

【表紙】

【提出書類】 有価証券報告書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成23年3月17日

【計算期間】 第10期（自 平成21年12月22日 至 平成22年12月20日）

【ファンド名】 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

【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】 隠地 保夫

【連絡場所】 東京都港区愛宕二丁目5番1号

【電話番号】 03-5405-0735

【縦覧に供する場所】 該当ありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

イ 当ファンドは、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	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、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは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
追 加 型	海 外	債 券
	内 外	不 動 産 投 信
		そ の 他 資 産 (資 産 複 合)

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

《属性区分表》

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株 式	年 1 回	グ ローバル (日本を含む)		
一 般 大 型 株 中 小 型 株	年 2 回	日 本		
債 券	年 4 回	北 米	ファミリーファンド	あ り
一 般 公 債 社 債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回(隔月)	欧 州		
	年12回(毎月)	ア ジ ア		
	日 々	オ セ ア ニ ア		
不動産投信	そ の 他 ()	中 南 米	ファンド・オブ・ファンズ	な し
そ の 他 資 産 (投資信託証券(資産複合(株式、債券 資産配分変更型))		ア フ リ カ		
資 産 複 合 () 資産配分固定型 資産配分変更型		中近東(中東)		
		エマージング		

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

商品分類、属性区分は、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 「中央三井アセット信託銀行株式会社」

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、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

□ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

2,000百万円（平成23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

(ハ) 大株主の状況

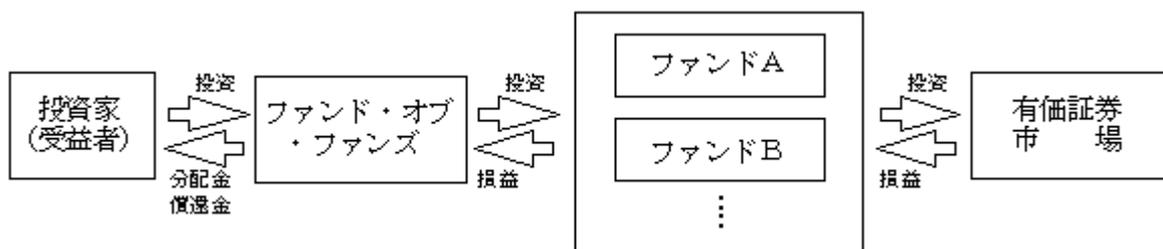
(平成23年1月31日現在)

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：投資対象とする他の投資信託の概要〕をご覧ください。

〔ファンドの特色〕

1. 他の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。

< 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

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。

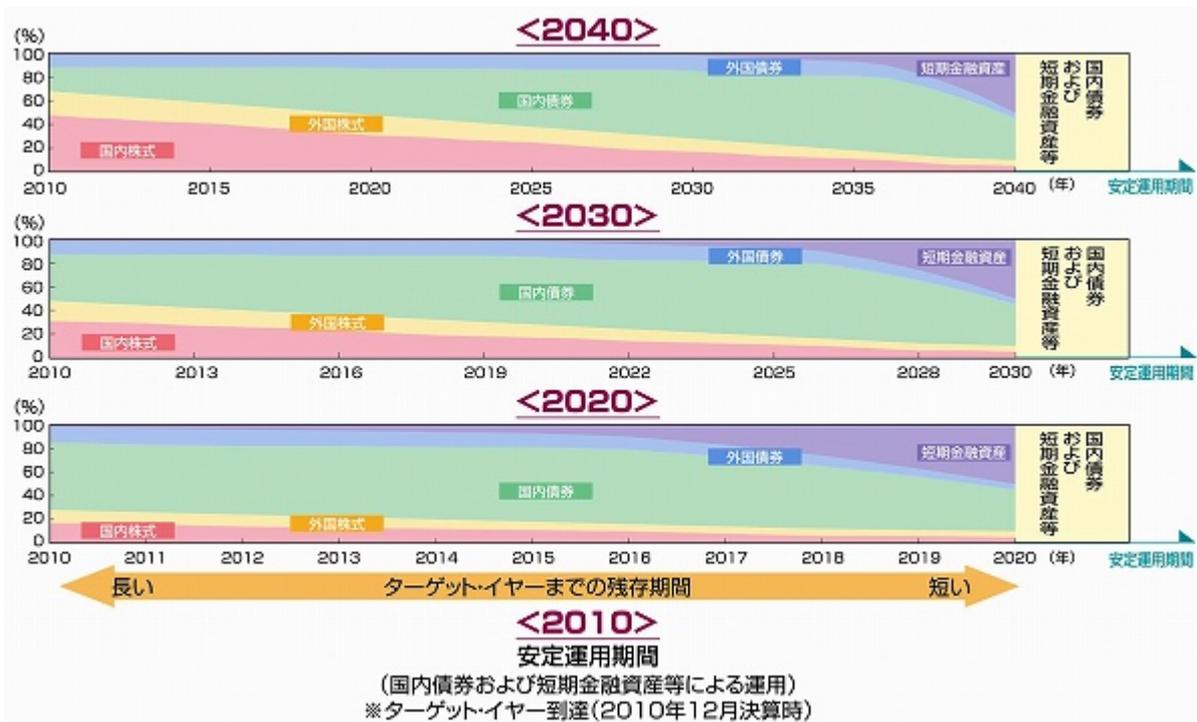
ターゲット・イヤー到達後の安定運用期間においても国内外の株式および外国債券への配分が予定されています。

〔基本的な投資資産配分（基本アロケーション）〕

2011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。

	< 2 0 4 0 >	< 2 0 3 0 >	< 2 0 2 0 >	< 2 0 1 0 >
国内株式	48%	31%	17%	5%
外国株式	20%	17%	11%	5%
国内債券	20%	39%	57%	35%
外国債券	10%	11%	13%	5%
短期金融資産	2%	2%	2%	50%

〔基本資産配分のイメージ図〕

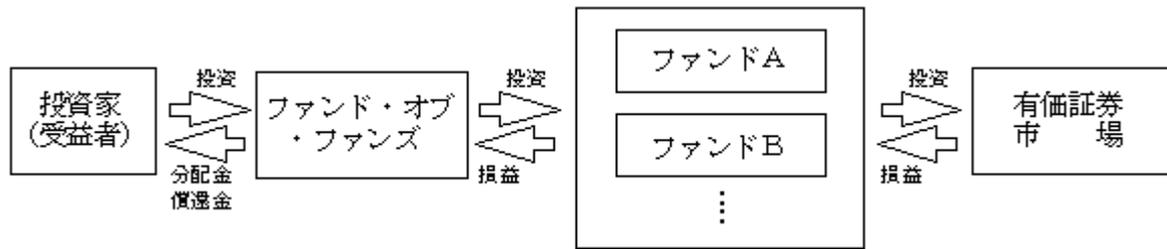


上記の図は、各決算時点での基本資産配分を表しています。また、現時点で予定している基本資産配分をもとに作

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。

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。



【投資対象とする投資信託とそれぞれのベンチマーク】

	投資対象とする投資信託	委託会社	ベンチマーク
国内株式	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）	三井住友アセット マネジメント株式会社	TOPIX（東証株価指数、 配当込み）
外国株式	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）		MSCI - KOKUSAI インデックス（円ベース）
国内債券	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＞		NOMURA - BPI（総合）
外国債券	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＞		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	S M A M ・ 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・国内株式パッシブ・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・年金国内債券パッシブファンド<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当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、当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当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・外国株式パッシブ・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・年金外国債券パッシブ・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当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当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。

(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、上記ロ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）

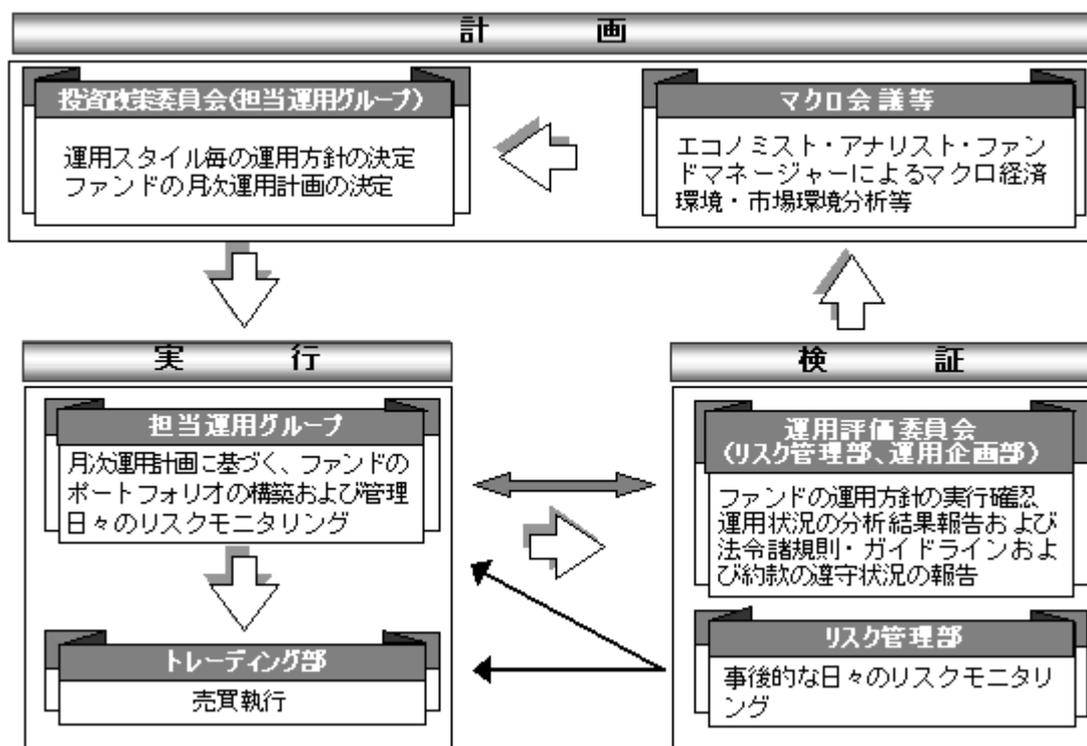
担当運用グループは、月次運用計画に基づき、ファンドのポートフォリオの構築、およびポートフォリオ管理の一環として日々のリスクモニタリングを行います。

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10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。

ロ 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。
- ロ 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ことがあります。
- 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主要な投資制限**

- イ 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。
 - ロ 投資信託証券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。
- 二 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。

投資信託協会規則に基づくファンド・オブ・ファンズにかかる投資制限

- イ 原則として複数のファンドに投資するものとします。
- ロ 委託会社（委託会社が運用の指図を行う他の投資信託、投資法人を含みます。）が、一ファンドに投資できる額は、当該投資されるファンドの委託会社の同意がない限り、同ファンドの純資産総額の50%以下とします。

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：投資対象とする他の投資信託の概要(平成23年3月17日現在)〕

〔SMAM・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 住友信託銀行株式会社

(2) 投資方針等

イ 基本方針

SMAM・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、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。

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、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。
- (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、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。

東証株価指数(TOPIX)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、TOPIXの算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIX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「SMAM・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。

ハ 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)

〔SMAM・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 中央三井アセット信託銀行株式会社

(2) 投資方針等

イ 基本方針

SMAM・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(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、NOMURA-BPI(総合)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

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、NOMURA-BPI(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、NOMURA-BPI(総合)の動きに連動する投資成果を目指します。

NOMURA-BPI(総合)は、野村証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証券株式会社およびその許諾者に帰属します。なお、野村証券株式会社およびその許諾者は、NOMURA-BPI(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、野村証券株式会社およびその許諾者は「SMAM・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。

ハ 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)

〔SMAM・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 住友信託銀行株式会社

(2) 投資方針等

イ 基本方針

SMAM・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、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。

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、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。
(ロ) 外貨建資産については、原則として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、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。

MSCI-KOKUSAIインデックス(円ベース)はMSCI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、MSCIインクが有しています。また、MSCIインクは「SMAM・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。

ハ 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 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・マーケッツ・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・マーケッツ・インクが有しています。シティグループ・グローバル・マーケッツ・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 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0.4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	0.10%
当該平均値が0.50%以上1.00%未満の場合	0.14%
当該平均値が1.00%以上の場合	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）

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、その基準価額は、保有する株式や債券の値動き、為替相場の変動等の影響により上下します。また、保有する株式や債券の発行者の経営・財務状況の変化およびそれらに関する外部評価の変化等にも影響を受けます。当ファンドが組み入れる投資信託の基準価額の変動により、当ファンドの基準価額も上下し、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、当ファンドは金融機関の預金とは異なり、元金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、預金や保険契約と異なり、預金保険、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。登録金融機関は、投資者保護基金には加入していません。

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

（イ）株式市場リスク

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

（ロ）債券市場リスク

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

（ハ）為替変動リスク

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

（ニ）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。

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チェックを行っています。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チェックを行います。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、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0.40%）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
年0.1575% (0.15%)	年0.3150% (0.30%)	年0.0420% (0.04%)
ターゲット・イヤーの 決算日の翌日以降		
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（税込み）は、各ファンドの基本アロケーション（平成23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% 程度、 < 2020 > 年0.578445% 程度

< 2030 > 年0.583485% 程度、 < 2040 > 年0.58863% 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%）の率を乗じて得た金額が信託財産の費用として計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。監査費用は、将来、監査法人との契約等により変更となることがあります。

ロ 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立て替えた立替金の利息は、信託財産中から支弁します。

ハ 有価証券の売買時の手数料、デリバティブ取引等に要する費用、および外国における資産の保管等に要する費用（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つたりすることから、あらかじめ具体的に記載することはできません。

(5)【課税上の取扱い】

イ 個別元本について

- (イ) 追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等(申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。)が当該受益者の元本(個別元本)にあたります。
- (ロ) 受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合については、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。(「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。)

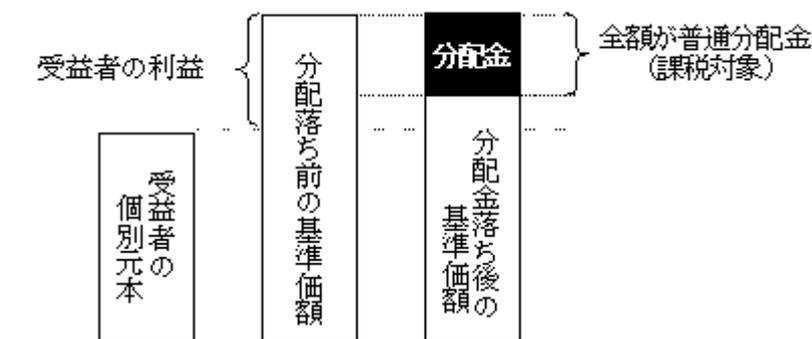
ロ 一部解約時および償還時の課税について

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。

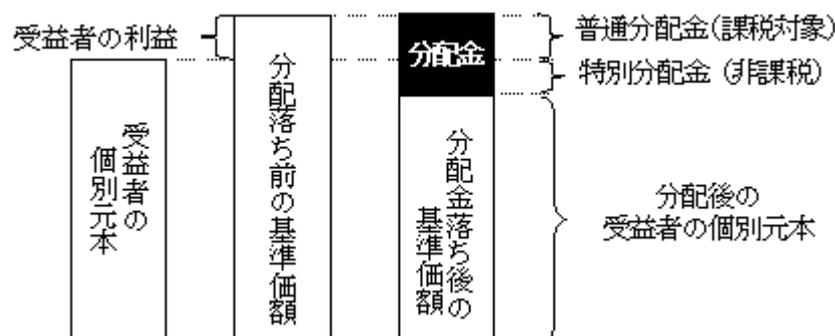
ハ 収益分配金の課税について

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「特別分配金」(受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分)の区分があります。

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



収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が特別分配金となり、当該収益分配金から当該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、平成23年12月31日までは10%（所得税7%および地方税3%）、平成24年1月1日以降は20%（所得税15%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行われ、申告不要制度が適用されます。確定申告による総合課税または申告分離課税の選択も可能です。

・ 一部解約時および償還時

一部解約時および償還時の譲渡益については、平成23年12月31日までは10%（所得税7%および地方税3%）、平成24年1月1日以降は20%（所得税15%および地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。ただし、特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。

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。

(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、平成23年12月31日までは7%（所得税のみ）、平成24年1月1日以降は15%（所得税のみ）の税率で源泉徴収されます。

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

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23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】

【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23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	322,352,597	99.82
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		566,399	0.18
合計(純資産総額)		322,918,996	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の比率をいいます。以下同じ。

投資信託受益証券の明細は以下の通りです。

銘柄名	主要投資対象	時価合計 (円)	投資比率 (%)
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)	国内株式	16,068,974	4.98
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>	国内債券	113,160,513	35.04
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)	外国株式	15,881,416	4.92
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>	外国債券	15,913,991	4.93
S M A M・マネーインカムファンド <適格機関投資家限定>	国内債券	161,327,703	49.96

【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23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	472,605,083	99.84
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		734,695	0.16
合計(純資産総額)		473,339,778	100.00

投資信託受益証券の明細は以下の通りです。

銘柄名	主要投資対象	時価合計 (円)	投資比率 (%)
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)	国内株式	79,932,265	16.89
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>	国内債券	270,469,671	57.14
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)	外国株式	51,650,841	10.91
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>	外国債券	61,288,372	12.95
S M A M・マネーインカムファンド <適格機関投資家限定>	国内債券	9,263,934	1.96

〔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23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	272,997,171	99.77
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		642,861	0.23
合計(純資産総額)		273,640,032	100.00

投資信託受益証券の明細は以下の通りです。

銘柄名	主要投資対象	時価合計 (円)	投資比率 (%)
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)	国内株式	84,300,041	30.81
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>	国内債券	107,178,615	39.17
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)	外国株式	46,238,822	16.90
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>	外国債券	29,911,325	10.93
S M A M・マネーインカムファンド <適格機関投資家限定>	国内債券	5,368,368	1.96

〔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23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	234,747,695	99.73
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		646,278	0.27
合計(純資産総額)		235,393,973	100.00

投資信託受益証券の明細は以下の通りです。

銘柄名	主要投資対象	時価合計 (円)	投資比率 (%)
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)	国内株式	113,019,494	48.01
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>	国内債券	46,783,632	19.87
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)	外国株式	47,086,827	20.00
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>	外国債券	23,336,031	9.91
S M A M・マネーインカムファンド <適格機関投資家限定>	国内債券	4,521,711	1.92

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

イ 主要投資銘柄

【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23年1月31日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量（口）	帳簿価額 単価／金額 （円）	評価額 単価／金額 （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 >	160,333,635	1.006 161,295,673	1.0062 161,327,703	49.96
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 >	101,489,250	1.114 113,060,343	1.115 113,160,513	35.04
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)	20,194,765	0.7811 15,775,186	0.7957 16,068,974	4.98
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 >	14,586,610	1.0973 16,007,272	1.091 15,913,991	4.93
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)	15,682,252	1.0018 15,711,091	1.0127 15,881,416	4.92

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。以下同じ。

【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23年1月31日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量（口）	帳簿価額 単価／金額 （円）	評価額 単価／金額 （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 >	242,573,696	1.114 270,247,473	1.115 270,469,671	57.14
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)	100,455,279	0.7808 78,443,179	0.7957 79,932,265	16.89
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 >	56,176,327	1.0972 61,638,924	1.091 61,288,372	12.95
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)	51,003,102	1.0018 51,095,095	1.0127 51,650,841	10.91
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 >	9,206,852	1.006 9,262,145	1.0062 9,263,934	1.96

【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23年1月31日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量（口）	帳簿価額 単価／金額 （円）	評価額 単価／金額 （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 >	96,124,319	1.1141 107,096,375	1.115 107,178,615	39.17
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)	105,944,504	0.7808 82,721,468	0.7957 84,300,041	30.81
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)	45,658,954	1.0017 45,740,942	1.0127 46,238,822	16.90
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 >	27,416,430	1.0972 30,081,358	1.091 29,911,325	10.93
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 >	5,335,290	1.006 5,367,338	1.0062 5,368,368	1.96

〔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23年1月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量(口)	帳簿価額 単価/金額 (円)	評価額 単価/金額 (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)	142,037,821	0.7809 110,919,346	0.7957 113,019,494	48.01
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)	46,496,324	1.0017 46,579,505	1.0127 47,086,827	20.00
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>	41,958,415	1.1143 46,758,212	1.115 46,783,632	19.87
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>	21,389,580	1.0974 23,473,311	1.091 23,336,031	9.91
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>	4,493,850	1.0059 4,520,813	1.0062 4,521,711	1.92

□ 種類別の投資比率

〔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23年1月31日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	99.82
合計	99.82

〔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23年1月31日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	99.84
合計	99.84

〔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23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

〔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23年1月31日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	99.73
合計	99.73

【投資不動産物件】

各ファンドとも該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

各ファンドとも該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

〔三井住友・DC年金プラン・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1期(平成13年12月20日)(分配落)	9,859,219	9,859
第1期(平成13年12月20日)(分配付)	9,859,219	9,859
第2期(平成14年12月20日)(分配落)	14,380,994	9,762
第2期(平成14年12月20日)(分配付)	14,380,994	9,762
第3期(平成15年12月22日)(分配落)	35,391,890	10,088
第3期(平成15年12月22日)(分配付)	35,391,890	10,088
第4期(平成16年12月20日)(分配落)	56,778,399	10,387
第4期(平成16年12月20日)(分配付)	56,778,399	10,387
第5期(平成17年12月20日)(分配落)	118,527,624	10,782
第5期(平成17年12月20日)(分配付)	118,527,624	10,782
第6期(平成18年12月20日)(分配落)	160,590,675	11,048
第6期(平成18年12月20日)(分配付)	160,590,675	11,048
第7期(平成19年12月20日)(分配落)	217,158,042	11,245
第7期(平成19年12月20日)(分配付)	217,158,042	11,245
第8期(平成20年12月22日)(分配落)	238,566,878	10,578
第8期(平成20年12月22日)(分配付)	238,566,878	10,578
第9期(平成21年12月21日)(分配落)	301,495,735	10,921
第9期(平成21年12月21日)(分配付)	301,495,735	10,921
第10期(平成22年12月20日)(分配落)	324,751,925	10,941
第10期(平成22年12月20日)(分配付)	324,751,925	10,941
平成22年1月末日	302,282,425	10,895
平成22年2月末日	302,735,833	10,866
平成22年3月末日	310,906,230	11,011
平成22年4月末日	313,606,425	11,063
平成22年5月末日	312,744,204	10,891
平成22年6月末日	314,939,898	10,860
平成22年7月末日	319,233,941	10,932
平成22年8月末日	319,977,033	10,874
平成22年9月末日	317,364,971	10,984
平成22年10月末日	320,144,377	10,915
平成22年11月末日	324,321,341	10,912
平成22年12月末日	323,280,936	10,935
平成23年1月末日	322,918,996	10,954

(注1) 純資産総額(分配付)および1万口当たりの純資産額(分配付)の欄は、各計算期間にかかる収益分配金の総額を含んでいます。以下同じ。

(注2) 純資産総額(分配落)および1万口当たりの純資産額(分配落)の欄は、収益分配時に外国税額控除規定が適用された場合には当該控除額を含んでいます。以下同じ。

〔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1期(平成13年12月20日)(分配落)	9,728,590	9,729
第1期(平成13年12月20日)(分配付)	9,728,590	9,729
第2期(平成14年12月20日)(分配落)	10,808,556	9,000
第2期(平成14年12月20日)(分配付)	10,808,556	9,000
第3期(平成15年12月22日)(分配落)	23,886,277	9,725
第3期(平成15年12月22日)(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
第4期(平成16年12月20日)(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
第5期(平成17年12月20日)(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
第6期(平成18年12月20日)(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
第7期(平成19年12月20日)(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
第8期(平成20年12月22日)(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
第9期(平成21年12月21日)(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
第10期(平成22年12月20日)(分配付)	460,154,017	10,871
平成22年1月末日	369,429,282	10,753
平成22年2月末日	375,949,811	10,684
平成22年3月末日	395,899,687	11,066
平成22年4月末日	405,340,975	11,148
平成22年5月末日	394,799,596	10,712
平成22年6月末日	393,841,625	10,596
平成22年7月末日	422,513,345	10,742
平成22年8月末日	423,401,388	10,584
平成22年9月末日	440,614,086	10,818
平成22年10月末日	443,799,292	10,681
平成22年11月末日	455,614,691	10,772
平成22年12月末日	459,537,722	10,851
平成23年1月末日	473,339,778	10,911

〔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1期(平成13年12月20日)(分配落)	9,574,161	9,574
第1期(平成13年12月20日)(分配付)	9,574,161	9,574
第2期(平成14年12月20日)(分配落)	10,514,023	8,353
第2期(平成14年12月20日)(分配付)	10,514,023	8,353
第3期(平成15年12月22日)(分配落)	14,059,509	9,390
第3期(平成15年12月22日)(分配付)	14,059,509	9,390
第4期(平成16年12月20日)(分配落)	26,147,117	10,035
第4期(平成16年12月20日)(分配付)	26,147,117	10,035
第5期(平成17年12月20日)(分配落)	55,989,814	12,178
第5期(平成17年12月20日)(分配付)	55,989,814	12,178
第6期(平成18年12月20日)(分配落)	101,147,764	13,183
第6期(平成18年12月20日)(分配付)	101,147,764	13,183
第7期(平成19年12月20日)(分配落)	149,262,430	12,809
第7期(平成19年12月20日)(分配付)	149,262,430	12,809
第8期(平成20年12月22日)(分配落)	146,078,912	9,332
第8期(平成20年12月22日)(分配付)	146,078,912	9,332
第9期(平成21年12月21日)(分配落)	214,049,126	10,168
第9期(平成21年12月21日)(分配付)	214,049,126	10,168
第10期(平成22年12月20日)(分配落)	266,798,732	10,308
第10期(平成22年12月20日)(分配付)	266,798,732	10,308
平成22年1月末日	219,406,366	10,170
平成22年2月末日	219,256,450	10,068
平成22年3月末日	236,527,861	10,638
平成22年4月末日	244,857,548	10,706
平成22年5月末日	231,712,556	10,064
平成22年6月末日	231,801,222	9,869
平成22年7月末日	239,903,829	10,035
平成22年8月末日	239,094,451	9,796
平成22年9月末日	247,175,969	10,086
平成22年10月末日	248,077,548	9,909
平成22年11月末日	259,507,589	10,138
平成22年12月末日	267,095,557	10,288
平成23年1月末日	273,640,032	10,379

〔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1期(平成13年12月20日)(分配落)	9,573,780	9,574
第1期(平成13年12月20日)(分配付)	9,573,780	9,574
第2期(平成14年12月20日)(分配落)	8,847,644	8,036
第2期(平成14年12月20日)(分配付)	8,847,644	8,036
第3期(平成15年12月22日)(分配落)	18,376,281	9,180
第3期(平成15年12月22日)(分配付)	18,376,281	9,180
第4期(平成16年12月20日)(分配落)	30,736,176	9,865
第4期(平成16年12月20日)(分配付)	30,736,176	9,865
第5期(平成17年12月20日)(分配落)	64,001,577	12,443
第5期(平成17年12月20日)(分配付)	64,001,577	12,443
第6期(平成18年12月20日)(分配落)	113,160,193	13,668
第6期(平成18年12月20日)(分配付)	113,160,193	13,668
第7期(平成19年12月20日)(分配落)	143,523,897	13,111
第7期(平成19年12月20日)(分配付)	143,523,897	13,111
第8期(平成20年12月22日)(分配落)	134,815,396	8,596
第8期(平成20年12月22日)(分配付)	134,815,396	8,596
第9期(平成21年12月21日)(分配落)	188,270,881	9,559
第9期(平成21年12月21日)(分配付)	188,270,881	9,559
第10期(平成22年12月20日)(分配落)	231,956,041	9,713
第10期(平成22年12月20日)(分配付)	231,956,041	9,713
平成22年1月末日	192,929,861	9,588
平成22年2月末日	193,106,075	9,453
平成22年3月末日	211,901,795	10,204
平成22年4月末日	217,494,235	10,257
平成22年5月末日	204,991,769	9,410
平成22年6月末日	203,780,129	9,145
平成22年7月末日	209,842,214	9,333
平成22年8月末日	205,117,501	9,025
平成22年9月末日	215,012,458	9,356
平成22年10月末日	213,057,924	9,143
平成22年11月末日	225,155,677	9,486
平成22年12月末日	230,999,664	9,697
平成23年1月末日	235,393,973	9,814

【分配の推移】

【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1期(平成13年3月13日～平成13年12月20日)	0
第2期(平成13年12月21日～平成14年12月20日)	0
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

【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1期(平成13年3月13日～平成13年12月20日)	0
第2期(平成13年12月21日～平成14年12月20日)	0
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

【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1期(平成13年3月13日～平成13年12月20日)	0
第2期(平成13年12月21日～平成14年12月20日)	0
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

【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1期(平成13年3月13日～平成13年12月20日)	0
第2期(平成13年12月21日～平成14年12月20日)	0
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

【収益率の推移】

【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1期	1.4
第2期	1.0
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

(注1) 収益率とは、計算期間末の分配基準価額から前期末分配基準価額を控除した額を前期末分配基準価額で除したものをいいます。以下同じ。

(注2) 収益分配時に外国税額控除規定が適用された場合には、上記収益率は同期間における受益者の投資収益率と異なる場合があります。以下同じ。

【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1期	2.7
第2期	7.5
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

【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1期	4.3
第2期	12.8
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

【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1期	4.3
第2期	16.1
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

(4) 【設定及び解約の実績】

【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1期	10,000,000	0
第2期	4,731,811	0
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

(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。

【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1期	10,000,000	0
第2期	2,009,839	0
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

【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1期	10,000,000	0
第2期	2,586,651	0
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

【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1期	10,000,000	0
第2期	1,009,825	0
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

〔参考情報：投資対象とする他の投資信託の現況〕

〔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23年1月28日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量(口)	帳簿価額 単価/金額 (円)	評価額 単価/金額 (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)	67,397,223,915	1.1283 76,044,287,744	1.2070 81,348,449,265	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)」の投資有価証券の上位30銘柄は以下の通りです。

<国内株式インデックス・マザーファンド(B号) 平成23年1月28日現在の上位30銘柄>

国/地域	種類	銘柄名/業種	数量 (株)	帳簿価額 単価/金額 (円)	評価額 単価/金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車 〔輸送用機器〕	3,295,500	3,220.00 10,611,510,000	3,390.00 11,171,745,000	3.48
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ 〔銀行業〕	19,162,000	396.00 7,588,152,000	434.00 8,316,308,000	2.59
日本	株式	本田技研工業 〔輸送用機器〕	2,164,600	3,010.00 6,515,446,000	3,525.00 7,630,215,000	2.37
日本	株式	キヤノン 〔電気機器〕	1,594,300	3,945.00 6,289,513,500	4,065.00 6,480,829,500	2.02
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ 〔銀行業〕	1,914,700	2,569.00 4,918,864,300	2,870.00 5,495,189,000	1.71
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ 〔銀行業〕	30,950,900	133.00 4,116,469,700	162.00 5,014,045,800	1.56
日本	株式	三菱商事 〔卸売業〕	2,027,500	2,116.00 4,290,190,000	2,315.00 4,693,662,500	1.46
日本	株式	ソニー 〔電気機器〕	1,440,900	2,971.00 4,280,913,900	2,908.00 4,190,137,200	1.30
日本	株式	武田薬品工業 〔医薬品〕	1,006,600	3,890.00 3,915,674,000	3,970.00 3,996,202,000	1.24
日本	株式	東京電力 〔電気・ガス業〕	1,888,700	1,950.00 3,682,965,000	2,001.00 3,779,288,700	1.18
日本	株式	日本電信電話 〔情報・通信業〕	951,500	3,790.00 3,606,185,000	3,800.00 3,615,700,000	1.13
日本	株式	ファナック 〔電気機器〕	267,100	11,990.00 3,202,529,000	12,920.00 3,450,932,000	1.07
日本	株式	任天堂 〔その他製品〕	146,800	22,730.00 3,336,764,000	22,200.00 3,258,960,000	1.01
日本	株式	ソフトバンク 〔情報・通信業〕	1,120,900	2,900.00 3,250,610,000	2,863.00 3,209,136,700	1.00
日本	株式	小松製作所 〔機械〕	1,272,500	2,318.00 2,949,655,000	2,502.00 3,183,795,000	0.99

日本	株式	エヌ・ティ・ティ・ドコモ 〔情報・通信業〕	20,928	135,800.00 2,842,022,400	146,500.00 3,065,952,000	0.95
日本	株式	三井物産 〔卸売業〕	2,186,700	1,307.00 2,858,016,900	1,394.00 3,048,259,800	0.95
日本	株式	パナソニック 〔電気機器〕	2,541,400	1,204.00 3,059,845,600	1,144.00 2,907,361,600	0.90
日本	株式	三菱地所 〔不動産業〕	1,776,000	1,412.00 2,507,712,000	1,586.00 2,816,736,000	0.88
日本	株式	日産自動車 〔輸送用機器〕	3,241,000	785.00 2,544,185,000	849.00 2,751,609,000	0.86
日本	株式	野村ホールディングス 〔証券、商品先物取引業〕	5,335,000	482.00 2,571,470,000	505.00 2,694,175,000	0.84
日本	株式	日立製作所 〔電気機器〕	5,759,000	396.00 2,280,564,000	461.00 2,654,899,000	0.83
日本	株式	東芝 〔電気機器〕	5,069,000	436.00 2,210,084,000	501.00 2,539,569,000	0.79
日本	株式	東日本旅客鉄道 〔陸運業〕	446,300	5,000.00 2,231,500,000	5,360.00 2,392,168,000	0.74
日本	株式	東京海上ホールディングス 〔保険業〕	961,000	2,367.00 2,274,687,000	2,483.00 2,386,163,000	0.74
日本	株式	三菱電機 〔電気機器〕	2,566,000	829.00 2,127,214,000	928.00 2,381,248,000	0.74
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス 〔小売業〕	1,060,700	2,045.00 2,169,131,500	2,160.00 2,291,112,000	0.71
日本	株式	関西電力 〔電気・ガス業〕	1,046,500	2,013.00 2,106,604,500	2,026.00 2,120,209,000	0.66
日本	株式	信越化学工業 〔化学〕	447,500	4,090.00 1,830,275,000	4,680.00 2,094,300,000	0.65
日本	株式	三井不動産 〔不動産業〕	1,197,000	1,482.00 1,773,954,000	1,699.00 2,033,703,000	0.63

〔SMAM・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23年1月28日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量（口）	帳簿価額 単価 / 金額 （円）	評価額 単価 / 金額 （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	52,205,596,464	1.1932 62,291,889,725	1.1990 62,594,510,160	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・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」の投資有価証券の上位30銘柄は以下の通りです。

<国内債券（NOMURA - BPI）マザーファンド 平成23年1月28日現在の上位30銘柄>

国/ 地域	種類	銘柄名	額面金額 （円）	帳簿価額 単価 / 金額 （円）	評価額 単価 / 金額 （円）	利率（％） / 償還期限	投資 比率 （％）
日本	国債証券	第239回利付国債 （10年）	3,930,000,000	102.47 4,027,385,400	101.69 3,996,731,400	1.4 2012/6/20	2.32
日本	国債証券	第253回利付国債 （10年）	3,857,000,000	104.39 4,026,627,900	103.58 3,995,119,170	1.6 2013/9/20	2.32
日本	国債証券	第260回利付国債 （10年）	3,646,000,000	105.14 3,833,404,400	104.27 3,801,939,420	1.6 2014/6/20	2.21
日本	国債証券	第250回利付国債 （10年）	3,739,000,000	100.91 3,773,044,840	100.66 3,763,752,180	0.5 2013/6/20	2.19
日本	国債証券	第247回利付国債 （10年）	3,670,000,000	101.67 3,731,509,800	101.27 3,716,609,000	0.8 2013/3/20	2.16
日本	国債証券	第244回利付国債 （10年）	3,578,000,000	101.95 3,648,112,040	101.51 3,632,242,480	1 2012/12/20	2.11
日本	国債証券	第268回利付国債 （10年）	3,470,000,000	105.25 3,652,214,800	104.42 3,623,443,400	1.5 2015/3/20	2.11
日本	国債証券	第270回利付国債 （10年）	3,433,000,000	104.56 3,589,766,600	103.76 3,562,080,800	1.3 2015/6/20	2.07
日本	国債証券	第265回利付国債 （10年）	3,405,000,000	105.10 3,578,893,350	104.28 3,550,768,050	1.5 2014/12/20	2.06
日本	国債証券	第258回利付国債 （10年）	3,410,000,000	103.78 3,539,223,000	103.12 3,516,664,800	1.3 2014/3/20	2.04
日本	国債証券	第263回利付国債 （10年）	3,355,000,000	105.39 3,535,834,500	104.48 3,505,304,000	1.6 2014/9/20	2.04
日本	国債証券	第256回利付国債 （10年）	3,105,000,000	104.02 3,229,896,800	103.25 3,206,160,900	1.4 2013/12/20	1.86
日本	国債証券	第274回利付国債 （10年）	2,588,000,000	105.46 2,729,495,520	104.93 2,715,795,440	1.5 2015/12/20	1.58
日本	国債証券	第306回利付国債 （10年）	2,550,000,000	102.11 2,604,024,000	102.44 2,612,347,500	1.4 2020/3/20	1.52
日本	国債証券	第272回利付国債 （10年）	2,440,000,000	105.19 2,566,655,800	104.33 2,545,700,800	1.4 2015/9/20	1.48
日本	国債証券	第308回利付国債 （10年）	2,120,000,000	102.40 2,171,052,000	101.31 2,147,814,400	1.3 2020/6/20	1.25

日本	国債証券	第305回利付国債 (10年)	2,090,000,000	101.48 2,120,932,000	101.82 2,128,100,700	1.3 2019/12/20	1.24
日本	国債証券	第243回利付国債 (10年)	2,036,000,000	102.10 2,078,801,600	101.50 2,066,601,080	1.1 2012/9/20	1.20
日本	国債証券	第303回利付国債 (10年)	1,960,000,000	102.68 2,012,528,000	102.93 2,017,467,200	1.4 2019/9/20	1.17
日本	国債証券	第310回利付国債 (10年)	2,000,000,000	99.54 1,990,909,100	98.31 1,966,300,000	1 2020/9/20	1.14
日本	国債証券	第297回利付国債 (10年)	1,694,000,000	103.58 1,754,779,400	103.56 1,754,374,160	1.4 2018/12/20	1.02
日本	国債証券	第238回利付国債 (10年)	1,675,000,000	102.18 1,711,515,000	101.41 1,698,617,500	1.4 2012/3/20	0.99
日本	国債証券	第277回利付国債 (10年)	1,574,000,000	106.15 1,670,911,000	105.57 1,661,766,240	1.6 2016/3/20	0.97
日本	国債証券	第237回利付国債 (10年)	1,630,000,000	102.35 1,668,305,000	101.52 1,654,824,900	1.5 2012/3/20	0.96
日本	国債証券	第301回利付国債 (10年)	1,568,000,000	103.82 1,627,897,600	103.94 1,629,857,600	1.5 2019/6/20	0.95
日本	国債証券	第293回利付国債 (10年)	1,521,000,000	107.14 1,629,599,400	106.81 1,624,701,780	1.8 2018/6/20	0.94
日本	国債証券	第290回利付国債 (10年)	1,552,000,000	104.25 1,618,068,640	104.15 1,616,408,000	1.4 2018/3/20	0.94
日本	国債証券	第296回利付国債 (10年)	1,516,000,000	104.60 1,585,736,000	104.47 1,583,765,200	1.5 2018/9/20	0.92
日本	国債証券	第289回利付国債 (10年)	1,488,000,000	105.16 1,564,780,800	104.97 1,562,028,000	1.5 2017/12/20	0.91
日本	国債証券	第242回利付国債 (10年)	1,490,000,000	102.31 1,524,428,700	101.66 1,514,823,400	1.2 2012/9/20	0.88

〔SMAM・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23年1月31日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量(口)	帳簿価額 単価/金額 (円)	評価額 単価/金額 (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	37,971,030,497	1.2292 46,673,990,687	1.2997 49,350,948,336	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・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」の投資有価証券の上位30銘柄は以下の通りです。

<外国株式インデックス・マザーファンド 平成23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 (株)	帳簿価額 単価/金額 (円)	評価額 単価/金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION 〔エネルギー〕	655,293	5,703.92 3,737,744,418	6,487.44 4,251,179,720	1.79
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〕	117,597	26,024.53 3,060,407,018	27,599.78 3,245,652,093	1.37
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP 〔ソフトウェア・サービス〕	1,002,202	2,078.71 2,083,287,620	2,279.92 2,284,949,203	0.96
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO 〔資本財〕	1,376,143	1,311.61 1,804,971,314	1,659.02 2,283,057,016	0.96
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP 〔ソフトウェア・サービス〕	162,326	11,735.55 1,904,985,814	13,075.91 2,122,561,351	0.90
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC 〔銀行〕	2,266,303	846.88 1,919,300,055	890.85 2,018,950,350	0.85
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED 〔食品・飲料・タバコ〕	445,800	4,863.63 2,168,206,254	4,479.77 1,997,083,249	0.84
アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION 〔エネルギー〕	258,707	6,709.19 1,735,716,926	7,668.47 1,983,888,963	0.84
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO 〔家庭用品・パーソナル用品〕	365,270	5,102.73 1,863,876,707	5,272.74 1,925,975,931	0.81
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO 〔各種金融〕	510,163	3,113.54 1,588,417,141	3,658.07 1,866,212,067	0.79
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〕	354,476	5,084.66 1,802,392,880	4,928.62 1,747,077,963	0.74
アメリカ	株式	AT&T INC 〔電気通信サービス〕	760,651	2,275.00 1,730,481,785	2,257.75 1,717,362,609	0.73
アメリカ	株式	WELLS FARGO & COMPANY 〔銀行〕	639,732	2,233.93 1,429,120,345	2,615.01 1,672,911,462	0.71
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC 〔電気通信サービス〕	6,790,038	206.84 1,404,472,509	231.75 1,573,627,530	0.66
オーストラリア	株式	BHP BILLITON LTD 〔素材〕	432,230	3,514.54 1,519,092,736	3,632.40 1,570,033,635	0.66
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A 〔ソフトウェア・サービス〕	31,721	47,808.69 1,516,539,591	49,359.30 1,565,726,631	0.66

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〕	1,033,916	1,360.07 1,406,201,029	1,490.65 1,541,216,707	0.65
イギリス	株式	BP PLC 〔エネルギー〕	2,417,584	556.78 1,346,074,990	633.27 1,531,003,050	0.65
アメリカ	株式	CITIGROUP INC 〔各種金融〕	3,739,518	344.94 1,289,931,776	387.65 1,449,637,614	0.61
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP 〔各種金融〕	1,290,779	928.89 1,198,992,092	1,116.96 1,441,758,838	0.61
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE 〔食品・飲料・タバコ〕	267,387	5,206.22 1,392,075,734	5,109.30 1,366,162,351	0.58
アメリカ	株式	ORACLE CORPORATION 〔ソフトウェア・サービス〕	517,629	2,235.57 1,157,200,315	2,628.15 1,360,411,832	0.57
イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS 〔エネルギー〕	456,706	2,530.25 1,155,580,584	2,865.23 1,308,568,759	0.55
フランス	株式	TOTAL SA 〔エネルギー〕	271,996	4,140.73 1,126,262,269	4,723.89 1,284,880,068	0.54
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC 〔テクノロジー・ハードウェアおよび機器〕	735,431	1,596.60 1,174,194,429	1,718.98 1,264,191,842	0.53
アメリカ	株式	INTEL CORP 〔半導体・半導体製造装置〕	716,022	1,751.83 1,254,350,896	1,762.50 1,261,995,792	0.53
アンティル	株式	SCHLUMBERGER LTD 〔エネルギー〕	175,834	6,324.00 1,111,975,974	7,118.20 1,251,622,827	0.53
スイス	株式	NOVARTIS AG-REG SHS 〔医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス〕	271,483	4,715.32 1,280,129,762	4,606.27 1,250,524,541	0.53
アメリカ	株式	WAL-MART STORES INC 〔食品・生活必需品小売り〕	262,440	4,422.70 1,160,693,519	4,656.77 1,222,122,981	0.52
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〕	90,430	12,091.46 1,093,431,089	12,571.28 1,136,821,212	0.48

