% 16/03/31	5,500,000	5,845,039.09	
US T 2.375% 17/7/31	5,000,000	5,383,203.15	
US T 2.375% 180630	2,000,000	2,162,031.26	
US T 2.5% 15/03/31	9,000,000	9,450,703.17	
US T 2.5% 15/04/30	10,000,000	10,509,375.00	
US T 2.50% 2017/06/30	5,000,000	5,408,203.15	
US T 2.625% 14/06/30	9,000,000	9,324,843.75	

US T 2.625% 14/07/31	6,000,000	6,228,281.28	
US T 2.625% 16/02/29	5,000,000	5,349,218.75	
US T 2.625% 16/04/30	5,000,000	5,360,546.90	
US T 2.625% 18/01/31	4,000,000	4,370,937.52	
US T 2.625% 18/04/30	4,000,000	4,376,250.00	
US T 2.625% 20/11/15	13,500,000	14,747,695.38	
US T 2.625% 20/8/15	11,000,000	12,032,109.43	
US T 2.625% 2014/12/31	8,000,000	8,381,250.00	
US T 2.75 17/12/31	4,000,000	4,393,125.00	
US T 2.75 2042/08/15	2,000,000	1,911,093.76	
US T 2.75% 16/11/30	6,000,000	6,510,468.78	
US T 2.75% 19/02/15	9,000,000	9,933,750.00	
US T 2.75% 2017/05/31	7,000,000	7,643,671.91	
US T 2.875% 18/03/31	4,000,000	4,425,000.00	
US T 3% 16/08/31	7,000,000	7,633,281.25	
US T 3% 16/09/30	5,000,000	5,460,156.25	
US T 3% 17/02/28	7,000,000	7,692,343.75	
US T 3% 42/05/15	2,000,000	2,017,031.26	
US T 3.125% 16/10/31	6,000,000	6,587,812.50	
US T 3.125% 17/01/31	7,000,000	7,720,781.25	
US T 3.125% 17/04/30	7,000,000	7,748,125.00	
US T 3.125% 19/05/15	10,000,000	11,286,718.80	
US T 3.125% 21/05/15	11,000,000	12,421,406.25	
US T 3.125% 41/11/15	2,000,000	2,072,812.50	
US T 3.125% 420215	3,000,000	3,105,937.50	
US T 3.25% 16/05/31	4,000,000	4,379,687.52	
US T 3.25% 16/06/30	6,000,000	6,578,906.28	
US T 3.25% 16/07/31	5,000,000	5,493,750.00	
US T 3.25% 17/03/31	4,000,000	4,443,750.00	
US T 3.25% 2016/12/31	6,000,000	6,639,843.78	
US T 3.375% 19/11/15	9,000,000	10,308,515.67	
US T 3.5% 18/02/15	8,500,000	9,664,765.62	
US T 3.5% 20/05/15	10,500,000	12,146,367.24	
US T 3.5% 39/02/15	4,000,000	4,482,500.00	
US T 3.625% 19/08/15	9,000,000	10,447,031.25	
US T 3.625% 20/02/15	13,000,000	15,136,875.00	
US T 3.625% 21/02/15	13,000,000	15,195,781.25	
US T 3.75% 18/11/15	7,000,000	8,130,937.50	
US T 3.75% 41/08/15	5,000,000	5,822,265.65	
US T 3.875% 18/05/15	6,000,000	6,960,000.00	
US T 3.875% 40/8/15	7,000,000	8,338,203.16	
US T 4% 14/02/15	6,500,000	6,783,867.22	
US T 4% 18/08/15	3,500,000	4,102,656.25	
US T 4% 2015/02/15	7,700,000	8,311,789.10	
US T 4.125 15/05/15	4,200,000	4,579,640.64	
US T 4.25% 13/11/15	6,900,000	7,153,359.37	
US T 4.25% 14/08/15	5,400,000	5,753,531.25	
US T 4.25% 14/11/15	6,100,000	6,558,929.71	



US T 4.25% 17/11/15	5,000,000	5,846,484.40	
US T 4.25% 39/05/15	6,000,000	7,590,468.78	
US T 4.25% 40/11/15	11,000,000	13,919,296.93	
US T 4.375% 38/02/15	4,200,000	5,402,906.25	
US T 4.375% 39/11/15	5,000,000	6,450,000.00	
US T 4.375% 40/05/15	10,000,000	12,901,562.50	
US T 4.375% 41/05/15	6,000,000	7,747,968.78	
US T 4.5 15/11/15	5,800,000	6,487,390.65	
US T 4.5% 160215	4,400,000	4,962,031.27	
US T 4.5% 17/05/15	3,000,000	3,501,796.89	
US T 4.5% 36/02/15	3,500,000	4,572,148.45	
US T 4.5% 38/05/15	3,000,000	3,930,000.00	
US T 4.5% 39/08/15	4,000,000	5,257,187.52	
US T 4.625% 16/11/15	5,200,000	6,013,718.77	
US T 4.625% 17/02/15	3,000,000	3,493,593.75	
US T 4.625% 40/02/15	7,000,000	9,376,718.75	
US T 4.75% 14/05/15	6,400,000	6,802,500.03	
US T 4.75% 17/08/15	3,000,000	3,558,515.64	
US T 4.75% 37/02/15	2,000,000	2,708,125.00	
US T 4.75% 41/02/15	11,000,000	15,027,890.68	
US T 4.875% 16/08/15	4,900,000	5,668,687.50	
US T 5% 37/05/15	2,000,000	2,800,781.26	
US T 5.125% 16/05/15	3,700,000	4,280,437.50	
US T 5.25% 28/11/15	2,000,000	2,748,593.76	
US T 5.25% 29/02/15	2,000,000	2,755,156.26	
US T 5.375% 31/02/15	3,020,000	4,284,153.12	
US T 5.5% 28/08/15	2,000,000	2,811,562.50	
US T 6% 26/02/15	1,000,000	1,440,156.25	
US T 6.125% 27/11/15	1,000,000	1,478,125.00	
US T 6.125% 29/08/15	1,100,000	1,657,820.31	
US T 6.25% 23/08/15	3,500,000	5,000,351.58	
US T 6.25% 30/05/15	1,000,000	1,537,812.50	
US T 6.5% 26/11/15	1,000,000	1,511,328.13	
US T 6.75% 26/08/15	1,000,000	1,538,046.88	
US T 6.875% 25/08/15	1,000,000	1,533,437.50	
US T 7.125% 23/02/15	1,400,000	2,103,609.38	
US T 7.25% 16/05/15	4,000,000	4,914,687.52	
US T 7.25% 22/08/15	2,500,000	3,751,562.50	
US T 7.5% 16/11/15	2,400,000	3,043,687.51	
US T 7.5% 24/11/15	1,000,000	1,586,484.38	
US T 7.875% 21/02/15	2,000,000	3,002,500.00	
US T 8% 21/11/15	2,800,000	4,312,218.76	
US T 8.125% 21/05/15	1,000,000	1,530,312.50	
US T 8.75% 17/05/15	3,000,000	4,058,671.89	
US T 8.75% 20/08/15	1,000,000	1,544,296.88	
US T 8.875% 17/08/15	2,000,000	2,751,406.26	
US T 8.875% 190215	2,100,000	3,092,742.19	
US TREASURY N/B 0.25	14,000,000	13,954,062.50	