〔 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23年1月31日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量（口）	帳簿価額 単価 / 金額 （円）	評価額 単価 / 金額 （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	5,431,416,035	1.1036 5,994,111,082	1.0959 5,952,288,832	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」の投資有価証券の上位30銘柄は以下の通りです。

<外国債券パッシブ・マザーファンド 平成23年1月31日現在の上位30銘柄>

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額 単価 / 金額 （円）	評価額 単価 / 金額 （円）	利率(%) / 償還期限	投資 比率 （%）
アメリカ	国債証券	US T 3.625% 19/08/15	16,000,000	8,459.39 1,353,502,400	8,591.56 1,374,650,875	3.625 2019/8/15	0.54
アメリカ	国債証券	US T 3.125% 19/05/15	16,000,000	8,177.06 1,308,330,900	8,315.66 1,330,506,000	3.125 2019/5/15	0.52
アメリカ	国債証券	US T 3.625% 20/02/15	15,000,000	8,397.79 1,259,668,875	8,527.40 1,279,110,585	3.625 2020/2/15	0.50
アメリカ	国債証券	US T 3.5% 20/05/15	15,000,000	8,286.14 1,242,922,054	8,406.77 1,261,016,320	3.5 2020/5/15	0.50
アメリカ	国債証券	US T 3.375% 19/11/15	15,000,000	8,265.61 1,239,842,179	8,397.79 1,259,668,875	3.375 2019/11/15	0.50
アメリカ	国債証券	US T 2.75% 19/02/15	15,000,000	7,992.27 1,198,841,343	8,121.88 1,218,283,054	2.75 2019/2/15	0.48
アメリカ	国債証券	US T 2.625% 20/8/15	15,000,000	7,665.03 1,149,755,835	7,774.11 1,166,117,671	2.625 2020/8/15	0.46
アメリカ	国債証券	US T 3.75% 18/11/15	13,000,000	8,626.21 1,121,408,153	8,749.41 1,137,423,503	3.75 2018/11/15	0.45
イギリス	国債証券	UKT 5% 12/03/07	7,560,000	13,658.79 1,032,605,245	13,729.69 1,037,965,214	5 2012/3/7	0.41
アメリカ	国債証券	US T 0.875% 12/01/31	12,000,000	8,258.55 991,026,783	8,259.83 991,180,776	0.875 2012/1/31	0.39
イタリア	国債証券	BTPS 6% 31/05/01	7,900,000	12,255.89 968,215,633	11,984.68 946,789,862	6 2031/5/1	0.37
アメリカ	国債証券	US T 2.375% 15/02/28	11,000,000	8,428.59 927,145,037	8,511.36 936,249,922	2.375 2015/2/28	0.37
イギリス	国債証券	UKT 4.5% 13/03/07	6,700,000	13,934.85 933,634,985	13,875.26 929,643,043	4.5 2013/3/7	0.37
イギリス	国債証券	UKT 2.25% 14/03/07	7,000,000	13,215.58 925,090,804	13,198.54 923,897,879	2.25 2014/3/7	0.36
アメリカ	国債証券	US T 1% 12/03/31	11,000,000	8,272.03 909,923,403	8,276.52 910,417,470	1 2012/3/31	0.36
フランス	国債証券	FRTR 3.0% 15/10/25	8,000,000	11,462.34 916,987,760	11,357.43 908,594,688	3 2015/10/25	0.36

アメリカ	国債証券	US T 2.125% 14/11/30	10,500,000	8,378.54 879,747,044	8,458.10 888,101,205	2.125 2014/11/30	0.35
アメリカ	国債証券	US T 4.375% 40/05/15	11,000,000	7,945.43 873,997,949	8,016.65 881,832,376	4.375 2040/5/15	0.35
フランス	国債証券	FRTR 3.75% 21/04/25	7,700,000	11,442.25 881,053,804	11,340.69 873,233,291	3.75 2021/4/25	0.34
アメリカ	国債証券	US T 2.625% 14/07/31	10,000,000	8,563.33 856,333,578	8,625.57 862,557,496	2.625 2014/7/31	0.34
アメリカ	国債証券	US T 2.375% 14/09/30	10,000,000	8,479.28 847,928,090	8,547.29 854,729,480	2.375 2014/9/30	0.34
アメリカ	国債証券	US T 2.5% 15/04/30	10,000,000	8,457.46 845,746,511	8,534.46 853,446,199	2.5 2015/4/30	0.34
イタリア	国債証券	BTPS 5% 12/02/01	7,400,000	11,507.32 851,542,111	11,494.82 850,617,087	5 2012/2/1	0.34
ドイツ	国債証券	DBR 5% 12/07/04	7,220,000	11,855.99 856,002,872	11,752.86 848,557,057	5 2012/7/4	0.33
アメリカ	国債証券	US T 1.75% 13/04/15	10,000,000	8,392.65 839,265,937	8,415.75 841,575,843	1.75 2013/4/15	0.33
アメリカ	国債証券	US T 1.75% 12/08/15	10,000,000	8,369.56 836,956,031	8,383.67 838,367,640	1.75 2012/8/15	0.33
アメリカ	国債証券	US T 4.625% 40/02/15	10,000,000	8,289.99 828,999,687	8,360.57 836,057,734	4.625 2040/2/15	0.33
アメリカ	国債証券	US T 1.375% 13/02/15	10,000,000	8,322.72 832,272,058	8,344.53 834,453,636	1.375 2013/2/15	0.33
アメリカ	国債証券	US T 1.375% 2013/01/15	10,000,000	8,323.36 832,336,218	8,343.25 834,325,308	1.375 2013/1/15	0.33
アメリカ	国債証券	US T 1.375% 12/11/15	10,000,000	8,322.07 832,207,890	8,341.32 834,132,812	1.375 2012/11/15	0.33

〔SMAM・マネーインカムファンド<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23年1月28日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量(口)	帳簿価額 単価/金額 (円)	評価額 単価/金額 (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	222,749,063	1.0073 224,375,542	1.0081 224,553,330	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。

<マネーインカム・マザーファンド 平成23年1月28日現在>

国/ 地域	種類	銘柄名	額面金額 (円)	帳簿価額 単価/金額 (円)	評価額 単価/金額 (円)	利率(%) / 償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第227回利付国債(10年)	143,000,000	100.61 143,882,739	100.18 143,270,270	1.6 2011/3/21	49.35
日本	国債証券	第231回利付国債(10年)	47,000,000	101.05 47,496,006	100.44 47,207,740	1.3 2011/6/20	16.26
日本	国債証券	第235回利付国債(10年)	46,000,000	101.27 46,585,625	101.10 46,508,760	1.4 2011/12/20	16.02
日本	国債証券	第234回利付国債(10年)	46,000,000	101.26 46,581,518	100.79 46,366,160	1.4 2011/9/20	15.97

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2011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

<2010>



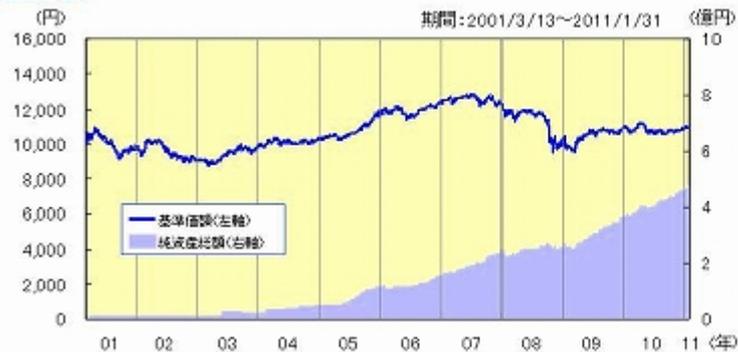
基準価額	10,954円
純資産総額	3億円

分配の推移

決算期	分配金
2010年12月	0円
2009年12月	0円
2008年12月	0円
2007年12月	0円
2006年12月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万円当たり、税引前です。
 ※直近計算期間を記載しています。

<2020>



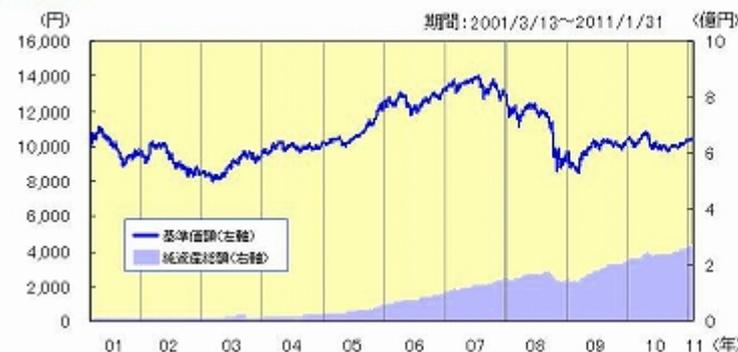
基準価額	10,911円
純資産総額	5億円

分配の推移

決算期	分配金
2010年12月	0円
2009年12月	0円
2008年12月	0円
2007年12月	0円
2006年12月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万円当たり、税引前です。
 ※直近計算期間を記載しています。

<2030>



基準価額	10,379円
純資産総額	3億円

分配の推移

決算期	分配金
2010年12月	0円
2009年12月	0円
2008年12月	0円
2007年12月	0円
2006年12月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万円当たり、税引前です。
 ※直近計算期間を記載しています。

<2040>



基準価額	9,814円
純資産総額	2億円

分配の推移

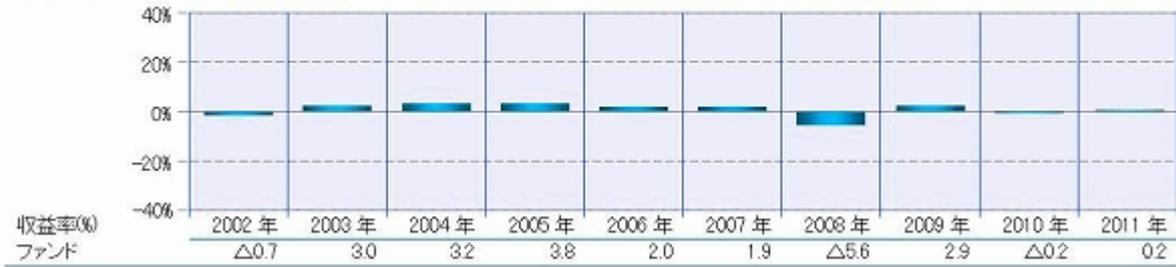
決算期	分配金
2010年12月	0円
2009年12月	0円
2008年12月	0円
2007年12月	0円
2006年12月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万円当たり、税引前です。
 ※直近計算期間を記載しています。

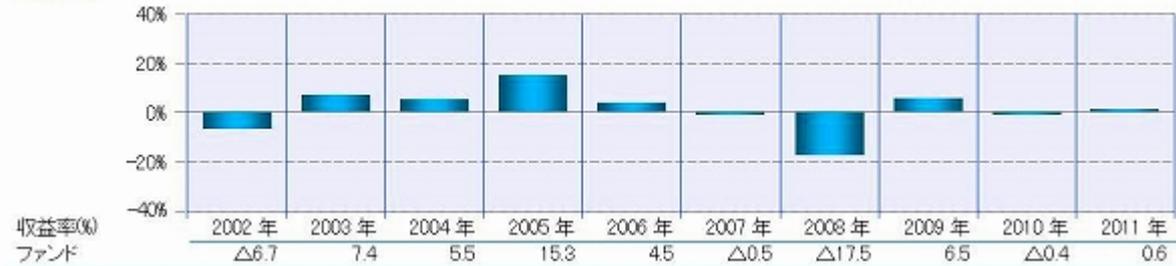
※基準価額は、1万円当たり、信託報酬控除後です。

年間収益率の推移(暦年ベース)

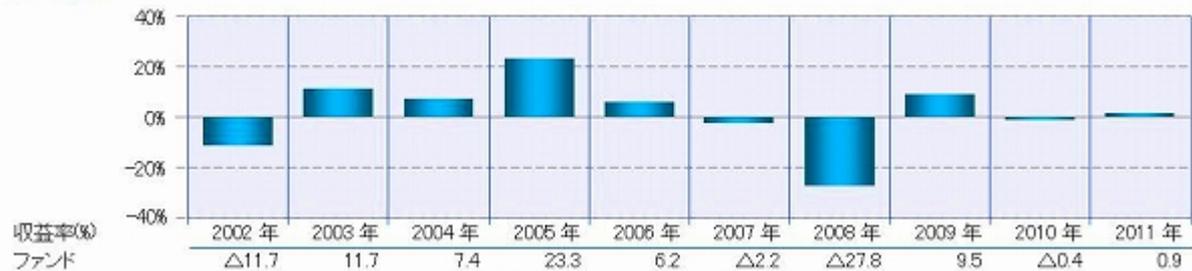
<2010>



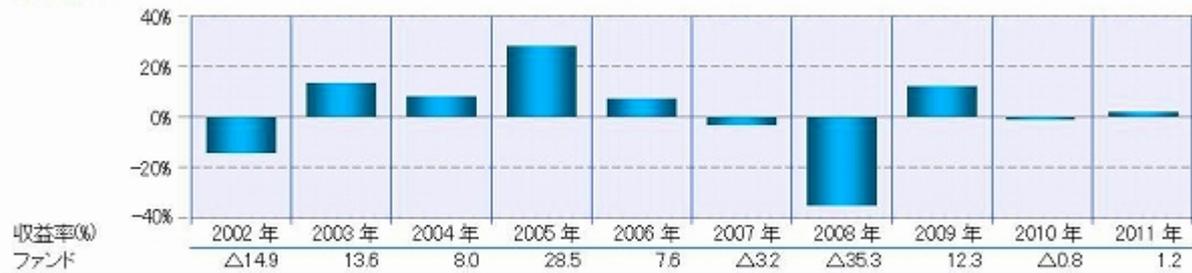
<2020>



<2030>



<2040>



2011年のファンドの収益率は、年初から2011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時まで取得申込みが行われ、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の申込受付分とします。

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

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

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

ファンドのお買付けに関しましては、クーリングオフ制度の適用はありません。

ロ 申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

ハ 申込手数料

無手数料です。

ニ 申込単位

お申込単位の詳細は、取扱いの販売会社または委託会社にお問い合わせください。

ホ 照会先

申込単位の詳細についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

ヘ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

ト 払込期日

取得申込者は、申込金額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数）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時までには解約請求のお申込みが行われ、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の解約請求受付分とします。

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

一部解約金は、解約請求受付日から起算して6営業日目からお支払いします。

一部解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

イ 基準価額の算出方法

基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を法令および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ことがあります。
- 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 ヶ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して 5 営業日目まで）から、販売会社において、決算日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払い前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として）に支払われます。
ただし、分配金自動再投資コースにかかる収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、累積投資契約に基づいて、毎計算期間終了日の翌営業日に再投資され、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 ヶ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も、何らの意思表示もない場合は、自動的に1年間更新されます。販売契約の内容は、必要に応じて、委託会社と販売会社との合意により変更されることがあります。

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、)に支払われます。

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

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

ロ 償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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」(以下「財務諸表等規則」といいます)(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」(以下「投資信託財産計算規則」といいます)(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。

また、第9期(平成20年12月23日から平成21年12月21日まで)については、改正前の財務諸表等規則および投資信託財産計算規則に基づき、第10期(平成21年12月22日から平成22年12月20日まで)については、改正後の財務諸表等規則および投資信託財産計算規則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9期(平成20年12月23日から平成21年12月21日まで)の財務諸表については、あずさ監査法人により監査を受け、第10期(平成21年12月22日から平成22年12月20日まで)の財務諸表については、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

なお、あずさ監査法人は、監査法人の種類の変更により平成22年7月1日をもって有限責任 あずさ監査法人となっております。

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9期 (平成21年12月21日現在)	第10期 (平成22年12月20日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,904,487	2,629,744
投資信託受益証券	300,035,462	324,173,010
未収利息	3	3
流動資産合計	302,939,952	326,802,757
資産合計	302,939,952	326,802,757
負債の部		
流動負債		
未払金	712,000	-
未払解約金	-	1,227,166
未払受託者報酬	59,426	66,847
未払委託者報酬	668,397	751,873
その他未払費用	4,394	4,946
流動負債合計	1,444,217	2,050,832
負債合計	1,444,217	2,050,832
純資産の部		
元本等		
元本	276,061,614	296,815,884
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	25,434,121	27,936,041
元本等合計	301,495,735	324,751,925
純資産合計	301,495,735	324,751,925
負債純資産合計	302,939,952	326,802,757

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第9期	第10期
	自 平成20年12月23日 至 平成21年12月21日	自 平成21年12月22日 至 平成22年12月20日
営業収益		
受取配当金	1,110,336	-
受取利息	3,964	577
有価証券売買等損益	8,660,793	2,146,548
その他収益	245	-
営業収益合計	9,775,338	2,147,125
営業費用		
受託者報酬	111,311	131,268
委託者報酬	1,252,036	1,476,535
その他費用	8,225	9,728
営業費用合計	1,371,572	1,617,531
営業利益	8,403,766	529,594
経常利益	8,403,766	529,594
当期純利益	8,403,766	529,594
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	147,549	39,441
期首剰余金又は期首欠損金()	13,029,068	25,434,121
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,946,588	5,290,062
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	4,946,588	5,290,062
剰余金減少額又は欠損金増加額	797,752	3,278,295
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	797,752	3,278,295
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金()	25,434,121	27,936,041

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第9期 自平成20年12月23日 至平成21年12月21日	第10期 自平成21年12月22日 至平成22年12月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券（売買目的有価証券）移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。なお、「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＞」および「SMAM・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞」投資信託受益証券については前日の基準価額で評価し、「SMAM・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）」および「SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞」投資信託受益証券については、当日の基準価額で評価しております。</p> <p>また、平成21年7月10日の信託約款の変更により、新たに上記の投資信託受益証券を投資対象とすることとし、平成20年12月23日に保有していた「SMAM・日本株式225ファンド」、「SMAM・国内債券インデックス・ファンド」、「ステート・ストリート外国株式インデックス・ファンド」および「ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンド」との銘柄入替を、平成21年9月18日に完了しております。</p>	<p>投資信託受益証券（売買目的有価証券）移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。なお、「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＞」および「SMAM・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞」投資信託受益証券については前日の基準価額で評価し、「SMAM・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）」および「SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞」投資信託受益証券については、当日の基準価額で評価しております。</p>
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>計算期間の取扱い 当計算期間は前期末および当期末が休日のため、平成20年12月23日から平成21年12月21日までとなっております。</p>	<p>計算期間の取扱い 当計算期間は前期末が休日のため、平成21年12月22日から平成22年12月20日までとなっております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	第9期 (平成21年12月21日現在)	第10期 (平成22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 276,061,614口	当計算期間の末日における受益権の総数 296,815,884口
2. 1単位当たり純資産額	1.0921円 (1万口 = 10,921円)	1.0941円 (1万口 = 10,941円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第9期 自平成20年12月23日 至平成21年12月21日	第10期 自平成21年12月22日 至平成22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(924,893円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(20,501,616円)、および分配準備積立金(8,092,202円)より、分配対象収益は29,518,711円(1万口当たり1,069.27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(92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(23,768,262円)、および分配準備積立金(7,969,652円)より、分配対象収益は31,738,006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。

(金融商品に関する注記)

(追加情報)

当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 平成20年3月10日)および「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日)を適用しております。

. 金融商品の状況に関する事項

項目	第10期 自平成21年12月22日 至平成22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、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 該当事項はありません。 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。 また、当ファンドは特定の投資信託受益証券を高位に組み入れ、原則として銘柄入替えを行わない方針ですので銘柄集中リスクがあります。 ただし、当ファンドが組み入れる特定の投資信託受益証券では、組み入れている投資信託受益証券で規定する投資方針等に基づいて多数の銘柄に分散投資が行われております。

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・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、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。リスクを管理する部署では、各種リスクごとに定められた頻度で、測定項目が上下限值（リミットあるいは注意レベル）内に収まっているかどうかのモニタリングを行っております。上下限値を越えていることが発見された場合は、原則として速やかに修正を行うよう、リスク管理を行う部署から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ます。また、是正勧告あるいは報告を受けた関連運用グループでは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、リスク管理を行う部署は、上下限値に抵触した事実ならびにその後の対処結果あるいは関連運用グループの対処方針の決定に関し、必要に応じて、リスク管理を行う部署の担当役員、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する体制となっております。</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	<p style="text-align: center;">第10期 自 平成21年12月22日 至 平成22年12月20日</p>
1．貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2．時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（投資信託受益証券） 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」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） 該当事項はありません。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 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9期(自平成20年12月23日至平成21年12月21日)

種類	貸借対照表計上額	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	300,035,462円	3,665,279円
合計	300,035,462円	3,665,279円

第10期(自平成21年12月22日至平成22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	1,691,345円
合計	1,691,345円

(デリバティブ取引に関する注記)

第9期(自平成20年12月23日至平成21年12月21日)

該当事項はありません。

第10期(平成22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9期(自平成20年12月23日至平成21年12月21日)

該当事項はありません。

第10期(自平成21年12月22日至平成22年12月20日)

該当事項はありません。

(その他の注記)

項目	第9期 (平成21年12月21日現在)	第10期 (平成22年12月20日現在)
期首元本額	225,537,810円	276,061,614円
期中追加設定元本額	64,237,153円	56,241,790円
期中一部解約元本額	13,713,349円	35,487,520円

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	口 数	評 価 額 (円)	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)	25,661,101	20,036,187	
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 >	130,811,285	145,723,771	
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)	16,447,019	16,476,623	
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 >	20,373,320	22,363,793	
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 >	118,859,480	119,572,636	
合 計			324,173,010	

【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9期 (平成21年12月21日現在)	第10期 (平成22年12月20日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,043,151	2,476,963
投資信託受益証券	364,737,899	458,795,865
未収入金	35,000	-
未収利息	2	3
流動資産合計	366,816,052	461,272,831
資産合計	366,816,052	461,272,831
負債の部		
流動負債		
未払金	1,125,000	-
未払受託者報酬	69,181	90,790
未払委託者報酬	778,208	1,021,279
その他未払費用	5,127	6,745
流動負債合計	1,977,516	1,118,814
負債合計	1,977,516	1,118,814
純資産の部		
元本等		
元本	338,380,695	423,280,286
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	26,457,841	36,873,731
元本等合計	364,838,536	460,154,017
純資産合計	364,838,536	460,154,017
負債純資産合計	366,816,052	461,272,831

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第9期 自 平成20年12月23日 至 平成21年12月21日	第10期 自 平成21年12月22日 至 平成22年12月20日
営業収益		
受取配当金	1,208,090	-
受取利息	4,899	1,083
有価証券売買等損益	18,678,996	6,263,967
その他収益	783	-
営業収益合計	19,892,768	6,265,050
営業費用		
受託者報酬	125,704	171,731
委託者報酬	1,414,037	1,931,799
その他費用	9,301	12,749
営業費用合計	1,549,042	2,116,279
営業利益	18,343,726	4,148,771
経常利益	18,343,726	4,148,771
当期純利益	18,343,726	4,148,771
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	294,438	87,642
期首剰余金又は期首欠損金()	3,158,032	26,457,841
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,430,905	8,456,300
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	5,430,905	8,456,300
剰余金減少額又は欠損金増加額	180,384	2,101,539
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	180,384	2,101,539
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金()	26,457,841	36,873,731

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第9期 自平成20年12月23日 至平成21年12月21日	第10期 自平成21年12月22日 至平成22年12月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券（売買目的有価証券）移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。なお、「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＞」および「SMAM・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞」投資信託受益証券については前日の基準価額で評価し、「SMAM・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）」および「SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞」投資信託受益証券については、当日の基準価額で評価しております。</p> <p>また、平成21年7月10日の信託約款の変更により、新たに上記の投資信託受益証券を投資対象とすることとし、平成20年12月23日に保有していた「SMAM・日本株式225ファンド」、「SMAM・国内債券インデックス・ファンド」、「ステート・ストリート外国株式インデックス・ファンド」および「ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンド」との銘柄入替を、平成21年9月18日に完了しております。</p>	<p>投資信託受益証券（売買目的有価証券）移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。なお、「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＞」および「SMAM・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞」投資信託受益証券については前日の基準価額で評価し、「SMAM・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）」および「SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞」投資信託受益証券については、当日の基準価額で評価しております。</p>
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>計算期間の取扱い 当計算期間は前期末および当期末が休日のため、平成20年12月23日から平成21年12月21日までとなっております。</p>	<p>計算期間の取扱い 当計算期間は前期末が休日のため、平成21年12月22日から平成22年12月20日までとなっております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	第9期 (平成21年12月21日現在)	第10期 (平成22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 338,380,695口	当計算期間の末日における受益権の総数 423,280,286口
2. 1単位当たり純資産額	1.0782円 (1万口 = 10,782円)	1.0871円 (1万口 = 10,871円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第9期 自平成20年12月23日 至平成21年12月21日	第10期 自平成21年12月22日 至平成22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(1,090,689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(64,536,712円)、および分配準備積立金(14,444,771円)より、分配対象収益は80,072,172円(1万口当たり2,366.33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(660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(85,673,127円)、および分配準備積立金(14,489,369円)より、分配対象収益は100,163,156円(1万口当たり2,366.35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)

(追加情報)

当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 平成20年3月10日)および「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日)を適用しております。

. 金融商品の状況に関する事項

項目	第10期 自平成21年12月22日 至平成22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 該当事項はありません。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 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。 また、当ファンドは特定の投資信託受益証券を高位に組み入れ、原則として銘柄入替えを行わない方針ですので銘柄集中リスクがあります。 ただし、当ファンドが組み入れる特定の投資信託受益証券では、組み入れている投資信託受益証券で規定する投資方針等に基づいて多数の銘柄に分散投資が行われております。</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・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、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。リスクを管理する部署では、各種リスクごとに定められた頻度で、測定項目が上下限值(リミットあるいは注意レベル)内に収まっているかどうかのモニタリングを行っております。上下限値を越えていることが発見された場合は、原則として速やかに修正を行うよう、リスク管理を行う部署から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ます。また、是正勧告あるいは報告を受けた関連運用グループでは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、リスク管理を行う部署は、上下限値に抵触した事実ならびにその後の対処結果あるいは関連運用グループの対処方針の決定に関し、必要に応じて、リスク管理を行う部署の担当役員、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する体制となっております。</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	<p style="text-align: center;">第10期 自 平成21年12月22日 至 平成22年12月20日</p>
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(投資信託受益証券) 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」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) 該当事項はありません。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 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9期（自平成20年12月23日 至 平成21年12月21日）

種類	貸借対照表計上額	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	364,737,899円	6,124,585円
合計	364,737,899円	6,124,585円

第10期（自平成21年12月22日 至 平成22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	5,215,154円
合計	5,215,154円

（デリバティブ取引に関する注記）

第9期（自平成20年12月23日 至 平成21年12月21日）

該当事項はありません。

第10期（平成22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9期（自平成20年12月23日 至 平成21年12月21日）

該当事項はありません。

第10期（自平成21年12月22日 至 平成22年12月20日）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項目	第9期 (平成21年12月21日現在)	第10期 (平成22年12月20日現在)
期首元本額	255,420,971円	338,380,695円
期中追加設定元本額	95,242,920円	111,793,677円
期中一部解約元本額	12,283,196円	26,894,086円

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	口数	評価額(円)	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)	106,525,764	83,175,316	
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>	230,872,317	257,191,761	
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)	54,968,776	55,067,719	
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>	49,537,145	54,376,924	
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>	8,930,562	8,984,145	
合計			458,795,865	

【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9期 (平成21年12月21日現在)	第10期 (平成22年12月20日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,266,621	2,355,632
投資信託受益証券	213,855,469	265,763,399
未収入金	15,000	-
未収利息	1	3
流動資産合計	215,137,091	268,119,034
資産合計	215,137,091	268,119,034
負債の部		
流動負債		
未払金	-	685,000
未払解約金	575,086	-
未払受託者報酬	41,622	51,552
未払委託者報酬	468,202	579,948
その他未払費用	3,055	3,802
流動負債合計	1,087,965	1,320,302
負債合計	1,087,965	1,320,302
純資産の部		
元本等		
元本	210,515,040	258,835,963
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	3,534,086	7,962,769
元本等合計	214,049,126	266,798,732
純資産合計	214,049,126	266,798,732
負債純資産合計	215,137,091	268,119,034

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第9期	第10期
	自平成20年12月23日 至平成21年12月21日	自平成21年12月22日 至平成22年12月20日
営業収益		
受取配当金	610,003	-
受取利息	2,942	508
有価証券売買等損益	14,990,649	4,853,930
その他収益	2,073	1,672
営業収益合計	15,605,667	4,856,110
営業費用		
受託者報酬	74,281	99,516
委託者報酬	835,628	1,119,431
その他費用	5,447	7,334
営業費用合計	915,356	1,226,281
営業利益	14,690,311	3,629,829
経常利益	14,690,311	3,629,829
当期純利益	14,690,311	3,629,829
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	281,000	92,382
期首剰余金又は期首欠損金()	10,457,315	3,534,086
剰余金増加額又は欠損金減少額	614,386	1,077,329
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	614,386	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	1,077,329
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,032,296	186,093
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	186,093
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,032,296	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金()	3,534,086	7,962,769

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第9期 自平成20年12月23日 至平成21年12月21日	第10期 自平成21年12月22日 至平成22年12月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券（売買目的有価証券）移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。なお、「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＞」および「SMAM・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞」投資信託受益証券については前日の基準価額で評価し、「SMAM・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）」および「SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞」投資信託受益証券については、当日の基準価額で評価しております。</p> <p>また、平成21年7月10日の信託約款の変更により、新たに上記の投資信託受益証券を投資対象とすることとし、平成20年12月23日に保有していた「SMAM・日本株式225ファンド」、「SMAM・国内債券インデックス・ファンド」、「ステート・ストリート外国株式インデックス・ファンド」および「ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンド」との銘柄入替を、平成21年9月18日に完了しております。</p>	<p>投資信託受益証券（売買目的有価証券）移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。なお、「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＞」および「SMAM・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞」投資信託受益証券については前日の基準価額で評価し、「SMAM・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）」および「SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞」投資信託受益証券については、当日の基準価額で評価しております。</p>
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>計算期間の取扱い 当計算期間は前期末および当期末が休日のため、平成20年12月23日から平成21年12月21日までとなっております。</p>	<p>計算期間の取扱い 当計算期間は前期末が休日のため、平成21年12月22日から平成22年12月20日までとなっております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	第9期 (平成21年12月21日現在)	第10期 (平成22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 210,515,040口	当計算期間の末日における受益権の総数 258,835,963口
2. 1単位当たり純資産額	1.0168円 (1万口=10,168円)	1.0308円 (1万口=10,308円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第9期 自平成20年12月23日 至平成21年12月21日	第10期 自平成21年12月22日 至平成22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(556,712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(56,347,279円)、および分配準備積立金(11,512,715円)より、分配対象収益は68,416,706円(1万口当たり3,249.96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(1,567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(72,575,315円)、および分配準備積立金(11,545,470円)より、分配対象収益は84,122,352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。

(金融商品に関する注記)

(追加情報)

当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 平成20年3月10日)および「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日)を適用しております。

. 金融商品の状況に関する事項

項目	第10期 自平成21年12月22日 至平成22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 該当事項はありません。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 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。 また、当ファンドは特定の投資信託受益証券を高位に組み入れ、原則として銘柄入替えを行わない方針ですので銘柄集中リスクがあります。 ただし、当ファンドが組み入れる特定の投資信託受益証券では、組み入れている投資信託受益証券で規定する投資方針等に基づいて多数の銘柄に分散投資が行われております。</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・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、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。リスクを管理する部署では、各種リスクごとに定められた頻度で、測定項目が上下限值（リミットあるいは注意レベル）内に収まっているかどうかのモニタリングを行っております。上下限値を越えていることが発見された場合は、原則として速やかに修正を行うよう、リスク管理を行う部署から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ます。また、是正勧告あるいは報告を受けた関連運用グループでは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、リスク管理を行う部署は、上下限値に抵触した事実ならびにその後の対処結果あるいは関連運用グループの対処方針の決定に関し、必要に応じて、リスク管理を行う部署の担当役員、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する体制となっております。</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	<p style="text-align: center;">第10期 自 平成21年12月22日 至 平成22年12月20日</p>
1．貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2．時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（投資信託受益証券） 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」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） 該当事項はありません。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 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9期（自平成20年12月23日 至 平成21年12月21日）

種類	貸借対照表計上額	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	213,855,469円	2,842,361円
合計	213,855,469円	2,842,361円

第10期（自平成21年12月22日 至 平成22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	4,373,096円
合計	4,373,096円

（デリバティブ取引に関する注記）

第9期（自平成20年12月23日 至 平成21年12月21日）

該当事項はありません。

第10期（平成22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9期（自平成20年12月23日 至 平成21年12月21日）

該当事項はありません。

第10期（自平成21年12月22日 至 平成22年12月20日）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項目	第9期 (平成21年12月21日現在)	第10期 (平成22年12月20日現在)
期首元本額	156,536,227円	210,515,040円
期中追加設定元本額	63,896,452円	58,503,162円
期中一部解約元本額	9,917,639円	10,182,239円

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	口数	評価額(円)	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)	114,174,536	89,147,477	
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>	89,552,402	99,761,375	
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)	45,759,484	45,841,851	
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>	23,530,435	25,829,358	
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>	5,152,424	5,183,338	
合計			265,763,399	

【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9期 (平成21年12月21日現在)	第10期 (平成22年12月20日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,143,215	1,528,948
投資信託受益証券	186,918,739	231,234,162
未収利息	2	2
流動資産合計	189,061,956	232,763,112
資産合計	189,061,956	232,763,112
負債の部		
流動負債		
未払金	333,000	-
未払解約金	-	256,768
未払受託者報酬	37,175	44,655
未払委託者報酬	418,172	502,363
その他未払費用	2,728	3,285
流動負債合計	791,075	807,071
負債合計	791,075	807,071
純資産の部		
元本等		
元本	196,953,425	238,807,427
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	8,682,544	6,851,386
元本等合計	188,270,881	231,956,041
純資産合計	188,270,881	231,956,041
負債純資産合計	189,061,956	232,763,112

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第9期	第10期
	自平成20年12月23日 至平成21年12月21日	自平成21年12月22日 至平成22年12月20日
営業収益		
受取配当金	311,295	-
受取利息	2,684	417
有価証券売買等損益	16,840,392	4,822,423
その他収益	42	-
営業収益合計	17,154,413	4,822,840
営業費用		
受託者報酬	66,958	87,210
委託者報酬	753,161	980,983
その他費用	4,905	6,409
営業費用合計	825,024	1,074,602
営業利益	16,329,389	3,748,238
経常利益	16,329,389	3,748,238
当期純利益	16,329,389	3,748,238
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	933,746	222,841
期首剰余金又は期首欠損金()	22,027,424	8,682,544
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,382,394	459,541
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,382,394	459,541
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,433,157	2,153,780
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,433,157	2,153,780
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金()	8,682,544	6,851,386

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第9期 自平成20年12月23日 至平成21年12月21日	第10期 自平成21年12月22日 至平成22年12月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券（売買目的有価証券）移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。なお、「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＞」および「SMAM・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞」投資信託受益証券については前日の基準価額で評価し、「SMAM・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）」および「SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞」投資信託受益証券については、当日の基準価額で評価しております。</p> <p>また、平成21年7月10日の信託約款の変更により、新たに上記の投資信託受益証券を投資対象とすることとし、平成20年12月23日に保有していた「SMAM・日本株式225ファンド」、「SMAM・国内債券インデックス・ファンド」、「ステート・ストリート外国株式インデックス・ファンド」および「ステート・ストリート外国債券インデックス・ファンド」との銘柄入替を、平成21年9月18日に完了しております。</p>	<p>投資信託受益証券（売買目的有価証券）移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、投資信託受益証券の基準価額で評価しております。なお、「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＞」および「SMAM・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞」投資信託受益証券については前日の基準価額で評価し、「SMAM・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）」および「SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞」投資信託受益証券については、当日の基準価額で評価しております。</p>
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>計算期間の取扱い 当計算期間は前期末および当期末が休日のため、平成20年12月23日から平成21年12月21日までとなっております。</p>	<p>計算期間の取扱い 当計算期間は前期末が休日のため、平成21年12月22日から平成22年12月20日までとなっております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	第9期 (平成21年12月21日現在)	第10期 (平成22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 196,953,425口	当計算期間の末日における受益権の総数 238,807,427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 8,682,544円	「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 6,851,386円
3. 1単位当たり純資産額	0.9559円 (1万口=9,559円)	0.9713円 (1万口=9,713円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第9期 自平成20年12月23日 至平成21年12月21日	第10期 自平成21年12月22日 至平成22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(277,473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(55,081,819円)、および分配準備積立金(9,299,298円)より、分配対象収益は64,658,590円(1万口当たり3,282.93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(310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(69,301,382円)、および分配準備積立金(9,097,589円)より、分配対象収益は78,399,281円(1万口当たり3,282.94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)

(追加情報)

当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 平成20年3月10日)および「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日)を適用しております。

. 金融商品の状況に関する事項

項目	第10期 自平成21年12月22日 至平成22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、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 該当事項はありません。 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>(2) 金融商品に係るリスク</p> <p>有価証券およびデリバティブ取引等</p> <p>当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p> <p>また、当ファンドは特定の投資信託受益証券を高位に組み入れ、原則として銘柄入替えを行わない方針ですので銘柄集中リスクがあります。</p> <p>ただし、当ファンドが組み入れる特定の投資信託受益証券では、組み入れている投資信託受益証券で規定する投資方針等に基づいて多数の銘柄に分散投資が行われております。</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・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、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。リスクを管理する部署では、各種リスクごとに定められた頻度で、測定項目が上下限值（リミットあるいは注意レベル）内に収まっているかどうかのモニタリングを行っております。上下限値を越えていることが発見された場合は、原則として速やかに修正を行うよう、リスク管理を行う部署から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ます。また、是正勧告あるいは報告を受けた関連運用グループでは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、リスク管理を行う部署は、上下限値に抵触した事実ならびにその後の対処結果あるいは関連運用グループの対処方針の決定に関し、必要に応じて、リスク管理を行う部署の担当役員、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する体制となっております。</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10期
	自平成21年12月22日 至平成22年12月20日
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）</p> <p>「重要な会計方針に係る事項に関する注記」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）</p> <p>該当事項はありません。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>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9期（自平成20年12月23日 至 平成21年12月21日）

種類	貸借対照表計上額	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	186,918,739円	2,105,453円
合計	186,918,739円	2,105,453円

第10期（自平成21年12月22日 至 平成22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	4,406,250円
合計	4,406,250円

（デリバティブ取引に関する注記）

第9期（自平成20年12月23日 至 平成21年12月21日）

該当事項はありません。

第10期（平成22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9期（自平成20年12月23日 至 平成21年12月21日）

該当事項はありません。

第10期（自平成21年12月22日 至 平成22年12月20日）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項目	第9期 (平成21年12月21日現在)	第10期 (平成22年12月20日現在)
期首元本額	156,842,820円	196,953,425円
期中追加設定元本額	57,723,829円	52,737,375円
期中一部解約元本額	17,613,224円	10,883,373円

（４）【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

種 類	銘 柄	口 数	評 価 額 (円)	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）	146,893,111	114,694,141	
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＞	36,492,517	40,652,663	
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）	48,993,047	49,081,234	
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＞	20,333,708	22,320,311	
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＞	4,459,059	4,485,813	
合 計			231,234,162	

（参考）

[「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）」の状況](#)

[「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](#)

[「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](#)

[「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＞」の状況](#)

[「S M A M ・ 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】

〔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23年1月31日現在

資産総額	323,173,691 円
負債総額	254,695 円
純資産総額(-)	322,918,996 円
発行済口数	294,808,678 口
1口当たり純資産額(/)	1.0954 円
(1万口当たり純資産額	10,954 円)

〔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23年1月31日現在

資産総額	474,053,456 円
負債総額	713,678 円
純資産総額(-)	473,339,778 円
発行済口数	433,820,279 口
1口当たり純資産額(/)	1.0911 円
(1万口当たり純資産額	10,911 円)

〔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23年1月31日現在

資産総額	274,214,109 円
負債総額	574,077 円
純資産総額(-)	273,640,032 円
発行済口数	263,642,377 口
1口当たり純資産額(/)	1.0379 円
(1万口当たり純資産額	10,379 円)

〔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23年1月31日現在

資産総額	236,099,235 円
負債総額	705,262 円
純資産総額(-)	235,393,973 円
発行済口数	239,865,492 口
1口当たり純資産額(/)	0.9814 円
(1万口当たり純資産額	9,814 円)

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

イ 名義書換

該当事項はありません。

ロ 受益者名簿

作成しません。

ハ 受益者に対する特典

ありません。

ニ 受益権の譲渡および譲渡制限等

(イ) 受益権の譲渡

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

(ロ) 受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件

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

ホ 受益権の再分割

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

ヘ 償還金

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

ト 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

イ 資本金の額および株式数

平成23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ます。

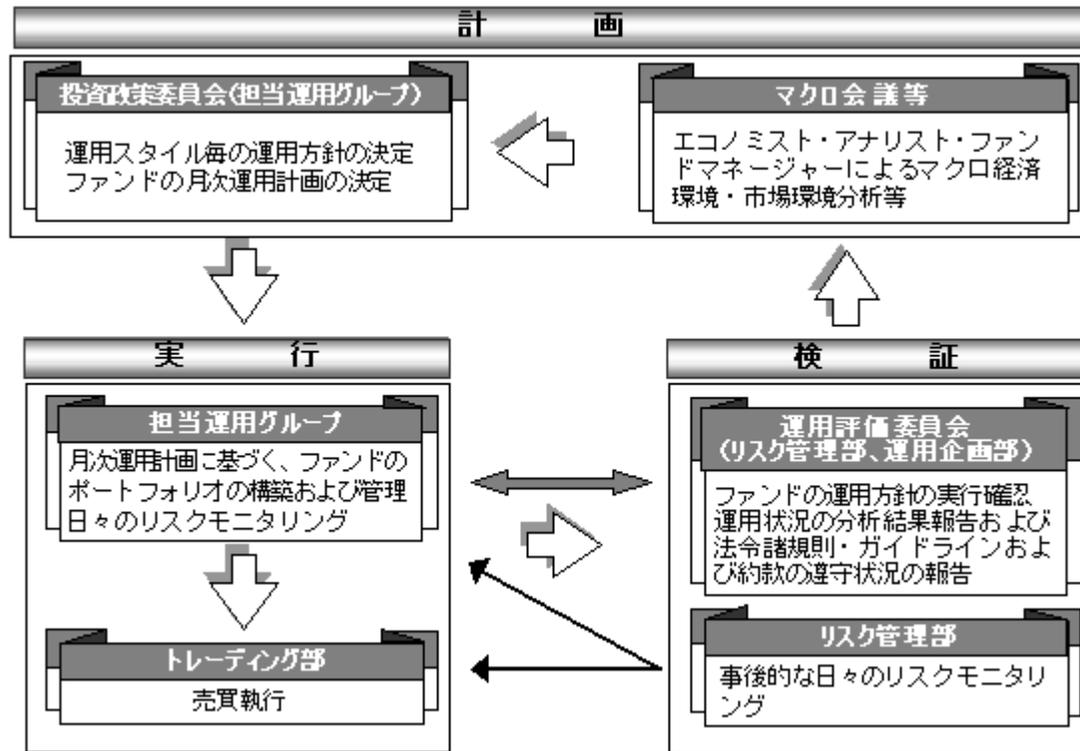
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役を若干名を選定します。

また、取締役会の決議によって、取締役社長を1名選定し、必要に応じて取締役会長1名のほか、取締役副社長、専務取締役、常務取締役を若干名選定することができます。

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23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23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	63 (1)	133,737 (191)
	追加型	260 (121)	4,949,638 (3,214,547)
	計	323 (122)	5,083,374 (3,214,738)
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		323 (122)	5,083,374 (3,214,738)

()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、第24期（平成20年4月1日から平成21年3月31日まで）については、改正前の「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、第25期（平成21年4月1日から平成22年3月31日まで）については、改正後の「財務諸表等規則」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、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24期（平成20年4月1日から平成21年3月31日まで）及び第25期（平成21年4月1日から平成22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、あずさ監査法人の監査を受けており、第26期中間会計期間（平成22年4月1日から平成22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。

なお、あずさ監査法人は、監査法人の種類の変更により平成22年7月1日付をもって、名称を有限責任 あずさ監査法人に変更しております。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	第 24 期 (平成21年3月31日現在)	第 25 期 (平成22年3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金及び預金	2 15,883,303	15,484,883
有価証券	2,998,947	2,999,185
前払費用	323,949	248,594
未収入金	3,593	6,524
未収委託者報酬	2,158,082	3,405,895
未収運用受託報酬	635,902	456,672
未収投資助言報酬	2 406,959	426,716
未収収益	8,062	7,020
未収還付法人税等	1,068,737	-
未収還付消費税等	182,000	-
繰延税金資産	68,795	244,770
その他の流動資産	2,641	1,392
流動資産計	23,740,977	23,281,654
固定資産		
有形固定資産		
建物	1 169,629	173,574
器具備品	200,701	150,631
有形固定資産合計	370,331	324,206
無形固定資産		
電話加入権	1 161	150
商標権	8,104	6,160
無形固定資産合計	8,266	6,310
投資その他の資産		
投資有価証券	2,542,125	6,923,150
関係会社株式	236,178	236,178

長期差入保証金	783,231	681,764
長期前払費用	14,643	7,822
会員権	20,113	20,113
繰延税金資産	34,393	524,820
投資その他の資産合計	3,630,686	8,393,850
固定資産計	4,009,284	8,724,367
資産合計	27,750,261	32,006,022

(単位：千円)

	第 24 期 (平成21年3月31日現在)	第 25 期 (平成22年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	44,497	46,362
未払金		
未払収益分配金	947	943
未払償還金	23,376	18,453
未払手数料	2 891,493	1,523,402
その他未払金	112,743	71,728
未払費用	612,126	869,497
未払消費税等	-	74,053
未払法人税等	-	1,264,485
賞与引当金	291,836	293,651
流動負債計	1,977,020	4,162,578
固定負債		
退職給付引当金	972,202	1,137,766
固定負債計	972,202	1,137,766
負債合計	2,949,223	5,300,344
(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	12,356,655	14,172,932
利益剰余金合計	14,177,860	15,994,137
株主資本計	24,806,844	26,623,121
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	5,805	82,556
評価・換算差額等計	5,805	82,556
純資産合計	24,801,038	26,705,677
負債・純資産合計	27,750,261	32,006,022

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

	第 24 期 （自 平成20年 4月 1日 至 平成21年 3月31日）	第 25 期 （自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日）
営業収益		
委託者報酬	20,072,582	21,113,167
運用受託報酬	3,506,635	2,492,177
投資助言報酬	2,048,748	1,893,038
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	60,260	43,853
その他	2,749	12,348
営業収益計	25,695,976	25,559,586
営業費用		
支払手数料	9,326,200	9,706,627
広告宣伝費	529,276	420,508
公告費	1,227	2,339
調査費		
調査費	538,515	579,477
委託調査費	1,310,113	1,556,961
営業雑経費		
通信費	30,202	31,515
印刷費	302,661	278,539
協会費	23,322	19,271
諸会費	14,373	12,955
情報機器関連費	2,036,426	2,005,507
販売促進費	55,223	13,183
その他	55,485	66,833
営業費用計	14,223,029	14,693,722
一般管理費		

給料		
役員報酬	174,486	155,835
給料・手当	4,004,575	4,192,414
賞与	1,051,279	719,290
賞与引当金繰入額	291,836	293,651
交際費	23,229	19,087
寄付金	4,000	23
事務委託費	356,543	195,150
旅費交通費	258,981	197,842
租税公課	81,166	86,095
不動産賃借料	762,812	714,209
退職給付費用	262,634	197,352
固定資産減価償却費	119,811	97,916
諸経費	281,968	280,916
一般管理費計	7,673,326	7,149,786
営業利益	3,799,620	3,716,077

営業外収益			
受取配当金		-	1,710
有価証券利息		22,216	4,645
受取利息	1	36,255	16,592
為替差益		11,209	-
時効成立分配金・償還金		7,832	3,492
原稿・講演料		3,910	3,255
還付加算金		-	37,708
雑収入		4,132	6,291
営業外収益計		85,555	73,696
営業外費用			
為替差損		-	5,113
時効成立後支払分配金・償還金		693	-
雑損失		82	-
営業外費用計		775	5,113
経常利益		3,884,401	3,784,660
特別利益			
投資有価証券償還益		1,136	2,459
投資有価証券売却益		122	31,117
特別利益計		1,259	33,577
特別損失			
固定資産除却損	2	688	5,302
投資有価証券償還損		84,238	-
投資有価証券評価損		65,553	51,557
投資有価証券売却損		464,272	2,724
特別損失計		614,753	59,583
税引前当期純利益		3,270,907	3,758,653
法人税、住民税及び事業税		1,206,047	1,817,726
法人税等調整額		369,088	722,069
法人税等合計		1,575,135	1,095,656
当期純利益		1,695,771	2,662,997

（３）【株主資本等変動計算書】

（単位：千円）

	第 24 期 （自 平成20年 4月 1日 至 平成21年 3月31日）	第 25 期 （自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日）
株主資本		
資本金		
前期末残高	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		
前期末残高	8,628,984	8,628,984
当期末残高	8,628,984	8,628,984
資本剰余金合計		
前期末残高	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		
前期末残高	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		
前期末残高	60,000	60,000
当期末残高	60,000	60,000
別途積立金		
前期末残高	1,476,959	1,476,959
当期末残高	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金		
前期末残高	13,483,283	12,356,655
当期変動額		

剰余金の配当	2,822,400	846,720
当期純利益	1,695,771	2,662,997
当期変動額合計	1,126,628	1,816,277
当期末残高	12,356,655	14,172,932
利益剰余金合計		
前期末残高	15,304,488	14,177,860
当期変動額		
剰余金の配当	2,822,400	846,720
当期純利益	1,695,771	2,662,997
当期変動額合計	1,126,628	1,816,277
当期末残高	14,177,860	15,994,137
株主資本合計		
前期末残高	25,933,472	24,806,844
当期変動額		
剰余金の配当	2,822,400	846,720
当期純利益	1,695,771	2,662,997
当期変動額合計	1,126,628	1,816,277
当期末残高	24,806,844	26,623,121

評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
前期末残高	25,392	5,805
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	31,197	88,361
当期変動額合計	31,197	88,361
当期末残高	5,805	82,556
評価・換算差額合計		
前期末残高	25,392	5,805
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	31,197	88,361
当期変動額合計	31,197	88,361
当期末残高	5,805	82,556
純資産合計		
前期末残高	25,958,864	24,801,038
当期変動額		
剰余金の配当	2,822,400	846,720
当期純利益	1,695,771	2,662,997
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	31,197	88,361
当期変動額合計	1,157,826	1,904,639
当期末残高	24,801,038	26,705,677

重要な会計方針

項目	第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)
1 有価証券の評価基準及び評価方法	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 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	満期保有目的の債券 同左 子会社株式及び関連会社株式 同左 その他有価証券 時価のあるもの 同左 時価のないもの 同左
2 固定資産の減価償却の方法	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 無形固定資産 定額法によっております。	有形固定資産 同左 無形固定資産 同左
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期の負担額を計上し ております。	同左

(2) 退職給付引当金	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>（会計方針の変更）</p> <p>当事業年度より、「退職給付に係る会計基準」の一部改正（その3）（企業会計基準第19号 平成20年7月31日）を適用しております。この変更が当事業年度の損益に与える影響はありません。また、本会計基準の適用に伴い発生する退職給付債務の差額はありませぬ。</p>
4 リース取引の処理方法	<p>所有権移転外ファイナンス・リース取引のうち、リース取引開始日が平成20年4月1日前に開始する事業年度に属するものについては、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。</p>	-
5 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>消費税等の会計処理は税抜方式によっております。</p>	同左

会計方針の変更

(会計処理の変更)

第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)
<p>リース取引に関する会計基準</p> <p>所有権移転外ファイナンス・リース取引については、従来、賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっておりましたが、企業会計基準第13号「リース取引に関する会計基準」（平成19年3月30日 企業会計基準委員会）及び企業会計基準適用指針第16号「リース取引に関する会計基準の適用指針」（同前）が平成20年4月1日以後開始する事業年度から適用されることになったことに伴い、当事業年度から同会計基準及び適用指針を適用しております。</p> <p>当事業年度において、通常の売買取引に係る方法に準じた会計処理による取引はありません。</p>	-

注記事項

(貸借対照表関係)

第24期 (平成21年3月31日現在)	第25期 (平成22年3月31日現在)
<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p> 建物 150,704千円</p> <p> 器具備品 941,423千円</p> <p>無形固定資産の減価償却累計額</p> <p> 電話加入権 72千円</p> <p> 商標権 11,337千円</p>	<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p> 建物 172,855千円</p> <p> 器具備品 863,358千円</p> <p>無形固定資産の減価償却累計額</p> <p> 電話加入権 83千円</p> <p> 商標権 13,282千円</p>
<p>2 関係会社に対する債権債務</p> <p> 現金及び預金 10,311,398千円</p> <p> 未収投資助言報酬 398,818千円</p> <p> 未払手数料 331,400千円</p>	<p>2 関係会社に対する債権債務</p> <p> 現金及び預金 10,591,647千円</p> <p> 未収投資助言報酬 295,911千円</p> <p> 未払手数料 441,536千円</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128,926千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102,815千円の支払保証を行っております。</p>

（損益計算書関係）

第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)
1 関係会社との取引に係るもの 受取利息 18,943千円	1 関係会社との取引に係るもの 受取利息 5,916千円
2 固定資産除却損は、器具備品688千円であります。	2 固定資産除却損は、器具備品5,302千円であります。

（株主資本等変動計算書関係）

第24期(自平成20年4月1日至平成21年3月31日)

1.発行済株式数に関する事項

	前期末株式数	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20年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,822,400	160,000	平成20年 3月31日	平成20年 6月24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21年6月30日開催の第24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21年6月30日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	846,720	48,000	平成21年 3月31日	平成21年 7月1日

第25期(自平成21年4月1日至平成22年3月31日)

1.発行済株式数に関する事項

	前期末株式数	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21年6月30日 定時株主総会	普通株式	846,720	48,000	平成21年 3月31日	平成21年 7月1日

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

平成22年6月24日開催の第25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22年6月24日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	1,323,000	75,000	平成22年 3月31日	平成22年 6月25日

(リース取引関係)

第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)																		
<p>1. リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引 (借主側)</p> <p>リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額(単位：千円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="text-align: left;">器具備品</th> <th style="text-align: right;">合計</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>取得価額相当額</td> <td style="text-align: right;">5,330 5,330</td> </tr> <tr> <td>減価償却累計額相当額</td> <td style="text-align: right;">5,330 5,330</td> </tr> <tr> <td>期末残高相当額</td> <td style="text-align: right;">- -</td> </tr> </tbody> </table> <p>未経過リース料期末残高相当額(単位：千円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tbody> <tr> <td style="padding-left: 20px;">1年以内</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> <tr> <td>合計</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> </tbody> </table> <p>支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額 (単位：千円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tbody> <tr> <td>支払リース料</td> <td style="text-align: right;">2,067</td> </tr> <tr> <td>減価償却費相当額</td> <td style="text-align: right;">1,900</td> </tr> <tr> <td>支払利息相当額</td> <td style="text-align: right;">37</td> </tr> </tbody> </table> <p>減価償却費相当額及び利息相当額の算定方法</p> <p>減価償却費相当額の算定方法</p> <ul style="list-style-type: none"> ・リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。 <p>利息相当額の算定方法</p> <ul style="list-style-type: none"> ・リース料総額とリース物件の取得価額相当額との差額を利息相当額とし、各期への配分方法については、利息法によっております。 	器具備品	合計	取得価額相当額	5,330 5,330	減価償却累計額相当額	5,330 5,330	期末残高相当額	- -	1年以内	-	合計	-	支払リース料	2,067	減価償却費相当額	1,900	支払利息相当額	37	-
器具備品	合計																		
取得価額相当額	5,330 5,330																		
減価償却累計額相当額	5,330 5,330																		
期末残高相当額	- -																		
1年以内	-																		
合計	-																		
支払リース料	2,067																		
減価償却費相当額	1,900																		
支払利息相当額	37																		

2. オペレーティング・リース取引 (借主側)		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)		未経過リース料(解約不能のもの)(単位:千円)	
1年以内	710,121	1年以内	667,234
<u>1年超</u>	<u>962,627</u>	<u>1年超</u>	<u>1,608,004</u>
合計	1,672,748	合計	2,275,239

（金融商品関係）

第25期(自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)

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

平成22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	15,484,883	15,484,883	-
(2)未収委託者報酬	3,405,895	3,405,895	-
(3)未収運用受託報酬	456,672	456,672	-
(4)未収投資助言報酬	426,716	426,716	-
(5)有価証券及び投資有価証券			
満期保有目的の債券	2,999,185	2,999,100	85
その他有価証券	6,874,409	6,874,409	-
(6)長期差入保証金	681,764	681,764	-
資産計	30,329,527	30,329,442	85
(1)未払金			
未払手数料	1,523,402	1,523,402	-
負債計	1,523,402	1,523,402	-

（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、当該帳簿価額によつていません。

(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	236,178
合計	236,178

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「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、51,557千円です。

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。

(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	15,484,883	-	-	-
未収委託者報酬	3,405,895	-	-	-
未収運用受託報酬	456,672	-	-	-
未収投資助言報酬	426,716	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券	3,000,000	-	-	-
その他有価証券のうち 満期があるもの	-	-	-	-
長期差入保証金	2,289	679,475	-	-
合計	22,776,457	679,475	-	-

(追加情報)

当事業年度より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

(有価証券関係)

第24期(平成21年3月31日現在)

1. 満期保有目的の債券で時価のあるもの

(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	2,998,947	2,998,800	147

小計	2,998,947	2,998,800	147
合計	2,998,947	2,998,800	147

2. その他有価証券で時価のあるもの

(単位：千円)

区分	取得原価	貸借対照表計上額	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	329,907	346,809	16,902
小計	329,907	346,809	16,902
(2)貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	2,117,725	2,095,017	22,707
小計	2,117,725	2,095,017	22,707
合計	2,447,632	2,441,827	5,805

3．時価評価されていない有価証券の内容及び貸借対照表計上額

(単位：千円)

	貸借対照表計上額	摘要
(1)子会社株式 子会社株式	236,178	
合計	236,178	
(2)その他有価証券 非上場株式 投資証券	298 100,000	
合計	100,298	

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
882,530	122	464,272

5．その他有価証券のうち満期があるもの及び満期保有目的の債券の決算日後における償還予定額

(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
(1)満期保有目的の債券 国債・地方債等	3,000,000	-	-	-
小計	3,000,000	-	-	-
(2)その他有価証券	-	-	-	-
小計	-	-	-	-
合計	3,000,000	-	-	-

第25期(平成22年3月31日現在)

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	2,999,185	2,999,100	85
小計	2,999,185	2,999,100	85
合計	2,999,185	2,999,100	85

2. 子会社株式及び関連会社株式

子会社及び関連会社株式（貸借対照表計上額 関係会社株式236,178千円）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	2,484,337	2,253,148	231,189
小計	2,484,337	2,253,148	231,189
(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	4,390,071	4,483,035	92,963
小計	4,390,071	4,483,035	92,963
合計	6,874,409	6,736,184	138,225

(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
1,539,393	31,117	2,724

(デリバティブ取引関係)

第24期(自平成20年4月1日至平成21年3月31日)

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。

第25期(自平成21年4月1日至平成22年3月31日)

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24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22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%;"> <tr> <td style="width: 80%;">退職給付債務</td> <td style="text-align: right;">972,202</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td style="text-align: right;"><u>972,202</u></td> </tr> </table>	退職給付債務	972,202	退職給付引当金	<u>972,202</u>	<p>2. 退職給付債務の額 (単位：千円)</p> <table style="width: 100%;"> <tr> <td style="width: 80%;">退職給付債務</td> <td style="text-align: right;">1,137,766</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td style="text-align: right;"><u>1,137,766</u></td> </tr> </table>	退職給付債務	1,137,766	退職給付引当金	<u>1,137,766</u>														
退職給付債務	972,202																						
退職給付引当金	<u>972,202</u>																						
退職給付債務	1,137,766																						
退職給付引当金	<u>1,137,766</u>																						
<p>3. 退職給付費用の額 (単位：千円)</p> <table style="width: 100%;"> <tr> <td style="width: 80%;">勤務費用</td> <td style="text-align: right;">145,258</td> </tr> <tr> <td>利息費用</td> <td style="text-align: right;">12,449</td> </tr> <tr> <td>過去勤務債務の費用処理額</td> <td style="text-align: right;">87,363</td> </tr> <tr> <td>数理計算上の差異の費用処理額</td> <td style="text-align: right;">6,153</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;"><u>11,409</u></td> </tr> <tr> <td>退職給付費用</td> <td style="text-align: right;"><u>262,634</u></td> </tr> </table>	勤務費用	145,258	利息費用	12,449	過去勤務債務の費用処理額	87,363	数理計算上の差異の費用処理額	6,153	その他	<u>11,409</u>	退職給付費用	<u>262,634</u>	<p>3. 退職給付費用の額 (単位：千円)</p> <table style="width: 100%;"> <tr> <td style="width: 80%;">勤務費用</td> <td style="text-align: right;">154,625</td> </tr> <tr> <td>利息費用</td> <td style="text-align: right;">14,583</td> </tr> <tr> <td>数理計算上の差異の費用処理額</td> <td style="text-align: right;">12,466</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;"><u>15,677</u></td> </tr> <tr> <td>退職給付費用</td> <td style="text-align: right;"><u>197,352</u></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	154,625	利息費用	14,583	数理計算上の差異の費用処理額	12,466	その他	<u>15,677</u>	退職給付費用	<u>197,352</u>
勤務費用	145,258																						
利息費用	12,449																						
過去勤務債務の費用処理額	87,363																						
数理計算上の差異の費用処理額	6,153																						
その他	<u>11,409</u>																						
退職給付費用	<u>262,634</u>																						
勤務費用	154,625																						
利息費用	14,583																						
数理計算上の差異の費用処理額	12,466																						
その他	<u>15,677</u>																						
退職給付費用	<u>197,352</u>																						

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

割引率 1.5%

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）

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）

4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

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

割引率 1.5%

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）

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）

（税効果会計関係）

第24期 (平成21年3月31日現在)	第25期 (平成22年3月31日現在)
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)	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)
(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 118,748	賞与引当金 119,486
未払社会保険料 12,792	未払社会保険料 12,746
未払事業所税 6,134	未払事業税 100,639
その他 5,436	未払事業所税 6,089
繰延税金資産計 143,111	その他 5,807
評価性引当額 -	繰延税金資産計 244,770
繰延税金資産合計 143,111	評価性引当額 -
繰延税金負債	繰延税金資産合計 244,770
未収還付税金 74,316	繰延税金資産の純額 244,770
繰延税金負債合計 74,316	
繰延税金資産の純額 68,795	
(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 395,589	退職給付引当金 462,957
ソフトウェア償却 101,933	ソフトウェア償却 111,245
投資有価証券評価損 56,627	投資有価証券評価損 73,440
特定外国子会社留保金額 193,760	特定外国子会社留保金額 213,896
その他有価証券評価差額金 2,362	その他 8,735
その他 14,742	繰延税金資産計 870,274
繰延税金資産計 765,014	評価性引当額 289,785
評価性引当額 730,620	繰延税金資産合計 580,489
繰延税金資産合計 34,393	繰延税金負債
繰延税金資産の純額 34,393	その他有価証券評価差額金 55,668
	繰延税金負債合計 55,668
	繰延税金資産の純額 524,820

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	40.7
(調整)	
評価性引当額の増減	5.4
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.5
住民税均等割等	0.2
その他	<u>1.4</u>
税効果会計適用後の法人税等の負担率	<u>48.2</u>

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	40.7
(調整)	
評価性引当額の増減	11.6
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.2
住民税均等割等	0.1
その他	<u>0.2</u>
税効果会計適用後の法人税等の負担率	<u>29.1</u>

(関連当事者情報)

第24期(自 平成20年 4月 1日 至 平成21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	199,000,000	生命保険業	% (被所有) 直接 40	当社の主要顧客 投信の販売委託	投資助言報酬 委託販売手数料	1,151,492 227,288	未収投資助言報酬 未払手数料	267,215 34,564
その他の関係会社	(株)三井住友銀行	東京都 千代田区	664,986,500	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	2,114,655	未払手数料	180,287

(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、当社規定の投資助言料率に基づき決定しております。

(2)その他営業取引については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

(追加情報)

当事業年度から平成18年10月17日公表の、「関連当事者の開示に関する会計基準」(企業会計基準委員会 企業会計基準第11号)及び「関連当事者の開示に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準委員会 企業会計基準第13号)を適用しております。

第25期(自 平成21年 4月 1日 至 平成22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	199,000,000	生命保険業	% (被所有) 直接 40	当社の主要顧客	投資助言報酬	1,125,661	未収投資助言報酬	295,911
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	2,495,661	未払手数料	347,340

(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 ディアル 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	1,019,546	未払手数料	238,828

(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24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)
1株当たり純資産額 1,405,954円57銭 1株当たり当期純利益 96,132円19銭	1株当たり純資産額 1,513,927円30銭 1株当たり当期純利益 150,963円55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いません。	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いません。
(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 24,801,038千円 普通株式に係る純資産額 24,801,038千円 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 26,705,677千円 普通株式に係る純資産額 26,705,677千円 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 1,695,771千円 普通株式に係る当期純利益 1,695,771千円 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 2,662,997千円 普通株式に係る当期純利益 2,662,997千円 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)

第24期(自平成20年4月1日至平成21年3月31日)

該当事項はありません。

第25期(自平成21年4月1日至平成22年3月31日)

該当事項はありません。

中間財務諸表

(1)中間貸借対照表

(単位：千円)

		第26期中間会計期間末 (平成22年9月30日現在)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		16,070,989
有価証券		4,943,990
前払費用		251,072
未収委託者報酬		3,680,857
未収運用受託報酬		476,281
未収投資助言報酬		424,563
未収収益		28,359
繰延税金資産		238,094
その他		3,965
流動資産合計		26,118,172
固定資産		
有形固定資産	1	282,221
無形固定資産		5,332
投資その他の資産		
投資有価証券		4,108,176
その他		1,523,074
投資その他の資産合計		5,631,251
固定資産合計		5,918,806
資産合計		32,036,978
負債の部		
流動負債		
預り金		44,787
未払金		1,890,909

未払費用		764,737
未払法人税等		980,584
前受収益		6,563
賞与引当金		322,819
その他	2	115,673
流動負債合計		4,126,076
固定負債		
退職給付引当金		1,226,435
固定負債合計		1,226,435
負債合計		5,352,511

純資産の部	
株主資本	
資本金	2,000,000
資本剰余金	
資本準備金	8,628,984
資本剰余金合計	8,628,984
利益剰余金	
利益準備金	284,245
その他利益剰余金	
配当準備積立金	60,000
別途積立金	1,476,959
繰越利益剰余金	14,195,382
利益剰余金合計	16,016,587
株主資本合計	26,645,571
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	38,896
評価・換算差額等合計	38,896
純資産合計	26,684,467
負債純資産合計	32,036,978

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

		第26期中間会計期間 (自 平成22年 4月 1日 至 平成22年 9月30日)	
営業収益			
委託者報酬			13,415,979
運用受託報酬			1,026,282
投資助言報酬			929,636
その他の営業収益			137,538
営業収益計			15,509,437
営業費用			9,566,713
一般管理費	1		3,742,792
営業利益			2,199,930
営業外収益	2		37,736
営業外費用			659
経常利益			2,237,008
特別利益			42,823
特別損失			26,822
税引前中間純利益			2,253,008
法人税、住民税及び事業税			923,945
法人税等調整額			16,386
法人税等合計			907,558
中間純利益			1,345,450

(3)中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

第26期中間会計期間 (自 平成22年 4月 1日 至 平成22年 9月30日)	
株主資本	
資本金	
前期末残高	2,000,000
当中間期末残高	2,000,000
資本剰余金	
資本準備金	
前期末残高	8,628,984
当中間期末残高	8,628,984
資本剰余金合計	
前期末残高	8,628,984
当中間期末残高	8,628,984
利益剰余金	
利益準備金	
前期末残高	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	
前期末残高	60,000
当中間期末残高	60,000
別途積立金	
前期末残高	1,476,959
当中間期末残高	1,476,959
繰越利益剰余金	
前期末残高	14,172,932
当中間期変動額	
剰余金の配当	1,323,000
中間純利益	1,345,450

当中間期変動額合計	22,450
当中間期末残高	14,195,382
利益剰余金合計	
前期末残高	15,994,137
当中間期変動額	
剰余金の配当	1,323,000
中間純利益	1,345,450
当中間期変動額合計	22,450
当中間期末残高	16,016,587
株主資本合計	
前期末残高	26,623,121
当中間期変動額	
剰余金の配当	1,323,000
中間純利益	1,345,450
当中間期変動額合計	22,450
当中間期末残高	26,645,571

評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
前期末残高		82,556
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)		43,660
当中間期変動額合計		43,660
当中間期末残高		38,896
評価・換算差額等合計		
前期末残高		82,556
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)		43,660
当中間期変動額合計		43,660
当中間期末残高		38,896
純資産合計		
前期末残高		26,705,677
当中間期変動額		
剰余金の配当		1,323,000
中間純利益		1,345,450
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)		43,660
当中間期変動額合計		21,210
当中間期末残高		26,684,467

中間財務諸表作成の基本となる重要な事項

第26期中間会計期間

(自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日)

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
- ・其他有価証券

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

(2) 無形固定資産

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

従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、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

従業員の退職給付に備えるため、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、発生時において全額を費用処理しております。

数理計算上の差異については、発生時において全額を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

(1) 消費税等の会計処理

税抜方式によっております。

中間財務諸表作成の基本となる重要な事項の変更

<p>第26期中間会計期間 (自平成22年4月1日 至 平成22年9月30日)</p>
<p>資産除去債務に関する会計基準</p> <p>企業会計基準第18号「資産除去債務に関する会計基準」（平成20年3月31日 企業会計基準委員会）及び企業会計基準適用指針第21号「資産除去債務に関する会計基準の適用指針」（同前）が平成22年4月1日以後開始する事業年度から適用されることになったことに伴い、当中間会計期間から同会計基準及び適用指針を適用しております。</p> <p>これによる損益の影響はありません。</p>

注 記 事 項

(中間貸借対照表関係)

<p>第26期中間会計期間末 (平成22年9月30日現在)</p>
<p>1.有形固定資産の減価償却累計額 908,018千円</p>
<p>2.消費税等の取扱い</p> <p>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。</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。</p> <p>当座借越極度額の総額 10,000,000千円</p> <p>借入実行残高 <u> -</u></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83,897千円の支払保証を行っております。</p>

(中間損益計算書関係)

<p>第26期中間会計期間 (自平成22年4月1日 至 平成22年9月30日)</p>

1．減価償却実施額	
有形固定資産	38,651千円
無形固定資産	977千円
2．営業外収益のうち主要なもの	
受取利息	4,445千円
受取配当金	12,720千円
為替差益	10,801千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第26期中間会計期間 （自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日）					
1. 発行済株式数に関する事項					
	前事業年度末 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. 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

（リース取引関係）

第26期中間会計期間 （自 平成22年4月1日 至 平成22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	670,670千円
1年超	1,274,557千円
合計	1,945,227千円

（金融商品関係）

1. 金融商品の時価等に関する事項

平成22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）

第26期中間会計期間末 （平成22年9月30日現在）			
区分	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金及び預金	16,070,989	16,070,989	-
(2) 未収委託者報酬	3,680,857	3,680,857	-
(3) 未収運用受託報酬	476,281	476,281	-
(4) 未収投資助言報酬	424,563	424,563	-
(5) 有価証券及び投資有価証券			
満期保有目的の債券	2,999,963	2,999,700	263
その他有価証券	6,003,462	6,003,462	-
(6) 投資その他の資産			
長期差入保証金	681,418	681,418	-
資産計	30,337,535	30,337,271	263
(1) 未払金			
未払手数料	1,839,602	1,839,602	-
負債計	1,839,602	1,839,602	-

（注1）金融商品の時価の算定方法及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、当該帳簿価額によつてい

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つております。

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）

第26期中間会計期間末 （平成22年9月30日現在）	
内容	中間貸借対照表計上額
(1) 子会社株式	236,178
合計	236,178
(2) その他有価証券	
非上場株式	298
投資証券	48,443
合計	48,741

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。

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。

（追加情報）

前事業年度の下期より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

（有価証券関係）

1. 満期保有目的の債券

（単位：千円）

第26期中間会計期間末 （平成22年9月30日現在）			
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	2,999,963	2,999,700	263
小計	2,999,963	2,999,700	263
合計	2,999,963	2,999,700	263

2. 子会社株式及び関連会社株式

第26期中間会計期間末 (平成22年9月30日現在)
子会社株式及び関連会社株式(中間貸借対照表計上額 236,178千円)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)

第26期中間会計期間末 (平成22年9月30日現在)			
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	2,912,845	2,755,148	157,696
小計	2,912,845	2,755,148	157,696
(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	3,090,617	3,182,865	92,248
小計	3,090,617	3,182,865	92,248
合計	6,003,462	5,938,014	65,447

(注) 非上場株式等(中間貸借対照表計上額 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。

(デリバティブ取引関係)

第26期中間会計期間 (自平成22年4月1日至平成22年9月30日)
当社は、デリバティブ取引を行っておりませんので、該当事項はありません。

(持分法損益等)

第26期中間会計期間 (自平成22年4月1日至平成22年9月30日)
該当事項はありません。

（資産除去債務等）

第26期中間会計期間 （自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日）
該当事項はありません。

（セグメント情報等）

第26期中間会計期間 （自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日）					
（セグメント情報）					
<p>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。</p> <p>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。</p>					
（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	13,415,979	1,026,282	929,636	137,538	15,509,437
2．地域ごとの情報					
（1）売上高					
<p>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。</p>					
（2）有形固定資産					
<p>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。</p>					
3．主要な顧客ごとの情報					
<p>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。</p>					
（追加情報）					

当中間会計期間より、企業会計基準第17号「セグメント情報等の開示に関する会計基準」(平成21年3月27日 企業会計基準委員会)及び企業会計基準適用指針第20号「セグメント情報等の開示に関する会計基準の適用指針」(平成20年3月21日 企業会計基準委員会)を適用しております。

(1株当たり情報)

第26期中間会計期間 (自平成22年4月1日至平成22年9月30日)	
1株当たり純資産額	1,512,724円91銭
1株当たり中間純利益	76,272円68銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載していません。	
(注) 1株当たり純資産額の算定上の基礎	
中間貸借対照表の純資産の部の合計額	26,684,467千円
普通株式に係る純資産額	26,684,467千円
普通株式の発行済株式数	17,640株
1株当たり純資産額の算定に用いられた普通株式の数	17,640株
1株当たり中間純利益の算定上の基礎	
中間損益計算書上の中間純利益	1,345,450千円
普通株式に係る中間純利益	1,345,450千円
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)

第26期中間会計期間 (自平成22年4月1日至平成22年9月30日)	
該当事項はありません。	

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

- イ 定款の変更、その他の重要事項
平成22年6月24日に開催された定時株主総会において、監査体制の一層の充実を図るため、監査役の員数を1名増員し5名以内とする定款の変更が決議されました。
- ロ 訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実
該当ありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

イ 受託会社

- (イ) 名称 中央三井アセット信託銀行株式会社
- (ロ) 資本金の額 11,000百万円（平成22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22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22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【参考情報】

当計算期間において書類が以下の通り提出されております。

提出年月日	書類名
平成22年3月18日	有価証券報告書
平成22年3月18日	有価証券届出書
平成22年9月17日	半期報告書
平成22年9月17日	有価証券届出書の訂正届出書

(参考)

「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>」投資信託受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の部に計上された「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

対象年月日	(平成21年12月18日現在)	(平成22年12月17日現在)
科目	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	22,601	23,246
親投資信託受益証券	91,466,555,917	81,060,739,056
未収入金	36,149,998	2,915,609,997
流動資産合計	91,502,728,516	83,976,372,299
資産合計	91,502,728,516	83,976,372,299
負債の部		
流動負債		
未払解約金	36,149,998	2,915,609,997
未払受託者報酬	1,878,590	1,613,662
未払委託者報酬	1,643,761	1,411,946
その他未払費用	29,898	28,237
流動負債合計	39,702,247	2,918,663,842
負債合計	39,702,247	2,918,663,842
純資産の部		
元本等		
1 元本		
元本	120,689,687,547	103,818,160,031
2 剰余金		
剰余金又は欠損金()	29,226,661,278	22,760,451,574
元本等合計	91,463,026,269	81,057,708,457
純資産合計	91,463,026,269	81,057,708,457
負債・純資産合計	91,502,728,516	83,976,372,299

(注) 「SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)」は、毎年11月30日(ただし、休業日の場合は翌営業日)に決算を行います。上記の貸借対照表は平成21年12月18日および平成22年12月17日現在における同ファンドの状況です。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自平成21年12月1日 至平成21年12月18日	自平成22年12月1日 至平成22年12月17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（売買目的有価証券） 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	親投資信託受益証券（売買目的有価証券） 同左

(貸借対照表に関する注記)

項目	（平成21年12月18日現在）	（平成22年12月17日現在）
1. 受益権総数	平成21年12月18日現在における受益権の総数 120,689,687,547口	平成22年12月17日現在における受益権の総数 103,818,160,031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 29,226,661,278円	「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 22,760,451,574円
3. 1単位当たり純資産額	0.7578円 （1万口 = 7,578円）	0.7808円 （1万口 = 7,808円）

(金融商品に関する注記)

(追加情報)

当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）および「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

・金融商品の状況に関する事項

項目	自平成22年12月1日 至平成22年12月17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。当ファンドにおける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、および価格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・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、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。リスクを管理する部署では、各種リスクごとに定められた頻度で、測定項目が上下限值（リミットあるいは注意レベル）内に収まっているかどうかのモニタリングを行っております。上下限値を越えていることが発見された場合は、原則として速やかに修正を行うよう、リスク管理を行う部署から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ます。また、是正勧告あるいは報告を受けた関連運用グループでは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、リスク管理を行う部署は、上下限値に抵触した事実ならびにその後の対処結果あるいは関連運用グループの対処方針の決定に関し、必要に応じて、リスク管理を行う部署の担当役員、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する体制となっております。</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	自平成22年12月1日 至平成22年12月17日
1．貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2．時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」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）

．取引の状況に関する事項

項目	自平成21年12月1日 至平成21年12月18日
1．取引の内容	当ファンドの行うことのできるデリバティブ取引は、次の通りです。 わが国の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。
2．取引に対する取組方針	デリバティブ取引につきましては信託約款等に従っており、その制限を遵守しております。
3．取引の利用目的	信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため。
4．取引に係るリスクの内容	デリバティブ取引に伴いファンドに影響を与える主なリスクとして価格変動リスクがあります。
5．取引に係るリスクの管理体制	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・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理ならびに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。
6．取引の時価等に関する事項についての補足説明	該当事項はありません。

．取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

（平成21年12月18日現在）

平成21年12月18日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（平成22年12月17日現在）

平成22年12月17日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（関連当事者との取引に関する注記）

（自平成21年12月1日至平成21年12月18日）

該当事項はありません。

（自平成22年12月1日至平成22年12月17日）

該当事項はありません。

(その他の注記)

(平成21年12月18日現在)	
期首	平成21年12月1日
期首元本額	121,441,785,720円
期首より平成21年12月18日現在までの追加設定元本額	5,321,622円
期首より平成21年12月18日現在までの一部解約元本額	757,419,795円

(平成22年12月17日現在)	
期首	平成22年12月1日
期首元本額	108,385,749,069円
期首より平成22年12月17日現在までの追加設定元本額	1,351,557円
期首より平成22年12月17日現在までの一部解約元本額	4,568,940,595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	銘柄名	元本額	評価額	
			単価	金額
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)	68,451,899,220円	1.1842円	81,060,739,056円

（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

対象年月日	（平成21年12月18日現在）	（平成22年12月17日現在）
科目	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	6,660,097,001	7,566,222,997
株式	328,304,616,060	315,867,721,675
新株予約権証券	3,192,000	-
派生商品評価勘定	848,700	58,097,850
未収入金	-	7,055,182,755
未収配当金	29,033,750	32,801,400
未収利息	12,772	10,364
前払金	26,921,000	-
流動資産合計	335,024,721,283	330,580,037,041
資産合計	335,024,721,283	330,580,037,041
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	28,547,750	-
前受金	-	58,563,000
未払金	11,115,000	17,070,000
未払解約金	64,542,083	3,446,748,571
流動負債合計	104,204,833	3,522,381,571
負債合計	104,204,833	3,522,381,571
純資産の部		
元本等		
1 元本		
元本	291,615,240,420	276,186,779,522
2 剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	43,305,276,030	50,870,875,948
元本等合計	334,920,516,450	327,057,655,470
純資産合計	334,920,516,450	327,057,655,470
負債・純資産合計	335,024,721,283	330,580,037,041

（注）「国内株式インデックス・マザーファンド（B号）」は、毎年11月30日（ただし、休業日の場合は翌営業日）に決算を行います。上記の貸借対照表は平成21年12月18日および平成22年12月17日現在における同マザーファンドの状況です。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自平成21年12月1日 至平成21年12月18日	自平成22年12月1日 至平成22年12月17日
1. 有価証券の評価基準及び 評価方法	株式および新株予約権証券（売買目的有 価証券） 移動平均法に基づき、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、取引所における最終相場（最終相場 のないものについては、それに準じる価 額）または金融商品取引業者等から提示 される気配相場に基づいて評価しており ます。	株式（売買目的有価証券） 同左
2. デリバティブの評価基準 及び評価方法	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。	先物取引 同左
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。	受取配当金の計上基準 同左

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成21年12月18日現在)	(平成22年12月17日現在)								
1. 担保資産	代用として、担保に供している資産は次 の通りであります。 <table style="margin-left: auto; margin-right: auto;"> <tr> <td style="text-align: center;"><u>担保資産</u></td> <td style="text-align: center;"><u>金額</u></td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">株式</td> <td style="text-align: center;">4,488,000,000円</td> </tr> </table>	<u>担保資産</u>	<u>金額</u>	株式	4,488,000,000円	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。 <table style="margin-left: auto; margin-right: auto;"> <tr> <td style="text-align: center;"><u>担保資産</u></td> <td style="text-align: center;"><u>金額</u></td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">株式</td> <td style="text-align: center;">4,882,500,000円</td> </tr> </table>	<u>担保資産</u>	<u>金額</u>	株式	4,882,500,000円
<u>担保資産</u>	<u>金額</u>									
株式	4,488,000,000円									
<u>担保資産</u>	<u>金額</u>									
株式	4,882,500,000円									
2. 受益権総数	平成21年12月18日現在における受益権の 総数 291,615,240口	平成22年12月17日現在における受益権の 総数 276,186,779,522口								
3. 1単位当たり純資産額	1.1485円 (1万口 = 11,485円)	1.1842円 (1万口 = 11,842円)								

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）および「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

・金融商品の状況に関する事項

項目	自平成22年12月1日 至平成22年12月17日
1．金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2．金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。当ファンドにおける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、および価格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・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、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。リスクを管理する部署では、各種リスクごとに定められた頻度で、測定項目が上下限值（リミットあるいは注意レベル）内に収まっているかどうかのモニタリングを行っております。上下限値を越えていることが発見された場合は、原則として速やかに修正を行うよう、リスク管理を行う部署から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ます。また、是正勧告あるいは報告を受けた関連運用グループでは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、リスク管理を行う部署は、上下限値に抵触した事実ならびにその後の対処結果あるいは関連運用グループの対処方針の決定に関し、必要に応じて、リスク管理を行う部署の担当役員、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する体制となっております。</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	自平成22年12月1日 至平成22年12月17日
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（株式） 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

・取引の状況に関する事項

項目	自平成21年12月1日 至平成21年12月18日
1. 取引の内容	当ファンドの行うことのできるデリバティブ取引は、次の通りです。 わが国の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。
2. 取引に対する取組方針	デリバティブ取引につきましては信託約款等に従っており、その制限を遵守しております。
3. 取引の利用目的	信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため。
4. 取引に係るリスクの内容	デリバティブ取引に伴いファンドに影響を与える主なリスクとして価格変動リスクがあります。
5. 取引に係るリスクの管理体制	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・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理ならびに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。
6. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	該当事項はありません。

・取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

株式関連

（平成21年12月18日現在）

（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 （TOPIX先物） 買建	6,636,641,000	-	6,609,720,000	26,921,000 (27,699,050)
		(6,637,419,050)	(-)		
	買建 合計	6,636,641,000 (6,637,419,050)	- (-)	6,609,720,000	26,921,000 (27,699,050)

（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。

3．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

なお、（ ）内は手数料相当額を含んだ場合の金額を表わしています。

4．株価指数先物取引の取引市場は、東京証券取引所です。

（平成22年12月17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 （TOPIX先物） 買建	6,300,537,000	-	6,359,100,000	58,563,000 (58,097,850)
		(6,301,002,150)	(-)		
	買建 合計	6,300,537,000 (6,301,002,150)	- (-)	6,359,100,000	58,563,000 (58,097,850)

（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。

3．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

なお、（ ）内は手数料相当額を含んだ場合の金額を表わしています。

4．株価指数先物取引の取引市場は、東京証券取引所です。

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21年12月 1 日 至 平成21年12月18日）

該当事項はありません。

（自 平成22年12月 1 日 至 平成22年12月17日）

該当事項はありません。

(その他の注記)