	US TREASURY N/B 0.375	4,000,000	3,998,750.00	
	US TREASURY N/B 0.625	10,000,000	9,962,500.00	
	US TREASURY N/B 1	8,000,000	7,916,250.00	
	US TREASURY N/B 1.625	3,000,000	2,952,187.50	
	UST 0.25 2014/06/30	9,000,000	8,999,296.92	
	UST 0.25 2015/07/15	14,000,000	13,963,906.32	
	UST 0.25 2015/08/15	8,000,000	7,976,875.04	
	UST 0.5 2017/07/31	8,000,000	7,930,000.00	
	UST 0.75 2017/06/30	5,000,000	5,016,796.90	
	UST 1 2019/06/30	7,000,000	6,946,953.16	
	米ドル小計 (邦貨換算額：円)	1,128,320,000	1,223,588,429.10 (103,075,089,267)	
カナダドル	CAN 1.5 2015/08/01	1,000,000	1,006,900.00	
	CAN 1.5% 170301	2,000,000	2,010,040.00	
	CAN 1.5% 170901	1,000,000	1,004,600.00	
	CAN 2% 14/03/01	3,000,000	3,031,380.00	
	CAN 2% 14/12/01	4,000,000	4,065,360.00	
	CAN 2% 16/06/01	2,000,000	2,046,280.00	
	CAN 2.5% 13/09/01	2,000,000	2,019,720.00	
	CAN 2.5% 2015/06/01	2,000,000	2,063,920.00	
	CAN 2.75% 16/09/01	2,000,000	2,100,820.00	
	CAN 2.75% 22/06/01	2,000,000	2,155,400.00	
	CAN 3% 14/06/01	4,500,000	4,620,645.00	
	CAN 3% 15/12/01	3,000,000	3,151,230.00	
	CAN 3.25% 21/06/01	3,000,000	3,352,710.00	
	CAN 3.5% 13/06/01	4,500,000	4,548,960.00	
	CAN 3.5% 20/06/01	3,000,000	3,382,380.00	
	CAN 3.75% 19/06/01	4,000,000	4,527,200.00	
	CAN 4% 16/06/01	3,000,000	3,270,630.00	
	CAN 4% 17/06/01	2,000,000	2,224,560.00	
	CAN 4% 41/06/01	4,000,000	5,302,000.00	
	CAN 4.25% 18/06/01	2,500,000	2,863,000.00	
	CAN 4.5% 15/06/01	2,000,000	2,160,160.00	
	CAN 5% 14/06/01	2,500,000	2,638,500.00	
	CAN 5% 37/06/01	4,000,000	5,878,680.00	
	CAN 5.75% 29/06/01	2,800,000	4,139,436.00	
	CAN 5.75% 33/06/01	3,000,000	4,631,970.00	
	CAN 8% 23/06/01	400,000	629,696.00	
	CAN 8% 27/06/01	1,000,000	1,720,600.00	
	CAN 9% 25/06/01	980,000	1,727,220.60	
	カナダドル小計 (邦貨換算額：円)	71,180,000	82,273,997.60 (7,008,099,115)	
オーストラリアドル	ACGB 2.75 2024/04/21	1,000,000	930,280.00	
	ACGB 4.25% 170721	1,000,000	1,059,100.00	
	ACGB 4.5% 14/10/21	3,000,000	3,090,630.00	
	ACGB 4.5% 20/04/15	4,000,000	4,351,804.00	
	ACGB 4.75% 15/10/21	1,000,000	1,050,100.00	
	ACGB 4.75% 16/06/15	4,000,000	4,258,568.00	

	ACGB 4.75% 27/04/21	1,200,000	1,334,160.00	
	ACGB 5.25% 19/03/15	5,000,000	5,624,065.00	
	ACGB 5.5% 13/12/15	1,000,000	1,026,570.00	
	ACGB 5.5% 18/01/21	2,000,000	2,240,000.00	
	ACGB 5.5% 23/04/21	2,000,000	2,363,600.00	
	ACGB 5.75% 21/05/15	5,000,000	5,915,000.00	
	ACGB 5.75% 22/07/15	2,000,000	2,393,000.00	
	ACGB 6% 17/02/15	3,300,000	3,711,345.00	
	ACGB 6.25% 14/06/15	3,000,000	3,154,167.00	
	ACGB 6.25% 15/04/15	3,000,000	3,231,150.00	
	オーストラリアドル小計 (邦貨換算額:円)	41,500,000	45,733,539.00 (4,035,070,145)	
英ポンド	UKT 1% 17/09/07	1,700,000	1,705,423.00	
	UKT 1.75 2022/09/07	2,000,000	1,963,300.00	
	UKT 1.75% 17/01/22	3,000,000	3,117,900.00	
	UKT 2% 16/01/22	7,000,000	7,304,360.00	
	UKT 2.25% 14/03/07	5,000,000	5,112,800.00	
	UKT 2.75% 15/01/22	5,000,000	5,233,500.00	
	UKT 3.75% 19/09/07	4,300,000	4,966,801.00	
	UKT 3.75% 20/09/07	5,000,000	5,793,500.00	
	UKT 3.75% 21/09/07	5,000,000	5,800,000.00	
	UKT 3.75% 520722	2,300,000	2,494,580.00	
	UKT 4% 16/09/07	4,800,000	5,391,696.00	
	UKT 4% 22/03/07	2,000,000	2,368,400.00	
	UKT 4% 60/01/22	2,000,000	2,323,000.00	
	UKT 4.25% 27/12/07	2,300,000	2,806,460.00	
	UKT 4.25% 32/06/07	2,800,000	3,392,872.00	
	UKT 4.25% 36/03/07	3,800,000	4,568,778.00	
	UKT 4.25% 39/09/07	2,500,000	2,983,825.00	
	UKT 4.25% 40/12/07	3,500,000	4,171,440.00	
	UKT 4.25% 46/12/07	3,900,000	4,649,229.00	
	UKT 4.25% 49/12/07	3,500,000	4,182,570.00	
	UKT 4.25% 55/12/07	3,900,000	4,709,835.00	
	UKT 4.5% 19/03/07	4,200,000	5,023,074.00	
	UKT 4.5% 34/09/07	4,000,000	4,960,000.00	
	UKT 4.5% 42/12/07	4,000,000	4,976,800.00	
	UKT 4.75% 15/09/07	4,400,000	4,908,728.00	
	UKT 4.75% 20/03/07	4,200,000	5,145,420.00	
	UKT 4.75% 30/12/07	3,800,000	4,897,630.00	
	UKT 4.75% 38/12/07	3,500,000	4,517,730.00	
	UKT 5% 14/09/07	5,500,000	5,931,200.00	
	UKT 5% 18/03/07	3,500,000	4,200,560.00	
	UKT 5% 25/03/07	3,600,000	4,672,080.00	
	UKT 6.0% 281207	2,000,000	2,916,700.00	
	UKT 8% 15/12/07	1,900,000	2,321,420.00	
	UKT 8% 21/06/07	2,620,000	3,944,383.80	
	UKT 8.75% 17/08/25	1,300,000	1,768,845.00	
	英ポンド小計	123,820,000	145,224,839.80	

	(邦貨換算額：円)		(19,882,732,817)
スイスフラン	SWITZERLAND 2.25% 200706	500,000	574,150.00
	SWITZERLAND 2.5% 160312	2,000,000	2,170,000.00
	SWITZERLAND 3% 180108	1,000,000	1,148,500.00
	SWITZERLAND 3% 19/05/12	1,500,000	1,768,050.00
	SWITZERLAND 4% 280408	900,000	1,302,750.00
	SWITZERLAND 4%230211	2,000,000	2,680,400.00
	SWITZERLAND 4.25% 140106	800,000	837,280.00
	SWITZERLAND 4.25% 170605	1,000,000	1,188,600.00
スイスフラン小計 (邦貨換算額：円)		9,700,000	11,669,730.00 (1,075,949,106)
シンガポールドル	SIGB 2.25% 21/06/01	500,000	540,954.00
	SIGB 2.875% 30/09/01	1,000,000	1,116,249.00
	SIGB 3.125% 22/09/01	1,000,000	1,164,301.00
	SIGB 3.25% 20/09/01	2,000,000	2,308,350.00
	SIGB 3.5% 27/03/01	1,500,000	1,788,627.00
	SIGB 3.625 140701	2,500,000	2,628,862.50
	SIGB 3.75% 160901	1,000,000	1,125,645.00
	SIGB 4% 18/09/01	3,200,000	3,806,976.00
シンガポールドル小計 (邦貨換算額：円)		12,700,000	14,479,964.50 (999,696,749)
マレーシア リングgit	MALAYSIAN 3.502 27/05/31	9,000,000	8,803,404.00
	MALAYSIAN 3.741 15/02/27	10,000,000	10,134,470.00
	MALAYSIAN 3.814%17/02/15	2,000,000	2,046,398.00
	MALAYSIAN 4.24 18/02/07	5,000,000	5,224,005.00
	MALAYSIAN 4.262 16/09/15	3,000,000	3,113,004.00
	MALAYSIAN 4.378 19/11/29	5,000,000	5,287,255.00
	MALAYSIAN 5.094 14/04/30	6,000,000	6,160,596.00
	MGS 3.418 2022/08/15	8,000,000	7,936,440.00
マレーシアリングgit小計 (邦貨換算額：円)		48,000,000	48,705,572.00 (1,340,864,397)
スウェーデン クローナ	SGB 3% 16/07/12	11,000,000	11,796,400.00
	SGB 3.5% 22/06/01	5,000,000	5,825,400.00
	SGB 3.5% 39/03/30	10,000,000	12,211,600.00
	SGB 3.75% 17/08/12	13,200,000	14,820,960.00
	SGB 4.25% 19/03/12	15,000,000	17,674,350.00
	SGB 4.5% 15/08/12	13,000,000	14,222,000.00
	SGB 5% 20/12/01	17,000,000	21,496,500.00
	SGB 6.75% 14/05/05	19,100,000	20,647,100.00
スウェーデンクローナ小計 (邦貨換算額：円)		103,300,000	118,694,310.00 (1,525,221,883)
ノルウェー クローネ	NORWAY GOV 3.75% 210525	11,000,000	12,510,300.00
	NORWAY GOV 4.25% 170519	10,000,000	11,115,000.00
	NORWAY GOV 4.5% 19/05/22	6,000,000	6,963,000.00
	NORWAY GOV 5% 150515	10,000,000	10,818,000.00