(平成21年12月18日現在)	
期首	平成21年12月1日
期首元本額	291,871,462,047円
期首より平成21年12月18日現在までの追加設定元本額	376,672,377円
期首より平成21年12月18日現在までの一部解約元本額	632,894,004円
平成21年12月18日現在における元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	6,436,301,161円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	260,424,491円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,441,364,505円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	904,234,457円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	10,120,310円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	2,567,339円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	235,360円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	3,190,741円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	383,443円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	250,086円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	718,471円
国内株式指数ファンド(TOPIX)	50,068,515円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	79,640,013,859円
バランスファンドVA(安定運用型) <適格機関投資家限定>	1,240,667,340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>	51,896,197,287円
SMAM・バランスファンドVA25 <適格機関投資家専用>	18,047,377,721円
SMAM・バランスファンドVA37.5 <適格機関投資家専用>	8,710,774,257円
SMAM・バランスファンドVA50 <適格機関投資家専用>	30,121,655,768円
SMAM・バランスファンドVL30 <適格機関投資家限定>	183,554,526円
SMAM・バランスファンドVL50 <適格機関投資家限定>	578,382,139円
世界6資産バランスファンドVA <適格機関投資家限定>	110,357,747円
SMAM・バランスファンドVA75 <適格機関投資家専用>	2,838,462,775円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型 <適格機関投資家限定>	130,883,749円
SMAM・インデックス・バランスVA25 <適格機関投資家専用>	885,539,088円
SMAM・インデックス・バランスVA50 <適格機関投資家専用>	3,250,891,887円
SMAM・バランスファンドVA40 <適格機関投資家専用>	5,101,104,661円
SMAM・バランスファンドVA35 <適格機関投資家専用>	13,309,783,639円
SMAM・バランスVA株40T <適格機関投資家限定>	1,391,276,134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)	10,985,782,870円
SMAM・グローバルバランス40VA <適格機関投資家限定>	245,633,153円
SMAM・バランスファンドVA20 <適格機関投資家専用>	3,076,192,140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)	47,052,758,523円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A <適格機関投資家専用>	313,911,953円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A <適格機関投資家専用>	158,001,702円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A <適格機関投資家専用>	61,437,106円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L <適格機関投資家専用>	934,045,428円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L <適格機関投資家専用>	1,588,672,307円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T <適格機関投資家専用>	564,041,884円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2 <適格機関投資家専用>	12,377,841円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2 <適格機関投資家専用>	2,321,542円

SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	324,405円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	278,061円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	72,680,049円
合計	291,615,240,420円

(平成22年12月17日現在)

期首	平成22年12月1日
期首元本額	280,913,684,027円
期首より平成22年12月17日現在までの追加設定元本額	75,608,699円
期首より平成22年12月17日現在までの一部解約元本額	4,802,513,204円
平成22年12月17日現在における元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	7,592,418,528円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	327,498,196円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,791,487,404円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,175,344,537円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	17,953,291円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	3,969,090円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	669,396円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	3,898,026円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	785,615円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	765,910円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	1,307,366円
国内株式指数ファンド(TOPIX)	433,493,077円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	68,451,899,220円
バランスファンドVA(安定運用型)〈適格機関投資家限定〉	869,221,944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〉	50,588,439,105円
SMAM・バランスファンドVA25〈適格機関投資家専用〉	16,928,877,476円
SMAM・バランスファンドVA37.5〈適格機関投資家専用〉	8,026,858,530円
SMAM・バランスファンドVA50〈適格機関投資家専用〉	27,185,091,900円
SMAM・バランスファンドVL30〈適格機関投資家限定〉	181,283,794円
SMAM・バランスファンドVL50〈適格機関投資家限定〉	561,265,682円
世界6資産バランスファンドVA〈適格機関投資家限定〉	104,949,490円
SMAM・バランスファンドVA75〈適格機関投資家専用〉	2,548,900,235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〉	125,599,077円
SMAM・インデックス・バランスVA25〈適格機関投資家専用〉	1,074,565,903円
SMAM・インデックス・バランスVA50〈適格機関投資家専用〉	3,618,601,426円
SMAM・バランスファンドVA40〈適格機関投資家専用〉	4,860,374,695円
SMAM・バランスファンドVA35〈適格機関投資家専用〉	11,668,132,076円
SMAM・バランスVA株40T〈適格機関投資家限定〉	1,337,574,333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)	10,891,880,678円
SMAM・グローバルバランス40VA〈適格機関投資家限定〉	226,531,234円
SMAM・バランスファンドVA20〈適格機関投資家専用〉	2,885,964,123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)	45,626,544,595円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A〈適格機関投資家専用〉	315,895,296円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A〈適格機関投資家専用〉	158,984,041円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A〈適格機関投資家専用〉	60,420,659円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L〈適格機関投資家専用〉	866,800,673円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L〈適格機関投資家専用〉	1,560,019,907円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T〈適格機関投資家専用〉	559,305,798円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2〈適格機関投資家専用〉	258,333,583円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2〈適格機関投資家専用〉	103,262,463円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2〈適格機関投資家専用〉	19,486,258円

SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	184,271,720円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	2,290,924,981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)	577,279,277円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	119,648,914円
合計	276,186,779,522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	117,000	179	20,943,000	
日本水産	343,100	261	89,549,100	
マルハニチロホールディングス	572,000	135	77,220,000	
サカタのタネ	38,100	1,125	42,862,500	
ホクト	30,200	1,893	57,168,600	
住石ホールディングス	107,600	78	8,392,800	
日鉄鉱業	76,000	375	28,500,000	
三井松島産業	174,000	162	28,188,000	
国際石油開発帝石	2,971	476,000	1,414,196,000	
日本海洋掘削	7,800	2,770	21,606,000	
関東天然瓦斯開発	22,000	438	9,636,000	
石油資源開発	45,400	3,055	138,697,000	
ショーボンドホールディングス	25,200	1,751	44,125,200	
ミライト・ホールディングス	70,700	575	40,652,500	
ダイセキ環境ソリューション	24	76,400	1,833,600	
間組	145,500	72	10,476,000	
東急建設	116,650	250	29,162,500	
コムシスホールディングス	142,600	860	122,636,000	
ミサワホーム	39,300	388	15,248,400	
高松コンストラクショングループ	22,800	1,108	25,262,400	
東建コーポレーション	10,200	2,939	29,977,800	
ヤマウラ	16,000	187	2,992,000	
大成建設	1,402,000	197	276,194,000	
大林組	884,000	376	332,384,000	
清水建設	840,000	351	294,840,000	
長谷工コーポレーション	1,880,000	76	142,880,000	
松井建設	37,000	340	12,580,000	
鹿島建設	1,301,000	220	286,220,000	
鉄建建設	216,000	83	17,928,000	
安藤建設	122,000	110	13,420,000	
太平工業	63,000	393	24,759,000	
西松建設	408,000	108	44,064,000	
三井住友建設	214,600	67	14,378,200	

大豊建設	115,000	77	8,855,000	
前田建設工業	191,000	280	53,480,000	
ナカノフドー建設	28,000	216	6,048,000	
奥村組	284,000	317	90,028,000	
大和小田急建設	22,000	225	4,950,000	
東鉄工業	36,000	576	20,736,000	
イチケン	50,000	115	5,750,000	
戸田建設	320,000	309	98,880,000	
青木あすなる建設	25,000	369	9,225,000	
北野建設	72,000	210	15,120,000	
植木組	49,000	124	6,076,000	
三井ホーム	34,000	435	14,790,000	
矢作建設工業	42,000	507	21,294,000	
ピーエス三菱	27,800	232	6,449,600	
大東建託	114,500	5,500	629,750,000	
新日本建設	48,200	213	10,266,600	
N I P P O	69,000	565	38,985,000	
東亜道路工業	76,000	132	10,032,000	
前田道路	85,000	661	56,185,000	
日本道路	96,000	202	19,392,000	
東亜建設工業	258,000	104	26,832,000	
五洋建設	337,000	141	47,517,000	
大林道路	48,000	163	7,824,000	
福田組	57,000	164	9,348,000	
住友林業	203,700	731	148,904,700	
日本基礎技術	46,000	180	8,280,000	
巴コーポレーション	49,400	256	12,646,400	
パナホーム	98,000	528	51,744,000	
大和ハウス工業	732,000	984	720,288,000	
ライト工業	70,800	199	14,089,200	
積水ハウス	882,000	798	703,836,000	
北陸電気工事	19,000	212	4,028,000	
ユアテック	48,000	332	15,936,000	
西部電気工業	23,000	347	7,981,000	
四電工	23,000	342	7,866,000	
中電工	40,700	989	40,252,300	
関電工	135,000	554	74,790,000	
きんでん	193,000	768	148,224,000	
東京エネシス	34,000	528	17,952,000	
トーエネック	42,000	478	20,076,000	
住友電設	17,100	344	5,882,400	
日本電設工業	52,000	818	42,536,000	
協和エクシオ	104,100	799	83,175,900	
新日本空調	21,400	494	10,571,600	
日本電話施設	50,000	263	13,150,000	
九電工	52,000	535	27,820,000	

三機工業	70,000	574	40,180,000
日揮	294,000	1,816	533,904,000
中外炉工業	101,000	311	31,411,000
ヤマト	32,000	320	10,240,000
太平電業	39,000	656	25,584,000
高砂熱学工業	84,200	709	59,697,800
三晃金属工業	53,000	174	9,222,000
NEC ネットエスアイ	23,000	1,073	24,679,000
朝日工業社	37,000	347	12,839,000
大気社	46,600	1,483	69,107,800
ダイダン	40,000	453	18,120,000
日比谷総合設備	38,300	775	29,682,500
東芝プラントシステム	48,000	1,165	55,920,000
東洋エンジニアリング	180,000	321	57,780,000
千代田化工建設	194,000	842	163,348,000
新興プラントテック	57,400	763	43,796,200
日本製粉	163,000	408	66,504,000
日清製粉グループ本社	264,500	1,051	277,989,500
日東富士製粉	19,000	304	5,776,000
昭和産業	118,000	243	28,674,000
鳥越製粉	22,800	814	18,559,200
協同飼料	127,000	102	12,954,000
中部飼料	27,900	586	16,349,400
日本配合飼料	108,000	104	11,232,000
東洋精糖	64,000	102	6,528,000
日本甜菜製糖	169,000	197	33,293,000
三井製糖	119,000	306	36,414,000
森永製菓	284,000	196	55,664,000
中村屋	70,000	402	28,140,000
江崎グリコ	105,000	975	102,375,000
名糖産業	12,200	1,108	13,517,600
不二家	170,000	168	28,560,000
山崎製パン	214,000	984	210,576,000
第一屋製パン	66,000	95	6,270,000
モロゾフ	43,000	278	11,954,000
森永乳業	249,000	345	85,905,000
ヤクルト本社	157,700	2,375	374,537,500
明治ホールディングス	86,700	3,725	322,957,500
雪印メグミルク	57,900	1,572	91,018,800
プリマハム	179,000	96	17,184,000
日本ハム	204,000	1,076	219,504,000
伊藤ハム	165,000	292	48,180,000
林兼産業	115,000	87	10,005,000
丸大食品	129,000	263	33,927,000
米久	26,000	671	17,446,000
S Foods	14,000	697	9,758,000

サッポロホールディングス	419,000	383	160,477,000	
アサヒビール	548,900	1,597	876,593,300	
キリンホールディングス	1,211,000	1,172	1,419,292,000	
宝ホールディングス	248,000	492	122,016,000	
オエノンホールディングス	95,000	215	20,425,000	
養命酒製造	22,000	795	17,490,000	
三国コカ・コーラボトリング	31,000	769	23,839,000	
コカ・コーラウエスト	91,300	1,530	139,689,000	
コカ・コーラ セントラル ジャパン	31,100	1,142	35,516,200	
ダイドードリンコ	12,400	3,100	38,440,000	
伊藤園	75,000	1,345	100,875,000	
キーコーヒー	22,900	1,487	34,052,300	
ジャパンフーズ	4,000	805	3,220,000	
日清オイリオグループ	131,000	420	55,020,000	
不二製油	72,300	1,192	86,181,600	
J - オイルミルズ	118,000	259	30,562,000	
キッコーマン	239,000	937	223,943,000	
味の素	797,000	845	673,465,000	
キューピー	150,400	1,025	154,160,000	
ハウス食品	107,100	1,306	139,872,600	
カゴメ	104,100	1,508	156,982,800	
焼津水産化学工業	11,600	860	9,976,000	
アリアケジャパン	25,100	1,355	34,010,500	
ニチレイ	328,000	380	124,640,000	
東洋水産	126,000	1,820	229,320,000	
日清食品ホールディングス	104,800	2,930	307,064,000	
永谷園	21,000	861	18,081,000	
フジッコ	28,000	1,044	29,232,000	
ロック・フィールド	14,400	1,298	18,691,200	
日本たばこ産業	6,095	283,600	1,728,542,000	
わらべや日洋	17,000	1,039	17,663,000	
なとり	7,800	822	6,411,600	
ミヨシ油脂	112,000	137	15,344,000	
片倉工業	30,600	834	25,520,400	
ゲンゼ	188,000	337	63,356,000	
東洋紡績	971,000	148	143,708,000	
ユニチカ	630,000	74	46,620,000	
富士紡ホールディングス	141,000	144	20,304,000	
日清紡ホールディングス	172,000	924	158,928,000	
倉敷紡績	270,000	151	40,770,000	
シキボウ	180,000	122	21,960,000	
日本毛織	95,000	694	65,930,000	
トーア紡コーポレーション	115,000	76	8,740,000	
ダイドーリミテッド	33,500	725	24,287,500	
帝国繊維	28,000	544	15,232,000	
帝人	1,042,000	341	355,322,000	

東レ	2,122,000	486	1,031,292,000
サカイオーベックス	95,000	129	12,255,000
住江織物	87,000	161	14,007,000
日本フェルト	10,200	409	4,171,800
イチカワ	22,000	158	3,476,000
日本バイリーン	32,000	419	13,408,000
日東製網	47,000	95	4,465,000
芦森工業	82,000	133	10,906,000
アツギ	244,000	110	26,840,000
ダイニック	62,000	156	9,672,000
セーレン	70,200	583	40,926,600
東海染工	51,000	86	4,386,000
小松精練	36,000	341	12,276,000
ワコールホールディングス	162,000	1,167	189,054,000
ホギメディカル	14,200	3,905	55,451,000
サンエー・インターナショナル	14,300	978	13,985,400
レナウン	47,500	210	9,975,000
クラウディア	2,800	1,203	3,368,400
三陽商会	135,000	338	45,630,000
オンワードホールディングス	183,000	729	133,407,000
ルック	13,000	143	1,859,000
ゴールドウイン	75,000	228	17,100,000
東京スタイル	99,000	610	60,390,000
デサント	66,000	477	31,482,000
ヤマトインターナショナル	14,400	370	5,328,000
特種東海製紙	181,000	192	34,752,000
王子製紙	1,204,000	391	470,764,000
三菱製紙	406,000	99	40,194,000
北越紀州製紙	169,000	471	79,599,000
中越パルプ工業	118,000	149	17,582,000
巴川製紙所	56,000	226	12,656,000
大王製紙	112,000	575	64,400,000
日本製紙グループ本社	131,300	2,076	272,578,800
レンゴー	220,000	549	120,780,000
トーモク	87,000	236	20,532,000
ザ・パック	18,400	1,503	27,655,200
クラレ	402,900	1,172	472,198,800
旭化成	1,589,000	523	831,047,000
共和レザー	13,400	309	4,140,600
コープケミカル	57,000	107	6,099,000
昭和電工	1,833,000	191	350,103,000
住友化学	1,884,000	391	736,644,000
日本化成	69,000	199	13,731,000
住友精化	55,000	362	19,910,000
日産化学工業	197,400	1,077	212,599,800
クレハ	178,000	497	88,466,000

テイカ	46,000	290	13,340,000
石原産業	488,000	84	40,992,000
片倉チッカリン	18,000	259	4,662,000
日本曹達	167,000	395	65,965,000
東ソー	687,000	258	177,246,000
トクヤマ	429,000	422	181,038,000
セントラル硝子	264,000	376	99,264,000
東亜合成	278,000	389	108,142,000
ダイソー	107,000	247	26,429,000
関東電化工業	65,000	630	40,950,000
電気化学工業	580,000	391	226,780,000
信越化学工業	455,900	4,315	1,967,208,500
日本カーバイド工業	74,000	241	17,834,000
堺化学工業	87,000	410	35,670,000
エア・ウォーター	219,000	1,033	226,227,000
大陽日酸	358,000	695	248,810,000
日本化学工業	103,000	210	21,630,000
日本パーカライジング	65,000	1,190	77,350,000
高圧ガス工業	34,000	501	17,034,000
チタン工業	43,000	270	11,610,000
四国化成工業	38,000	482	18,316,000
戸田工業	41,000	809	33,169,000
ステラ ケミファ	11,900	3,595	42,780,500
保土谷化学工業	69,000	322	22,218,000
日本触媒	224,000	824	184,576,000
大日精化工業	100,000	445	44,500,000
カネカ	339,000	554	187,806,000
三菱瓦斯化学	433,000	556	240,748,000
三井化学	1,248,000	286	356,928,000
J S R	229,100	1,499	343,420,900
東京応化工業	49,400	1,800	88,920,000
三菱ケミカルホールディングス	1,586,500	528	837,672,000
日本合成化学工業	66,000	558	36,828,000
ダイセル化学工業	356,000	586	208,616,000
住友ベークライト	256,000	469	120,064,000
積水化学工業	568,000	580	329,440,000
日本ゼオン	259,000	702	181,818,000
アイカ工業	76,500	952	72,828,000
宇部興産	1,154,000	229	264,266,000
積水樹脂	37,000	832	30,784,000
タキロン	65,000	275	17,875,000
旭有機材工業	99,000	213	21,087,000
日立化成工業	117,700	1,703	200,443,100
ニチバン	24,000	307	7,368,000
リケンテクノス	46,000	271	12,466,000
大倉工業	74,000	226	16,724,000

積水化成成品工業	63,000	363	22,869,000
群栄化学工業	79,000	241	19,039,000
タイガースポリマー	16,400	359	5,887,600
日本カーリット	22,800	461	10,510,800
日本化薬	189,000	872	164,808,000
日本精化	22,600	537	12,136,200
A D E K A	110,000	907	99,770,000
日油	236,000	396	93,456,000
ハリマ化成	25,300	501	12,675,300
花王	745,600	2,172	1,619,443,200
第一工業製薬	52,000	250	13,000,000
三洋化成工業	75,000	665	49,875,000
大日本塗料	189,000	107	20,223,000
日本ペイント	235,000	635	149,225,000
関西ペイント	309,000	790	244,110,000
中国塗料	72,000	674	48,528,000
日本特殊塗料	24,600	357	8,782,200
藤倉化成	36,000	562	20,232,000
太陽ホールディングス	19,700	2,605	51,318,500
D I C	1,057,000	183	193,431,000
サカタインクス	50,000	417	20,850,000
東洋インキ製造	247,000	399	98,553,000
富士フイルムホールディングス	583,700	2,935	1,713,159,500
資生堂	454,700	1,771	805,273,700
ライオン	307,000	449	137,843,000
高砂香料工業	91,000	501	45,591,000
マンダム	27,500	2,223	61,132,500
ミルボン	14,300	2,217	31,703,100
ファンケル	53,600	1,234	66,142,400
コーセー	48,800	2,072	101,113,600
ドクターシーラボ	181	316,000	57,196,000
エステー	17,000	976	16,592,000
コニシ	20,700	1,015	21,010,500
長谷川香料	34,200	1,397	47,777,400
小林製薬	37,300	3,805	141,926,500
荒川化学工業	20,800	874	18,179,200
メック	23,200	386	8,955,200
日本高純度化学	79	270,800	21,393,200
荏原ユーザライト	4,500	1,675	7,537,500
アース製薬	17,000	2,868	48,756,000
イハラケミカル工業	54,000	276	14,904,000
北興化学工業	29,000	245	7,105,000
大成ラミック	5,700	2,265	12,910,500
クミアイ化学工業	66,000	275	18,150,000
日本農薬	62,000	439	27,218,000
アキレス	229,000	120	27,480,000

有沢製作所	44,200	487	21,525,400	
日東電工	226,100	3,790	856,919,000	
レック	8,100	1,417	11,477,700	
アロン化成	18,000	372	6,696,000	
きもと	27,400	813	22,276,200	
藤森工業	20,600	1,210	24,926,000	
前澤化成工業	18,700	746	13,950,200	
J S P	18,400	1,175	21,620,000	
エフピコ	13,500	4,585	61,897,500	
天馬	21,300	917	19,532,100	
信越ポリマー	53,500	500	26,750,000	
東リ	79,000	149	11,771,000	
ニフコ	52,500	2,307	121,117,500	
日本バルカー工業	121,000	252	30,492,000	
ユニ・チャーム	150,500	3,380	508,690,000	
協和発酵キリン	325,000	867	281,775,000	
武田薬品工業	1,025,700	3,985	4,087,414,500	
アステラス製薬	607,000	3,125	1,896,875,000	
大日本住友製薬	194,500	752	146,264,000	
塩野義製薬	400,000	1,601	640,400,000	
田辺三菱製薬	226,700	1,323	299,924,100	
わかもと製薬	33,000	248	8,184,000	
あすか製薬	35,000	567	19,845,000	
日本新薬	64,000	1,115	71,360,000	
中外製薬	272,100	1,526	415,224,600	
科研製薬	115,000	989	113,735,000	
エーザイ	337,200	2,965	999,798,000	
ロート製薬	126,000	972	122,472,000	
小野薬品工業	136,600	3,825	522,495,000	
久光製薬	76,900	3,390	260,691,000	
有機合成薬品工業	24,000	233	5,592,000	
持田製薬	106,000	878	93,068,000	
大正製薬	216,000	1,804	389,664,000	
参天製薬	84,600	2,888	244,324,800	
扶桑薬品工業	104,000	258	26,832,000	
日本ケミファ	49,000	284	13,916,000	
ツムラ	75,600	2,630	198,828,000	
キッセイ薬品工業	56,200	1,624	91,268,800	
生化学工業	51,400	934	48,007,600	
栄研化学	22,800	915	20,862,000	
日水製薬	8,400	694	5,829,600	
鳥居薬品	17,900	1,700	30,430,000	
東和薬品	14,100	4,595	64,789,500	
沢井製薬	18,300	6,830	124,989,000	
ゼリア新薬工業	40,000	1,010	40,400,000	
第一三共	920,800	1,819	1,674,935,200	

キョーリン製薬ホールディングス	74,000	1,439	106,486,000
大幸薬品	10,600	1,228	13,016,800
昭和シェル石油	243,600	754	183,674,400
コスモ石油	754,000	264	199,056,000
ニチレキ	34,000	321	10,914,000
東燃ゼネラル石油	412,000	930	383,160,000
ユシロ化学工業	14,800	1,227	18,159,600
ビービー・カストロール	11,300	347	3,921,100
AOCホールディングス	69,900	458	32,014,200
出光興産	32,500	8,240	267,800,000
JXホールディングス	3,040,100	547	1,662,934,700
横浜ゴム	304,000	423	128,592,000
東洋ゴム工業	237,000	199	47,163,000
ブリヂストン	858,000	1,607	1,378,806,000
住友ゴム工業	193,500	843	163,120,500
藤倉ゴム工業	13,200	363	4,791,600
オカモト	102,000	346	35,292,000
フコク	10,000	848	8,480,000
ニッタ	25,600	1,580	40,448,000
東海ゴム工業	42,200	1,127	47,559,400
三ツ星ベルト	71,000	487	34,577,000
バンドー化学	97,000	339	32,883,000
日東紡績	229,000	213	48,777,000
旭硝子	1,348,000	937	1,263,076,000
日本板硝子	1,180,000	218	257,240,000
石塚硝子	41,000	171	7,011,000
日本山村硝子	112,000	220	24,640,000
日本電気硝子	565,000	1,132	639,580,000
オハラ	11,600	1,169	13,560,400
住友大阪セメント	520,000	195	101,400,000
太平洋セメント	1,164,000	117	136,188,000
デイ・シイ	24,900	154	3,834,600
日本ヒューム	6,000	255	1,530,000
日本コンクリート工業	43,000	138	5,934,000
東海カーボン	255,000	495	126,225,000
日本カーボン	140,000	260	36,400,000
東洋炭素	13,600	4,760	64,736,000
ノリタケカンパニーリミテド	143,000	299	42,757,000
TOTO	388,000	593	230,084,000
日本碍子	330,000	1,329	438,570,000
日本特殊陶業	243,000	1,242	301,806,000
MARUWA	6,900	2,368	16,339,200
品川リフラクトリーズ	74,000	247	18,278,000
黒崎播磨	57,000	351	20,007,000
東京窯業	30,000	218	6,540,000
ニッカトー	10,600	398	4,218,800

フジミインコーポレーテッド	25,100	1,279	32,102,900
ニチアス	134,000	436	58,424,000
ニチハ	30,500	681	20,770,500
新日本製鐵	7,187,000	300	2,156,100,000
住友金属工業	5,077,000	205	1,040,785,000
神戸製鋼所	3,801,000	211	802,011,000
日新製鋼	1,062,000	177	187,974,000
中山製鋼所	164,000	113	18,532,000
合同製鐵	168,000	182	30,576,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	648,300	2,836	1,838,578,800
東京製鐵	153,300	945	144,868,500
共英製鋼	29,800	1,305	38,889,000
大和工業	62,300	2,528	157,494,400
東京鐵鋼	65,000	224	14,560,000
大阪製鐵	16,500	1,437	23,710,500
淀川製鋼所	211,000	382	80,602,000
東洋鋼鈑	67,000	465	31,155,000
住友鋼管	16,300	573	9,339,900
丸一鋼管	90,600	1,758	159,274,800
モリ工業	51,000	337	17,187,000
大同特殊鋼	462,000	486	224,532,000
日本高周波鋼業	136,000	101	13,736,000
日本金属工業	51,000	113	5,763,000
日本冶金工業	73,000	249	18,177,000
山陽特殊製鋼	141,000	498	70,218,000
愛知製鋼	148,000	560	82,880,000
日立金属	179,000	964	172,556,000
日本金属	88,000	166	14,608,000
大平洋金属	188,000	675	126,900,000
日本電工	112,000	646	72,352,000
栗本鐵工所	165,000	113	18,645,000
日本鑄鉄管	45,000	129	5,805,000
三菱製鋼	174,000	252	43,848,000
日亜鋼業	41,000	223	9,143,000
日本精線	26,000	449	11,674,000
シンニッタン	33,600	346	11,625,600
新家工業	73,000	136	9,928,000
日本輕金属	634,000	155	98,270,000
大紀アルミニウム工業所	47,000	260	12,220,000
三井金属鋳業	789,000	266	209,874,000
東邦亜鉛	155,000	417	64,635,000
三菱マテリアル	1,707,000	266	454,062,000
住友金属鋳山	755,000	1,370	1,034,350,000
DOWAホールディングス	327,000	529	172,983,000
古河機械金属	487,000	106	51,622,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	30,900	3,720	114,948,000

東邦チタニウム	46,000	1,954	89,884,000
住友軽金属工業	295,000	99	29,205,000
古河スカイ	122,000	240	29,280,000
古河電気工業	865,000	371	320,915,000
住友電気工業	965,700	1,125	1,086,412,500
フジクラ	412,000	410	168,920,000
昭和電線ホールディングス	348,000	93	32,364,000
タツタ電線	43,000	223	9,589,000
日立電線	211,000	230	48,530,000
沖電線	51,000	156	7,956,000
カナレ電気	700	1,240	868,000
平河ヒューテック	5,600	682	3,819,200
リョービ	160,000	359	57,440,000
アサヒホールディングス	38,300	1,756	67,254,800
稲葉製作所	9,700	830	8,051,000
宮地エンジニアリンググループ	67,000	87	5,829,000
三協・立山ホールディングス	339,000	108	36,612,000
トーカロ	15,700	1,534	24,083,800
アルファC O	9,600	858	8,236,800
SUMCO	169,600	1,129	191,478,400
川田テクノロジーズ	6,600	1,540	10,164,000
東洋製罐	189,500	1,586	300,547,000
ホッカインホールディングス	56,000	241	13,496,000
コロナ	14,500	781	11,324,500
横河ブリッジホールディングス	51,000	551	28,101,000
駒井ハルテック	58,000	199	11,542,000
高田機工	25,000	171	4,275,000
三和ホールディングス	280,000	275	77,000,000
文化シャッター	76,000	217	16,492,000
東洋シャッター	3,200	270	864,000
住生活グループ	330,000	1,780	587,400,000
日本ファイルコン	24,200	415	10,043,000
ノーリツ	50,600	1,453	73,521,800
長府製作所	25,100	1,890	47,439,000
リンナイ	43,500	4,940	214,890,000
ダイニチ工業	12,100	557	6,739,700
日東精工	43,000	276	11,868,000
三洋工業	47,000	110	5,170,000
岡部	53,800	392	21,089,600
中国工業	63,000	98	6,174,000
東プレ	53,600	651	34,893,600
高周波熱錬	36,700	710	26,057,000
東京製綱	192,000	274	52,608,000
パイオラックス	11,300	1,819	20,554,700
日本発條	200,000	867	173,400,000
中央発條	38,000	318	12,084,000

三益半導体工業	22,800	907	20,679,600
アタカ大機	18,000	233	4,194,000
日本製鋼所	421,000	834	351,114,000
日立ツール	17,500	955	16,712,500
三浦工業	42,900	2,134	91,548,600
タクマ	108,000	244	26,352,000
ツガミ	81,000	578	46,818,000
オークマ	183,000	612	111,996,000
東芝機械	165,000	424	69,960,000
アマダ	386,000	656	253,216,000
アイダエンジニアリング	76,800	374	28,723,200
牧野フライス製作所	128,000	660	84,480,000
オーエスジー	121,900	947	115,439,300
ダイジェット工業	43,000	115	4,945,000
旭ダイヤモンド工業	59,000	1,518	89,562,000
森精機製作所	147,300	964	141,997,200
ディスコ	27,900	5,280	147,312,000
日東工器	15,300	2,140	32,742,000
豊和工業	177,000	80	14,160,000
大阪機工	109,000	132	14,388,000
オーエム製作所	25,000	305	7,625,000
津田駒工業	63,000	159	10,017,000
島精機製作所	36,100	1,919	69,275,900
日阪製作所	33,000	1,083	35,739,000
やまびこ	12,900	850	10,965,000
ベガサスマシン製造	30,200	234	7,066,800
ナブテスコ	103,600	1,685	174,566,000
三井海洋開発	23,900	1,479	35,348,100
レオン自動機	28,000	204	5,712,000
S M C	81,600	14,370	1,172,592,000
新川	22,400	903	20,227,200
ホソカワミクロン	52,000	348	18,096,000
ユニオンツール	16,800	2,325	39,060,000
オイレス工業	27,800	1,548	43,034,400
サトー	26,700	1,121	29,930,700
日本エアーテック	10,100	424	4,282,400
日精樹脂工業	28,200	286	8,065,200
ワイエイシイ	15,500	665	10,307,500
小松製作所	1,296,300	2,500	3,240,750,000
住友重機械工業	699,000	523	365,577,000
日立建機	122,400	1,978	242,107,200
日工	38,000	295	11,210,000
巴工業	9,200	1,167	10,736,400
井関農機	286,000	216	61,776,000
T O W A	30,700	655	20,108,500
丸山製作所	78,000	175	13,650,000

北川鉄工所	150,000	146	21,900,000
クボタ	1,147,000	798	915,306,000
荏原実業	6,800	1,297	8,819,600
三菱化工機	82,000	187	15,334,000
月島機械	41,000	627	25,707,000
帝国電機製作所	9,500	1,720	16,340,000
新東工業	57,400	765	43,911,000
澁谷工業	16,400	850	13,940,000
アイチ コーポレーション	44,500	370	16,465,000
小森コーポレーション	74,000	974	72,076,000
鶴見製作所	20,000	542	10,840,000
住友精密工業	47,000	373	17,531,000
酒井重工業	64,000	152	9,728,000
荏原製作所	484,000	397	192,148,000
石井鐵工所	43,000	161	6,923,000
西島製作所	30,300	1,691	51,237,300
ダイキン工業	285,600	2,902	828,811,200
オルガノ	46,000	641	29,486,000
トーヨーカネツ	155,000	152	23,560,000
栗田工業	149,600	2,553	381,928,800
椿本チエイン	142,000	435	61,770,000
大同工業	64,000	170	10,880,000
日本コンベヤ	122,000	84	10,248,000
木村化工機	27,900	578	16,126,200
アネスト岩田	49,000	337	16,513,000
ダイフク	114,500	583	66,753,500
加藤製作所	68,000	190	12,920,000
油研工業	62,000	182	11,284,000
タダノ	116,000	437	50,692,000
フジテック	77,000	418	32,186,000
シーケーディ	76,800	703	53,990,400
キトー	77	84,000	6,468,000
平和	56,300	1,188	66,884,400
理想科学工業	21,700	1,471	31,920,700
SANKYO	78,200	4,545	355,419,000
日本金銭機械	26,300	676	17,778,800
マースエンジニアリング	13,100	1,436	18,811,600
福島工業	8,000	917	7,336,000
オーイズミ	13,000	264	3,432,000
ダイコク電機	10,100	1,033	10,433,300
アマノ	71,600	806	57,709,600
JUKI	50,000	152	7,600,000
サンデン	155,000	346	53,630,000
マックス	45,000	972	43,740,000
グローリー	71,800	2,017	144,820,600
大和冷機工業	35,000	420	14,700,000

セガサミーホールディングス	275,700	1,546	426,232,200	
日本ビストンリング	115,000	245	28,175,000	
リケン	105,000	365	38,325,000	
帝国ビストンリング	34,300	820	28,126,000	
ホシザキ電機	53,000	1,581	83,793,000	
大豊工業	19,400	782	15,170,800	
日本精工	580,000	753	436,740,000	
N T N	604,000	445	268,780,000	
ジェイテクト	277,100	999	276,822,900	
不二越	268,000	270	72,360,000	
日本トムソン	93,000	662	61,566,000	
T H K	174,900	1,923	336,332,700	
ユーシン精機	13,500	1,681	22,693,500	
前澤給装工業	6,800	1,017	6,915,600	
イーグル工業	33,000	810	26,730,000	
日本ビラー工業	31,000	617	19,127,000	
キッツ	112,100	413	46,297,300	
日立工機	70,000	794	55,580,000	
マキタ	170,200	3,375	574,425,000	
日立造船	1,102,000	121	133,342,000	
三菱重工業	4,378,000	310	1,357,180,000	
I H I	1,790,000	183	327,570,000	
イビデン	159,800	2,560	409,088,000	
コニカミノルタホールディングス	691,500	853	589,849,500	
ブラザー工業	337,000	1,226	413,162,000	
ミネベア	390,000	528	205,920,000	
日立製作所	5,866,000	411	2,410,926,000	
東芝	5,163,000	439	2,266,557,000	
三菱電機	2,613,000	855	2,234,115,000	
富士電機ホールディングス	797,000	246	196,062,000	
東洋電機製造	50,000	428	21,400,000	
安川電機	290,000	770	223,300,000	
シンフォニアテクノロジー	172,000	198	34,056,000	
明電舎	267,000	382	101,994,000	
オリジン電気	42,000	406	17,052,000	
デンヨー	26,100	690	18,009,000	
東芝テック	161,000	392	63,112,000	
芝浦メカトロニクス	50,000	336	16,800,000	
マブチモーター	37,000	4,260	157,620,000	
日本電産	129,700	8,590	1,114,123,000	
高岳製作所	112,000	363	40,656,000	
ダイヘン	151,000	404	61,004,000	
日新電機	46,000	475	21,850,000	
大崎電気工業	41,000	710	29,110,000	
オムロン	291,500	2,175	634,012,500	
日東工業	40,700	930	37,851,000	

I D E C	34,900	764	26,663,600
エルピーダメモリ	215,700	913	196,934,100
ジーエス・ユアサ コーポレーション	509,000	581	295,729,000
サクサホールディングス	76,000	159	12,084,000
メルコホールディングス	14,800	2,851	42,194,800
テクノメディカ	20	297,900	5,958,000
日本電気	3,383,000	246	832,218,000
富士通	2,518,000	565	1,422,670,000
沖電気工業	985,000	73	71,905,000
岩崎通信機	160,000	70	11,200,000
電気興業	78,000	406	31,668,000
サンケン電気	158,000	368	58,144,000
ナカヨ通信機	26,000	193	5,018,000
アイホン	17,000	1,388	23,596,000
ルネサスエレクトロニクス	67,200	805	54,096,000
セイコーエプソン	179,000	1,478	264,562,000
ワコム	539	128,800	69,423,200
アルバック	48,800	2,109	102,919,200
アクセル	9,800	2,195	21,511,000
ナナオ	22,200	1,862	41,336,400
日本信号	61,400	638	39,173,200
京三製作所	54,000	383	20,682,000
能美防災	30,000	525	15,750,000
ホーチキ	19,000	413	7,847,000
マスプロ電工	15,600	739	11,528,400
日本無線	109,000	277	30,193,000
パナソニック	2,588,300	1,162	3,007,604,600
シャープ	1,171,000	849	994,179,000
アンリツ	115,000	627	72,105,000
富士通ゼネラル	65,000	470	30,550,000
日立国際電気	60,000	817	49,020,000
ソニー	1,468,000	2,964	4,351,152,000
T D K	147,200	5,770	849,344,000
帝国通信工業	57,000	197	11,229,000
三洋電機	1,885,000	135	254,475,000
宮越商事	12,000	350	4,200,000
ミツミ電機	92,000	1,527	140,484,000
タムラ製作所	82,000	256	20,992,000
アルプス電気	208,700	854	178,229,800
パイオニア	377,400	342	129,070,800
日本電波工業	20,800	1,539	32,011,200
日本トリム	2,750	1,820	5,005,000
ローランド ディー . ジー .	12,500	1,444	18,050,000
フォスター電機	25,100	2,287	57,403,700
クラリオン	30,000	161	4,830,000
S M K	81,000	449	36,369,000

ヨコオ	24,100	588	14,170,800
東光	137,000	155	21,235,000
ホシデン	65,400	1,010	66,054,000
ヒロセ電機	41,900	8,930	374,167,000
日本航空電子工業	61,000	639	38,979,000
T O A	32,000	457	14,624,000
ユニデン	91,000	257	23,387,000
アルパイン	52,200	1,152	60,134,400
スミダコーポレーション	19,700	936	18,439,200
アイコム	15,100	2,209	33,355,900
船井電機	24,200	3,045	73,689,000
横河電機	264,900	676	179,072,400
新電元工業	100,000	395	39,500,000
山武	72,600	1,964	142,586,400
日本光電工業	48,700	1,731	84,299,700
チノー	57,000	209	11,913,000
共和電業	29,000	290	8,410,000
日本電子材料	13,300	526	6,995,800
堀場製作所	45,100	2,352	106,075,200
アドバンテスト	179,700	1,895	340,531,500
小野測器	32,000	289	9,248,000
エスベック	31,400	650	20,410,000
パナソニック電工SUNX	27,800	530	14,734,000
キーエンス	58,300	23,640	1,378,212,000
日置電機	13,200	1,740	22,968,000
シスメックス	45,900	5,540	254,286,000
メガチップス	23,700	1,692	40,100,400
O B A R A	21,600	925	19,980,000
日本電産コパル電子	27,000	698	18,846,000
ミヤチテクノス	18,700	630	11,781,000
東京電波	9,700	638	6,188,600
澤藤電機	17,000	214	3,638,000
コーセル	36,100	1,209	43,644,900
日立メディコ	16,000	765	12,240,000
オプテックス	18,500	1,231	22,773,500
千代田インテグレ	12,100	1,191	14,411,100
東光電気	20,000	447	8,940,000
スタンレー電気	176,200	1,563	275,400,600
岩崎電気	114,000	153	17,442,000
ウシオ電機	159,200	1,461	232,591,200
岡谷電機産業	13,300	343	4,561,900
ヘリオス テクノ ホールディング	29,600	219	6,482,400
日本セラミック	18,000	1,437	25,866,000
新神戸電機	23,000	970	22,310,000
日本デジタル研究所	19,100	954	18,221,400
古河電池	20,000	562	11,240,000

双信電機	14,400	383	5,515,200	
図研	17,800	721	12,833,800	
日本電子	102,000	299	30,498,000	
カシオ計算機	251,100	672	168,739,200	
ファナック	272,000	12,370	3,364,640,000	
日本シイエムケイ	57,900	466	26,981,400	
エンプラス	15,400	1,203	18,526,200	
ローム	130,700	5,340	697,938,000	
浜松ホトニクス	101,500	2,964	300,846,000	
三井ハイテック	37,700	469	17,681,300	
新光電気工業	68,000	944	64,192,000	
京セラ	217,300	8,610	1,870,953,000	
太陽誘電	118,000	1,230	145,140,000	
村田製作所	274,300	5,450	1,494,935,000	
ユーシン	33,800	762	25,755,600	
双葉電子工業	44,400	1,598	70,951,200	
北陸電気工業	120,000	168	20,160,000	
パナソニック電工	244,000	1,097	267,668,000	
ニチコン	84,000	1,153	96,852,000	
日本ケミコン	170,000	414	70,380,000	
K O A	33,500	993	33,265,500	
市光工業	80,000	227	18,160,000	
小糸製作所	131,000	1,314	172,134,000	
ミツバ	51,000	737	37,587,000	
スター精密	50,400	908	45,763,200	
大日本スクリーン製造	292,000	559	163,228,000	
キヤノン電子	23,300	2,242	52,238,600	
キヤノン	1,624,000	4,145	6,731,480,000	
リコー	785,000	1,191	934,935,000	
日本電産サンキョー	64,000	688	44,032,000	
M U T O Hホールディングス	40,000	197	7,880,000	
東京エレクトロン	205,400	5,130	1,053,702,000	
トヨタ紡織	91,000	1,444	131,404,000	
鬼怒川ゴム工業	70,000	404	28,280,000	
ユニプレス	33,600	1,653	55,540,800	
豊田自動織機	235,900	2,532	597,298,800	
モリタホールディングス	41,000	473	19,393,000	
三櫻工業	27,300	747	20,393,100	
デンソー	574,400	2,838	1,630,147,200	
東海理化電機製作所	61,100	1,611	98,432,100	
三井造船	1,006,000	215	216,290,000	
佐世保重工業	170,000	168	28,560,000	
川崎重工業	2,039,000	277	564,803,000	
日本車輛製造	100,000	408	40,800,000	
日本輸送機	36,000	210	7,560,000	
近畿車輛	40,000	445	17,800,000	

日産自動車	3,300,800	795	2,624,136,000
いすゞ自動車	1,521,000	380	577,980,000
トヨタ自動車	3,358,200	3,255	10,930,941,000
日野自動車	331,000	426	141,006,000
三菱自動車工業	5,394,000	122	658,068,000
エフテック	9,300	1,501	13,959,300
武蔵精密工業	25,600	2,115	54,144,000
トヨタ車体	45,000	1,551	69,795,000
日産車体	98,000	715	70,070,000
関東自動車工業	39,500	693	27,373,500
新明和工業	120,000	357	42,840,000
極東開発工業	51,600	341	17,595,600
日信工業	52,400	1,503	78,757,200
トピー工業	225,000	226	50,850,000
ティラド	89,000	354	31,506,000
曙ブレーキ工業	125,400	532	66,712,800
タチエス	35,000	1,358	47,530,000
NOK	126,900	1,653	209,765,700
フタバ産業	77,100	628	48,418,800
カヤバ工業	165,000	624	102,960,000
シロキ工業	60,000	310	18,600,000
大同メタル工業	38,000	634	24,092,000
プレス工業	126,000	390	49,140,000
カルソニックカンセイ	139,000	328	45,592,000
太平洋工業	54,000	485	26,190,000
ケーヒン	54,600	1,924	105,050,400
河西工業	36,000	454	16,344,000
アイシン精機	214,400	2,938	629,907,200
富士機工	7,000	289	2,023,000
マツダ	2,028,000	244	494,832,000
ダイハツ工業	277,000	1,192	330,184,000
愛知機械工業	61,000	340	20,740,000
今仙電機製作所	17,600	1,201	21,137,600
本田技研工業	2,205,400	3,235	7,134,469,000
スズキ	545,500	2,034	1,109,547,000
富士重工業	828,000	647	535,716,000
ヤマハ発動機	399,000	1,347	537,453,000
ショーワ	54,300	611	33,177,300
T B K	30,000	428	12,840,000
エクセディ	31,700	2,679	84,924,300
豊田合成	73,200	1,953	142,959,600
愛三工業	29,700	746	22,156,200
ヨロズ	14,900	1,465	21,828,500
エフ・シー・シー	38,700	1,948	75,387,600
シマノ	107,700	4,120	443,724,000
タカタ	40,800	2,544	103,795,200