	NORWAY GOV 6.5% 130515	2,000,000	2,036,800.00	
ノルウェークローネ小計 (邦貨換算額:円)		39,000,000	43,443,100.00 (655,990,810)	
デンマーク クローネ	DGB 2% 14/11/15	13,000,000	13,517,400.00	
	DGB 3% 21/11/15	14,000,000	16,182,600.00	
	DGB 4% 15/11/15	16,000,000	17,875,200.00	
	DGB 4% 17/11/15	15,000,000	17,673,000.00	
	DGB 4% 19/11/15	21,000,000	25,573,800.00	
	DGB 4.5% 39/11/15	27,000,000	40,059,900.00	
	DGB 7% 24/11/10	5,080,000	8,195,564.00	
デンマーククローネ小計 (邦貨換算額:円)		111,080,000	139,077,464.00 (2,075,035,762)	
メキシコペソ	MEX BONOS 7.25% 161215	70,000,000	75,734,330.00	
	MEX BONOS 7.75% 17/12/14	20,000,000	22,353,860.00	
	MEX BONOS 8% 200611	50,000,000	58,688,500.00	
	MEX BONOS 8.5% 290531	50,000,000	62,708,450.00	
	MEX BONOS 8.5% 381118	65,000,000	82,280,185.00	
	MEX BONOS 9.5% 141218	80,000,000	87,250,480.00	
メキシコペソ小計 (邦貨換算額:円)		335,000,000	389,015,805.00 (2,563,614,154)	
ポーランド ズロチ	POLGB 5% 16/04/25	4,000,000	4,200,000.00	
	POLGB 5.00% 13/10/24	6,500,000	6,581,250.00	
	POLGB 5.25% 17/10/25	8,000,000	8,668,800.00	
	POLGB 5.25% 2020/10/25	5,000,000	5,505,000.00	
	POLGB 5.5% 19/10/25	6,000,000	6,678,000.00	
	POLGB 5.5% 2015/04/25	8,000,000	8,360,000.00	
	POLGB 5.75% 14/04/25	8,000,000	8,252,000.00	
	POLGB 5.75% 21/10/25	4,000,000	4,560,400.00	
	POLGB 5.75% 22/09/23	10,200,000	11,786,100.00	
	POLGB 6.25% 15/10/24	7,500,000	8,088,750.00	
ポーランドズロチ小計 (邦貨換算額:円)		67,200,000	72,680,300.00 (1,984,898,993)	
南アフリカ ランド	REP SOUTH AFRICA 8.25	8,000,000	8,801,600.00	
	SAGB 6.5 2041/02/28	10,000,000	8,102,000.00	
	SAGB 6.75% 210331	50,000,000	51,130,000.00	
	SAGB 7 2031/02/28	35,000,000	32,161,500.00	
	SAGB 8% 181221	50,000,000	54,847,500.00	
	SAGB 8.75% 141221	13,000,000	13,914,940.00	
南アフリカランド小計 (邦貨換算額:円)		166,000,000	168,957,540.00 (1,674,369,221)	
ユーロ	BGB 2.75% 16/03/28	2,000,000	2,153,400.00	
	BGB 3% 190928	2,000,000	2,205,160.00	
	BGB 3.25% 16/09/28	2,500,000	2,754,375.00	
	BGB 3.5% 15/03/28	1,500,000	1,613,175.00	
	BGB 3.5% 17/06/28	2,000,000	2,239,760.00	
	BGB 3.75% 15/09/28	3,300,000	3,618,780.00	

BGB 3.75% 20/09/28	4,000,000	4,612,400.00	
BGB 4% 14/03/28	3,200,000	3,357,216.00	
BGB 4% 17/03/28	2,500,000	2,846,825.00	
BGB 4% 18/03/28	2,500,000	2,892,625.00	
BGB 4% 19/03/28	2,500,000	2,918,000.00	
BGB 4% 2022/03/28	3,500,000	4,102,875.00	
BGB 4% 32/03/28	1,000,000	1,163,380.00	
BGB 4.25% 14/09/28	2,500,000	2,682,700.00	
BGB 4.25% 2041/03/28	2,000,000	2,427,100.00	
BGB 4.25% 21/09/28	3,000,000	3,573,900.00	
BGB 4.25% 22/09/28	2,000,000	2,376,060.00	
BGB 4.5% 26/03/28	1,000,000	1,225,700.00	
BGB 5% 35/03/28	3,500,000	4,629,520.00	
BGB 5.5% 17/09/28	1,740,000	2,118,972.00	
BGB 5.5% 28/03/28	3,000,000	4,087,440.00	
BGB 8% 15/03/28	2,000,000	2,353,960.00	
BTNS 1 2017/07/25	3,500,000	3,556,350.00	
BTNS 1.75% 170225	3,500,000	3,678,080.00	
BTNS 2% 15/07/12	5,000,000	5,233,250.00	
BTNS 2.25% 16/02/25	4,000,000	4,250,520.00	
BTNS 2.5% 14/01/12	6,500,000	6,669,000.00	
BTNS 2.5% 15/01/15	7,200,000	7,556,400.00	
BTNS 2.5% 16/07/25	3,600,000	3,874,680.00	
BTNS 3% 14/07/12	5,500,000	5,751,075.00	
BTPS 2.5% 15/03/01	3,000,000	3,032,340.00	
BTPS 3 14/04/01	2,000,000	2,038,000.00	
BTPS 3% 15/04/15	2,500,000	2,550,200.00	
BTPS 3% 15/06/15	6,400,000	6,528,320.00	
BTPS 3% 15/11/01	4,000,000	4,084,720.00	
BTPS 3.5% 14/06/01	5,000,000	5,132,250.00	
BTPS 3.75% 13/12/15	5,000,000	5,120,000.00	
BTPS 3.75% 15/08/01	6,200,000	6,438,700.00	
BTPS 3.75% 16/04/15	3,000,000	3,126,600.00	
BTPS 3.75% 16/08/01	6,000,000	6,251,580.00	
BTPS 3.75% 21/03/01	6,000,000	5,948,280.00	
BTPS 3.75% 21/08/01	6,300,000	6,200,334.00	
BTPS 4% 17/02/01	6,000,000	6,282,900.00	
BTPS 4% 20/09/01	5,500,000	5,581,950.00	
BTPS 4% 37/02/01	5,500,000	4,861,065.00	
BTPS 4.25 19/02/01	5,400,000	5,624,262.00	
BTPS 4.25% 14/07/01	1,300,000	1,350,635.00	
BTPS 4.25% 14/08/01	6,900,000	7,175,310.00	
BTPS 4.25% 15/02/01	5,000,000	5,238,500.00	
BTPS 4.25% 19/09/01	6,000,000	6,229,680.00	
BTPS 4.25% 20/03/01	5,000,000	5,158,500.00	
BTPS 4.5% 18/02/01	6,000,000	6,372,780.00	
BTPS 4.5% 18/08/01	5,000,000	5,293,750.00	
BTPS 4.5% 19/03/01	2,000,000	2,109,260.00	

BTPS 4.5% 20/02/01	5,500,000	5,760,700.00	
BTPS 4.5% 26/03/01	3,000,000	2,984,940.00	
BTPS 4.75 2017/06/01	2,000,000	2,145,960.00	
BTPS 4.75% 16/09/15	3,500,000	3,767,225.00	
BTPS 4.75% 170501	4,000,000	4,292,120.00	
BTPS 4.75% 21/09/01	6,000,000	6,306,480.00	
BTPS 4.75% 23/08/01	5,500,000	5,691,840.00	
BTPS 5% 22/03/01	2,000,000	2,123,960.00	
BTPS 5% 25/03/01	5,000,000	5,216,650.00	
BTPS 5% 34/08/01	4,970,000	5,044,450.60	
BTPS 5% 39/08/01	4,000,000	4,068,520.00	
BTPS 5% 40/09/01	2,000,000	2,032,860.00	
BTPS 5.25 17/08/01	5,000,000	5,476,650.00	
BTPS 5.25% 29/11/01	6,200,000	6,484,456.00	
BTPS 5.5% 22/09/01	6,000,000	6,564,000.00	
BTPS 5.75% 33/02/01	3,700,000	4,077,289.00	
BTPS 6% 14/11/15	1,000,000	1,077,830.00	
BTPS 6% 31/05/01	6,900,000	7,781,130.00	
BTPS 6.5% 27/11/01	5,960,000	7,004,966.80	
BTPS 7.25% 26/11/01	2,000,000	2,504,160.00	
BTPS 9.00% 23/11/01	2,000,000	2,751,000.00	
BUNDESOBL-164 0.5	3,000,000	3,015,840.00	
BUNDESOBLIGA 2% 16/02/26	3,000,000	3,183,900.00	
DBR 1.75% 220704	5,500,000	5,676,550.00	
DBR 2% 22/01/04	2,000,000	2,119,260.00	
DBR 2.25% 20/09/04	4,000,000	4,361,000.00	
DBR 2.25% 21/09/04	3,000,000	3,253,560.00	
DBR 2.5% 21/01/04	4,000,000	4,429,920.00	
DBR 3% 20/07/04	4,000,000	4,582,000.00	
DBR 3.25% 15/07/04	5,500,000	5,949,075.00	
DBR 3.25% 20/01/04	5,500,000	6,386,490.00	
DBR 3.25% 21/07/04	5,000,000	5,833,150.00	
DBR 3.25% 42/07/04	2,500,000	3,022,075.00	
DBR 3.5% 160104	5,200,000	5,741,580.00	
DBR 3.5% 19/07/04	5,000,000	5,869,000.00	
DBR 3.75% 15/01/04	6,000,000	6,458,220.00	
DBR 3.75% 17/01/04	5,000,000	5,706,500.00	
DBR 3.75% 19/01/04	4,000,000	4,729,600.00	
DBR 4% 18/01/04	6,000,000	7,062,120.00	
DBR 4% 37/01/04	5,200,000	6,884,800.00	
DBR 4.00% 16/07/04	3,900,000	4,428,840.00	
DBR 4.25% 14/01/04	5,700,000	5,950,800.00	
DBR 4.25% 14/07/04	6,500,000	6,921,850.00	
DBR 4.25% 17/07/04	4,000,000	4,705,600.00	
DBR 4.25% 18/07/04	5,200,000	6,249,256.00	
DBR 4.25% 39/07/04	3,500,000	4,888,275.00	
DBR 4.75% 28/07/04	3,000,000	4,097,190.00	
DBR 4.75% 34/07/04	3,600,000	5,158,728.00	