テイ・エス テック	49,300	1,588	78,288,400
日本電産トーソク	17,700	956	16,921,200
テルモ	204,400	4,615	943,306,000
クリエートメディック	3,800	864	3,283,200
日機装	94,000	694	65,236,000
島津製作所	312,000	641	199,992,000
JMS	33,000	290	9,570,000
クボテック	56	28,400	1,590,400
モリテックス	9,200	485	4,462,000
長野計器	19,500	745	14,527,500
東京計器	108,000	123	13,284,000
愛知時計電機	31,000	219	6,789,000
東京精密	51,800	1,322	68,479,600
ニコン	456,300	1,640	748,332,000
トプコン	62,400	512	31,948,800
オリンパス	307,900	2,566	790,071,400
理研計器	19,100	701	13,389,100
タムロン	25,600	1,716	43,929,600
HOYA	600,800	1,996	1,199,196,800
ノーリツ鋼機	22,300	538	11,997,400
エー・アンド・デイ	27,100	353	9,566,300
日本電産コパル	21,000	1,448	30,408,000
シチズンホールディングス	285,700	569	162,563,300
リズム時計工業	139,000	140	19,460,000
セイコーホールディングス	145,000	319	46,255,000
ニプロ	49,400	1,619	79,978,600
SRIスポーツ	175	95,200	16,660,000
バンダイナムコホールディングス	305,200	881	268,881,200
共立印刷	36,700	135	4,954,500
フランスベッドホールディングス	189,000	112	21,168,000
パイロットコーポレーション	252	150,500	37,926,000
トッパン・フォームズ	51,500	845	43,517,500
フジシールインターナショナル	27,400	1,836	50,306,400
タカラトミー	77,800	660	51,348,000
廣済堂	20,900	135	2,821,500
タカノ	12,000	489	5,868,000
プロネクサス	31,200	424	13,228,800
ホクシン	30,300	112	3,393,600
ウッドワン	50,000	257	12,850,000
大建工業	118,000	218	25,724,000
凸版印刷	735,000	746	548,310,000
大日本印刷	794,000	1,110	881,340,000
図書印刷	47,000	137	6,439,000
共同印刷	82,000	196	16,072,000
日本写真印刷	48,800	2,003	97,746,400
光村印刷	25,000	274	6,850,000

宝印刷	7,000	687	4,809,000	
アシックス	244,000	1,018	248,392,000	
ツツミ	11,800	2,237	26,396,600	
ローランド	27,000	1,048	28,296,000	
小松ウオール工業	7,600	782	5,943,200	
ヤマハ	209,500	1,017	213,061,500	
河合楽器製作所	115,000	187	21,505,000	
クリナップ	31,200	562	17,534,400	
ビジョン	18,100	2,730	49,413,000	
パラマウントベッド	21,400	2,235	47,829,000	
兼松日産農林	51,000	132	6,732,000	
キングジム	17,600	570	10,032,000	
リンテック	55,500	2,151	119,380,500	
イトーキ	68,900	232	15,984,800	
任天堂	149,500	23,680	3,540,160,000	
三菱鉛筆	22,600	1,430	32,318,000	
タカラスタANDARD	120,000	570	68,400,000	
コクヨ	136,300	720	98,136,000	
ナカバヤシ	55,000	177	9,735,000	
グローブライド	142,000	103	14,626,000	
岡村製作所	104,000	538	55,952,000	
美津濃	128,000	392	50,176,000	
ユニハアー	30,200	1,139	34,397,800	
東京電力	1,925,900	1,970	3,794,023,000	
中部電力	805,000	2,004	1,613,220,000	
関西電力	1,066,500	2,028	2,162,862,000	
中国電力	360,000	1,671	601,560,000	
北陸電力	268,200	2,064	553,564,800	
東北電力	652,600	1,813	1,183,163,800	
四国電力	264,700	2,449	648,250,300	
九州電力	576,800	1,827	1,053,813,600	
北海道電力	242,600	1,669	404,899,400	
沖縄電力	16,000	4,030	64,480,000	
電源開発	163,000	2,623	427,549,000	
東京瓦斯	3,272,000	366	1,197,552,000	
大阪瓦斯	2,623,000	314	823,622,000	
東邦瓦斯	672,000	405	272,160,000	
北海道瓦斯	50,000	243	12,150,000	
西部瓦斯	299,000	218	65,182,000	
静岡瓦斯	75,500	499	37,674,500	
東武鉄道	1,113,000	457	508,641,000	
相鉄ホールディングス	421,000	274	115,354,000	
東京急行電鉄	1,437,000	377	541,749,000	
京浜急行電鉄	671,000	730	489,830,000	
小田急電鉄	834,000	772	643,848,000	
京王電鉄	675,000	565	381,375,000	

京成電鉄	421,000	558	234,918,000
富士急行	75,000	420	31,500,000
新京成電鉄	34,000	350	11,900,000
東日本旅客鉄道	455,000	5,330	2,425,150,000
西日本旅客鉄道	2,439	298,500	728,041,500
東海旅客鉄道	2,273	678,000	1,541,094,000
アートコーポレーション	5,700	1,290	7,353,000
西日本鉄道	321,000	346	111,066,000
ハマキョウレックス	8,300	2,431	20,177,300
サカイ引越センター	4,400	1,830	8,052,000
近畿日本鉄道	2,373,000	257	609,861,000
阪急阪神ホールディングス	1,746,000	383	668,718,000
南海電気鉄道	543,000	330	179,190,000
京阪電気鉄道	583,000	335	195,305,000
名糖運輸	9,800	672	6,585,600
名古屋鉄道	901,000	222	200,022,000
日本通運	1,038,000	359	372,642,000
ヤマトホールディングス	531,200	1,167	619,910,400
山九	322,000	365	117,530,000
丸運	18,200	214	3,894,800
丸全昭和運輸	86,000	268	23,048,000
センコー	102,000	274	27,948,000
トナミホールディングス	66,000	160	10,560,000
日本梱包運輸倉庫	79,000	968	76,472,000
日本石油輸送	23,000	194	4,462,000
福山通運	182,000	439	79,898,000
セイノーホールディングス	202,000	567	114,534,000
神奈川中央交通	31,000	409	12,679,000
日立物流	45,700	1,260	57,582,000
日本郵船	2,204,000	369	813,276,000
商船三井	1,269,000	567	719,523,000
川崎汽船	809,000	366	296,094,000
NSユナイテッド海運	98,000	211	20,678,000
乾汽船	29,000	501	14,529,000
明治海運	28,500	345	9,832,500
飯野海運	133,800	391	52,315,800
共栄タンカー	27,000	161	4,347,000
第一中央汽船	164,000	211	34,604,000
全日本空輸	3,483,000	306	1,065,798,000
パスコ	31,000	244	7,564,000
国際航業ホールディングス	15,000	179	2,685,000
日新	104,000	214	22,256,000
三菱倉庫	185,000	1,084	200,540,000
三井倉庫	112,000	340	38,080,000
住友倉庫	193,000	433	83,569,000
澁澤倉庫	72,000	294	21,168,000

東陽倉庫	40,000	186	7,440,000
日本トランスシティ	55,000	290	15,950,000
ケイヒン	66,000	100	6,600,000
安田倉庫	21,500	482	10,363,000
東洋埠頭	90,000	137	12,330,000
宇徳	20,800	236	4,908,800
上組	285,000	698	198,930,000
サンリツ	8,700	599	5,211,300
キムラユニティー	2,900	683	1,980,700
キューソー流通システム	7,400	877	6,489,800
郵船ロジスティクス	21,300	1,214	25,858,200
近鉄エクスプレス	23,300	2,281	53,147,300
東海運	17,100	190	3,249,000
バンテック	123	125,000	15,375,000
システナ	294	84,100	24,725,400
新日鉄ソリューションズ	22,700	1,752	39,770,400
コア	9,200	681	6,265,200
I Tホールディングス	86,400	1,111	95,990,400
グリー	44,600	1,098	48,970,800
コーエーテクモホールディングス	54,600	643	35,107,800
三菱総合研究所	5,100	1,912	9,751,200
ドワンゴ	145	168,500	24,432,500
ベリサーブ	16	135,000	2,160,000
マクロミル	145	181,000	26,245,000
ティーガイア	229	143,500	32,861,500
GMOペイメントゲートウェイ	73	195,800	14,293,400
ザッパラス	171	129,600	22,161,600
インターネットイニシアティブ	164	230,800	37,851,200
ソネットエンタテインメント	151	248,600	37,538,600
S R Aホールディングス	13,300	862	11,464,600
J B I Sホールディングス	31,800	319	10,144,200
朝日ネット	11,000	322	3,542,000
パナソニック電気インフォメーションシステムズ	5,400	2,250	12,150,000
フェイス	923	10,140	9,359,220
野村総合研究所	146,500	1,814	265,751,000
サイバネットシステム	210	23,530	4,941,300
インテージ	8,000	1,671	13,368,000
シンプレクス・ホールディングス	466	36,800	17,148,800
クレスコ	8,600	508	4,368,800
フジ・メディア・ホールディングス	2,701	130,600	352,750,600
オービック	8,910	16,030	142,827,300
ティーディーシーソフトウェアエンジニアリング	5,600	765	4,284,000
ヤフー	18,960	32,450	615,252,000
トレンドマイクロ	114,800	2,773	318,340,400
日本オラクル	41,600	3,880	161,408,000
アルファシステムズ	8,000	1,509	12,072,000

フューチャーアーキテクト	316	36,150	11,423,400
シーエーシー	15,800	653	10,317,400
ソフトバンク・テクノロジー	7,200	649	4,672,800
トーセ	8,200	535	4,387,000
オービックビジネスコンサルタント	7,050	4,310	30,385,500
日立ビジネスソリューション	7,900	800	6,320,000
伊藤忠テクノソリューションズ	37,200	3,100	115,320,000
アイティフォー	33,900	282	9,559,800
東計電算	2,300	1,233	2,835,900
エクスネット	23	132,400	3,045,200
大塚商会	20,900	5,760	120,384,000
サイボウズ	472	24,100	11,375,200
アグレックス	3,300	798	2,633,400
電通国際情報サービス	20,100	590	11,859,000
ウェザーニューズ	7,500	1,399	10,492,500
C I J	23,800	276	6,568,800
ネットワンシステムズ	654	118,100	77,237,400
アルゴグラフィックス	10,700	1,048	11,213,600
エイベックス・グループ・ホールディングス	51,100	1,152	58,867,200
日本ユニシス	73,100	624	45,614,400
兼松エレクトロニクス	11,800	826	9,746,800
東京放送ホールディングス	141,000	1,177	165,957,000
日本テレビ放送網	22,650	12,580	284,937,000
テレビ朝日	648	143,300	92,858,400
スカパー J S A Tホールディングス	2,029	31,100	63,101,900
テレビ東京ホールディングス	11,700	1,274	14,905,800
アイ・ティー・シーネットワーク	22,100	469	10,364,900
イー・アクセス	1,122	51,400	57,670,800
N E C モバイリング	9,200	2,395	22,034,000
日本電信電話	1,101,200	3,745	4,123,994,000
K D D I	4,008	498,000	1,995,984,000
光通信	34,600	1,853	64,113,800
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	21,308	141,400	3,012,951,200
G M O インターネット	25,300	428	10,828,400
学研ホールディングス	123,000	188	23,124,000
ゼンリン	40,000	974	38,960,000
昭文社	16,300	621	10,122,300
角川グループホールディングス	25,100	2,048	51,404,800
インプレスホールディングス	41,100	150	6,165,000
アイネット	12,300	473	5,817,900
松竹	165,000	539	88,935,000
東宝	168,400	1,317	221,782,800
東映	110,000	397	43,670,000
葵プロモーション	14,000	457	6,398,000
エヌ・ティ・ティ・データ	1,823	283,500	516,820,500
D T S	26,200	1,044	27,352,800

スクウェア・エニックス・ホールディングス	85,500	1,434	122,607,000	
シーイーシー	18,600	402	7,477,200	
カブコン	56,900	1,337	76,075,300	
ジャステック	14,500	478	6,931,000	
住商情報システム	27,800	1,425	39,615,000	
C S K	41,500	374	15,521,000	
日本システムウエア	14,400	357	5,140,800	
アイネス	37,500	654	24,525,000	
T K C	16,900	1,697	28,679,300	
富士ソフト	36,300	1,467	53,252,100	
N S D	50,400	943	47,527,200	
コナミ	116,800	1,725	201,480,000	
福井コンピュータ	8,700	434	3,775,800	
J B C C ホールディングス	22,800	520	11,856,000	
ソフトバンク	1,143,700	2,821	3,226,377,700	
ハウスイ	35,000	108	3,780,000	
インターニックス	13,900	388	5,393,200	
高千穂交易	6,300	911	5,739,300	
伊藤忠食品	4,700	2,725	12,807,500	
エレマテック	18,600	1,200	22,320,000	
J A L U X	7,100	665	4,721,500	
トーメンデバイス	2,800	1,772	4,961,600	
双日	1,732,600	170	294,542,000	
アルフレッサ ホールディングス	67,200	3,575	240,240,000	
横浜冷凍	44,400	550	24,420,000	
神栄	48,000	149	7,152,000	
山下医科器械	2,200	1,156	2,543,200	
ラサ商事	9,400	318	2,989,200	
あい ホールディングス	57,400	308	17,679,200	
ダイワボウホールディングス	247,000	229	56,563,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	46,400	684	31,737,600	
U K C ホールディングス	17,600	940	16,544,000	
日本コークス工業	236,500	154	36,421,000	
ミタチ産業	7,300	473	3,452,900	
J F E 商事ホールディングス	173,000	374	64,702,000	
シップヘルスケアホールディングス	35,500	1,028	36,494,000	
富士興産	124,000	75	9,300,000	
協栄産業	41,000	174	7,134,000	
小野建	23,300	766	17,847,800	
佐鳥電機	20,900	640	13,376,000	
エコートレーディング	3,600	835	3,006,000	
伯東	15,900	831	13,212,900	
中山福	3,200	597	1,910,400	
ナガイレーベン	12,600	2,130	26,838,000	
菱食	25,400	1,847	46,913,800	
松田産業	18,700	1,390	25,993,000	

メディopalホールディングス	237,200	904	214,428,800
アドヴァン	18,400	618	11,371,200
S P K	5,800	1,116	6,472,800
アズワン	16,100	1,750	28,175,000
スズデン	8,200	518	4,247,600
尾家産業	9,500	858	8,151,000
シモジマ	17,300	1,142	19,756,600
ドウシシャ	12,000	1,890	22,680,000
高速	10,500	733	7,696,500
黒田電気	36,000	1,136	40,896,000
丸文	24,700	486	12,004,200
ハピネット	5,300	1,008	5,342,400
トーマンエレクトロニクス	9,200	1,199	11,030,800
エクセル	12,900	1,035	13,351,500
マルカキカイ	9,300	581	5,403,300
ガリバーインターナショナル	7,430	3,885	28,865,550
日本エム・ディ・エム	30,300	205	6,211,500
進和	14,500	1,040	15,080,000
エスケイジャパン	10,100	285	2,878,500
ダイトエレクトロン	14,900	689	10,266,100
シークス	18,600	984	18,302,400
田中商事	9,000	324	2,916,000
オーハシテクニカ	17,300	597	10,328,100
マクニカ	12,500	2,031	25,387,500
白銅	11,700	871	10,190,700
伊藤忠商事	1,800,000	818	1,472,400,000
丸紅	2,256,000	570	1,285,920,000
高島	46,000	131	6,026,000
F & A アクアホールディングス	18,200	776	14,123,200
長瀬産業	144,000	1,018	146,592,000
蝶理	194,000	103	19,982,000
豊田通商	285,500	1,434	409,407,000
三共生興	48,000	285	13,680,000
兼松	607,000	75	45,525,000
ツカモトコーポレーション	73,000	89	6,497,000
三井物産	2,227,600	1,312	2,922,611,200
日本紙パルプ商事	140,000	297	41,580,000
日立ハイテクノロジーズ	79,100	1,892	149,657,200
カメイ	25,000	390	9,750,000
東都水産	56,000	131	7,336,000
スターゼン	73,000	237	17,301,000
山善	102,900	440	45,276,000
椿本興業	30,000	226	6,780,000
住友商事	1,420,900	1,172	1,665,294,800
内田洋行	63,000	301	18,963,000
三菱商事	2,065,200	2,195	4,533,114,000

第一実業	59,000	330	19,470,000
キヤノンマーケティングジャパン	87,200	1,176	102,547,200
西華産業	97,000	222	21,534,000
佐藤商事	26,100	481	12,554,100
菱洋エレクトロ	30,000	945	28,350,000
東京産業	17,000	256	4,352,000
ユアサ商事	280,000	84	23,520,000
神鋼商事	69,000	197	13,593,000
阪和興業	242,000	391	94,622,000
カナデン	26,000	523	13,598,000
菱電商事	32,000	511	16,352,000
フルサト工業	15,300	550	8,415,000
岩谷産業	277,000	248	68,696,000
すてきなイスグループ	126,000	188	23,688,000
昭光通商	112,000	137	15,344,000
ニチモウ	48,000	168	8,064,000
極東貿易	41,000	154	6,314,000
イワキ	35,000	205	7,175,000
三愛石油	58,000	405	23,490,000
稲畑産業	72,000	498	35,856,000
G S Iクレオス	93,000	125	11,625,000
明和産業	31,300	253	7,918,900
東邦ホールディングス	78,900	1,073	84,659,700
サンゲツ	42,800	1,925	82,390,000
ミツウロコ	39,200	510	19,992,000
シナネン	50,000	365	18,250,000
伊藤忠エネクス	54,900	427	23,442,300
ザ・トーカイ	63,000	347	21,861,000
サンリオ	71,900	1,933	138,982,700
サンワテクノス	16,600	642	10,657,200
リョーサン	40,500	2,119	85,819,500
新光商事	26,300	687	18,068,100
トーホー	39,000	310	12,090,000
三信電気	27,200	689	18,740,800
東陽テクニカ	36,500	870	31,755,000
モスフードサービス	29,100	1,539	44,784,900
加賀電子	26,700	1,039	27,741,300
ソーダニッカ	25,000	343	8,575,000
立花エレテック	16,000	688	11,008,000
P a l t a c	16,600	1,547	25,680,200
太平洋興発	116,000	70	8,120,000
ヤマタネ	140,000	113	15,820,000
丸紅建材リース	31,000	100	3,100,000
日鐵商事	63,000	256	16,128,000
トラスコ中山	32,500	1,397	45,402,500
オートバックスセブン	33,500	3,200	107,200,000

加藤産業	37,100	1,346	49,936,600
イエローハット	26,900	800	21,520,000
富士エレクトロニクス	16,400	1,225	20,090,000
J Kホールディングス	26,800	420	11,256,000
日伝	10,100	2,460	24,846,000
北沢産業	29,000	174	5,046,000
杉本商事	14,200	723	10,266,600
因幡電機産業	29,100	2,285	66,493,500
住金物産	112,000	186	20,832,000
ミスミグループ本社	87,600	2,053	179,842,800
江守商事	600	790	474,000
アルテック	18,400	313	5,759,200
タキヒヨー	43,000	401	17,243,000
スズケン	106,300	2,526	268,513,800
ジェコス	19,100	307	5,863,700
ローソン	89,400	3,840	343,296,000
サンエー	8,800	3,220	28,336,000
キリン堂	11,100	398	4,417,800
ダイユーエイト	4,100	515	2,111,500
カワチ薬品	18,200	1,722	31,340,400
エービーシー・マート	31,500	2,892	91,098,000
ハードオフコーポレーション	7,400	415	3,071,000
アスクル	20,200	1,666	33,653,200
ゲオ	443	96,200	42,616,600
ポイント	21,560	3,455	74,489,800
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	27,000	113	3,051,000
くらコーポレーション	14,900	1,292	19,250,800
キャンドウ	99	70,100	6,939,900
バル	8,100	3,000	24,300,000
エディオン	96,900	746	72,287,400
サーラコーポレーション	26,000	464	12,064,000
パルス	122	83,600	10,199,200
あみやき亭	44	260,500	11,462,000
ハニーズ	25,030	1,030	25,780,900
アルペン	19,900	1,462	29,093,800
ビックカメラ	676	33,950	22,950,200
D C Mホールディングス	125,200	510	63,852,000
MonotaRO	8,000	819	6,552,000
ユニバース	800	1,201	960,800
J . フロント リテイリング	612,000	472	288,864,000
ドトール・日レスホールディングス	43,800	1,099	48,136,200
マツモトキヨシホールディングス	48,900	1,763	86,210,700
ココカラファイン	25,100	1,809	45,405,900
三越伊勢丹ホールディングス	511,200	980	500,976,000
クリエイトSDホールディングス	8,800	1,814	15,963,200
C H Iグループ	18,900	280	5,292,000

ブックオフコーポレーション	14,800	686	10,152,800
あさひ	12,200	1,089	13,285,800
サークルKサンクス	55,700	1,238	68,956,600
日本調剤	4,060	3,040	12,342,400
コスモス薬品	12,200	3,065	37,393,000
セブン&アイ・ホールディングス	1,080,300	2,157	2,330,207,100
ツルハホールディングス	19,700	3,760	74,072,000
サンマルクホールディングス	8,400	3,370	28,308,000
フェリシモ	7,200	1,080	7,776,000
トリドール	81	113,200	9,169,200
メディカルシステムネットワーク	1,500	621	931,500
総合メディカル	5,900	2,223	13,115,700
はるやま商事	14,900	409	6,094,100
カップ・クリエイト	17,600	1,971	34,689,600
ライトオン	24,400	484	11,809,600
ジーンズメイト	12,900	391	5,043,900
良品計画	30,300	3,480	105,444,000
三城ホールディングス	34,400	815	28,036,000
コナカ	37,400	349	13,052,600
G - 7ホールディングス	5,100	514	2,621,400
イオン北海道	15,700	294	4,615,800
コジマ	36,600	526	19,251,600
コーナン商事	24,300	1,004	24,397,200
エコス	11,700	450	5,265,000
ワタミ	29,700	1,647	48,915,900
マルシェ	4,300	680	2,924,000
ドン・キホーテ	42,600	2,500	106,500,000
メガネトップ	28,200	828	23,349,600
西松屋チェーン	59,200	791	46,827,200
ゼンショー	99,100	804	79,676,400
幸楽苑	12,000	1,210	14,520,000
ハークスレイ	7,200	512	3,686,400
サイゼリヤ	34,900	1,585	55,316,500
ポプラ	9,000	516	4,644,000
ユナイテッドアローズ	25,400	1,218	30,937,200
ハイデイ日高	9,800	1,427	13,984,600
京都きもの友禅	16,000	949	15,184,000
コロワイド	83,000	443	36,769,000
荳番屋	4,400	2,355	10,362,000
トップカルチャー	7,500	364	2,730,000
スギホールディングス	41,700	1,958	81,648,600
スクロール	38,500	343	13,205,500
ファミリーマート	87,600	2,882	252,463,200
木曽路	28,100	1,720	48,332,000
千趣会	48,200	505	24,341,000
タカキュー	34,000	159	5,406,000

ケーヨー	46,200	423	19,542,600
上新電機	56,000	827	46,312,000
日本瓦斯	26,800	1,230	32,964,000
ベスト電器	86,000	264	22,704,000
マルエツ	55,000	324	17,820,000
ロイヤルホールディングス	38,700	907	35,100,900
東天紅	32,000	137	4,384,000
いなげや	22,000	893	19,646,000
島忠	50,000	1,907	95,350,000
チヨダ	35,200	1,047	36,854,400
ライフコーポレーション	16,400	1,306	21,418,400
カスミ	37,000	455	16,835,000
リンガーハット	22,000	1,009	22,198,000
さが美	36,000	125	4,500,000
M r M a x	28,800	289	8,323,200
テンアライド	16,900	295	4,985,500
A O K Iホールディングス	24,700	1,424	35,172,800
オークワ	34,000	854	29,036,000
コメリ	35,300	1,948	68,764,400
青山商事	66,900	1,457	97,473,300
しまむら	27,000	7,750	209,250,000
C F Sコーポレーション	26,500	435	11,527,500
高島屋	352,000	721	253,792,000
松屋	26,500	594	15,741,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	150,000	600	90,000,000
丸栄	56,000	125	7,000,000
ニッセンホールディングス	55,900	401	22,415,900
パルコ	67,600	768	51,916,800
丸井グループ	338,900	690	233,841,000
原信ナルスホールディングス	15,000	1,191	17,865,000
ダイエー	123,150	327	40,270,050
イズミヤ	94,000	336	31,584,000
イオン	910,900	1,007	917,276,300
ユニー	210,300	812	170,763,600
イズミ	71,800	1,186	85,154,800
東武ストア	22,000	241	5,302,000
平和堂	51,300	1,066	54,685,800
フジ	29,600	1,730	51,208,000
ヤオコー	11,200	2,582	28,918,400
ゼビオ	31,200	1,767	55,130,400
ケーズホールディングス	60,100	2,283	137,208,300
O l y m p i c	19,400	630	12,222,000
東日カーライフグループ	60,000	94	5,640,000
アインファーマシーズ	9,500	2,751	26,134,500
元気寿司	7,200	961	6,919,200
ヤマダ電機	118,230	5,650	667,999,500

アークランドサカモト	18,200	1,001	18,218,200	
ニトリホールディングス	51,100	7,340	375,074,000	
グルメ杵屋	17,000	455	7,735,000	
愛眼	17,400	471	8,195,400	
吉野家ホールディングス	693	102,700	71,171,100	
松屋フーズ	8,400	1,346	11,306,400	
サガミチェーン	34,000	506	17,204,000	
プレナス	32,300	1,218	39,341,400	
ミニストップ	18,100	1,280	23,168,000	
イメージホールディングス	13,700	275	3,767,500	
アークス	33,700	1,252	42,192,400	
パロー	47,500	695	33,012,500	
ベルク	9,200	943	8,675,600	
大庄	14,100	1,025	14,452,500	
ファーストリテイリング	60,300	12,920	779,076,000	
サンドラッグ	49,700	2,324	115,502,800	
ヤマザワ	5,900	1,184	6,985,600	
ペルーナ	37,900	455	17,244,500	
新生銀行	1,366,000	93	127,038,000	
あおぞら銀行	948,000	166	157,368,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	19,530,200	440	8,593,288,000	
りそなホールディングス	793,100	515	408,446,500	
中央三井トラスト・ホールディングス	1,490,000	329	490,210,000	
三井住友フィナンシャルグループ	1,952,400	2,891	5,644,388,400	
第四銀行	340,000	260	88,400,000	
北越銀行	295,000	166	48,970,000	
西日本シティ銀行	917,000	257	235,669,000	
札幌北洋ホールディングス	386,400	397	153,400,800	
千葉銀行	1,020,000	536	546,720,000	
横浜銀行	1,771,000	424	750,904,000	
常陽銀行	1,002,000	359	359,718,000	
群馬銀行	603,000	454	273,762,000	
武蔵野銀行	43,100	2,541	109,517,100	
千葉興業銀行	52,600	504	26,510,400	
筑波銀行	117,400	300	35,220,000	
東京都民銀行	51,100	1,136	58,049,600	
七十七銀行	434,000	437	189,658,000	
青森銀行	203,000	230	46,690,000	
秋田銀行	170,000	252	42,840,000	
山形銀行	159,000	392	62,328,000	
岩手銀行	17,500	4,050	70,875,000	
東邦銀行	212,000	264	55,968,000	
東北銀行	144,000	135	19,440,000	
みちのく銀行	139,000	165	22,935,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	1,045,000	365	381,425,000	
静岡銀行	797,000	754	600,938,000	

十六銀行	315,000	267	84,105,000	
スルガ銀行	275,000	778	213,950,000	
八十二銀行	482,000	459	221,238,000	
山梨中央銀行	157,000	375	58,875,000	
大垣共立銀行	337,000	263	88,631,000	
福井銀行	224,000	260	58,240,000	
北國銀行	298,000	288	85,824,000	
清水銀行	8,300	3,670	30,461,000	
滋賀銀行	234,000	458	107,172,000	
南都銀行	241,000	432	104,112,000	
百五銀行	226,000	363	82,038,000	
京都銀行	458,000	784	359,072,000	
三重銀行	118,000	226	26,668,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	1,812,000	169	306,228,000	
広島銀行	767,000	348	266,916,000	
山陰合同銀行	150,000	585	87,750,000	
中国銀行	211,000	1,012	213,532,000	
鳥取銀行	76,000	177	13,452,000	
伊予銀行	276,000	673	185,748,000	
百十四銀行	293,000	307	89,951,000	
四国銀行	197,000	272	53,584,000	
阿波銀行	215,000	519	111,585,000	
鹿児島銀行	160,000	546	87,360,000	
大分銀行	168,000	297	49,896,000	
宮崎銀行	170,000	217	36,890,000	
肥後銀行	208,000	427	88,816,000	
佐賀銀行	160,000	238	38,080,000	
十八銀行	173,000	233	40,309,000	
沖縄銀行	19,200	3,345	64,224,000	
琉球銀行	55,900	985	55,061,500	
住友信託銀行	2,304,000	501	1,154,304,000	
みずほ信託銀行	2,478,000	85	210,630,000	
八千代銀行	14,200	2,156	30,615,200	
みずほフィナンシャルグループ	31,502,600	153	4,819,897,800	
紀陽ホールディングス	1,021,000	117	119,457,000	
山口フィナンシャルグループ	253,000	820	207,460,000	
長野銀行	106,000	165	17,490,000	
名古屋銀行	230,000	268	61,640,000	
愛知銀行	8,600	5,280	45,408,000	
第三銀行	163,000	218	35,534,000	
中京銀行	110,000	217	23,870,000	
東日本銀行	135,000	170	22,950,000	
愛媛銀行	168,000	228	38,304,000	
トマト銀行	104,000	156	16,224,000	
みなと銀行	278,000	143	39,754,000	
京葉銀行	216,000	422	91,152,000	

関西アーバン銀行	367,000	133	48,811,000
栃木銀行	131,000	407	53,317,000
北日本銀行	8,300	1,983	16,458,900
東和銀行	300,000	77	23,100,000
トモニホールディングス	202,700	341	69,120,700
フィデアホールディングス	146,200	204	29,824,800
池田泉州ホールディングス	749,100	117	87,644,700
S B Iホールディングス	30,875	12,230	377,601,250
ジャフコ	35,600	2,312	82,307,200
大和証券グループ本社	2,561,000	424	1,085,864,000
野村ホールディングス	5,437,900	523	2,844,021,700
みずほ証券	669,000	234	156,546,000
みずほインベスターズ証券	621,000	90	55,890,000
岡三証券グループ	218,000	347	75,646,000
丸三証券	80,300	533	42,799,900
東洋証券	99,000	154	15,246,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	290,000	333	96,570,000
光世証券	63,000	93	5,859,000
水戸証券	80,000	150	12,000,000
いちよし証券	57,600	638	36,748,800
松井証券	155,300	603	93,645,900
だいこう証券ビジネス	14,900	319	4,753,100
マネックスグループ	1,616	23,000	37,168,000
カブドットコム証券	108,800	377	41,017,600
極東証券	34,300	708	24,284,400
岩井コスモホールディングス	26,900	609	16,382,100
N K S Jホールディングス	2,164,000	602	1,302,728,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	771,300	2,034	1,568,824,200
ソニーフィナンシャルホールディングス	1,250	326,500	408,125,000
第一生命保険	10,388	133,100	1,382,642,800
富士火災海上保険	89,000	118	10,502,000
東京海上ホールディングス	979,000	2,500	2,447,500,000
T & Dホールディングス	472,150	2,129	1,005,207,350
クレディセゾン	199,000	1,297	258,103,000
セディナ	156,700	158	24,758,600
芙蓉総合リース	25,600	2,653	67,916,800
興銀リース	37,700	2,002	75,475,400
東京センチュリーリース	62,300	1,351	84,167,300
日本証券金融	115,000	614	70,610,000
大阪証券金融	56,600	166	9,395,600
ポケットカード	37,100	227	8,421,700
リコーリース	19,300	2,213	42,710,900
イオンクレジットサービス	119,000	1,128	134,232,000
アコム	55,740	915	51,002,100
プロミス	96,950	436	42,270,200
ジャックス	187,000	228	42,636,000

日立キャピタル	63,600	1,252	79,627,200
オリックス	134,800	7,880	1,062,224,000
三菱UFJリース	66,300	3,210	212,823,000
アサックス	38	88,700	3,370,600
NECキャピタルソリューション	7,800	1,213	9,461,400
日本駐車場開発	2,953	3,870	11,428,110
昭栄	53,300	715	38,109,500
野村不動産ホールディングス	111,000	1,447	160,617,000
ヒューリック	76,700	681	52,232,700
パーク24	126,000	860	108,360,000
三井不動産	1,220,000	1,566	1,910,520,000
三菱地所	1,809,000	1,482	2,680,938,000
平和不動産	210,500	257	54,098,500
東京建物	542,000	375	203,250,000
ダイビル	78,600	670	52,662,000
サンケイビル	55,100	490	26,999,000
東急不動産	530,000	395	209,350,000
京阪神不動産	38,800	388	15,054,400
住友不動産	620,000	1,935	1,199,700,000
東宝不動産	32,200	555	17,871,000
大京	326,000	162	52,812,000
テオーシー	111,200	352	39,142,400
東京楽天地	47,000	303	14,241,000
レオパレス21	18,900	166	3,137,400
フジ住宅	37,600	418	15,716,800
空港施設	34,600	345	11,937,000
住友不動産販売	10,220	3,850	39,347,000
ゴールドクレスト	25,070	2,165	54,276,550
東栄住宅	21,800	1,333	29,059,400
日本エスリード	15,000	840	12,600,000
東急リバブル	29,200	943	27,535,600
飯田産業	23,500	858	20,163,000
日神不動産	5,300	625	3,312,500
アーネストワン	51,000	1,028	52,428,000
サンヨーハウジング名古屋	115	80,500	9,257,500
イオンモール	118,800	2,095	248,886,000
タクトホーム	157	87,200	13,690,400
エヌ・ティ・ティ都市開発	1,915	74,900	143,433,500
ランドビジネス	184	17,810	3,277,040
日本空港ビルデング	84,300	1,270	107,061,000
日本工営	90,000	249	22,410,000
ネクスト	77	89,600	6,899,200
日本M&Aセンター	63	349,500	22,018,500
アコーディア・ゴルフ	795	77,800	61,851,000
パソナグループ	237	60,700	14,385,900
リンクアンドモチベーション	56	50,500	2,828,000

テンブホールディングス	37,400	788	29,471,200
学情	15,600	300	4,680,000
スタジオアリス	13,100	791	10,362,100
シミック	590	22,790	13,446,100
N E C フィールディング	22,400	1,048	23,475,200
総合警備保障	98,200	964	94,664,800
カカクコム	193	495,500	95,631,500
ルネサンス	11,700	300	3,510,000
新日本科学	21,000	394	8,274,000
エムスリー	114	422,000	48,108,000
ディー・エヌ・エー	107,500	2,969	319,167,500
博報堂 D Y ホールディングス	37,650	4,755	179,025,750
ぐるなび	172	127,700	21,964,400
一休	243	41,950	10,193,850
ジャパンベストレスキューシステム	40	69,500	2,780,000
ジェイコムホールディングス	26	94,400	2,454,400
P G M ホールディングス	604	58,000	35,032,000
イーピーエス	157	195,600	30,709,200
アミューズ	4,000	938	3,752,000
T A C	16,700	333	5,561,100
ケネディクス	3,245	22,170	71,941,650
電通	248,000	2,545	631,160,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	1,616	6,530	10,552,480
びあ	8,200	813	6,666,600
イオンファンタジー	9,100	939	8,544,900
みらかホールディングス	67,000	3,150	211,050,000
アルプス技研	14,100	747	10,532,700
サニックス	55,500	172	9,546,000
日本空調サービス	1,600	722	1,155,200
オリエンタルランド	73,300	7,660	561,478,000
ダスキン	72,000	1,550	111,600,000
明光ネットワークジャパン	24,600	674	16,580,400
ファルコ S D ホールディングス	14,900	673	10,027,700
秀英予備校	7,600	373	2,834,800
田谷	3,100	680	2,108,000
ラウンドワン	75,700	519	39,288,300
リゾートトラスト	42,500	1,347	57,247,500
ビー・エム・エル	15,400	2,260	34,804,000
ワタベウェディング	8,900	928	8,259,200
もしもしホットライン	17,600	2,060	36,256,000
東急コミュニティー	5,100	2,412	12,301,200
リソー教育	3,525	4,185	14,752,125
ウェアハウス	10,100	315	3,181,500
ユー・エス・エス	35,580	6,480	230,558,400
東京個別指導学院	21,800	259	5,646,200
カルチャア・コンビニエンス・クラブ	149,400	477	71,263,800

テー・オー・ダブリュー	4,500	503	2,263,500	
セントラルスポーツ	6,400	887	5,676,800	
リゾートソリューション	34,000	156	5,304,000	
エイチ・アイ・エス	29,200	1,827	53,348,400	
共立メンテナンス	12,300	1,355	16,666,500	
イチネンホールディングス	23,600	401	9,463,600	
建設技術研究所	15,500	472	7,316,000	
燦ホールディングス	2,700	1,327	3,582,900	
東京テアトル	117,000	118	13,806,000	
ホリプロ	3,300	693	2,286,900	
よみうりランド	65,000	279	18,135,000	
東京都競馬	201,000	129	25,929,000	
常磐興産	82,000	122	10,004,000	
カナモト	38,000	447	16,986,000	
東京ドーム	213,000	216	46,008,000	
トランス・コスモス	39,000	833	32,487,000	
乃村工藝社	63,000	285	17,955,000	
藤田観光	71,000	396	28,116,000	
日本管財	10,000	1,373	13,730,000	
白洋舎	29,000	232	6,728,000	
セコム	283,500	3,885	1,101,397,500	
セントラル警備保障	9,700	847	8,215,900	
丹青社	36,000	228	8,208,000	
メイテック	41,800	1,817	75,950,600	
アサツー ディ・ケイ	44,700	2,300	102,810,000	
応用地質	29,700	689	20,463,300	
船井総合研究所	29,000	546	15,834,000	
進学会	9,800	299	2,930,200	
ベネッセホールディングス	86,200	3,685	317,647,000	
イオンディライト	30,800	1,560	48,048,000	
ナック	4,900	1,030	5,047,000	
ニチイ学館	51,200	719	36,812,800	
ダイセキ	40,400	1,692	68,356,800	
合計	393,116,687		315,867,721,675	

差入委託証拠金代用有価証券1,500,000株

(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) . 取引の時価等に関する事項」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

対象年月日	(平成21年12月18日現在)	(平成22年12月17日現在)
科目	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	462,797	15,957
親投資信託受益証券	62,492,208,797	62,564,927,758
未収入金	3,037,998	3,385,000
流動資産合計	62,495,709,592	62,568,328,715
資産合計	62,495,709,592	62,568,328,715
負債の部		
流動負債		
未払解約金	3,499,998	3,399,999
未払受託者報酬	7,774,626	8,172,909
未払委託者報酬	7,774,567	8,172,848
流動負債合計	19,049,191	19,745,756
負債合計	19,049,191	19,745,756
純資産の部		
元本等		
1 元本		
元本	56,997,351,974	56,148,785,611
2 剰余金		
剰余金又は欠損金()	5,479,308,427	6,399,797,348
元本等合計	62,476,660,401	62,548,582,959
純資産合計	62,476,660,401	62,548,582,959
負債・純資産合計	62,495,709,592	62,568,328,715

(注) 「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、毎年6月20日(ただし、休業日の場合は翌営業日)に決算を行います。上記の貸借対照表は平成21年12月18日および平成22年12月17日現在における同ファンドの状況です。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自平成21年6月23日 至平成21年12月18日	自平成22年6月22日 至平成22年12月17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（売買目的有価証券） 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	親投資信託受益証券（売買目的有価証券） 同左

(貸借対照表に関する注記)

項目	（平成21年12月18日現在）	（平成22年12月17日現在）
1. 受益権総数	平成21年12月18日現在における受益権の総数 56,997,351,974口	平成22年12月17日現在における受益権の総数 56,148,785,611口
2. 1単位当たり純資産額	1.0961円 （1万口 = 10,961円）	1.1140円 （1万口 = 11,140円）

(金融商品に関する注記)

(追加情報)

当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）および「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

・金融商品の状況に関する事項

項目	自平成22年6月22日 至平成22年12月17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。当ファンドにおける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、および価格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・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、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。リスクを管理する部署では、各種リスクごとに定められた頻度で、測定項目が上下限值(リミットあるいは注意レベル)内に収まっているかどうかのモニタリングを行っております。上下限値を越えていることが発見された場合は、原則として速やかに修正を行うよう、リスク管理を行う部署から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ます。また、是正勧告あるいは報告を受けた関連運用グループでは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、リスク管理を行う部署は、上下限値に抵触した事実ならびにその後の対処結果あるいは関連運用グループの対処方針の決定に関し、必要に応じて、リスク管理を行う部署の担当役員、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する体制となっております。</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	自 平成22年 6月22日 至 平成22年12月17日
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」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）

．取引の状況に関する事項

項目	自平成21年6月23日 至平成21年12月18日
1．取引の内容	当ファンドの行うことのできるデリバティブ取引は、次の通りです。 a．わが国の取引所等における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。 b．わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。 異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（「スワップ取引」）。 金利先渡し取引。
2．取引に対する取組方針	デリバティブ取引につきましては信託約款等に従っており、その制限を遵守しております。
3．取引の利用目的	信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため。
4．取引に係るリスクの内容	デリバティブ取引に伴いファンドに影響を与える主なリスクとして価格変動リスクがあります。
5．取引に係るリスクの管理体制	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・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理ならびに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。
6．取引の時価等に関する事項についての補足説明	該当事項はありません。

．取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

（平成21年12月18日現在）

平成21年12月18日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（平成22年12月17日現在）

平成22年12月17日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（関連当事者との取引に関する注記）

（自平成21年6月23日 至 平成21年12月18日）

該当事項はありません。

（自平成22年6月22日 至 平成22年12月17日）

該当事項はありません。

(その他の注記)

(平成21年12月18日現在)	
期首	平成21年6月23日
期首元本額	53,596,754,611円
期首より平成21年12月18日現在までの追加設定元本額	5,015,781,559円
期首より平成21年12月18日現在までの一部解約元本額	1,615,184,196円

(平成22年12月17日現在)	
期首	平成22年6月22日
期首元本額	57,416,251,092円
期首より平成22年12月17日現在までの追加設定元本額	1,633,807,188円
期首より平成22年12月17日現在までの一部解約元本額	2,901,272,669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	銘柄名	元本額	評価額	
			単価	金額
親投資信託 受益証券	国内債券(NOMURA - BPI) マザーファンド	52,233,200,667円	1.1978円	62,564,927,758円

（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

対象年月日	（平成21年12月18日現在）	（平成22年12月17日現在）
科目	金額（円）	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	870,400,202	776,997,904
国債証券	125,858,344,810	124,035,347,180
地方債証券	11,454,828,030	11,479,099,285
特殊債券	20,155,188,461	18,242,063,795
社債券	15,156,058,810	14,565,665,810
未収入金	-	77,007,000
未収利息	790,028,460	820,887,736
前払費用	87,797,811	37,342,127
流動資産合計	174,372,646,584	170,034,410,837
資産合計	174,372,646,584	170,034,410,837
負債の部		
流動負債		
未払金	100,000,000	706,532,200
未払解約金	102,151,865	32,431,842
流動負債合計	202,151,865	738,964,042
負債合計	202,151,865	738,964,042
純資産の部		
元本等		
1 元本		
元本	147,855,793,518	141,333,052,840
2 剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	26,314,701,201	27,962,393,955
元本等合計	174,170,494,719	169,295,446,795
純資産合計	174,170,494,719	169,295,446,795
負債・純資産合計	174,372,646,584	170,034,410,837

（注）「国内債券（NOMURA - B P I）マザーファンド」は、毎年6月20日（ただし、休業日の場合は翌営業日）に決算を行います。上記の貸借対照表は平成21年12月18日および平成22年12月17日現在における同マザーファンドの状況です。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自平成21年6月23日 至平成21年12月18日	自平成22年6月22日 至平成22年12月17日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券および社債券（売買目的有価証券） 個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、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。	国債証券、地方債証券、特殊債券および社債券（売買目的有価証券） 同左

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成21年12月18日現在)	(平成22年12月17日現在)
1. 受益権総数	平成21年12月18日現在における受益権の総数 147,855,793,518口	平成22年12月17日現在における受益権の総数 141,333,052,840口
2. 1単位当たり純資産額	1.1780円 (1万口 = 11,780円)	1.1978円 (1万口 = 11,978円)

(金融商品に関する注記)

(追加情報)

当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）および「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

・金融商品の状況に関する事項

項目	自平成22年6月22日 至平成22年12月17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、地方債証券、特殊債券および社債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。当ファンドにおける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、および価格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・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、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。リスクを管理する部署では、各種リスクごとに定められた頻度で、測定項目が上下限值(リミットあるいは注意レベル)内に収まっているかどうかのモニタリングを行っております。上下限値を越えていることが発見された場合は、原則として速やかに修正を行うよう、リスク管理を行う部署から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ます。また、是正勧告あるいは報告を受けた関連運用グループでは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、リスク管理を行う部署は、上下限値に抵触した事実ならびにその後の対処結果あるいは関連運用グループの対処方針の決定に関し、必要に応じて、リスク管理を行う部署の担当役員、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する体制となっております。</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	自 平成22年 6月22日 至 平成22年12月17日
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(国債証券、地方債証券、特殊債券および社債券) 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」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）

．取引の状況に関する事項

項目	自平成21年6月23日 至平成21年12月18日
1．取引の内容	当ファンドの行うことのできるデリバティブ取引は、次の通りです。 a．わが国の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。 b．わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。 異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（「スワップ取引」）。 金利先渡し取引。
2．取引に対する取組方針	デリバティブ取引につきましては信託約款等に従っており、その制限を遵守しております。
3．取引の利用目的	信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため。
4．取引に係るリスクの内容	デリバティブ取引に伴いファンドに影響を与える主なリスクとして価格変動リスクがあります。
5．取引に係るリスクの管理体制	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・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理ならびに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。
6．取引の時価等に関する事項についての補足説明	該当事項はありません。

．取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

（平成21年12月18日現在）

平成21年12月18日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（平成22年12月17日現在）

平成22年12月17日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（関連当事者との取引に関する注記）

（自平成21年6月23日 至平成21年12月18日）

該当事項はありません。

（自平成22年6月22日 至平成22年12月17日）

該当事項はありません。

(その他の注記)

(平成21年12月18日現在)	
期首	平成21年6月23日
期首元本額	145,855,334,842円
期首より平成21年12月18日現在までの追加設定元本額	12,334,238,291円
期首より平成21年12月18日現在までの一部解約元本額	10,333,779,615円
平成21年12月18日現在における元本の内訳	
三井住友・DC年金日本債券インデックス・ファンド	12,249,032,745円
S M A M ・国内債券インデックス・ファンド	81,240,171,668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>	1,317,175,864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>	53,049,413,241円
合計	147,855,793,518円

(平成22年12月17日現在)	
期首	平成22年6月22日
期首元本額	145,176,769,466円
期首より平成22年12月17日現在までの追加設定元本額	5,130,848,937円
期首より平成22年12月17日現在までの一部解約元本額	8,974,565,563円
平成22年12月17日現在における元本の内訳	
三井住友・DC年金日本債券インデックス・ファンド	14,402,739,946円
S M A M ・国内債券インデックス・ファンド	73,651,016,224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>	1,046,096,003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>	52,233,200,667円
合計	141,333,052,840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)	220,000,000	235,265,800	
	第2回利付国債(40年)	250,000,000	254,492,500	
	第3回利付国債(40年)	240,000,000	244,636,800	
	第237回利付国債(10年)	1,730,000,000	1,758,493,100	
	第238回利付国債(10年)	2,075,000,000	2,106,602,250	
	第239回利付国債(10年)	3,930,000,000	4,001,093,700	
	第242回利付国債(10年)	1,490,000,000	1,516,030,300	
	第243回利付国債(10年)	2,036,000,000	2,068,046,640	
	第244回利付国債(10年)	2,978,000,000	3,025,618,220	
	第247回利付国債(10年)	3,670,000,000	3,718,700,900	

第250回利付国債(10年)	3,669,000,000	3,693,068,640
第253回利付国債(10年)	3,857,000,000	3,998,937,600
第256回利付国債(10年)	2,935,000,000	3,033,968,200
第258回利付国債(10年)	2,960,000,000	3,056,466,400
第260回利付国債(10年)	3,746,000,000	3,911,610,660
第263回利付国債(10年)	3,355,000,000	3,510,001,000
第265回利付国債(10年)	3,405,000,000	3,555,739,350
第268回利付国債(10年)	3,470,000,000	3,628,405,500
第270回利付国債(10年)	3,433,000,000	3,564,621,220
第272回利付国債(10年)	2,200,000,000	2,297,614,000
第274回利付国債(10年)	2,338,000,000	2,456,092,380
第277回利付国債(10年)	1,274,000,000	1,346,248,540
第280回利付国債(10年)	1,353,000,000	1,453,094,940
第282回利付国債(10年)	1,386,000,000	1,475,175,240
第284回利付国債(10年)	1,350,000,000	1,437,588,000
第285回利付国債(10年)	1,304,000,000	1,389,033,840
第286回利付国債(10年)	1,365,000,000	1,462,338,150
第288回利付国債(10年)	1,343,000,000	1,429,502,630
第289回利付国債(10年)	1,488,000,000	1,562,161,920
第290回利付国債(10年)	1,552,000,000	1,617,944,480
第293回利付国債(10年)	1,521,000,000	1,627,363,530
第296回利付国債(10年)	1,516,000,000	1,585,296,360
第297回利付国債(10年)	1,694,000,000	1,755,204,220
第300回利付国債(10年)	950,000,000	989,548,500
第301回利付国債(10年)	1,568,000,000	1,630,641,600
第303回利付国債(10年)	1,960,000,000	2,018,172,800
第305回利付国債(10年)	2,230,000,000	2,271,143,500
第306回利付国債(10年)	2,250,000,000	2,305,642,500
第308回利付国債(10年)	2,120,000,000	2,149,044,000
第309回利付国債(10年)	1,000,000,000	995,720,000
第310回利付国債(10年)	2,000,000,000	1,968,520,000
第2回利付国債(30年)	150,000,000	160,311,000
第4回利付国債(30年)	160,000,000	183,910,400
第5回利付国債(30年)	110,000,000	113,599,200
第7回利付国債(30年)	140,000,000	146,624,800
第10回利付国債(30年)	270,000,000	224,804,700
第11回利付国債(30年)	110,000,000	103,356,000
第12回利付国債(30年)	260,000,000	262,626,000
第14回利付国債(30年)	260,000,000	276,499,600
第16回利付国債(30年)	290,000,000	313,846,700
第18回利付国債(30年)	240,000,000	250,730,400
第19回利付国債(30年)	150,000,000	156,753,000
第21回利付国債(30年)	292,000,000	305,578,000
第22回利付国債(30年)	209,000,000	226,907,120
第23回利付国債(30年)	111,000,000	120,471,630
第24回利付国債(30年)	200,000,000	217,178,000

第25回利付国債(30年)	385,000,000	403,029,550
第26回利付国債(30年)	299,000,000	318,757,920
第27回利付国債(30年)	421,000,000	457,677,520
第28回利付国債(30年)	451,000,000	490,331,710
第29回利付国債(30年)	580,000,000	618,633,800
第30回利付国債(30年)	410,000,000	428,331,100
第31回利付国債(30年)	650,000,000	665,827,500
第32回利付国債(30年)	630,000,000	658,791,000
第33回利付国債(30年)	420,000,000	411,553,800
第23回利付国債(20年)	10,000,000	11,431,400
第25回利付国債(20年)	50,000,000	56,116,500
第28回利付国債(20年)	350,000,000	417,490,500
第30回利付国債(20年)	450,000,000	518,584,500
第32回利付国債(20年)	150,000,000	174,840,000
第33回利付国債(20年)	230,000,000	272,386,700
第35回利付国債(20年)	315,000,000	367,267,950
第37回利付国債(20年)	230,000,000	265,896,100
第39回利付国債(20年)	223,000,000	250,988,730
第40回利付国債(20年)	492,000,000	544,038,840
第42回利付国債(20年)	400,000,000	451,304,000
第43回利付国債(20年)	710,000,000	818,480,900
第46回利付国債(20年)	289,000,000	316,475,230
第48回利付国債(20年)	368,000,000	413,286,080
第50回利付国債(20年)	223,000,000	237,675,630
第52回利付国債(20年)	350,000,000	379,263,500
第54回利付国債(20年)	305,000,000	333,328,400
第56回利付国債(20年)	290,000,000	309,986,800
第58回利付国債(20年)	270,000,000	285,198,300
第59回利付国債(20年)	280,000,000	289,368,800
第61回利付国債(20年)	160,000,000	152,513,600
第63回利付国債(20年)	316,000,000	328,564,160
第64回利付国債(20年)	330,000,000	346,160,100
第65回利付国債(20年)	520,000,000	544,393,200
第70回利付国債(20年)	620,000,000	683,382,600
第72回利付国債(20年)	530,000,000	563,665,600
第74回利付国債(20年)	628,000,000	666,188,680
第75回利付国債(20年)	490,000,000	518,714,000
第78回利付国債(20年)	560,000,000	577,046,400
第82回利付国債(20年)	583,000,000	614,476,170
第84回利付国債(20年)	694,000,000	720,594,080
第85回利付国債(20年)	602,000,000	631,528,100
第88回利付国債(20年)	759,000,000	814,839,630
第90回利付国債(20年)	698,000,000	738,135,000
第92回利付国債(20年)	685,000,000	713,174,050
第93回利付国債(20年)	657,000,000	673,089,930
第95回利付国債(20年)	686,000,000	730,548,840

	第97回利付国債(20年)	570,000,000	597,793,200	
	第99回利付国債(20年)	734,000,000	757,722,880	
	第100回利付国債(20年)	713,000,000	745,619,750	
	第102回利付国債(20年)	720,000,000	772,840,800	
	第105回利付国債(20年)	777,000,000	798,149,940	
	第107回利付国債(20年)	873,000,000	895,811,490	
	第109回利付国債(20年)	940,000,000	934,303,600	
	第111回利付国債(20年)	933,000,000	969,974,790	
	第113回利付国債(20年)	1,010,000,000	1,032,916,900	
	第114回利付国債(20年)	993,000,000	1,014,339,570	
	第116回利付国債(20年)	1,030,000,000	1,066,019,100	
	第118回利付国債(20年)	280,000,000	280,786,800	
	第119回利付国債(20年)	700,000,000	679,406,000	
	第121回利付国債(20年)	780,000,000	769,501,200	
	第122回利付国債(20年)	380,000,000	368,717,800	
	国債証券 小計	119,345,000,000	124,035,347,180	
地方債証券	第1回東京都公募公債(20年)	200,000,000	199,990,000	
	第7回東京都公募公債(20年)	100,000,000	104,876,000	
	第8回東京都公募公債(30年)	100,000,000	99,469,000	
	第575回東京都公募公債	26,000,000	26,157,820	
	第576回東京都公募公債	50,000,000	50,410,000	
	第586回東京都公募公債	41,000,000	41,717,090	
	第597回東京都公募公債	200,000,000	201,492,000	
	第598回東京都公募公債	100,000,000	100,502,000	
	第599回東京都公募公債	100,000,000	102,059,000	
	第603回東京都公募公債	100,000,000	103,428,000	
	第629回東京都公募公債	100,000,000	104,483,000	
	第656回東京都公募公債	300,000,000	313,941,000	
	第660回東京都公募公債	200,000,000	209,868,000	
	第668回東京都公募公債	200,000,000	208,074,000	
	平成13年度第4回北海道公募公債	130,000,000	131,794,000	
	平成16年度第11回北海道公募公債	100,000,000	102,969,000	
	平成18年度第8回北海道公募公債(5年)	100,000,000	101,120,000	
	平成19年度第9回北海道公募公債	200,000,000	210,204,000	
	第7回神奈川県公募公債(20年)	200,000,000	208,076,000	
	第24回神奈川県公募公債(5年)	100,000,000	101,388,000	
	第120回神奈川県公募公債	100,000,000	100,727,000	
	第147回神奈川県公募公債	200,000,000	215,596,000	
	第31回大阪府公募公債(5年)	100,000,000	101,945,000	
	第44回大阪府公募公債(5年)	200,000,000	205,014,000	
	第263回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,689,000	
	第273回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,368,000	
	第297回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	106,089,000	
	第311回大阪府公募公債(10年)	250,000,000	262,782,500	
	平成14年度第2回京都府公募公債	100,000,000	101,462,000	

平成15年度第3回京都府公募公債	100,000,000	103,482,000	
第9回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	101,982,000	
平成16年度第5回兵庫県公募公債	100,000,000	103,929,000	
平成16年度第13回兵庫県公募公債	100,000,000	103,135,000	
平成17年度第4回兵庫県公募公債	200,000,000	206,408,000	
平成19年度第18回兵庫県公募公債	100,000,000	104,555,000	
平成13年度第3回静岡県公募公債	100,000,000	100,988,000	
平成14年度第2回静岡県公募公債	100,000,000	101,733,000	
平成15年度第3回静岡県公募公債	100,000,000	103,047,000	
平成19年度第7回静岡県公募公債	100,000,000	106,611,000	
平成20年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	104,987,000	
平成14年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	101,556,000	
平成21年度第7回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	207,158,000	
平成16年度第2回広島県公募公債	100,000,000	104,266,000	
平成14年度第3回埼玉県公募公債	100,000,000	101,601,000	
平成17年度第4回埼玉県公募公債	200,000,000	208,144,000	
平成19年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	107,481,000	
平成21年度第2回埼玉県公募公債	146,000,000	151,882,340	
平成17年度第5回福岡県公募公債	100,000,000	104,738,000	
平成21年度第13回福岡県公募公債	200,000,000	200,174,000	
平成17年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	103,493,000	
平成18年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	106,860,000	
第1回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,951,000	
第4回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,032,000	
第14回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,787,000	
第17回共同発行市場公募地方債	200,000,000	210,096,000	
第20回共同発行市場公募地方債	200,000,000	208,170,000	
第23回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,412,000	
第30回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,636,000	
第31回共同発行市場公募地方債	100,500,000	105,135,060	
第36回共同発行市場公募地方債	200,000,000	210,610,000	
第38回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,505,000	
第40回共同発行市場公募地方債	200,000,000	216,340,000	
第47回共同発行市場公募地方債	300,000,000	319,959,000	
第51回共同発行市場公募地方債	200,000,000	214,624,000	
第66回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,387,000	
第75回共同発行市場公募地方債	300,000,000	313,575,000	
平成14年度第3回大阪市公募公債	125,000,000	126,850,000	
平成17年度第10回大阪市公募公債	192,500,000	200,521,475	
平成19年度第7回大阪市公募公債	100,000,000	105,997,000	
平成21年度第4回大阪市公募公債	200,000,000	206,628,000	
第12回乙号名古屋市公募公債	100,000,000	101,630,000	
第12回あ号名古屋市公募公債	100,000,000	101,163,000	
第464回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	104,848,000	
平成21年度第1回京都市公募公債	100,000,000	103,414,000	
平成15年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	102,978,000	

	第16回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	104,789,000	
	平成17年度第4回横浜市公募公債	300,000,000	314,418,000	
	平成14年度第7回札幌市公募公債	100,000,000	100,926,000	
	平成16年度第2回札幌市公募公債	100,000,000	104,090,000	
	平成15年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	103,390,000	
	平成16年度第6回福岡市公募公債	100,000,000	103,304,000	
	平成18年度第4回福岡市公募公債	100,000,000	106,445,000	
	平成16年度第1回広島市公募公債	100,000,000	103,588,000	
	地方債証券 小計	11,061,000,000	11,479,099,285	
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	516,165,000	
	第7回政府保証日本政策投資銀行債券	103,000,000	106,173,430	
	第7回日本政策投資銀行債券	100,000,000	100,982,000	
	第15回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,600,000	
	第16回日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,818,000	
	第28回日本政策投資銀行債券	200,000,000	202,070,000	
	第39回日本政策投資銀行債券	100,000,000	105,753,000	
	第4回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,275,000	
	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	105,435,000	
	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	212,542,000	
	第10回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	323,277,000	
	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	203,617,300	
	第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,868,000	
	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	213,708,000	
	第27回道路債券	100,000,000	108,545,000	
	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	318,714,000	
	第32回道路債券	100,000,000	108,372,000	
	第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,045,000	
	第42回道路債券	100,000,000	105,183,000	
	第48回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	313,962,000	
	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	105,424,000	
	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	317,946,000	
	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	101,387,000	
	第313回政府保証道路債券	200,000,000	203,748,000	
	第314回政府保証道路債券	100,000,000	101,529,000	
	第323回政府保証道路債券	100,000,000	103,546,000	
	第326回政府保証道路債券	100,000,000	103,447,000	
	第327回政府保証道路債券	150,000,000	155,752,500	
	第328回政府保証道路債券	100,000,000	103,908,000	
	第331回政府保証道路債券	200,000,000	210,316,000	
	第337回政府保証道路債券	100,000,000	103,544,000	
	第1回公営企業債券(5年)	100,000,000	101,707,000	
	第2回公営企業債券	200,000,000	203,646,000	
	第3回政府保証地方公共団体金融機構債券	700,000,000	724,521,000	
	第4回公営企業債券(20年)	200,000,000	211,392,000	
	第18回公営企業債券(20年)	100,000,000	109,452,000	

第19回公営企業債券	100,000,000	107,338,000	
第22回公営企業債券(20年)	200,000,000	210,164,000	
第28回公営企業債券	100,000,000	106,976,000	
第804回政府保証公営企業債券	3,000,000	3,017,910	
第809回政府保証公営企業債券	20,000,000	20,244,000	
第812回政府保証公営企業債券	200,000,000	203,114,000	
第813回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,623,000	
第820回政府保証公営企業債券	3,000,000	3,059,010	
第823回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,189,000	
第824回政府保証公営企業債券	200,000,000	202,436,000	
第828回政府保証公営企業債券	100,000,000	100,553,000	
第831回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,594,000	
第840回政府保証公営企業債券	200,000,000	208,552,000	
第851回政府保証公営企業債券	400,000,000	414,512,000	
第858回政府保証公営企業債券	100,000,000	104,848,000	
第860回政府保証公営企業債券	300,000,000	316,317,000	
第861回政府保証公営企業債券	100,000,000	105,469,000	
第863回政府保証公営企業債券	400,000,000	430,732,000	
第875回政府保証公営企業債券	300,000,000	318,657,000	
第876回政府保証公営企業債券	101,000,000	108,577,020	
第882回政府保証公営企業債券	100,000,000	105,400,000	
第7回首都高速道路債券	100,000,000	103,221,000	
第193回政府保証首都高速道路債券	200,000,000	208,180,000	
第195回政府保証首都高速道路債券	200,000,000	207,792,000	
第4回阪神高速道路債券	100,000,000	101,294,000	
第136回政府保証阪神高速道路債券	100,000,000	103,062,000	
第12回中小企業債券	100,000,000	105,349,000	
第176回政府保証中小企業債券	100,000,000	103,561,000	
第184回政府保証中小企業債券	100,000,000	103,833,000	
第12回国際協力銀行債券	100,000,000	103,822,000	
第29回国際協力銀行債券	100,000,000	106,147,000	
第12回都市再生債券	100,000,000	101,206,000	
第341回東京交通債券	100,000,000	104,968,000	
第13回関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,376,000	
第6回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	103,935,000	
第140回政府保証預金保険機構債券	100,000,000	100,889,000	
第143回政府保証預金保険機構債券	200,000,000	202,198,000	
第1回貸付債権担保住宅金融公庫債券	56,818,000	58,510,608	
第1回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	45,969,000	46,159,311	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	62,152,000	64,216,067	
第2回貸付債権担保住宅金融公庫債券	31,067,000	31,959,244	
第2回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	47,231,000	47,670,720	
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	47,557,000	48,679,820	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	51,247,000	52,053,627	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	55,364,000	58,002,648	
第7回貸付債権担保住宅金融公庫債券	39,479,000	40,460,053	

第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	56,048,000	58,486,088
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	57,328,000	59,536,274
第9回貸付債権担保住宅金融公庫債券	41,928,000	42,236,590
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	57,721,000	60,070,244
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券	43,938,000	43,946,348
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	58,923,000	61,244,566
第12回貸付債権担保住宅金融公庫債券	49,859,000	50,465,285
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	81,037,000	83,445,419
第18回貸付債権担保住宅金融公庫債券	53,231,000	54,437,214
第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,778,000	94,238,568
第30回貸付債権担保住宅金融公庫債券	67,499,000	67,984,992
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	71,099,000	71,605,935
第32回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,444,000	95,925,826
第35回貸付債権担保住宅金融公庫債券	72,961,000	73,932,840
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券	71,889,000	73,339,720
第37回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,810,000	98,572,918
第40回貸付債権担保住宅金融公庫債券	71,392,000	73,218,207
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	72,037,000	75,723,133
第43回貸付債権担保住宅金融公庫債券	71,635,000	74,849,978
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	99,135,000
第44回貸付債権担保住宅金融公庫債券	71,275,000	74,556,501
第48回貸付債権担保住宅金融公庫債券	74,681,000	78,323,939
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	76,536,000	79,889,042
第3回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	64,909,000	67,089,942
第15回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	81,619,000	83,864,338
第12回政府保証国民生活債券	137,000,000	141,693,620
第5回沖縄復興開発金融公庫債券	100,000,000	103,497,000
い第681号商工債	100,000,000	101,371,000
い第697号商工債	100,000,000	102,907,000
い第698号商工債	200,000,000	206,004,000
い第707号商工債	100,000,000	103,133,000
い第681号農林債	400,000,000	405,436,000
い第688号農林債	400,000,000	407,392,000
い第698号農林債	100,000,000	102,895,000
い第704号農林債	100,000,000	102,710,000
い第707号農林債	200,000,000	205,994,000
い第709号農林債	100,000,000	102,378,000
第589回あおぞら債	200,000,000	201,402,000
第219回信金中金債(5年)	200,000,000	203,850,000
第223回信金中金債(5年)	200,000,000	205,762,000
第225回信金中金債(5年)	200,000,000	205,036,000
第230回信金中金債(5年)	100,000,000	102,651,000
第236回信金中金債(5年)	200,000,000	203,230,000
第237回信金中金債(5年)	100,000,000	101,962,000
第106号商工債(3年)	200,000,000	202,050,000
第2回韓国中小企業銀行	100,000,000	100,736,000

	第1回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	207,188,000	
	第5回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	207,380,000	
	特殊債券 小計	17,595,461,000	18,242,063,795	
社債券	第11回メリルリンチ・アンド・カンパニー・インク	100,000,000	100,526,000	
	第12回ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポレーション	100,000,000	100,883,000	
	第2回ジェー・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニー	100,000,000	101,128,000	
	第3回ジェイ・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニー	100,000,000	101,347,000	
	第9回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク	100,000,000	104,016,000	
	第7回シティグループ・インク円貨社債(2002)	200,000,000	201,864,000	
	第11回シティグループ・インク円貨社債(2003)	100,000,000	99,435,000	
	第15回シティグループ・インク円貨債券	100,000,000	100,293,000	
	第6回ザ・ベアー・スターンズ・カンパニーズ・インク	100,000,000	100,464,000	
	第3回バンク・オブ・アメリカ・コーポレーション円貨	100,000,000	101,358,000	
	第4回パークレイズ・バンク・ピーエルシー円貨債(2010)	100,000,000	100,696,000	
	第4回ウォルマート・ストアーズ・インク円貨債(2010)	100,000,000	100,637,000	
	H S B C 銀行 P L C 第1回円貨社債	100,000,000	102,116,000	
	H S B C 銀行 P L C 第2回円貨社債	100,000,000	99,961,000	
	第1回キリンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,646,000	
	第4回日本たばこ産業株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,213,000	
	第23回住友化学工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,748,000	
	第38回三井化学株式会社無担保社債	100,000,000	101,373,000	
	第4回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	101,208,000	
	第8回旭硝子株式会社無担保社債	100,000,000	100,644,000	
	第30回新日本製鐵株式会社無担保社債	200,000,000	229,954,000	
	第46回株式会社神戸製鋼所無担保社債	100,000,000	105,706,000	
	第11回ジェイ エフ イー ホールディングス株式会	100,000,000	102,363,000	
	第50回株式会社東芝無担保社債	100,000,000	100,401,000	
	第25回シャープ株式会社無担保社債	100,000,000	102,235,000	
	第12回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	100,911,000	
	第23回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	106,375,000	
	第26回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	106,568,000	
	第20回三洋電機株式会社無担保社債	100,000,000	105,179,000	
	第20回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,907,000	
	第22回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	106,971,000	
	第1回トヨタ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	113,795,000	
	第3回凸版印刷株式会社無担保社債	100,000,000	102,925,000	
	第54回丸紅株式会社無担保社債	200,000,000	202,296,000	
	第53回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	104,402,000	
	第18回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,518,000	
	第64回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	107,063,000	
	第38回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	98,930,000	
	第2回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	200,000,000	201,860,000	
	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	107,243,000	
	第4回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	300,000,000	303,810,000	
	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	103,288,000	

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	205,680,000	
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	97,762,000	
第57回株式会社東京三菱銀行無担保社債	100,000,000	106,973,000	
第72回株式会社東京三菱銀行無担保社債	100,000,000	103,246,000	
第92回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	102,171,000	
第104回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	300,000,000	309,177,000	
第6回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	104,368,000	
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	101,981,000	
第4回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	104,146,000	
第8回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	105,142,000	
第20回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	106,812,000	
第42回株式会社三井住友銀行無担保社債	200,000,000	203,356,000	
第47回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	101,650,000	
第8回株式会社みずほ銀行無担保社債	100,000,000	105,753,000	
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	99,889,000	
第10回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	200,000,000	203,446,000	
第27回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	105,916,000	
第113回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	101,939,000	
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	104,783,000	
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	104,657,000	
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	100,718,000	
第27回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	106,403,000	
第62回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	101,402,000	
第65回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	96,228,000	
第66回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	100,983,000	
第59回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	102,180,000	
第68回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	100,726,000	
第29回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	107,283,000	
第22回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	116,662,000	
第7回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	116,020,000	
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	109,495,000	
第24回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	102,270,000	
第32回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,272,000	
第35回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	100,829,000	
第10回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	105,110,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	107,704,000	
第13回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	104,583,000	
第19回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,696,000	
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	98,763,000	
第46回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	101,652,000	
第48回日本電信電話株式会社電信電話債券	200,000,000	208,414,000	
第53回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	104,431,000	
第2回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	101,356,000	
第10回株式会社エヌ・ティ・ティ・ドコモ無担保社債	100,000,000	100,922,000	
第16回株式会社エヌ・ティ・ティ・ドコモ無担保社債	100,000,000	102,547,000	
第425回東京電力株式会社社債	100,000,000	116,251,000	

第457回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	107,794,000	
第483回東京電力株式会社社債(一般担保付)	108,000,000	108,627,480	
第489回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	101,026,000	
第506回東京電力株式会社社債(一般担保付)	110,000,000	110,892,100	
第526回東京電力株式会社社債(一般担保付)	300,000,000	318,831,000	
第528回東京電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	212,722,000	
第536回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	105,405,000	
第541回東京電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	203,552,000	
第547回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	106,128,000	
第406回中部電力株式会社社債	100,000,000	114,229,000	
第463回中部電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	202,274,000	
第469回中部電力株式会社社債	300,000,000	311,484,000	
第433回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,152,000	
第448回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	108,738,000	
第466回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,821,000	
第470回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,356,000	
第306回中国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	116,632,000	
第337回中国電力株式会社社債(一般担保付)	43,000,000	43,774,430	
第279回北陸電力株式会社社債(一般担保付)	270,000,000	282,914,100	
第383回東北電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	227,286,000	
第253回四国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	93,867,000	
第343回九州電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	113,458,000	
第360回九州電力株式会社社債(一般担保付)	90,000,000	90,488,700	
第388回九州電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	107,700,000	
第292回北海道電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	107,735,000	
第10回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	103,385,000	
第12回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	103,412,000	
第20回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	105,868,000	
第24回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	103,008,000	
第19回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	105,238,000	
第20回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	101,865,000	
社債券 小計	14,021,000,000	14,565,665,810	
合計		168,322,176,070	

「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

対象年月日	(平成21年12月21日現在)	(平成22年12月20日現在)
科目	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3	334,198
親投資信託受益証券	51,072,881,823	49,098,541,502
未収入金	-	17,449,998
流動資産合計	51,072,881,826	49,116,325,698
資産合計	51,072,881,826	49,116,325,698
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	17,449,998
未払受託者報酬	1,676,518	1,572,342
未払委託者報酬	609,634	571,753
その他未払費用	36,666	34,920
流動負債合計	2,322,818	19,629,013
負債合計	2,322,818	19,629,013
純資産の部		
元本等		
1 元本		
元本	53,134,611,232	49,010,188,864
2 剰余金		
剰余金又は欠損金()	2,064,052,224	86,507,821
元本等合計	51,070,559,008	49,096,696,685
純資産合計	51,070,559,008	49,096,696,685
負債・純資産合計	51,072,881,826	49,116,325,698

(注) 「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、毎年11月30日（ただし、休業日の場合は翌営業日）に決算を行います。上記の貸借対照表は平成21年12月21日および平成22年12月20日現在における同ファンドの状況です。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自平成21年12月1日 至平成21年12月21日	自平成22年12月1日 至平成22年12月20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（売買目的有価証券） 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	親投資信託受益証券（売買目的有価証券） 同左

(貸借対照表に関する注記)

項目	（平成21年12月21日現在）	（平成22年12月20日現在）
1. 受益権総数	平成21年12月21日現在における受益権の総数 53,134,611,232口	平成22年12月20日現在における受益権の総数 49,010,188,864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 2,064,052,224円	
3. 1単位当たり純資産額	0.9612円 (1万口 = 9,612円)	1.0018円 (1万口 = 10,018円)

(金融商品に関する注記)

(追加情報)

当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）および「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

・金融商品の状況に関する事項

項目	自平成22年12月1日 至平成22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、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せん。当ファンドにおける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・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、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。リスクを管理する部署では、各種リスクごとに定められた頻度で、測定項目が上下限值（リミットあるいは注意レベル）内に収まっているかどうかのモニタリングを行っております。上下限値を越えていることが発見された場合は、原則として速やかに修正を行うよう、リスク管理を行う部署から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ます。また、是正勧告あるいは報告を受けた関連運用グループでは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、リスク管理を行う部署は、上下限値に抵触した事実ならびにその後の対処結果あるいは関連運用グループの対処方針の決定に関し、必要に応じて、リスク管理を行う部署の担当役員、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する体制となっております。</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	自平成22年12月1日 至平成22年12月20日
1．貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2．時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」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）

．取引の状況に関する事項

項目	自平成21年12月1日 至平成21年12月21日
1．取引の内容	当ファンドの行うことのできるデリバティブ取引は、次の通りです。 a．わが国の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引ならびに外国の市場におけるこれらの取引と類似の取引。 b．わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の市場における通貨にかかる先物取引およびオプション取引。 c．わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の市場におけるこれらの取引と類似の取引。 異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（「スワップ取引」）。 金利先渡し取引および為替先渡し取引。 外国為替の売買の予約取引。
2．取引に対する取組方針	デリバティブ取引につきましては信託約款等に従っており、その制限を遵守しております。
3．取引の利用目的	信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため。
4．取引に係るリスクの内容	デリバティブ取引に伴いファンドに影響を与える主なリスクとしてマーケットリスクがあげられます。マーケットリスクについては、ポジションや時価、予想損失額の把握が重要だと考えております。
5．取引に係るリスクの管理体制	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・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理ならびに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。
6．取引の時価等に関する事項についての補足説明	該当事項はありません。

．取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

（平成21年12月21日現在）

平成21年12月21日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（平成22年12月20日現在）

平成22年12月20日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（関連当事者との取引に関する注記）

（自平成21年12月1日 至平成21年12月21日）

該当事項はありません。

（自平成22年12月1日 至平成22年12月20日）

該当事項はありません。

(その他の注記)

(平成21年12月21日現在)	
期首	平成21年12月1日
期首元本額	53,078,700,307円
期首より平成21年12月21日現在までの追加設定元本額	56,256,848円
期首より平成21年12月21日現在までの一部解約元本額	345,923円

(平成22年12月20日現在)	
期首	平成22年12月1日
期首元本額	50,617,003,270円
期首より平成22年12月20日現在までの追加設定元本額	2,338,110円
期首より平成22年12月20日現在までの一部解約元本額	1,609,152,516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	銘柄名	元本額	評価額	
			単価	金額
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	38,191,149,271円	1.2856円	49,098,541,502円

（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

対象年月日	（平成21年12月21日現在）	（平成22年12月20日現在）
科目	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	975,559,532	664,129,905
コール・ローン	403,479,161	887,588,956
株式	237,869,317,354	231,704,878,175
新株予約権証券	202,726	-
投資証券	3,781,454,101	4,099,490,024
派生商品評価勘定	4,954,770	18,787,057
未収入金	989,341,742	4,995,392,722
未収配当金	303,170,194	367,816,069
未収利息	552	1,215
差入委託証拠金	352,839,779	621,421,054
流動資産合計	244,680,319,911	243,359,505,177
資産合計	244,680,319,911	243,359,505,177
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	29,316,874	15,963,678
未払金	243,173,249	17,471,958
未払解約金	53,497,466	3,386,139,717
流動負債合計	325,987,589	3,419,575,353
負債合計	325,987,589	3,419,575,353
純資産の部		
元本等		
1 元本		
元本	198,253,619,962	186,633,553,887
2 剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	46,100,712,360	53,306,375,937
元本等合計	244,354,332,322	239,939,929,824
純資産合計	244,354,332,322	239,939,929,824
負債・純資産合計	244,680,319,911	243,359,505,177

（注）「外国株式インデックス・マザーファンド」は、毎年11月30日（ただし、休業日の場合は翌営業日）に決算を行います。上記の貸借対照表は平成21年12月21日および平成22年12月20日現在における同マザーファンドの状況です。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自平成21年12月1日 至平成21年12月21日	自平成22年12月1日 至平成22年12月20日
1. 有価証券の評価基準及び 評価方法	株式、新株予約権証券および投資証券 (売買目的有価証券) 移動平均法に基づき、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、取引所もしくは店頭市場における最 終相場（最終相場のないものについて は、それに準じる価額）、または金融商品 取引業者等から提示される気配相場に基 づいて評価しております。 なお売買停止措置がとられている銘柄 について、必要であると判断された場合 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。	株式および投資証券（売買目的有価証 券） 同左
2. デリバティブの評価基準 及び評価方法	(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。 (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。	(1)先物取引 同左 (2)為替予約取引 同左
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、株式の配当落 ち日において、その金額が確定している ものについては当該金額、未だ確定して いない場合には入金日基準で計上して おります。	受取配当金の計上基準 同左
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。	外貨建資産等の会計処理 同左

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成21年12月21日現在)	(平成22年12月20日現在)
1. 受益権総数	平成21年12月21日現在における受益権の 総数 198,253,619,962口	平成22年12月20日現在における受益権の 総数 186,633,553,887口
2. 1単位当たり純資産額	1.2325円 (1万口 = 12,325円)	1.2856円 (1万口 = 12,856円)

(金融商品に関する注記)

(追加情報)

当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 平成20年3月10日)および「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日)を適用しております。

・金融商品の状況に関する事項

項目	自平成22年12月1日 至平成22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、株式および投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。当ファンドにおける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、先物取引および為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、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。リスクを管理する部署では、各種リスクごとに定められた頻度で、測定項目が上下限值(リミットあるいは注意レベル)内に収まっているかどうかのモニタリングを行っております。上下限値を越えていることが発見された場合は、原則として速やかに修正を行うよう、リスク管理を行う部署から関連する運用グループには是正勧告あるいは報告が行われます。また、是正勧告あるいは報告を受けた関連運用グループでは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、リスク管理を行う部署は、上下限値に抵触した事実ならびにその後の対処結果あるいは関連運用グループの対処方針の決定に関し、必要に応じて、リスク管理を行う部署の担当役員、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する体制となっております。</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	自平成22年12月1日 至平成22年12月20日
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（株式および投資証券） 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

取引の状況に関する事項

項目	自平成21年12月1日 至平成21年12月21日
1. 取引の内容	当ファンドの行うことのできるデリバティブ取引は、次の通りです。 a. わが国の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。 b. わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引。 c. わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。 異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（「スワップ取引」）。 金利先渡取引および為替先渡取引。 外国為替の売買の予約取引。
2. 取引に対する取組方針	デリバティブ取引につきましては信託約款等に従っており、その制限を遵守しております。
3. 取引の利用目的	信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため。
4. 取引に係るリスクの内容	デリバティブ取引に伴いファンドに影響を与える主なリスクとしてマーケットリスクがあげられます。マーケットリスクについては、ポジションや時価、予想損失額の把握が重要だと考えております。
5. 取引に係るリスクの管理体制	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・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理ならびに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。
6. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	該当事項はありません。

. 取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

株式関連

(平成21年12月21日現在)

(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				
	S P 5 0 0	1,620,453,537 (17,887,775米ドル)	()	1,615,910,448 (17,837,625米ドル)	4,543,089 (50,150米ドル)
	D J E U R	705,552,227 (5,434,850ユーロ)	()	699,968,668 (5,391,840ユーロ)	5,583,559 (43,010ユーロ)
	F T S E	336,627,317 (2,302,985英ポンド)	()	331,671,423 (2,269,080英ポンド)	4,955,894 (33,905英ポンド)
買建 合計		2,662,633,081		2,647,550,539	15,082,542

(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。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

通貨関連

(平成21年12月21日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場外取引	為替予約取引				
	買建				
	米ドル	152,158,452	-	154,080,633	1,922,181
	カナダドル	24,227,450	-	24,567,743	340,293
	シンガポールドル	30,972,447	-	31,341,109	368,662
	売建				
	米ドル	528,474,745	-	535,150,837	6,676,092
	カナダドル	42,839,481	-	43,441,195	601,714
	ユーロ	176,889,550	-	178,790,255	1,900,705
	英ポンド	112,717,738	-	113,886,524	1,168,786
	スイスフラン	34,997,760	-	35,450,212	452,452
	スウェーデンクローナ	12,691,611	-	12,933,007	241,396
	ノルウェークローネ	6,105,293	-	6,204,770	99,477
	デンマーククローネ	3,736,071	-	3,775,690	39,619
	オーストラリアドル	39,147,311	-	39,789,070	641,759
	シンガポールドル	7,451,833	-	7,540,531	88,698
	買建 合計	207,358,349	-	209,989,485	2,631,136
	売建 合計	965,051,393	-	976,962,091	11,910,698

(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

- 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。
- 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。

(平成22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	2,574,016,712 (30,613,900米ドル)	()	2,577,085,632 (30,650,400米ドル)	3,068,920 (36,500米ドル)
	DJ EUR	1,013,989,983 (9,183,860ユーロ)	()	1,002,211,443 (9,077,180ユーロ)	11,778,540 (106,680ユーロ)
	FTSE	509,212,352 (3,909,800英ポンド)	()	508,512,312 (3,904,425英ポンド)	700,040 (5,375英ポンド)
買建 合計		4,097,219,047		4,087,809,387	9,409,660

(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。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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			
市場外取引	為替予約取引					
	買建					
	米ドル	420,355,000	-	420,350,000	5,000	
	ユーロ	132,481,560	-	132,480,000	1,560	
	英ポンド	130,232,500	-	130,230,000	2,500	
	オーストラリアドル	17,488,792	-	17,446,706	42,086	
	売建					
	米ドル	2,734,756,054	-	2,738,012,880	3,256,826	
	カナダドル	289,743,690	-	287,802,126	1,941,564	
	ユーロ	751,335,007	-	745,058,697	6,276,310	
	英ポンド	549,351,408	-	544,874,592	4,476,816	
	スイスフラン	202,552,352	-	201,390,395	1,161,957	
	スウェーデンクローナ	80,230,684	-	79,665,359	565,325	
	ノルウェークローネ	17,987,067	-	17,834,202	152,865	
	デンマーククローネ	24,348,298	-	24,131,732	216,566	
	オーストラリアドル	226,770,166	-	226,225,110	545,056	
	シンガポールドル	40,007,791	-	39,803,239	204,552	
	買建 合計		700,557,852	-	700,506,706	51,146

	売建 合計	4,917,082,517	-	4,904,798,332	12,284,185
--	-------	---------------	---	---------------	------------

(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21年12月1日 至 平成21年12月21日)

該当事項はありません。

(自 平成22年12月1日 至 平成22年12月20日)

該当事項はありません。

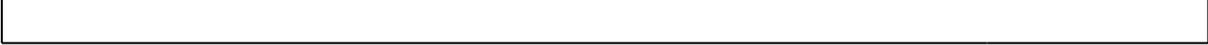
(その他の注記)

(平成21年12月21日現在)	
期首	平成21年12月1日
期首元本額	197,914,050,085円
期首より平成21年12月21日現在までの追加設定元本額	430,759,795円
期首より平成21年12月21日現在までの一部解約元本額	91,189,918円
平成21年12月21日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	1,621,638,979円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	114,849,834円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	540,230,155円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	318,483,623円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	5,376,117円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	1,146,095円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	130,773円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	1,993,682円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	253,148円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	169,360円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	594,265円
外国株式指数ファンド	29,238,272円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	41,438,443,670円
バランスファンドVA(安定運用型)〈適格機関投資家限定〉	575,527,935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〉	23,876,444,063円
SMAM・バランスファンドVA25〈適格機関投資家専用〉	11,322,065,299円
SMAM・バランスファンドVA37.5〈適格機関投資家専用〉	7,020,318,772円
SMAM・バランスファンドVA50〈適格機関投資家専用〉	27,295,278,911円
SMAM・バランスファンドVL30〈適格機関投資家限定〉	83,936,366円
SMAM・バランスファンドVL50〈適格機関投資家限定〉	358,658,455円
世界6資産バランスファンドVA〈適格機関投資家限定〉	76,802,257円
SMAM・バランスファンドVA75〈適格機関投資家専用〉	2,895,427,478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〉	174,065,546円
SMAM・インデックス・バランスVA25〈適格機関投資家専用〉	534,636,371円
SMAM・インデックス・バランスVA50〈適格機関投資家専用〉	2,933,164,720円
SMAM・バランスファンドVA40〈適格機関投資家専用〉	4,691,144,556円
SMAM・バランスファンドVA35〈適格機関投資家専用〉	9,124,892,287円
SMAM・バランスVA株40T〈適格機関投資家限定〉	1,265,020,203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)	2,246,214,836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)	10,138,182,335円
SMAM・グローバルバランス40VA〈適格機関投資家限定〉	666,710,005円
SMAM・バランスファンドVA20〈適格機関投資家専用〉	3,071,508,695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)	44,194,415,314円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A〈適格機関投資家専用〉	97,451,371円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A〈適格機関投資家専用〉	58,973,085円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A〈適格機関投資家専用〉	24,153,726円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L〈適格機関投資家専用〉	288,763,640円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L〈適格機関投資家専用〉	636,604,401円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T〈適格機関投資家専用〉	530,711,362円
合計	198,253,619,962円