DBR 4.75% 40/07/04	4,000,000	6,033,720.00	
DBR 5.5% 31/01/04	3,300,000	4,954,290.00	
DBR 5.625% 28/01/04	2,980,000	4,395,887.40	
DBR 6% 16/06/20	890,000	1,070,759.00	
DBR 6.25% 24/01/04	2,200,000	3,252,876.00	
DBR 6.25% 300104	2,200,000	3,508,560.00	
DBR 6.5% 27/07/04	2,000,000	3,174,000.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	3,000,000	3,018,990.00	
FINNISH GO 1.75% 160415	2,000,000	2,104,160.00	
FINNISH GO 3.875% 170915	2,000,000	2,311,660.00	
FINNISH GOV'T 1.625	2,000,000	1,995,900.00	
FRANCE 3.75% 17/04/25	8,000,000	9,096,240.00	
FRANCE 3.75% 19/10/25	5,000,000	5,812,400.00	
FRANCE O.A.T.3.5% 150425	5,600,000	6,039,320.00	
FRANCE O.A.T.3.5% 200425	6,000,000	6,878,220.00	
FRANCE O.A.T.4% 600425	2,000,000	2,371,100.00	
FRANCE OAT4% 141025	5,000,000	5,361,750.00	
FRTR 2.5% 20/10/25	5,500,000	5,892,975.00	
FRTR 3.0% 15/10/25	7,200,000	7,768,656.00	
FRTR 3.0% 220425	8,000,000	8,748,800.00	
FRTR 3.25% 16/04/25	6,700,000	7,356,935.00	
FRTR 3.25% 21/10/25	7,000,000	7,837,200.00	
FRTR 3.5% 26/04/25	6,000,000	6,734,700.00	
FRTR 3.75% 21/04/25	5,700,000	6,624,939.00	
FRTR 4% 14/04/25	5,300,000	5,580,529.00	
FRTR 4% 18/04/25	6,000,000	6,987,480.00	
FRTR 4% 38/10/25	4,700,000	5,548,820.00	
FRTR 4% 55/04/25	3,170,000	3,754,389.50	
FRTR 4.25% 17/10/25	4,500,000	5,258,475.00	
FRTR 4.25% 18/10/25	5,000,000	5,924,500.00	
FRTR 4.25% 19/04/25	7,400,000	8,814,362.00	
FRTR 4.25% 23/10/25	7,000,000	8,414,350.00	
FRTR 4.5% 41/04/25	4,700,000	6,010,736.00	
FRTR 4.75% 35/04/25	4,600,000	5,989,522.00	
FRTR 5% 16/10/25	7,600,000	8,923,540.00	
FRTR 5.5% 29/04/25	6,000,000	8,295,480.00	
FRTR 5.75% 32/10/25	4,700,000	6,842,166.00	
FRTR 6.00% 25/10/25	3,500,000	4,926,705.00	
FRTR 8.5% 19/10/25	2,550,000	3,766,732.50	
FRTR 8.5% 23/04/25	1,200,000	1,921,440.00	
IRISH 4% 14/01/15	2,500,000	2,559,250.00	
IRISH 4.4% 19/06/18	1,500,000	1,515,270.00	
IRISH 4.5% 18/10/18	2,000,000	2,078,460.00	
IRISH 4.5% 20/04/18	2,490,000	2,505,512.70	
IRISH 4.6% 16/04/18	1,800,000	1,917,954.00	
IRISH 5% 2020/10/18	2,000,000	2,068,860.00	
IRISH 5.4% 25/03/13	2,000,000	2,044,360.00	
IRISH 5.9% 19/10/18	2,000,000	2,191,440.00	



ITALY 5.75% 16/07/25	1,000,000	1,091,800.00	
NETHER 1% 14/01/15	3,000,000	3,030,990.00	
NETHER GOV 2.25% 220715	3,000,000	3,165,150.00	
NETHERLANDS 0.75 150415	2,000,000	2,030,700.00	
NETHERLANDS 2.5% 170115	3,000,000	3,250,050.00	
NETHERLANDS 2.5% 330115	1,600,000	1,640,320.00	
NETHERLANDS 2.75 150115	3,500,000	3,693,550.00	
NETHERLANDS 3.25% 150715	3,600,000	3,888,828.00	
NETHERLANDS 3.25% 210715	3,500,000	4,003,930.00	
NETHERLANDS 3.5% 200715	3,000,000	3,484,800.00	
NETHERLANDS 3.75% 140715	3,400,000	3,595,670.00	
NETHERLANDS 3.75% 230115	2,000,000	2,378,700.00	
NETHERLANDS 3.75% 420115	3,000,000	3,844,950.00	
NETHERLANDS 4% 16/07/15	3,300,000	3,731,640.00	
NETHERLANDS 4% 18/07/15	3,500,000	4,105,955.00	
NETHERLANDS 4% 19/07/15	1,500,000	1,780,500.00	
NETHERLANDS 4.5% 170715	3,000,000	3,534,150.00	
NETHERLANDS 5.5% 280115	3,000,000	4,293,990.00	
NETHERLANDS 7.5% 230115	1,000,000	1,540,170.00	
NETHERLANDS GOVT4%370115	2,700,000	3,496,230.00	
OBL 0.5% 170407	5,000,000	5,044,900.00	
OBL 0.75% 17/02/24	2,500,000	2,550,825.00	
OBL 1.75% 15/10/09	4,000,000	4,191,800.00	
OBL 2.25% 14/04/11	4,000,000	4,117,000.00	
OBL 2.25% 15/04/10	5,500,000	5,784,625.00	
OBL 2.5% 14/10/10	4,000,000	4,180,000.00	
OBL 2.5% 15/02/27	4,500,000	4,746,375.00	
OBL-160 2.75% 16/04/08	4,000,000	4,350,320.00	
OBL-161 1.25% 161014	2,000,000	2,081,160.00	
RAGB 3.2% 17/02/20	2,700,000	3,004,506.00	
RAGB 3.4% 14/10/20	2,000,000	2,122,100.00	
RAGB 3.5% 15/07/15	3,200,000	3,475,680.00	
RAGB 3.5% 21/09/15	4,000,000	4,626,680.00	
RAGB 3.65% 22/04/20	2,000,000	2,337,300.00	
RAGB 3.9% 20/07/15	3,000,000	3,548,640.00	
RAGB 4% 16/09/15	1,000,000	1,134,680.00	
RAGB 4.15% 37/03/15	2,800,000	3,606,960.00	
RAGB 4.3% 14/07/15	2,400,000	2,558,640.00	
RAGB 4.3% 17/09/15	1,500,000	1,758,300.00	
RAGB 4.35% 19/03/15	2,200,000	2,640,924.00	
RAGB 4.65% 18/01/15	2,000,000	2,391,400.00	
RAGB 4.85% 26/03/15	2,000,000	2,629,500.00	
RAGB 6.25% 27/07/15	2,000,000	3,007,200.00	
RFGB 3.125% 14/09/15	1,500,000	1,580,400.00	
RFGB 3.375% 20/04/15	1,200,000	1,382,700.00	
RFGB 3.5% 21/04/15	1,000,000	1,162,630.00	
RFGB 4% 25/07/04	1,000,000	1,229,850.00	
RFGB 4.25% 15/07/04	1,300,000	1,437,670.00	