(平成22年12月20日現在)

期首	平成22年12月1日
期首元本額	191,043,057,505円
期首より平成22年12月20日現在までの追加設定元本額	108,030,768円
期首より平成22年12月20日現在までの一部解約元本額	4,517,534,386円
平成22年12月20日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	2,803,682,267円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	148,808,679円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	701,988,457円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	431,770,902円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	7,689,654円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	1,761,962円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	373,011円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	2,594,020円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	537,309円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	528,870円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	1,042,215円
外国株式指数ファンド	137,599,325円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	38,191,149,271円
バランスファンドVA(安定運用型)〈適格機関投資家限定〉	393,086,069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〉	22,782,105,535円
SMAM・バランスファンドVA25〈適格機関投資家専用〉	10,348,970,916円
SMAM・バランスファンドVA37.5〈適格機関投資家専用〉	6,372,869,592円
SMAM・バランスファンドVA50〈適格機関投資家専用〉	24,616,163,526円
SMAM・バランスファンドVL30〈適格機関投資家限定〉	80,570,492円
SMAM・バランスファンドVL50〈適格機関投資家限定〉	338,909,318円
世界6資産バランスファンドVA〈適格機関投資家限定〉	71,255,126円
SMAM・バランスファンドVA75〈適格機関投資家専用〉	2,633,074,793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〉	167,175,106円
SMAM・インデックス・バランスVA25〈適格機関投資家専用〉	651,397,705円
SMAM・インデックス・バランスVA50〈適格機関投資家専用〉	3,235,904,693円
SMAM・バランスファンドVA40〈適格機関投資家専用〉	4,391,921,759円
SMAM・バランスファンドVA35〈適格機関投資家専用〉	7,982,961,500円
SMAM・バランスVA株40T〈適格機関投資家限定〉	1,189,043,389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)	3,372,916,266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)	9,825,240,948円
SMAM・グローバルバランス40VA〈適格機関投資家限定〉	605,744,672円
SMAM・バランスファンドVA20〈適格機関投資家専用〉	2,600,746,958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)	41,001,585,724円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A〈適格機関投資家専用〉	93,351,100円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A〈適格機関投資家専用〉	56,894,675円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A〈適格機関投資家専用〉	23,329,919円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L〈適格機関投資家専用〉	263,328,911円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L〈適格機関投資家専用〉	605,982,206円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T〈適格機関投資家専用〉	499,497,047円
合計	186,633,553,887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				
ALPHA NATURAL RESOURCES INC	16,380	51.94	850,777.20	
ANADARKO PETROLEUM CORP	64,414	66.00	4,251,324.00	
APACHE CORPORATION	49,767	116.45	5,795,367.15	
ARCH COAL INC	20,777	32.07	666,318.39	
BAKER HUGHES INC	56,073	56.25	3,154,106.25	
CABOT OIL & GAS CORPORATION	14,620	36.63	535,530.60	
CAMERON INTERNATIONAL CORP	31,812	49.54	1,575,966.48	
CHESAPEAKE ENERGY CORPORATION	84,015	23.30	1,957,549.50	
CHEVRON CORPORATION	261,907	88.49	23,176,150.43	
CIMAREX ENERGY CO	10,800	88.22	952,776.00	
CONCHO RESOURCES INC	11,000	84.71	931,810.00	
CONOCOPHILLIPS	183,496	65.06	11,938,249.76	
CONSOL ENERGY INC	29,262	42.91	1,255,632.42	
DENBURY RESOURCES INC	51,454	18.74	964,247.96	
DEVON ENERGY CORPORATION	53,594	73.09	3,917,185.46	
DIAMOND OFFSHORE DRILLING,INC.	9,156	64.00	585,984.00	
EL PASO CORPORATION	94,720	13.20	1,250,304.00	
EOG RESOURCES INC	33,028	91.67	3,027,676.76	
EXXON MOBIL CORPORATION	663,493	72.17	47,884,289.81	
FMC TECHNOLOGIES INC	15,415	86.44	1,332,472.60	
HALLIBURTON CO	118,781	39.89	4,738,174.09	
HELMERICH & PAYNE INC	13,800	48.74	672,612.00	
HESS CORPORATION	38,597	75.44	2,911,757.68	
KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	10,269	63.46	651,670.74	
MARATHON OIL CORP	91,323	35.21	3,215,482.83	
MURPHY OIL CORPORATION	23,697	72.11	1,708,790.67	
NABORS INDUSTRIES LTD	35,784	21.84	781,522.56	
NATIONAL-OILWELL VARCO INC.	54,053	63.58	3,436,689.74	
NEWFIELD EXPLORATION CO	17,287	71.01	1,227,549.87	
NOBLE CORPORATION	34,318	35.10	1,204,561.80	
NOBLE ENERGY INC	22,611	85.03	1,922,613.33	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	105,842	95.20	10,076,158.40	
PEABODY ENERGY CORP	34,833	60.53	2,108,441.49	
PETROHAWK ENERGY CORP	41,122	18.76	771,448.72	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	15,415	85.06	1,311,199.90	
PLAINS EXPLORATION & PRODUCTION COMPANY	17,100	30.16	515,736.00	
PRIDE INTERNATIONAL INC	23,200	30.95	718,040.00	
RANGE RESOURCES CORPORATION	21,671	42.71	925,568.41	
ROWAN COMPANIES INC	15,145	34.39	520,836.55	

SCHLUMBERGER LTD	178,034	81.34	14,481,285.56	
SOUTHWESTERN ENERGY COMPANY	45,561	35.77	1,629,716.97	
SPECTRA ENERGY CORPORATION	83,663	24.40	2,041,377.20	
SUNOCO INC	16,294	38.59	628,785.46	
ULTRA PETROLEUM CORP	19,548	47.28	924,229.44	
VALERO ENERGY CORP	74,795	21.08	1,576,678.60	
WEATHERFORD INTL LTD	96,045	21.99	2,112,029.55	
WILLIAMS COS INC	77,411	23.90	1,850,122.90	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	27,405	89.33	2,448,088.65	
AIRGAS INC	10,900	63.04	687,136.00	
ALCOA INC	134,795	14.56	1,962,615.20	
ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	10,880	57.62	626,905.60	
BALL CORPORATION	11,403	68.50	781,105.50	
CELANESE CORPORATION	21,123	40.50	855,481.50	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	9,540	124.98	1,192,309.20	
CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	17,570	76.10	1,337,077.00	
CROWN HOLDINGS INC	21,100	33.51	707,061.00	
DOW CHEMICAL	150,984	33.95	5,125,906.80	
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	118,108	49.86	5,888,864.88	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	8,927	80.25	716,391.75	
ECOLAB INC	30,497	50.07	1,526,984.79	
FMC CORPORATION	9,200	79.75	733,700.00	
FREEMONT-MCMORAN COPPER-B	61,321	113.71	6,972,810.91	
INTERNATIONAL PAPER CO	52,575	25.94	1,363,795.50	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	10,392	55.10	572,599.20	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,943	93.74	557,096.82	
MEADWESTVACO CORP	23,015	25.18	579,517.70	
MONSANTO CO	70,257	64.60	4,538,602.20	
MOSAIC CO/THE	20,343	67.33	1,369,694.19	
NEWMONT MINING CORP	63,888	59.40	3,794,947.20	
NUCOR CORP	40,506	44.58	1,805,757.48	
OWENS-ILLINOIS INC	21,339	29.97	639,529.83	
PPG INDUSTRIES INC	21,223	82.01	1,740,498.23	
PRAXAIR INC	39,970	93.52	3,737,994.40	
SEALED AIR CORP	21,138	25.05	529,506.90	
SIGMA-ALDRICH	15,456	66.75	1,031,688.00	
THE LUBRIZOL CORPORATION	8,900	109.75	976,775.00	
UNITED STATES STEEL CORPORATION	18,809	58.90	1,107,850.10	
VULCAN MATERIALS CO	16,753	46.06	771,643.18	
WEYERHAEUSER CO	69,099	18.16	1,254,837.84	
3M COMPANY	88,249	86.37	7,622,066.13	
AGCO CORP	12,100	47.06	569,426.00	
AMETEK INC	13,760	59.22	814,867.20	
BOEING CO	90,436	65.03	5,881,053.08	
BUCYRUS INTERNATIONAL INC-A	9,900	89.63	887,337.00	
CATERPILLAR INC	82,140	92.59	7,605,342.60	

COOPER INDUSTRIES PLC-CL-A	21,752	58.47	1,271,839.44	
CUMMINS INC	24,548	107.96	2,650,202.08	
DANAHER CORP	72,184	46.80	3,378,211.20	
DEERE & CO	55,224	81.55	4,503,517.20	
DOVER CORP	24,274	57.36	1,392,356.64	
EATON CORP	21,096	100.04	2,110,443.84	
EMERSON ELECTRIC CO	98,038	58.33	5,718,556.54	
FASTENAL COMPANY	17,234	59.54	1,026,112.36	
FIRST SOLAR,INC.	7,220	133.25	962,065.00	
FLOWERVE CORP	7,619	116.12	884,718.28	
FLUOR CORP	23,036	63.76	1,468,775.36	
FOSTER WHEELER AG	17,596	33.16	583,483.36	
GENERAL DYNAMICS CORP	41,771	70.28	2,935,665.88	
GENERAL ELECTRIC CO	1,392,143	17.70	24,640,931.10	
GOODRICH CORPORATION	15,937	86.78	1,383,012.86	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	95,362	52.99	5,053,232.38	
ILLINOIS TOOL WORKS	55,460	51.97	2,882,256.20	
INGERSOLL-RAND PLC	42,803	47.00	2,011,741.00	
ITT CORPORATION	22,766	51.70	1,177,002.20	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	15,890	43.52	691,532.80	
JOY GLOBAL INC	13,959	85.55	1,194,192.45	
KBR,INC.	21,085	29.96	631,706.60	
L-3 COMMUNICATIONS HLDGS INC	15,010	70.44	1,057,304.40	
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	39,987	70.07	2,801,889.09	
MASCO CORP	48,766	13.06	636,883.96	
NORTHROP GRUMMAN CORP	36,358	64.12	2,331,274.96	
PACCAR INC	42,316	56.50	2,390,854.00	
PALL CORPORATION	15,476	50.00	773,800.00	
PARKER HANNIFIN CORPORATION	21,379	84.82	1,813,366.78	
PENTAIR INC	12,050	36.39	438,499.50	
PRECISION CASTPARTS CORP	18,320	140.63	2,576,341.60	
QUANTA SERVICES INC	25,859	19.47	503,474.73	
RAYTHEON COMPANY	48,481	45.17	2,189,886.77	
ROCKWELL AUTOMATION INC	18,498	72.06	1,332,965.88	
ROCKWELL COLLINS INC.	20,964	58.33	1,222,830.12	
ROPER INDUSTRIES INC	12,300	78.10	960,630.00	
SPX CORP	6,868	71.83	493,328.44	
TEXTRON INC	37,118	23.29	864,478.22	
TYCO INTERNATIONAL LTD	66,170	41.75	2,762,597.50	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	115,013	78.80	9,063,024.40	
URS CORPORATION	10,900	43.10	469,790.00	
WW GRAINGER INC	7,600	136.19	1,035,044.00	
AVERY DENNISON CORP	13,262	42.30	560,982.60	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	4,000	238.02	952,080.00	
CINTAS CORP	16,913	29.19	493,690.47	
DUN & BRADSTREET CORP	6,801	81.56	554,689.56	

EQUIFAX INC	17,342	35.85	621,710.70	
IHS INC-CLASS A	5,400	79.62	429,948.00	
IRON MOUNTAIN INC	22,122	25.32	560,129.04	
MANPOWER INC	10,692	64.98	694,766.16	
NETFLIX INC	5,780	180.02	1,040,515.60	
PITNEY BOWES INC	25,773	24.54	632,469.42	
REPUBLIC SERVICES INC	49,094	30.41	1,492,948.54	
ROBERT HALF INTL INC	19,091	30.42	580,748.22	
RR DONNELLEY & SONS CO	25,698	17.53	450,485.94	
STERICYCLE,INC.	10,400	78.75	819,000.00	
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	14,200	33.93	481,806.00	
WASTE MANAGEMENT INC	59,224	36.28	2,148,646.72	
C.H.ROBINSON WORLDWIDE,INC.	21,160	79.00	1,671,640.00	
CSX CORP	49,306	63.66	3,138,819.96	
DELTA AIR LINES INC	28,000	12.46	348,880.00	
EXPEDITORS INTL WASH INC	27,178	55.35	1,504,302.30	
FEDEX CORP	38,941	93.07	3,624,238.87	
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	12,900	39.60	510,840.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	47,877	62.67	3,000,451.59	
SOUTHWEST AIRLINES	24,000	12.93	310,320.00	
UNION PACIFIC CORP	64,760	91.18	5,904,816.80	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	11,000	24.14	265,540.00	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	94,486	73.06	6,903,147.16	
AUTOLIV INC	11,200	80.22	898,464.00	
BORGWARNER INC	15,100	71.05	1,072,855.00	
FORD MOTOR COMPANY	395,089	16.80	6,637,495.20	
GENERAL MOTORS CO	67,800	34.00	2,305,200.00	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	32,434	11.64	377,531.76	
HARLEY-DAVIDSON INC	30,886	34.50	1,065,567.00	
JOHNSON CONTROLS INC	87,583	38.65	3,385,082.95	
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	13,500	52.70	711,450.00	
COACH INC	38,345	58.23	2,232,829.35	
D.R.HORTON INC	39,548	11.39	450,451.72	
FORTUNE BRANDS INC	20,002	61.47	1,229,522.94	
GARMIN LTD	15,016	31.76	476,908.16	
HASBRO INC	16,714	49.44	826,340.16	
LEGGETT & PLATT INC	20,215	23.23	469,594.45	
MATTEL INC	45,782	25.66	1,174,766.12	
MOHAWK INDUSTRIES INC	8,183	59.92	490,325.36	
NEWELL RUBBERMAID INC	37,844	18.00	681,192.00	
NIKE INC -CL B	48,102	90.05	4,331,585.10	
POLO RALPH LAUREN CORPORATION	8,438	114.16	963,282.08	
PULTE GROUP INC	43,751	7.06	308,882.06	
STANLEY BLACK & DECKER INC	20,028	63.37	1,269,174.36	
TOLL BROTHERS INC	20,139	18.61	374,786.79	
VF CORP	11,065	89.21	987,108.65	

WHIRLPOOL CORP	10,184	90.08	917,374.72	
APOLLO GROUP INC-CL A	17,373	38.48	668,513.04	
CARNIVAL CORP	59,388	42.51	2,524,583.88	
DARDEN RESTAURANTS INC	17,140	49.89	855,114.60	
DEVRY INC	8,600	46.04	395,944.00	
H&R BLOCK INC	41,192	12.99	535,084.08	
INTL GAME TECHNOLOGY	40,760	16.90	688,844.00	
LAS VEGAS SANDS CORP	43,800	45.38	1,987,644.00	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	38,537	41.65	1,605,066.05	
MCDONALD'S CORPORATION	138,598	76.81	10,645,712.38	
MGM MIRAGE	44,000	13.64	600,160.00	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	18,871	42.41	800,319.11	
STARBUCKS CORP	96,157	32.76	3,150,103.32	
STARWOOD HOTELS & RESORTS	25,164	59.75	1,503,549.00	
WYNN RESORTS LTD	10,421	104.95	1,093,683.95	
YUM! BRANDS INC	60,704	50.05	3,038,235.20	
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	32,320	34.22	1,105,990.40	
CBS CORP-CL B	80,893	18.77	1,518,361.61	
COMCAST CORP-CL A	269,289	21.41	5,765,477.49	
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	94,389	20.06	1,893,443.34	
DIRECTV-CLASS A	113,010	39.26	4,436,772.60	
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-A	18,230	42.47	774,228.10	
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-C	18,230	37.07	675,786.10	
DISH NETWORK CORP.	28,864	17.97	518,686.08	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	62,125	10.83	672,813.75	
LIBERTY GLOBAL INC-A	15,740	35.48	558,455.20	
LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	14,963	33.66	503,654.58	
MCGRAW-HILL COMPANIES INC	40,251	36.30	1,461,111.30	
NEWS CORP-CL A	237,722	14.47	3,439,837.34	
NEWS CORPORATION-CLASS B	55,331	16.14	893,042.34	
OMNICOM GROUP	38,769	46.44	1,800,432.36	
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	11,100	52.08	578,088.00	
THE WALT DISNEY CO.	236,729	37.05	8,770,809.45	
TIME WARNER CABLE,INC.	46,100	65.30	3,010,330.00	
TIME WARNER INC	146,050	31.51	4,602,035.50	
VIACOM INC-CLASS B	72,388	38.61	2,794,900.68	
VIRGIN MEDIA INC	40,577	26.11	1,059,465.47	
WASHINGTON POST CO B	817	423.00	345,591.00	
ABERCROMBIE & FITCH CO -CL A	11,771	57.11	672,241.81	
ADVANCE AUTO PARTS	11,038	66.79	737,228.02	
AMAZON.COM INC	46,622	177.58	8,279,134.76	
AMERICAN EAGLE OUTFITTERS INC	24,500	15.22	372,890.00	
AUTOZONE INC	3,758	269.99	1,014,622.42	
BED BATH & BEYOND INC	34,549	47.72	1,648,678.28	
BEST BUY COMPANY INC	45,426	34.27	1,556,749.02	
CARMAX INC	30,322	35.51	1,076,734.22	

DOLLAR GENERAL CORP	12,000	30.66	367,920.00	
DOLLAR TREE INC	16,850	57.36	966,516.00	
EXPEDIA INC	26,283	26.83	705,172.89	
FAMILY DOLLAR STORES	16,736	49.58	829,770.88	
GAMESTOP CORP-CL A	18,147	21.67	393,245.49	
GAP INC/THE	58,371	21.19	1,236,881.49	
GENUINE PARTS CO	19,884	51.12	1,016,470.08	
HOME DEPOT INC	218,866	35.10	7,682,196.60	
J.C.PENNEY CO INC (HLDG CO)	27,397	33.70	923,278.90	
KOHL'S CORP	37,557	53.80	2,020,566.60	
LIBERTY MEDIA-INTERACTIVE A	72,707	15.97	1,161,130.79	
LIMITED BRANDS	34,993	31.24	1,093,181.32	
LOWE'S COMPANIES INC	182,725	25.17	4,599,188.25	
MACY'S INC	56,248	25.89	1,456,260.72	
NORDSTROM INC	23,535	42.31	995,765.85	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	17,800	62.77	1,117,306.00	
PETSMART INC	15,091	40.15	605,903.65	
PRICELINE.COM INC	6,292	400.64	2,520,826.88	
ROSS STORES INC	16,036	62.96	1,009,626.56	
SEARS HOLDINGS CORP	6,310	67.78	427,691.80	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	12,090	82.02	991,621.80	
STAPLES INC	96,976	22.53	2,184,869.28	
TARGET CORP	89,319	58.52	5,226,947.88	
TIFFANY & CO	16,407	65.16	1,069,080.12	
TJX COMPANIES INC	52,595	43.44	2,284,726.80	
URBAN OUTFITTERS,INC.	16,700	36.36	607,212.00	
COSTCO WHOLESALE CORP	57,204	71.84	4,109,535.36	
CVS CAREMARK CORPORATION	176,853	34.40	6,083,743.20	
KROGER CO	77,569	21.70	1,683,247.30	
SAFEWAY INC	48,149	21.56	1,038,092.44	
SYSCO CORP	77,685	29.30	2,276,170.50	
WAL-MART STORES INC	265,640	54.41	14,453,472.40	
WALGREEN CO	126,806	37.58	4,765,369.48	
WHOLE FOODS MARKET INC	19,300	50.83	981,019.00	
ALTRIA GROUP INC	271,356	24.99	6,781,186.44	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	82,792	30.03	2,486,243.76	
BROWN-FORMAN CORPORATION	10,115	70.01	708,151.15	
BUNGE LIMITED	17,438	62.04	1,081,853.52	
CAMPBELL SOUP CO	27,579	35.39	976,020.81	
COCA-COLA CO/THE	270,987	65.70	17,803,845.90	
COCA-COLA ENTERPRISES INC	44,704	25.25	1,128,776.00	
CONAGRA FOODS INC	58,363	22.49	1,312,583.87	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	24,323	22.15	538,754.45	
DR.PEPPER SNAPPLE GROUP,INC	31,837	37.97	1,208,850.89	
GENERAL MILLS INC	83,214	36.38	3,027,325.32	
HANSEN NATURAL CORPORATION	9,600	52.75	506,400.00	

HJ HEINZ CO	42,219	50.75	2,142,614.25	
HORMEL FOODS CORPORATION	10,000	51.55	515,500.00	
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	15,500	65.86	1,020,830.00	
KELLOGG CO	33,634	51.23	1,723,069.82	
KRAFT FOODS INC-A	227,411	31.93	7,261,233.23	
LORILLARD INC	20,120	82.39	1,657,686.80	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	16,430	47.71	783,875.30	
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	26,100	62.52	1,631,772.00	
MOLSON COORS BREWING COMPANY	21,525	50.80	1,093,470.00	
PEPSICO INC	207,274	65.97	13,673,865.78	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	238,852	59.69	14,257,075.88	
RALCORP HOLDINGS INC	7,450	64.57	481,046.50	
REYNOLDS AMERICAN INC	45,944	32.46	1,491,342.24	
SARA LEE CORP	80,711	17.26	1,393,071.86	
THE HERSHEY COMPANY	20,410	48.30	985,803.00	
TYSON FOODS INC-CL A	36,900	17.18	633,942.00	
AVON PRODUCTS INC	54,613	28.84	1,575,038.92	
CHURCH & DWIGHT CO INC	9,200	68.82	633,144.00	
CLOROX COMPANY	18,061	62.54	1,129,534.94	
COLGATE-PALMOLIVE CO	63,285	81.00	5,126,085.00	
ENERGIZER HOLDINGS INC	9,117	74.31	677,484.27	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	15,062	79.30	1,194,416.60	
KIMBERLY-CLARK CORP	52,930	62.74	3,320,828.20	
PROCTER & GAMBLE CO	369,670	64.81	23,958,312.70	
AETNA INC	53,202	30.37	1,615,744.74	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	11,200	82.34	922,208.00	
AMERISOURCEBERGEN CORP	36,218	33.18	1,201,713.24	
BARD(C.R.) INC	12,310	95.72	1,178,313.20	
BAXTER INTERNATIONAL INC	76,066	51.27	3,899,903.82	
BECKMAN COULTER INC	8,891	72.07	640,774.37	
BECTON DICKINSON & CO	30,016	85.21	2,557,663.36	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	198,125	7.65	1,515,656.25	
CARDINAL HEALTH INC	44,990	38.71	1,741,562.90	
CAREFUSION CORPORATION	29,445	24.86	732,002.70	
CERNER CORP	9,440	96.98	915,491.20	
CIGNA CORP	36,211	36.70	1,328,943.70	
COVENTRY HEALTH CARE INC	20,613	26.64	549,130.32	
COVIDIEN PLC	66,075	46.48	3,071,166.00	
DAVITA INC	13,008	70.01	910,690.08	
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	18,609	34.44	640,893.96	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	15,060	84.75	1,276,335.00	
EXPRESS SCRIPTS INC	66,824	54.91	3,669,305.84	
HENRY SCHEIN INC	12,350	62.09	766,811.50	
HOLOGIC INC	34,680	18.03	625,280.40	
HOSPIRA INC	21,733	57.44	1,248,343.52	
HUMANA INC.	22,343	55.36	1,236,908.48	

INTUITIVE SURGICAL INC	5,249	265.76	1,394,974.24
LABORATORY CRP OF AMR HLDGS	12,996	88.92	1,155,604.32
MCKESSON CORP	33,967	68.81	2,337,269.27
MEDCO HEALTH SOLUTIONS INC	57,122	62.15	3,550,132.30
MEDTRONIC INC	141,154	37.40	5,279,159.60
OMNICARE INC	15,500	24.43	378,665.00
PATTERSON COS INC	13,032	30.89	402,558.48
QUEST DIAGNOSTICS	19,299	54.22	1,046,391.78
ST JUDE MEDICAL INC	44,520	42.56	1,894,771.20
STRYKER CORP	38,253	54.53	2,085,936.09
UNITEDHEALTH GROUP INC	146,452	35.05	5,133,142.60
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	15,967	70.37	1,123,597.79
WELLPOINT INC	51,760	55.93	2,894,936.80
ZIMMER HOLDINGS INC	25,697	54.50	1,400,486.50
ABBOTT LABORATORIES	200,894	48.40	9,723,269.60
ALLERGAN INC	39,808	70.85	2,820,396.80
AMGEN INC	124,893	57.42	7,171,356.06
BIOGEN IDEC INC	31,297	68.14	2,132,577.58
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	223,139	26.49	5,910,952.11
CELGENE CORP	60,572	59.27	3,590,102.44
CEPHALON INC	9,463	65.24	617,366.12
COVANCE INC	8,500	51.67	439,195.00
ELI LILLY & CO	134,873	35.01	4,721,903.73
FOREST LABORATORIES,INC.	37,830	32.71	1,237,419.30
GENZYME CORP - GENL DIVISION	32,960	69.79	2,300,278.40
GILEAD SCIENCES INC	109,414	37.19	4,069,106.66
HUMAN GENOME SCIENCES INC	23,800	23.85	567,630.00
ILLUMINA INC	15,900	63.76	1,013,784.00
JOHNSON & JOHNSON	358,876	62.54	22,444,105.04
LIFE TECHNOLOGIES CORPORATION	23,215	55.47	1,287,736.05
MERCK & CO. INC.	400,511	36.48	14,610,641.28
MYLAN INC	38,900	21.40	832,460.00
PERRIGO CO	11,300	67.03	757,439.00
PFIZER INC	1,046,916	17.03	17,828,979.48
PHARMACEUTICAL PRODUCT DEVELOPMENT INC	14,700	26.58	390,726.00
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	53,726	55.78	2,996,836.28
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	26,708	35.45	946,798.60
WARNER CHILCOTT PLC	15,000	22.56	338,400.00
WATERS CORP	12,321	80.17	987,774.57
WATSON PHARMACEUTICALS INC	17,400	51.61	898,014.00
BB & T CORPORATION	90,363	26.16	2,363,896.08
COMERICA INC	23,950	41.34	990,093.00
FIFTH THIRD BANCORP	105,738	14.07	1,487,733.66
HUDSON CITY BANCORP INC	59,969	12.51	750,212.19
KEYCORP	114,915	8.42	967,584.30
M & T BANK CORP	11,008	82.75	910,912.00

MARSHALL & ILSLEY CORPORATION	70,652	6.85	483,966.20
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	52,300	18.10	946,630.00
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	50,000	13.61	680,500.00
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	68,201	58.50	3,989,758.50
REGIONS FINANCIAL CORPORATION	157,470	6.24	982,612.80
SUNTRUST BANKS INC	64,503	27.04	1,744,161.12
US BANCORP	249,590	26.20	6,539,258.00
WELLS FARGO & COMPANY	647,332	29.96	19,394,066.72
AMERICAN EXPRESS COMPANY	141,177	44.01	6,213,199.77
AMERIPRISE FINANCIAL INC	33,351	55.20	1,840,975.20
BANK OF AMERICA CORP	1,305,779	12.57	16,413,642.03
BANK OF NEW YORK MELLON CORP(THE)	157,901	29.39	4,640,710.39
BLACKROCK INC	11,650	187.20	2,180,880.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	59,186	40.49	2,396,441.14
CIT GROUP INC	25,200	43.57	1,097,964.00
CITIGROUP INC	3,786,518	4.70	17,796,634.60
CME GROUP INC.	8,820	319.26	2,815,873.20
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	70,281	18.02	1,266,463.62
EATON VANCE CORP	15,000	31.23	468,450.00
FRANKLIN RESOURCES INC	20,575	114.60	2,357,895.00
GOLDMAN SACHS GROUP INC	63,749	164.04	10,457,385.96
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	8,268	119.23	985,793.64
INVESCO LIMITED	60,239	22.78	1,372,244.42
JEFFERIES GROUP INC	13,400	26.66	357,244.00
JPMORGAN CHASE & CO	516,763	39.67	20,499,988.21
LEGG MASON INC	20,603	36.34	748,713.02
LEUCADIA NATIONAL CORPORATION	24,856	28.56	709,887.36
MOODY'S CORP	25,616	26.35	674,981.60
MORGAN STANLEY	163,905	26.24	4,300,867.20
NASDAQ STOCK MARKET INC	16,080	23.50	377,880.00
NORTHERN TRUST CORP	28,905	54.26	1,568,385.30
NYSE EURONEXT	34,329	29.85	1,024,720.65
SCHWAB (CHARLES) CORP	130,852	16.81	2,199,622.12
SEI INVESTMENTS COMPANY	17,324	23.98	415,429.52
SLM CORPORATION	64,061	12.06	772,575.66
STATE STREET CORP	64,867	45.47	2,949,502.49
T ROWE PRICE GROUP INC	33,462	62.99	2,107,771.38
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	31,894	18.68	595,779.92
ACE LIMITED	43,908	61.05	2,680,583.40
AFLAC INC	61,345	55.56	3,408,328.20
ALLSTATE CORP	65,833	31.31	2,061,231.23
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	15,500	52.56	814,680.00
AON CORPORATION	39,539	45.10	1,783,208.90
ARCH CAPITAL GROUP LTD.	6,500	88.66	576,290.00
ASSURANT INC	13,289	37.20	494,350.80
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	14,803	36.38	538,533.14

BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	111,400	79.95	8,906,430.00	
CHUBB CORP	40,891	59.20	2,420,747.20	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	20,333	31.81	646,792.73	
EVEREST RE GROUP LTD	6,903	84.68	584,546.04	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL INC-CL A	29,561	13.87	410,011.07	
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	66,000	12.84	847,440.00	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	56,786	26.17	1,486,089.62	
LINCOLN NATIONAL CORP	41,827	28.43	1,189,141.61	
LOEWS CORPORATION	43,510	38.65	1,681,661.50	
MARSH & MCLENNAN COS	71,756	27.09	1,943,870.04	
METLIFE INC	121,863	43.93	5,353,441.59	
OLD REPUBLIC INTL CORP	32,961	13.44	442,995.84	
PARTNERRE LTD	9,068	77.73	704,855.64	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	41,900	31.93	1,337,867.00	
PROGRESSIVE CORP	84,383	19.62	1,655,594.46	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	60,464	58.09	3,512,353.76	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	6,763	62.21	420,726.23	
TORCHMARK CORPORATION	10,939	60.40	660,715.60	
TRANSATLANTIC HOLDINGS INC	8,000	51.54	412,320.00	
TRAVELERS COS INC(THE)	61,078	55.18	3,370,284.04	
UNUM GROUP	41,670	23.83	992,996.10	
VALIDUS HOLDINGS LTD	10,200	29.04	296,208.00	
W.R.BERKLEY CORPORATION	17,343	27.28	473,117.04	
WHITE MOUNTAINS INSURANCE GROUP LTD.	1,050	327.00	343,350.00	
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	22,398	34.13	764,443.74	
XL GROUP PLC	45,100	21.70	978,670.00	
CB RICHARD ELLIS GROUP INC-A	36,000	20.50	738,000.00	
ACCENTURE PLC-CL A	82,443	50.32	4,148,531.76	
ACTIVISION BLIZZARD INC	69,020	12.15	838,593.00	
ADOBE SYSTEMS INC	68,116	28.79	1,961,059.64	
AKAMAI TECHNOLOGIES	23,506	50.87	1,195,750.22	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	6,950	70.07	486,986.50	
AUTODESK INC	29,834	39.13	1,167,404.42	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	64,076	46.86	3,002,601.36	
BMC SOFTWARE INC	23,578	48.26	1,137,874.28	
CA INC	53,913	24.89	1,341,894.57	
CITRIX SYSTEMS INC	24,198	69.21	1,674,743.58	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATION	39,105	72.40	2,831,202.00	
COMPUTER SCIENCES CORP	19,862	48.40	961,320.80	
EBAY INC	153,431	29.78	4,569,175.18	
ELECTRONIC ARTS INC	42,181	15.91	671,099.71	
F5 NETWORKS INC	10,240	136.01	1,392,742.40	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	33,112	27.44	908,593.28	
FISERV INC	19,976	60.44	1,207,349.44	
GOOGLE INC-CL A	32,121	590.80	18,977,086.80	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	164,326	145.00	23,827,270.00	

INTUIT INC	38,722	49.39	1,912,479.58
LENDER PROCESSING SERVICES,INC.	11,400	30.47	347,358.00
MASTERCARD INC-CL A	13,934	221.26	3,083,036.84
MCAFEE INC	19,412	46.37	900,134.44
MICROSOFT CORP	1,014,202	27.79	28,184,673.58
NUANCE COMMUNICATIONS INC	30,500	18.34	559,370.00
ORACLE CORPORATION	523,629	31.39	16,436,714.31
PAYCHEX INC	41,544	31.00	1,287,864.00
RED HAT INC	25,000	47.83	1,195,750.00
SAIC INC	50,200	15.70	788,140.00
SALESFORCE.COM,INC.	15,235	136.50	2,079,577.50
SYMANTEC CORPORATION	101,213	16.94	1,714,548.22
SYNOPSYS INC	18,684	27.14	507,083.76
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	21,919	15.28	334,922.32
VERISIGN INC	22,318	34.28	765,061.04
VISA INC	64,716	66.90	4,329,500.40
VMWARE INC	9,400	88.70	833,780.00
WESTERN UNION COMPANY	86,846	18.28	1,587,544.88
YAHOO! INC	167,010	16.32	2,725,603.20
AGILENT TECHNOLOGIES INC	46,258	40.54	1,875,299.32
AMPHENOL CORPORATION -CL A	23,444	53.15	1,246,048.60
APPLE INC	118,997	320.61	38,151,628.17
ARROW ELECTRONICS INC	15,990	33.91	542,220.90
AVAGO TECHNOLOGIES LTD.	12,000	28.17	338,040.00
AVNET INC	20,900	33.00	689,700.00
CISCO SYSTEMS INC	744,431	19.50	14,516,404.50
CORNING INC	203,502	18.99	3,864,502.98
DELL INC	226,852	13.64	3,094,261.28
DOLBY LABORATORIES INC-CL A	7,300	67.75	494,575.00
EMC CORP/MASS	267,503	22.96	6,141,868.88
FLEXTRONICS INTL LTD	101,331	7.65	775,182.15
FLIR SYSTEMS INC	20,940	28.45	595,743.00
HARRIS CORP	16,650	46.40	772,560.00
HEWLETT-PACKARD CO	303,994	41.96	12,755,588.24
JUNIPER NETWORKS INC	67,123	36.49	2,449,318.27
MOTOROLA INC	285,579	8.88	2,535,941.52
NETAPP INC	46,744	53.80	2,514,827.20
QUALCOMM INC	209,120	49.32	10,313,798.40
SANDISK CORP	30,800	48.87	1,505,196.00
SEAGATE TECHNOLOGY	59,968	14.70	881,529.60
TERADATA CORP	21,677	43.50	942,949.50
TYCO ELECTRONICS LTD	57,629	35.34	2,036,608.86
WESTERN DIGITAL CORP	29,523	32.97	973,373.31
XEROX CORP	179,540	11.75	2,109,595.00
AMERICAN TOWER CORPORATION -CL A	51,609	49.61	2,560,322.49
AT&T INC	770,051	29.21	22,493,189.71

CENTURYLINK INC	40,212	45.13	1,814,767.56	
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	37,222	41.69	1,551,785.18	
FRONTIER COMMUNICATIONS CORPORATION	128,980	9.25	1,193,065.00	
METROPCS COMMUNICATIONS INC.	32,700	12.08	395,016.00	
NII HOLDINGS INC	21,479	45.30	972,998.70	
QWEST COMMUNICATIONS INTL	204,888	7.41	1,518,220.08	
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	15,000	39.16	587,400.00	
SPRINT NEXTEL CORP	380,323	4.16	1,582,143.68	
TELEPHONE AND DATA SYSTEMS	6,500	36.73	238,745.00	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	368,220	34.64	12,755,140.80	
WINDSTREAM CORPORATION	64,500	13.99	902,355.00	
AES CORPORATION	90,066	11.44	1,030,355.04	
ALLEGHENY ENERGY INC	23,612	23.67	558,896.04	
ALLIANT ENERGY CORP	14,248	36.85	525,038.80	
AMEREN CORPORATION	32,024	28.40	909,481.60	
AMERICAN ELECTRIC POWER	62,050	35.99	2,233,179.50	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	21,800	25.23	550,014.00	
CALPINE CORP	43,100	13.14	566,334.00	
CENTERPOINT ENERGY INC	53,409	15.87	847,600.83	
CONSOLIDATED EDISON INC	37,347	49.34	1,842,700.98	
CONSTELLATION ENERGY GROUP	26,023	28.75	748,161.25	
DOMINION RESOURCES INC/VA	76,825	42.57	3,270,440.25	
DTE ENERGY COMPANY	21,773	45.37	987,841.01	
DUKE ENERGY CORP	171,769	17.74	3,047,182.06	
EDISON INTERNATIONAL	40,953	38.68	1,584,062.04	
ENERGEN CORPORATION	8,700	46.93	408,291.00	
ENTERGY CORP	24,579	70.51	1,733,065.29	
EQT CORPORATION	18,380	44.05	809,639.00	
EXELON CORP	86,056	41.08	3,535,180.48	
FIRSTENERGY CORP	39,795	36.28	1,443,762.60	
INTEGRYS ENERGY GROUP,INC.	10,300	49.24	507,172.00	
MDU RESOURCES GROUP INC	23,200	20.19	468,408.00	
NEXTERA ENERGY INC	51,260	51.67	2,648,604.20	
NISOURCE INC	37,692	17.11	644,910.12	
NORTHEAST UTILITIES	21,800	31.88	694,984.00	
NRG ENERGY INC	33,525	18.67	625,911.75	
NSTAR	13,700	42.23	578,551.00	
ONEOK INC	12,400	54.16	671,584.00	
P G & E CORPORATION	50,474	48.10	2,427,799.40	
PEPCO HOLDINGS INC	28,834	18.31	527,950.54	
PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	13,444	41.51	558,060.44	
PPL CORPORATION	61,844	26.03	1,609,799.32	
PROGRESS ENERGY INC	38,376	43.66	1,675,496.16	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	66,448	31.64	2,102,414.72	
QEP RESOURCES INC	22,311	36.71	819,036.81	
SCANA CORP	16,463	40.76	671,031.88	

SEMPRA ENERGY	30,061	52.47	1,577,300.67	
SOUTHERN CO	108,218	37.90	4,101,462.20	
WISCONSIN ENERGY CORP	15,216	59.13	899,722.08	
XCEL ENERGY INC	59,012	23.73	1,400,354.76	
ADVANCED MICRO DEVICES	73,485	8.10	595,228.50	
ALTERA CORPORATION	40,470	36.61	1,481,606.70	
ANALOG DEVICES	39,105	37.49	1,466,046.45	
APPLIED MATERIALS INC	176,529	13.61	2,402,559.69	
BROADCOM CORP-CL A	59,022	43.82	2,586,344.04	
CREE INC	14,000	67.57	945,980.00	
INTEL CORP	726,022	21.46	15,580,432.12	
KLA-TENCOR CORPORATION	22,724	39.83	905,096.92	
LAM RESEARCH CORP	16,064	51.85	832,918.40	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	28,658	34.92	1,000,737.36	
LSI CORPORATION	91,857	6.00	551,142.00	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	71,874	18.86	1,355,543.64	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	39,400	23.83	938,902.00	
MEMC ELECTRONIC MATERIALS	31,806	11.08	352,410.48	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	24,508	34.10	835,722.80	
MICRON TECHNOLOGY INC	119,941	8.21	984,715.61	
NATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	33,092	13.80	456,669.60	
NVIDIA CORP	76,794	14.37	1,103,529.78	
TEXAS INSTRUMENTS INC	155,841	32.53	5,069,507.73	
XILINX INC	34,753	28.21	980,382.13	
米ドル 小計	42,755,671		1,513,574,521.83	
(邦貨換算額)			(127,261,345,795)	(単位：円)
カナダドル				
ATHABASCA OIL SANDS CORP	26,000	15.48	402,480.00	
CAMECO CORP	50,960	39.94	2,035,342.40	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	141,890	43.03	6,105,526.70	
CENOVUS ENERGY INC	97,848	31.54	3,086,125.92	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	29,100	43.96	1,279,236.00	
ENBRIDGE INC	47,129	55.73	2,626,499.17	
ENCANA CORP	96,648	28.39	2,743,836.72	
HUSKY ENERGY INC	33,342	25.54	851,554.68	
IMPERIAL OIL LTD	39,564	38.63	1,528,357.32	
MEG ENERGY CORPORATION	3,500	43.60	152,600.00	
NEXEN INC	69,708	21.21	1,478,506.68	
NIKO RESOURCES LTD	5,880	102.91	605,110.80	
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORPORATION	33,000	33.69	1,111,770.00	
PETROBAKKEN ENERGY LTD-A	11,100	20.63	228,993.00	
PETROBANK ENERGY & RESOURCES	13,600	43.52	591,872.00	
PROGRESS ENERGY RESOURCES CORP	21,400	11.05	236,470.00	
SUNCOR ENERGY INC	203,492	36.30	7,386,759.60	
TALISMAN ENERGY INC	130,932	20.89	2,735,169.48	

TRANSCANADA CORP	90,277	38.03	3,433,234.31	
VERMILION ENERGY INC	10,500	46.01	483,105.00	
AGNICO-EAGLE MINES	21,550	76.46	1,647,713.00	
AGRIUM INC	20,723	83.15	1,723,117.45	
BARRICK GOLD CORP	128,539	52.37	6,731,587.43	
CENTERRA GOLD INC	21,000	20.57	431,970.00	
ELDORADO GOLD CORPORATION	70,200	18.45	1,295,190.00	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	10,300	111.23	1,145,669.00	
FRANCO-NEVADA CORPORATION	15,500	33.31	516,305.00	
GOLDCORP INC	104,199	44.97	4,685,829.03	
IAMGOLD CORP	47,300	18.00	851,400.00	
INMET MINING CORPORATION	6,322	75.02	474,276.44	
IVANHOE MINES LTD	35,100	25.45	893,295.00	
KINROSS GOLD CORP	147,124	18.70	2,751,218.80	
OSISKO MINING CORPORATION	43,000	14.83	637,690.00	
PAN AMERICAN SILVER CORP	14,072	38.98	548,526.56	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	38,428	139.96	5,378,382.88	
SHERRITT INTERNATIONAL CORPORATION	36,500	8.26	301,490.00	
SILVER WHEATON CORPORATION	43,000	37.71	1,621,530.00	
SINO-FOREST CORPORATION-CL A	30,871	23.61	728,864.31	
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	75,317	58.39	4,397,759.63	
YAMANA GOLD INC	96,570	12.38	1,195,536.60	
BOMBARDIER INC 'B'	184,659	4.78	882,670.02	
CAE INC	32,014	11.24	359,837.36	
FINNING INTERNATIONAL INC	21,750	26.25	570,937.50	
SNC-LAVALIN GROUP INC	19,581	56.83	1,112,788.23	
RITCHIE BROS. AUCTIONEERS	12,400	21.26	263,624.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	60,634	68.14	4,131,600.76	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	22,686	65.45	1,484,798.70	
MAGNA INTERNATIONAL INC	28,712	51.89	1,489,865.68	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	15,500	30.00	465,000.00	
TIM HORTONS INC	23,100	41.26	953,106.00	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	43,506	20.96	911,885.76	
THOMSON REUTERS CORP	48,678	37.14	1,807,900.92	
YELLOW MEDIA INC	69,500	6.30	437,850.00	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	9,758	65.96	643,637.68	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B	16,600	26.35	437,410.00	
EMPIRE CO LTD A	4,400	55.80	245,520.00	
LOBLAW COMPANIES LTD	14,333	40.34	578,193.22	
METRO INC -A	14,300	45.20	646,360.00	
SHOPPERS DRUG MART CORP	27,620	38.74	1,069,998.80	
WESTON (GEORGE) LTD	6,480	82.70	535,896.00	
SAPUTO INC	19,040	38.87	740,084.80	
VITERRA INC	45,000	9.25	416,250.00	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	34,393	30.55	1,050,706.15	
BANK OF MONTREAL	73,379	58.00	4,255,982.00	