RFGB 4.375% 19/07/04	1,000,000	1,213,480.00	
SPANISH GOV'T 3.75	2,000,000	2,024,600.00	
SPGB 3% 15/04/30	6,000,000	5,997,180.00	
SPGB 3.15% 16/01/31	3,800,000	3,774,084.00	
SPGB 3.25% 16/04/30	5,000,000	4,956,500.00	
SPGB 3.3% 14/10/31	5,000,000	5,045,400.00	
SPGB 3.4% 14/04/30	1,000,000	1,010,450.00	
SPGB 3.8% 17/01/31	4,500,000	4,484,835.00	
SPGB 4% 15/07/30	2,500,000	2,553,575.00	
SPGB 4% 20/04/30	4,000,000	3,810,720.00	
SPGB 4.1% 18/07/30	4,000,000	3,959,200.00	
SPGB 4.2% 37/01/31	3,250,000	2,585,212.50	
SPGB 4.25% 14/01/31	3,500,000	3,568,250.00	
SPGB 4.25% 16/10/31	4,000,000	4,068,120.00	
SPGB 4.3% 19/10/31	4,000,000	3,922,800.00	
SPGB 4.4% 15/01/31	3,800,000	3,921,980.00	
SPGB 4.6% 19/07/30	3,500,000	3,509,100.00	
SPGB 4.65% 25/07/30	3,500,000	3,207,295.00	
SPGB 4.7% 41/07/30	3,000,000	2,548,500.00	
SPGB 4.75% 14/07/30	4,500,000	4,638,600.00	
SPGB 4.8% 24/01/31	3,300,000	3,121,074.00	
SPGB 4.85% 20/10/31	4,000,000	3,970,400.00	
SPGB 4.9% 40/07/30	4,000,000	3,489,400.00	
SPGB 5.5% 17/07/30	3,380,000	3,586,416.60	
SPGB 5.5% 21/04/30	4,000,000	4,103,800.00	
SPGB 5.75% 32/07/30	2,700,000	2,712,231.00	
SPGB 5.85% 220131	3,500,000	3,649,905.00	
SPGB 5.9% 26/07/30	1,000,000	1,023,850.00	
SPGB 6% 29/01/31	2,400,000	2,482,680.00	
ユーロ小計 (邦貨換算額：円)	838,580,000	929,463,807.60 (103,495,794,976)	
国債証券合計		251,392,427,395 (251,392,427,395)	
合計		251,392,427,395	
(外貨建有価証券邦貨換算額合計：円)		(251,392,427,395)	

(注) 金額欄の( )内は、外貨建有価証券にかかるもので、内書きであります。

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	40.2%	41.0%
カナダドル	国債証券	28銘柄	2.7%	2.8%
オーストラリアドル	国債証券	16銘柄	1.6%	1.6%
英ポンド	国債証券	35銘柄	7.7%	7.9%
スイスフラン	国債証券	8銘柄	0.4%	0.4%
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git	国債証券	8銘柄	0.5%	0.5%
スウェーデンクローナ	国債証券	8銘柄	0.6%	0.6%
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	0.8%	0.8%
メキシコペソ	国債証券	6銘柄	1.0%	1.0%

ポーランドズロチ	国債証券	10銘柄	0.8%	0.8%
南アフリカランド	国債証券	6銘柄	0.7%	0.7%
ユーロ	国債証券	227銘柄	40.3%	41.2%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引に関する注記)」に同様の内容が記載されているため、省略しております。

## 「SMAM・マネーインカムファンド&lt;適格機関投資家限定&gt;」の状況

## (1) 貸借対照表

(単位：円)

(平成24年12月19日現在)

資産の部	
流動資産	
親投資信託受益証券	245,990,987
流動資産合計	245,990,987
資産合計	245,990,987
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	1,656
未払委託者報酬	14,756
流動負債合計	16,412
負債合計	16,412
純資産の部	
元本等	
元本	244,077,572
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	1,897,003
元本等合計	245,974,575
純資産合計	245,974,575
負債純資産合計	245,990,987

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自平成24年4月14日 至平成24年12月19日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

## (追加情報)

自平成24年4月14日  
至平成24年12月19日

当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」(企業会計基準第24号 平成21年12月4日)および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日)を適用しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(平成24年12月19日現在)
1. 受益権総数	平成24年12月19日における受益権の総数 244,077,572口
2. 1単位当たり純資産額	1.0078円 (1万口 = 10,078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24年4月14日 至平成24年12月19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、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。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

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

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成24年12月19日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（デリバティブ取引に関する注記）

（平成24年12月19日現在）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

（自 平成24年4月14日 至 平成24年12月19日）

該当事項はありません。

（その他の注記）

（平成24年12月19日現在）

期首（平成24年 4月14日）における元本額	239,513,968円
期首より平成24年12月19日現在までの追加設定元本額	13,525,251円
期首より平成24年12月19日現在までの一部解約元本額	8,961,647円

（3）附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託 受益証券	マネーインカム・マザーファンド	243,483,111	245,990,987	
	親投資信託受益証券 小計	243,483,111	245,990,987	
合計		243,483,111	245,990,987	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考情報）

S M A M ・ マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞は、「マネーインカム・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

「マネーインカム・マザーファンド」の状況

（1）貸借対照表

（単位：円）

（平成24年12月19日現在）

資産の部

流動資産

コール・ローン	17,276,678
国債証券	1,571,116,620
未収入金	14,208,500
未収利息	2,725,450
前払費用	2,306,307

流動資産合計	1,607,633,555
資産合計	1,607,633,555
負債の部	
流動負債	
未払解約金	18,301,825
流動負債合計	18,301,825
負債合計	18,301,825
純資産の部	
元本等	
元本	1,573,115,652
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	16,216,078
元本等合計	1,589,331,730
純資産合計	1,589,331,730
負債純資産合計	1,607,633,555

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 平成24年 4月14日 至 平成24年12月19日
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>

## (追加情報)

自 平成24年 4月14日 至 平成24年12月19日
当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」(企業会計基準第24号 平成21年12月4日)および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日)を適用しております。

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(平成24年12月19日現在)
1. 受益権総数	平成24年12月19日における受益権の総数 1,573,115,652口
2. 1単位当たり純資産額	1.0103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24年 4月14日 至 平成24年12月19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。</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24年12月19日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(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24年12月19日現在)

該当事項はありませぬ。

(関連当事者との取引に関する注記)

(自平成24年4月14日 至 平成24年12月19日)

該当事項はありませぬ。

(その他の注記)

(平成24年12月19日現在)	
期首(平成24年4月14日)における元本額	1,686,382,428円
期首より平成24年12月19日現在までの追加設定元本額	695,139,016円
期首より平成24年12月19日現在までの一部解約元本額	808,405,792円
平成24年12月19日現在の元本の内訳	
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	27,064,543円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	3,950,963円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	801,887円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	592,889円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	614,587円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	158,784円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	346,458円
三井住友・ロシア株式オープン	999,001円
S M A M円高期待ファンド(豪ドル安型)	17,646,855円
S M A M円高期待ファンド(米ドル安型)	3,392,719円
S M A M円高期待ファンド(ユーロ安型)	7,450,554円

アジア高成長国C Bファンド	29,767,812円
日興ニューバーガー米国小型ハイクオリティファンド(毎月決算型)	99,128円
日興ニューバーガー米国小型ハイクオリティファンド(資産成長型)	297,384円
S M A M ・ マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	243,483,111円
S M A M ・ バランス先物ファンドV A 2 0 <適格機関投資家限定>	681,335,007円
S M A M ・ F G マネーファンドV A <適格機関投資家限定>	555,113,970円
合 計	1,573,115,652円

(3) 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247回利付国債(10年)	787,500,000	788,838,750	
	第250回利付国債(10年)	258,500,000	259,011,830	
	第253回利付国債(10年)	258,500,000	261,405,540	
	第256回利付国債(10年)	258,500,000	261,860,500	
	国債証券 小計	1,563,000,000	1,571,116,620	
合 計		1,563,000,000	1,571,116,620	

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。

## 独立監査人の監査報告書

平成25年2月5日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 鈴木 敏夫 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010の平成23年12月21日から平成24年12月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010の平成24年12月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以上

- 
- (注) 1. 上記は、当社が、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. 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

平成25年2月5日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士 鈴木 敏夫 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020の平成23年12月21日から平成24年12月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020の平成24年12月20日現在の信託財産の状況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、当社が、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．財務諸表の範囲にはXBR Lデータ自体は含まれていません。

### 独立監査人の監査報告書

平成25年2月5日

三井住友アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士 鈴木 敏夫 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2030の平成23年12月21日から平成24年12月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2030の平成24年12月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

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

以上

---

(注)1. 上記は、当社が、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. 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

### 独立監査人の監査報告書

平成25年2月5日

三井住友アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員

公認会計士 鈴木 敏夫 印

業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2040の平成23年12月21日から平成24年12月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

#### 財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040の平成24年12月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

#### 利害関係

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

以上

---

（注）1．上記は、当社が、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．財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

[委託会社の監査報告書（当期）へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成24年 6月15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 公認会計士 鈴木 敏夫 印  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 辰巳 幸久 印  
業務執行社員

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23年4月1日から平成24年3月31日までの第27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24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

---

上記は、当社が、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。

[委託会社の中間監査報告書へ](#)



## 独立監査人の中間監査報告書

平成24年11月30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	鈴木 敏 夫
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	辰 巳 幸 久

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24年4月1日から平成25年3月31日までの第28期事業年度の中間会計期間（平成24年4月1日から平成24年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友アセットマネジメント株式会社の平成24年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成24年4月1日から平成24年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 強調事項

追加情報に記載されているとおり、会社は平成24年9月28日に、トヨタアセットマネジメント株式会社、トヨタファイナンシャルサービス株式会社、あいおいニッセイ同和損害保険株式会社、三井住友海上火災保険株式会社と、平成25年4月1日を効力発生日としてトヨタアセットマネジメント株式会社と経営統合する旨の合意書を締結した。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

### 利害関係

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

以上

上記は、当社が、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。