BANK OF NOVA SCOTIA	133,551	56.60	7,558,986.60	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	50,942	78.69	4,008,625.98	
NATIONAL BANK OF CANADA	21,761	70.86	1,541,984.46	
ROYAL BANK OF CANADA	185,232	51.50	9,539,448.00	
TORONTO-DOMINION BANK	114,083	72.20	8,236,792.60	
CI FINANCIAL CORP	19,200	22.00	422,400.00	
IGM FINANCIAL INC	15,601	43.08	672,091.08	
ONEX CORPORATION	12,923	29.18	377,093.14	
TMX GROUP INC	9,421	36.24	341,417.04	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,560	395.00	1,011,200.00	
GREAT-WEST LIFECO INC	37,404	25.57	956,420.28	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANC	11,000	36.16	397,760.00	
INTACT FINANCIAL CORPORATION	15,200	50.49	767,448.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	228,845	16.96	3,881,211.20	
POWER CORP OF CANADA	45,260	27.01	1,222,472.60	
POWER FINANCIAL CORP	31,786	30.03	954,533.58	
SUN LIFE FINANCIAL INC	75,083	30.48	2,288,529.84	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	66,693	31.50	2,100,829.50	
BROOKFIELD PROPERTIES CORP	32,363	16.85	545,316.55	
CGI GROUP INC - CL A	31,587	16.54	522,448.98	
OPEN TEXT CORPORATION	7,500	47.16	353,700.00	
RESEARCH IN MOTION	63,721	60.69	3,867,227.49	
BCE INC	32,920	35.72	1,175,902.40	
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	57,000	34.50	1,966,500.00	
TELUS CORPORATION	4,400	46.69	205,436.00	
TELUS CORPORATION -NON VOTE	22,397	44.68	1,000,697.96	
CANADIAN UTILITIES LIMITED	10,800	54.12	584,496.00	
FORTIS INC	22,790	34.10	777,139.00	
TRANSALTA CORP	30,268	21.45	649,248.60	
カナダドル 小計	4,401,799		160,479,161.37	
(邦貨換算額)			(13,322,979,976)	(単位 : 円)
ユーロ				
COMPAGNIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE-VERITA	19,750	21.96	433,710.00	
ENI SPA	339,783	16.26	5,524,871.58	
FUGRO NV-CVA	8,345	58.76	490,352.20	
GALP ENERGIA SGPS S.A	30,500	14.14	431,270.00	
NESTE OIL OYJ	16,085	11.75	188,998.75	
OMV AG	20,389	29.57	602,902.73	
REPSOL YPF SA	94,990	20.80	1,975,792.00	
SAIPEM	34,620	35.42	1,226,240.40	
SBM OFFSHORE NV	22,287	15.97	355,923.39	
TECHNIP S.A.	12,569	69.45	872,917.05	
TENARIS S.A.	60,869	17.86	1,087,120.34	
TOTAL SA	274,996	39.77	10,936,590.92	
ACERINOX SA	14,036	12.50	175,450.00	

AIR LIQUIDE	36,858	97.81	3,605,080.98
AKZO NOBEL	29,516	45.35	1,338,550.60
ARCELOR MITTAL	111,348	29.02	3,231,875.70
BASF SE	119,523	60.83	7,270,584.09
CIMPOR-CIMENTOS DE PORTUGAL	20,500	5.17	106,067.00
CRH PLC	99,280	15.21	1,510,048.80
ERAMET	750	255.90	191,925.00
HEIDELBERGCEMENT AG	18,700	48.23	901,901.00
IMERYS SA	4,515	50.40	227,556.00
K+S AG	19,220	55.04	1,057,868.80
KONINKLIJKE DSM NV	20,581	40.99	843,718.09
LAFARGE SA	26,532	46.89	1,244,218.14
LANXESS	10,000	57.07	570,700.00
LINDE AG	21,971	112.65	2,475,033.15
OUTOKUMPU OYJ	15,029	13.09	196,729.61
RAUTARUUKKI OYJ	12,273	17.06	209,377.38
SALZGITTER AG	5,570	57.56	320,609.20
SOLVAY SA	7,685	79.29	609,343.65
STORA ENSO OYJ-R SHS	78,312	6.88	538,786.56
THYSSENKRUPP AG	42,758	31.42	1,343,670.15
UMICORE	14,450	38.69	559,142.75
UPM-KYMMENE OYJ	67,376	11.85	798,405.60
VOESTALPINE AG	13,753	34.73	477,710.45
WACKER CHEMIE AG	2,150	129.70	278,855.00
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	18,235	35.12	640,413.20
ALSTOM RGPT	26,413	35.84	946,773.98
BEKAERT NV	5,000	82.72	413,600.00
BOSKALIS WESTMINSTER NV	8,800	35.24	310,112.00
BOUYGUES	30,931	31.99	989,637.34
BRENNTAG AG	3,000	72.91	218,730.00
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	51,123	38.75	1,981,016.25
EIFFAGE SA	5,600	34.79	194,824.00
EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	53,580	17.65	945,954.90
FINMECCANICA SPA	49,089	8.46	415,538.38
FOMENTO DE CONSTRUC Y CONTRA	5,502	18.30	100,686.60
GEA GROUP AG	20,300	20.38	413,714.00
HOCHTIEF AG	6,337	64.67	409,813.79
KONE OYJ-B	20,700	42.08	871,056.00
LEGRAND SA	20,100	31.49	633,049.50
MAN SE	14,093	91.52	1,289,791.36
METSO OYJ	16,771	41.77	700,524.67
PHILIPS ELECTRONICS NV	128,545	22.46	2,887,120.70
PRYSMIAN SPA	25,400	12.82	325,628.00
SAFRAN SA	21,277	26.99	574,372.61
SCHNEIDER ELECTRIC SA	31,407	115.35	3,622,797.45
SIEMENS AG-REG	107,291	92.38	9,911,542.58

THALES SA	12,475	26.21	326,969.75	
VALLOUREC	14,600	79.53	1,161,138.00	
VINCI S.A.	58,063	40.54	2,354,164.33	
WARTSILA OYJ-B SHARES	10,051	57.75	580,445.25	
ZARDOYA OTIS SA	19,500	11.01	214,695.00	
BIC	3,400	65.38	222,292.00	
BUREAU VERITAS SA	6,520	55.90	364,468.00	
EDENRED	19,367	18.75	363,131.25	
RANDSTAD HOLDING NV	14,298	36.87	527,167.26	
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	39,310	13.45	528,719.50	
AEROPORTS DE PARIS (ADP)	3,800	60.90	231,420.00	
AIR FRANCE-KLM	19,327	13.77	266,132.79	
ATLANTIA SPA	32,326	15.20	491,355.20	
BRISA	26,718	5.24	140,242.78	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	31,179	16.74	522,092.35	
DEUTSCHE POST AG-REG	109,648	12.59	1,381,016.56	
FERROVIAL SA	60,368	7.86	474,613.21	
FRAPORT AG	5,000	47.78	238,900.00	
GROUPE EUROTUNNEL SA	64,000	6.94	444,416.00	
IBERIA LINEAS AER DE ESPANA	63,493	3.20	203,368.07	
RYANAIR HOLDINGS PLC	1,656	3.73	6,190.12	
TNT NV	48,993	19.12	936,991.12	
VOPAK	9,100	34.95	318,045.00	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	43,066	61.95	2,667,938.70	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE(BMW)AG-PFD	7,041	40.00	281,640.00	
CONTINENTAL AG	6,600	58.14	383,724.00	
DAIMLER AG	117,623	53.68	6,314,002.64	
FIAT SPA	97,516	14.51	1,414,957.16	
MICHELIN (CGDE)-B	23,045	53.74	1,238,438.30	
NOKIAN RENKAAT OYJ	13,997	27.18	380,438.46	
PEUGEOT SA	19,955	29.76	593,960.57	
PIRELLI & C.	33,352	6.12	204,114.24	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PREF	11,565	62.06	717,723.90	
RENAULT SA	25,225	43.11	1,087,449.75	
VOLKSWAGEN AG	3,944	111.80	440,939.20	
VOLKSWAGEN AG PFD	22,125	121.80	2,694,825.00	
ADIDAS AG	27,124	50.48	1,369,219.52	
CHRISTIAN DIOR SA	8,220	108.20	889,404.00	
HERMES INTERNATIONAL	1,343	157.35	211,321.05	
LUXOTTICA GROUP SPA	15,130	21.96	332,254.80	
LVMH MOET HENNESSY LOUI V SA	31,888	123.20	3,928,601.60	
PUMA AG	666	245.25	163,336.50	
ACCOR SA	19,567	32.96	644,928.32	
AUTOGRILL SPA	13,200	10.26	135,432.00	
OPAP SA	30,006	13.00	390,078.00	
SODEXO	12,086	52.53	634,877.58	

TUI AG	20,000	10.04	200,800.00	
AXEL SPRINGER AG	1,800	117.00	210,600.00	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	13,600	27.76	377,536.00	
GESTEVISION TELECINCO SA	22,600	8.53	192,868.40	
JC DECAUX S.A.	7,300	22.25	162,461.50	
KABEL DEUTSCHLAND HOLDINGS AG	6,800	36.71	249,662.00	
LAGARDERE S.C.A.	14,571	29.30	426,930.30	
M6-METROPOLE TELEVISION	8,300	18.34	152,263.50	
MEDIASET SPA	98,634	4.49	443,113.24	
PAGESJAUNES SA	19,000	6.79	129,181.00	
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-PFD	10,000	23.13	231,300.00	
PUBLICIS GROUPE	16,600	38.06	631,796.00	
REED ELSEVIER NV	91,096	9.15	834,257.16	
SANOMA OYJ	10,500	16.19	169,995.00	
SES	39,896	18.28	729,498.36	
TELEVISION FRANCAISE (T.F.1)	16,976	13.09	222,215.84	
VIVENDI SA	160,477	20.62	3,309,035.74	
WOLTERS KLUWER-CVA	38,242	16.49	630,801.79	
INDITEX	28,093	58.17	1,634,169.81	
PPR	9,686	123.95	1,200,579.70	
CARREFOUR SA	78,916	33.04	2,607,384.64	
CASINO GUICHARD PERRACHON	6,840	73.51	502,808.40	
COLRUYT NV	10,445	39.02	407,563.90	
DELHAIZE GROUP	13,078	55.07	720,205.46	
JERONIMO MARTINS SGPS S.A.	27,800	12.05	334,990.00	
KESKO OYJ-B SHS	8,334	34.96	291,356.64	
KONINKLIJKE AHOLD NV	158,997	9.60	1,526,371.20	
METRO AG	16,429	55.82	917,066.78	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	93,894	43.29	4,065,140.73	
COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	22,629	19.85	449,185.65	
DANONE	75,860	47.20	3,580,592.00	
HEINEKEN HOLDING NV	15,439	32.13	496,055.07	
HEINEKEN NV	33,100	36.09	1,194,579.00	
KERRY GROUP PLC-A	21,598	25.50	550,749.00	
PARMALAT SPA	215,000	1.94	417,100.00	
PERNOD-RICARD SA	26,277	69.72	1,832,032.44	
SUEDZUCKER AG	8,500	20.20	171,700.00	
UNILEVER NV-CVA	211,420	23.67	5,005,368.50	
BEIERSDORF AG	13,640	41.88	571,243.20	
HENKEL AG & CO KGAA	17,300	38.52	666,482.50	
HENKEL AG & CO KGAA	22,578	45.98	1,038,136.44	
L'OREAL	30,950	85.73	2,653,343.50	
BIOMERIEUX	1,800	75.04	135,072.00	
CELESIO AG	9,104	18.44	167,923.28	
ESSILOR INTERNATIONAL	26,503	49.22	1,304,610.17	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	25,540	43.06	1,099,752.40	

FRESENIUS SE	4,100	62.81	257,521.00	
FRESENIUS SE-PFD	10,020	63.57	636,971.40	
BAYER AG	107,403	56.45	6,062,899.35	
ELAN CORPORATION PLC	85,566	4.40	376,747.09	
GRIFOLS S.A.	16,200	10.08	163,377.00	
MERCK KGAA	8,381	60.10	503,698.10	
ORION OYJ	11,098	16.14	179,121.72	
QIAGEN N.V.	31,000	14.72	456,475.00	
SANOFI-AVENTIS	136,076	48.65	6,620,777.78	
UCB SA	13,497	26.00	350,989.48	
ALPHA BANK A.E.	69,321	4.44	307,785.24	
ANGLO IRISH BANK CORPORATION PLC	96,000	0.00	96.00	
BANCA CARIGE S.P.A	84,000	1.59	133,644.00	
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	312,414	0.85	265,864.31	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	553,684	7.59	4,202,461.56	
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	388,402	0.61	236,925.22	
BANCO DE SABADELL SA	134,475	3.08	415,124.32	
BANCO DE VALENCIA SA	30,032	3.31	99,405.92	
BANCO ESPIRITO SANTO,S.A(BES)	72,900	2.85	208,275.30	
BANCO POPOLARE SPA	82,182	3.31	272,433.33	
BANCO POPULAR ESPANOL	113,047	3.95	446,761.74	
BANCO SANTANDER SA	1,071,641	7.97	8,546,336.97	
BANK OF CYPRUS PUBLIC CO LTD	112,500	2.76	310,500.00	
BANKINTER,S.A.	37,500	4.12	154,687.50	
BNP PARIBAS	124,903	49.71	6,208,928.13	
COMMERZBANK AG	94,343	5.72	539,830.64	
CREDIT AGRICOLE SA	123,690	10.09	1,248,032.10	
DEXIA	75,950	2.74	208,786.55	
EFG EUROBANK ERGASIAS	44,991	4.56	205,158.96	
ERSTE GROUP BANK AG	25,213	33.70	849,804.16	
INTESA SANPAOLO	1,001,490	2.08	2,083,099.20	
INTESA SANPAOLO-RNC	134,503	1.82	245,198.96	
KBC GROUPE SA	20,251	26.44	535,537.69	
NATIONAL BANK OF GREECE S,A.	120,339	6.80	818,305.20	
NATIXIS	118,000	3.55	419,018.00	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	5,750	40.75	234,312.50	
SOCIETE GENERALE	82,679	41.29	3,413,815.91	
UNICREDIT SPA	1,758,241	1.56	2,748,130.68	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	78,394	6.63	519,752.22	
AGEAS	292,000	1.77	518,008.00	
CNP-CIE NATL A PORTEFEUILLE	3,700	37.02	136,992.50	
CRITERIA CAIXACORP SA	117,507	3.98	468,500.40	
DEUTSCHE BANK AG -REG	121,326	39.80	4,828,774.80	
DEUTSCHE BOERSE AG	25,747	52.40	1,349,142.80	
EURAZEO	4,200	55.22	231,924.00	
EXOR SPA	7,897	23.17	182,973.49	

GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	10,855	62.97	683,539.35
ING GROEP NV-CVA	498,242	7.36	3,670,548.81
MEDIOBANCA SPA	58,668	6.51	382,222.02
POHJOLA BANK PLC	17,903	9.05	162,111.66
AEGON NV	205,788	4.53	933,865.94
ALLIANZ SE-REG	59,219	89.90	5,323,788.10
ASSICURAZIONI GENERALI	152,351	14.38	2,190,807.38
AXA SA	222,194	12.64	2,809,643.13
CNP ASSURANCES	19,484	14.09	274,626.98
DELTA LLOYD NV	9,600	15.04	144,384.00
HANNOVER RUECKVERSICHERUNGS AG	7,400	40.69	301,143.00
MAPFRE SA	93,649	2.06	192,916.94
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	24,434	111.60	2,726,834.40
SAMPO OYJ-A SHS	56,854	20.09	1,142,196.86
SCOR SE	20,958	18.99	398,097.21
VIENNA INSURANCE GROUP AG WIENER VERSICH	4,800	38.50	184,824.00
IMMOFINANZ AG	140,000	3.03	425,320.00
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	27,000	15.29	412,830.00
ATOS ORIGIN	5,731	39.75	227,807.25
CAP GEMINI SA	19,604	34.80	682,219.20
DASSAULT SYSTEMES SA	7,233	57.04	412,570.32
INDRA SISTEMAS SA	11,128	13.10	145,776.80
SAP AG	111,720	37.99	4,244,801.40
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	15,500	11.91	184,605.00
ALCATEL-LUCENT	302,916	2.28	691,557.22
NEOPOST SA	3,718	66.33	246,614.94
NOKIA OYJ	487,267	7.52	3,666,684.17
BELGACOM SA	19,531	25.19	492,083.54
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	370,142	9.67	3,580,753.70
ELISA OYJ	17,422	15.61	271,957.42
FRANCE TELECOM SA	241,420	15.91	3,842,199.30
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	32,849	6.68	219,431.32
ILIAD SA	2,000	81.65	163,300.00
KONINKLIJKE KPN NV	204,075	10.83	2,210,132.25
MOBISTAR SA	3,264	45.68	149,115.84
PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	73,352	9.69	711,441.04
TELECOM ITALIA SPA	1,260,901	0.95	1,197,855.95
TELECOM ITALIA-RNC	762,811	0.80	611,774.42
TELEFONICA S.A.	535,372	17.06	9,133,446.32
TELEKOM AUSTRIA AG	43,626	10.49	457,636.74
A2A S.P.A.	131,000	1.02	134,537.00
ACCIONA S.A.	3,430	53.56	183,710.80
E.ON AG	234,782	22.40	5,259,116.80
EDP RENOVAVEIS SA	27,000	4.47	120,771.00
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	256,624	2.59	665,426.03
ELECTRICITE DE FRANCE(EDF)	32,949	31.78	1,047,283.96

ENAGAS	24,000	15.12	363,000.00	
ENEL GREEN POWER SPA	200,000	1.61	322,000.00	
ENEL SPA	857,547	3.74	3,213,657.38	
FORTUM OYJ	57,481	21.57	1,239,865.17	
GAS NATURAL SDG SA	42,046	11.40	479,324.40	
GDF SUEZ	160,905	27.18	4,373,397.90	
IBERDROLA RENOVABLES	117,000	2.60	304,668.00	
IBERDROLA SA	520,845	5.57	2,901,106.65	
PUBLIC POWER CORP	16,106	11.45	184,413.70	
RED ELECTRICA CORPORATION S.A.	14,300	35.75	511,225.00	
RWE AG	54,730	49.01	2,682,317.30	
RWE AG-NON VTG PFD	4,813	45.70	219,954.10	
SNAM RETE GAS	191,283	3.72	713,007.38	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	37,000	15.16	561,105.00	
TERNA SPA	164,846	3.14	517,616.44	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	45,930	21.65	994,614.15	
VERBUND AG	7,970	26.36	210,089.20	
ASML HOLDING NV	56,982	28.79	1,640,796.69	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	143,000	7.04	1,008,007.00	
STMICROELECTRONICS NV	84,305	7.59	640,549.39	
ユーロ 小計	23,111,389		312,867,982.02	
(邦貨換算額)			(34,543,753,894)	(単位 : 円)
英ポンド				
AMEC PLC	42,935	11.55	495,899.25	
BG GROUP PLC	440,495	13.24	5,834,356.27	
BP PLC	2,447,584	4.67	11,433,888.65	
CAIRN ENERGY PLC	176,000	4.18	737,088.00	
ESSAR ENERGY PLC	42,000	5.77	242,550.00	
PETROFAC LIMITED	35,000	15.13	529,550.00	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	462,106	20.71	9,570,215.26	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	351,130	20.69	7,266,635.35	
TULLOW OIL PLC	117,400	12.35	1,449,890.00	
ANGLO AMERICAN PLC	171,591	31.50	5,405,116.50	
ANTOFAGASTA PLC	50,670	15.30	775,251.00	
BHP BILLITON PLC	287,397	25.00	7,184,925.00	
EURASIAN NATURAL RESOURCES CORPORATION	33,700	9.92	334,472.50	
FRESNILLO PLC	22,200	15.38	341,436.00	
JOHNSON MATTHEY PLC	26,901	20.37	547,973.37	
KAZAKHMYS PLC	29,000	15.83	459,070.00	
LONMIN PLC	21,656	18.73	405,616.88	
RANDGOLD RESOURCES LTD	11,922	56.15	669,420.30	
REXAM PLC	114,549	3.26	373,429.74	
RIO TINTO PLC	188,993	44.18	8,349,710.74	
VEDANTA RESOURCES PLC	16,400	24.22	397,208.00	
XSTRATA PLC	268,017	14.49	3,884,906.41	

BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	50,000	5.53	276,750.00
BAE SYSTEMS PLC	437,735	3.25	1,422,638.75
BALFOUR BEATTY PLC	86,839	3.14	272,934.97
BUNZL PLC	46,008	7.23	332,867.88
COBHAM PLC	145,074	1.98	288,262.03
INVENSYS PLC	101,258	3.51	355,618.09
ROLLS-ROYCE GROUP PLC	238,193	6.30	1,500,615.90
ROLLS-ROYCE GROUP PLC-C SHRS ENTITLEMENT	16,191,552	0.00	16,191.55
SMITHS GROUP PLC	51,366	12.35	634,370.10
WEIR GROUP PLC/THE	26,000	17.90	465,400.00
WOLSELEY PLC	37,832	19.59	741,128.88
AGGREKO PLC	34,400	15.34	527,696.00
CAPITA GROUP PLC	81,599	7.00	571,600.99
EXPERIAN PLC	134,894	8.13	1,097,362.69
G4S PLC	180,927	2.52	457,383.45
INTERTEK GROUP PLC	22,000	18.67	410,740.00
SERCO GROUP PLC	61,528	5.89	362,399.92
BRITISH AIRWAYS PLC	78,550	2.70	212,242.10
FIRSTGROUP PLC	63,315	3.93	248,891.26
BURBERRY GROUP PLC	57,437	11.30	649,038.10
CARNIVAL PLC	23,267	27.64	643,099.88
COMPASS GROUP PLC	244,578	5.79	1,416,106.62
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	38,349	12.34	473,226.66
THOMAS COOK GROUP PLC	116,000	1.83	213,208.00
TUI TRAVEL PLC	80,000	2.38	190,880.00
WHITBREAD PLC	23,456	18.05	423,380.80
BRITISH SKY BROADCASTING PLC	146,655	7.28	1,067,648.40
ITV PLC	480,000	0.72	346,080.00
PEARSON PLC	107,053	10.17	1,088,729.01
REED ELSEVIER PLC	154,148	5.28	813,901.44
WPP PLC	163,667	7.83	1,281,512.61
HOME RETAIL GROUP	108,094	1.96	212,728.99
KINGFISHER PLC	301,840	2.55	770,899.36
MARKS & SPENCER GROUP PLC	203,199	3.75	762,809.04
NEXT PLC	24,544	19.85	487,198.40
SAINSBURY (J) PLC	160,638	3.72	597,733.99
TESCO PLC	1,046,082	4.33	4,533,719.38
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	271,792	2.64	719,161.63
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	46,800	11.33	530,244.00
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	260,126	24.55	6,386,093.30
DIAGEO PLC	326,810	11.80	3,856,358.00
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	132,170	19.41	2,565,419.70
SABMILLER PLC	123,710	22.43	2,775,433.85
UNILEVER PLC	167,097	19.72	3,295,152.84
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	80,363	35.77	2,874,584.51
SMITH & NEPHEW PLC	117,783	6.55	772,067.56

ASTRAZENECA PLC	186,521	29.41	5,485,582.61	
GLAXOSMITHKLINE PLC	677,043	12.65	8,567,979.16	
SHIRE PLC	71,600	15.30	1,095,480.00	
BARCLAYS PLC	1,491,627	2.59	3,874,501.13	
HSBC HOLDINGS PLC	2,294,303	6.55	15,039,156.16	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,321,754	0.66	3,538,966.41	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	2,312,954	0.37	874,759.20	
STANDARD CHARTERED PLC	303,843	17.34	5,268,637.62	
3I GROUP PLC	132,000	3.28	433,620.00	
ICAP PLC	71,716	5.37	385,114.92	
INVESTEC PLC	66,000	5.06	333,960.00	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	18,902	8.23	155,563.46	
MAN GROUP PLC	227,945	2.94	670,158.30	
SCHRODERS PLC	14,200	17.83	253,186.00	
ADMIRAL GROUP PLC	25,200	15.51	390,852.00	
AVIVA PLC	360,434	3.85	1,390,914.80	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	787,491	0.99	781,191.07	
OLD MUTUAL PLC	722,324	1.20	866,788.80	
PRUDENTIAL PLC	330,753	6.70	2,217,698.86	
RESOLUTION LTD	183,068	2.32	426,365.37	
RSA INSURANCE GROUP PLC	431,885	1.24	535,969.28	
STANDARD LIFE PLC	294,048	2.10	617,500.80	
AUTONOMY CORP PLC	29,800	15.43	459,814.00	
SAGE GROUP PLC (THE)	163,063	2.75	449,727.75	
ARM HOLDINGS PLC	175,000	3.94	689,500.00	
BT GROUP PLC	1,019,899	1.82	1,860,295.77	
CABLE & WIRELESS WORLDWIDE	351,018	0.68	240,622.83	
INMARSAT PLC	54,000	6.85	369,900.00	
VODAFONE GROUP PLC	6,872,038	1.70	11,685,900.61	
CENTRICA PLC	664,735	3.30	2,197,613.91	
INTERNATIONAL POWER PLC	204,253	4.35	888,500.55	
NATIONAL GRID PLC	455,217	5.52	2,512,797.84	
SCOTTISH & SOUTHERN ENERGY	120,608	11.85	1,429,204.80	
SEVERN TRENT PLC	30,994	14.36	445,073.84	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	86,391	5.85	505,819.30	
英ポンド 小計	54,985,001		193,568,837.00	
(邦貨換算額)			(25,210,405,330)	(単位：円)
スイスフラン				
TRANSOCEAN LTD	41,500	67.10	2,784,650.00	
GIVAUDAN-REG	1,050	1,022.00	1,073,100.00	
HOLCIM LTD-REG	31,497	70.85	2,231,562.45	
SIKA AG	276	2,034.00	561,384.00	
SYNGENTA AG	12,451	275.00	3,424,025.00	
ABB LTD	285,603	20.92	5,974,814.76	
GEBERIT AG-REG	5,050	215.40	1,087,770.00	

SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,500	114.60	286,500.00	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	6,210	112.30	697,383.00	
ADECCO SA-REG	16,734	60.45	1,011,570.30	
SGS SA	707	1,640.00	1,159,480.00	
KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	7,335	132.90	974,821.50	
CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-BR A	67,377	55.60	3,746,161.20	
THE SWATCH GROUP AG-B	4,019	425.00	1,708,075.00	
THE SWATCH GROUP AG-REG	6,100	77.00	469,700.00	
ARYZTA AG	11,300	42.75	483,075.00	
LINDT & SPRUENGLI AG	116	2,864.00	332,224.00	
LINDT & SPRUENGLI AG-REG	15	29,870.00	448,050.00	
NESTLE SA-REGISTERED	451,600	55.95	25,267,020.00	
SONOVA HOLDING AG	5,942	121.90	724,329.80	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	970	221.90	215,243.00	
SYNTHES INC	7,650	126.60	968,490.00	
ACTELION LTD	13,016	50.70	659,911.20	
LONZA GROUP AG-REG	6,552	76.90	503,848.80	
NOVARTIS AG-REG SHS	274,983	56.75	15,605,285.25	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	91,330	138.50	12,649,205.00	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	146,826	37.65	5,527,998.90	
GAM HOLDING LTD	27,273	15.25	415,913.25	
JULIUS BAER GROUP LTD	27,473	43.35	1,190,954.55	
PARGESA HOLDING SA-BR	3,200	79.85	255,520.00	
UBS AG-REGISTERED	474,325	15.49	7,347,294.25	
BALOISE HOLDING AG	6,200	90.90	563,580.00	
SWISS LIFE HOLDING AG	4,070	131.80	536,426.00	
SWISS RE-REG	46,500	50.10	2,329,650.00	
ZURICH FINANCIAL SERVICES AG	18,978	242.30	4,598,369.40	
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	24,282	18.65	452,859.30	
SWISSCOM AG-REG	2,977	411.00	1,223,547.00	
スイスフラン 小計	2,133,987		109,489,791.91	
(邦貨換算額)			(9,488,385,366)	(単位：円)
スウェーデンクローナ				
BOLIDEN AB	37,000	134.00	4,958,000.00	
HOLMEN AB-B SHARES	6,133	213.80	1,311,235.40	
SSAB AB-A SHARES	22,942	110.80	2,541,973.60	
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	74,742	104.40	7,803,064.80	
ALFA LAVAL AB	44,752	136.30	6,099,697.60	
ASSA ABLOY AB-B	39,466	191.80	7,569,578.80	
ATLAS COPCO AB-A SHS	88,832	170.70	15,163,622.40	
ATLAS COPCO AB-B SHS	49,796	153.50	7,643,686.00	
HEXAGON AB-B SHS	34,500	140.80	4,857,600.00	
SANDVIK AB	133,454	129.20	17,242,256.80	
SCANIA AB-B SHS	42,132	156.00	6,572,592.00	
SKANSKA AB-B SHS	52,490	129.50	6,797,455.00	

SKF AB-B SHARES	49,648	189.60	9,413,260.80	
VOLVO AB-B SHS	177,800	111.70	19,860,260.00	
SECURITAS AB-B SHS	42,457	76.80	3,260,697.60	
ELECTROLUX AB-SER B	30,083	185.50	5,580,396.50	
HUSQVARNA AB-B SHS	57,983	53.70	3,113,687.10	
CDON GROUP AB-NEW	6,300	31.20	196,560.00	
MODERN TIMES GROUP-B SHS	6,300	467.90	2,947,770.00	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	133,044	231.90	30,852,903.60	
SWEDISH MATCH AB	29,571	193.40	5,719,031.40	
GETINGE AB-B SHS	25,538	139.10	3,552,335.80	
NORDEA BANK AB	420,529	73.80	31,035,040.20	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A	182,523	55.90	10,203,035.70	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	64,708	215.80	13,963,986.40	
SWEDBANK AB - A SHARES	94,460	94.95	8,968,977.00	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	13,000	115.60	1,502,800.00	
INVESTOR AB-B SHS	57,949	142.30	8,246,142.70	
KINNEVIK INVESTMENT AB-B	30,000	140.10	4,203,000.00	
RATOS AB-B SHS	14,000	247.20	3,460,800.00	
ERICSSON LM-B SHS	391,523	77.25	30,245,151.75	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	10,120	627.00	6,345,240.00	
TELE2 AB -B SHS	41,873	145.20	6,079,959.60	
TELIASONERA AB	289,271	53.35	15,432,607.85	
スウェーデンクローナ 小計	2,794,919		312,744,406.40	
(邦貨換算額)			(3,837,373,866)	(単位 : 円)
ノルウェークローネ				
AKER SOLUTIONS ASA	20,600	93.50	1,926,100.00	
SEADRILL LID	37,995	191.80	7,287,441.00	
STATOIL ASA	143,564	136.90	19,653,911.60	
NORSK HYDRO ASA	121,797	40.47	4,929,124.59	
YARA INTERNATIONAL ASA	24,005	325.50	7,813,627.50	
ORKLA ASA	100,350	56.15	5,634,652.50	
RENEWABLE ENERGY CORP AS	69,670	17.30	1,205,291.00	
DNB NOR ASA	127,019	80.40	10,212,327.60	
TELENOR ASA	107,792	91.95	9,911,474.40	
ノルウェークローネ 小計	752,792		68,573,950.19	
(邦貨換算額)			(960,721,042)	(単位 : 円)
デンマーククローネ				
NOVOZYMES A/S-B SHARES	5,703	763.50	4,354,240.50	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	26,862	182.60	4,905,001.20	
A P MOLLER - MAERSK A/S	174	51,000.00	8,874,000.00	
A P MOLLER-MAERSK A/S-A	78	49,400.00	3,853,200.00	
DSV A/S	26,280	119.10	3,129,948.00	
CARLSBERG AS-B	13,816	562.00	7,764,592.00	
COLOPLAST-B	2,952	755.00	2,228,760.00	

WILLIAM DEMANT HOLDING	2,860	414.10	1,184,326.00	
NOVO NORDISK A/S-B	54,653	620.50	33,912,186.50	
DANSKE BANK A/S	58,898	144.10	8,487,201.80	
TRYG A/S	3,368	256.70	864,565.60	
デンマーククロネ 小計	195,644		79,558,021.60	
(邦貨換算額)			(1,179,049,880)	(単位 : 円)
オーストラリアドル				
CALTEX AUSTRALIA LIMITED	18,000	14.26	256,680.00	
ORIGIN ENERGY LIMITED	113,581	17.00	1,930,877.00	
PALADIN ENERGY LIMITED	88,000	4.91	432,080.00	
SANTOS LTD	110,511	12.97	1,433,327.67	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	80,856	43.17	3,490,553.52	
WORLEY PARSONS LIMITED	25,600	26.91	688,896.00	
ALUMINA LTD	326,977	2.61	853,409.97	
AMCOR LIMITED	165,527	6.65	1,100,754.55	
BHP BILLITON LTD	437,430	45.03	19,697,472.90	
BLUESCOPE STEEL LTD	234,327	2.29	536,608.83	
BORAL LIMITED	95,596	4.83	461,728.68	
FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	156,000	6.78	1,057,680.00	
INCITEC PIVOT LTD	218,000	3.85	839,300.00	
JAMES HARDIE INDUSTRIES SE	56,003	6.68	374,100.04	
MACARTHUR COAL LIMITED	22,400	12.42	278,208.00	
NEWCREST MINING LIMITED	99,578	40.77	4,059,795.06	
ONESTEEL LIMITED	174,695	2.62	457,700.90	
ORICA LIMITED	46,423	25.39	1,178,679.97	
OZ MINERALS LIMITED	386,524	1.69	655,158.18	
RIO TINTO LIMITED	56,781	85.65	4,863,292.65	
SIMS METAL MANAGEMENT LTD	22,195	22.10	490,509.50	
CSR LIMITED	207,940	1.71	355,577.40	
LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	16,905	32.70	552,793.50	
BRAMBLES LIMITED	183,532	6.97	1,279,218.04	
ASCIANO LTD	404,000	1.60	646,400.00	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	133,138	2.62	348,821.56	
QR NATIONAL LTD	215,000	2.88	619,200.00	
TOLL HOLDINGS LIMITED	91,620	5.93	543,306.60	
BILLABONG INTERNATIONAL LTD	30,611	8.08	247,336.88	
CROWN LTD	54,965	8.22	451,812.30	
TABCORP HOLDINGS LIMITED	83,545	7.17	599,017.65	
TATTS GROUP LTD	172,000	2.53	435,160.00	
FAIRFAX MEDIA LTD	265,729	1.38	368,034.66	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	79,432	3.01	239,090.32	
METCASH LTD	104,000	4.07	423,280.00	
WESFARMERS LIMITED	129,884	31.52	4,093,943.68	
WESFARMERS LIMITED-PPP	20,754	32.06	665,373.24	
WOOLWORTHS LIMITED	160,898	26.84	4,318,502.32	

COCA-COLA AMATIL LIMITED	76,917	10.98	844,548.66	
FOSTER'S GROUP LTD	245,619	5.59	1,373,010.21	
GOODMAN FIELDER LIMITED	167,000	1.36	227,955.00	
COCHLEAR LIMITED	8,003	80.03	640,480.09	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	15,000	16.64	249,600.00	
SONIC HEALTHCARE LTD	49,926	11.91	594,618.66	
CSL LIMITED	71,014	36.82	2,614,735.48	
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	333,392	23.59	7,864,717.28	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	47,400	9.98	473,052.00	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	201,768	50.70	10,229,637.60	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	277,011	24.15	6,689,815.65	
WESTPAC BANKING CORPORATION	389,477	23.19	9,031,971.63	
ASX LTD	23,410	38.55	902,455.50	
MACQUARIE GROUP LTD	43,932	37.48	1,646,571.36	
AMP LIMITED	269,161	5.37	1,445,394.57	
AXA ASIA PACIFIC HOLDINGS LTD	131,340	6.26	822,188.40	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	271,006	3.81	1,032,532.86	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	136,073	18.30	2,490,135.90	
SUNCORP-METWAY LIMITED	168,481	8.78	1,479,263.18	
COMPUTERSHARE LIMITED	55,029	10.88	598,715.52	
TELSTRA CORPORATION LIMITED	566,187	2.77	1,568,337.99	
AGL ENERGY LIMITED	62,769	15.40	966,642.60	
オーストラリアドル 小計	8,898,872		115,110,061.71	
(邦貨換算額)			(9,557,588,423)	(単位：円)
ニュージーランドドル				
FLETCHER BUILDING LTD	81,957	7.73	633,527.61	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	130,557	2.14	279,391.98	
SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP	82,890	3.32	275,194.80	
TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	256,909	2.23	572,907.07	
CONTACT ENERGY LIMITED	35,256	6.24	219,997.44	
ニュージーランドドル 小計	587,569		1,981,018.90	
(邦貨換算額)			(122,506,208)	(単位：円)
香港ドル				
MONGOLIA ENERGY CORPORATION LTD.	450,000	2.37	1,066,500.00	
HUTCHISON WHAMPOA LTD	275,000	77.95	21,436,250.00	
NWS HOLDINGS LTD	107,000	12.50	1,337,500.00	
NWS HOLDINGS LTD NEW	53,500	12.50	668,750.00	
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	165,000	22.20	3,663,000.00	
MTR CORPORATION	183,500	28.45	5,220,575.00	
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	31,000	70.40	2,182,400.00	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	96,000	28.05	2,692,800.00	
SANDS CHINA LTD	312,000	16.30	5,085,600.00	
SHANGRI-LA ASIA LTD.	166,000	21.50	3,569,000.00	
SJM HOLDINGS LIMITED	220,000	12.28	2,701,600.00	

WYNN MACAU LTD	202,000	17.30	3,494,600.00	
ESPRIT HOLDINGS LTD	154,927	38.50	5,964,689.50	
LI & FUNG LTD	293,600	43.80	12,859,680.00	
LIFESTYLE INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED	73,000	19.78	1,443,940.00	
BANK OF EAST ASIA	198,620	32.60	6,475,012.00	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	475,500	26.15	12,434,325.00	
HANG SENG BANK LTD	101,200	130.50	13,206,600.00	
WING HANG BANK LIMITED	22,000	107.80	2,371,600.00	
HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	132,500	176.20	23,346,500.00	
AIA GROUP LTD	1,032,000	22.35	23,065,200.00	
CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	180,000	113.80	20,484,000.00	
HANG LUNG GROUP LTD	107,000	50.90	5,446,300.00	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	310,000	36.30	11,253,000.00	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	140,000	52.50	7,350,000.00	
HOPEWELL HOLDINGS LTD	72,000	24.65	1,774,800.00	
HYSAN DEVELOPMENT CO	91,000	33.40	3,039,400.00	
KERRY PROPERTIES LTD	91,500	41.00	3,751,500.00	
NEW WORLD DEVELOPMENT	324,000	14.64	4,743,360.00	
SINO LAND CO	348,000	14.94	5,199,120.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	184,000	126.20	23,220,800.00	
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	99,500	121.30	12,069,350.00	
WHARF HOLDINGS LTD	180,000	53.75	9,675,000.00	
WHEELOCK&COMPANY LTD	115,000	29.35	3,375,250.00	
FOXCONN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	298,000	5.47	1,630,060.00	
PCCW LIMITED	510,000	3.25	1,657,500.00	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	63,000	35.30	2,223,900.00	
CLP HOLDINGS LTD	248,100	62.90	15,605,490.00	
HONG KONG & CHINA GAS	578,765	18.78	10,869,206.70	
HONGKONG ELECTRIC HOLDINGS	178,500	48.85	8,719,725.00	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	25,500	86.05	2,194,275.00	
香港ドル 小計	8,888,212		308,568,158.20	
(邦貨換算額)			(3,335,621,790)	(単位：円)
シンガポールドル				
COSCO CORP SINGAPORE LTD	95,000	2.11	200,450.00	
FRASER & NEAVE LTD	132,000	6.13	809,160.00	
KEPPEL CORP LTD	170,000	10.80	1,836,000.00	
NOBLE GROUP LTD	411,400	2.07	851,598.00	
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	123,820	4.95	612,909.00	
SEMBCORP MARINE LTD	103,400	5.04	521,136.00	
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG	231,000	3.23	746,130.00	
YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	170,000	1.90	323,000.00	
COMFORTDELGRO CORP LTD	258,000	1.57	405,060.00	
NEPTUNE ORIENT LINES LTD	140,000	2.18	305,200.00	
SINGAPORE AIRLINES LTD	67,266	15.08	1,014,371.28	
GENTING SINGAPORE PLC	771,000	2.11	1,626,810.00	

SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	210,250	3.94	828,385.00	
CYCLE & CARRIAGE LTD	14,000	35.54	497,560.00	
OLAM INTERNATIONAL LTD	141,000	3.06	431,460.00	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	891,600	0.77	686,532.00	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	253,000	6.01	1,520,530.00	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	222,000	14.40	3,196,800.00	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	323,000	9.88	3,191,240.00	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	157,000	17.98	2,822,860.00	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	117,000	8.38	980,460.00	
CAPITALAND LTD	331,000	3.62	1,198,220.00	
CAPITAMALLS ASIA LTD	190,000	1.84	349,600.00	
CITY DEVELOPMENTS LTD	70,000	12.92	904,400.00	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LIMITED	220,000	2.26	497,200.00	
KEPPEL LAND LTD	90,000	4.54	408,600.00	
UOL GROUP LIMITED	62,000	4.51	279,620.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,034,015	3.09	3,195,106.35	
STARHUB LIMITED	80,000	2.50	200,000.00	
シンガポールドル 小計	7,078,751		30,440,397.63	
(邦貨換算額)			(1,937,226,905)	(単位：円)
イスラエルシュケル				
DELEK GROUP LTD	530	909.60	482,088.00	
ISRAEL CHEMICALS LIMITED	59,000	59.60	3,516,400.00	
ISRAEL CORPORATION LTD/THE	310	4,156.00	1,288,360.00	
MAKHTESHIM-AGAN INDUSTRIES LTD	32,000	16.01	512,320.00	
ELBIT SYSTEMS LTD	3,000	190.00	570,000.00	
TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	121,800	186.60	22,727,880.00	
BANK HAPOALIM BM	135,000	18.28	2,467,800.00	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	156,000	18.11	2,825,160.00	
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	70,000	8.09	566,440.00	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	16,000	38.39	614,240.00	
NICE SYSTEMS LTD	8,200	119.50	979,900.00	
BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	234,000	10.20	2,386,800.00	
CELLCOM ISRAEL LTD	6,700	117.00	783,900.00	
PARTNER COMMUNICATIONS COMPANY LTD	11,000	73.22	805,420.00	
イスラエルシュケル 小計	853,540		40,526,708.00	
(邦貨換算額)			(947,919,700)	(単位：円)
合計	157,438,146		231,704,878,175	単位：円
(外貨建有価証券邦貨換算額合計)			(231,704,878,175)	(単位：円)

(注)

- 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券にかかるもので、内書きであります。
- 米ドル表示の株式については、569銘柄、信託財産純資産総額に対する比率53.0%、合計に対する比率54.9%です。
カナダドル表示の株式については、93銘柄、信託財産純資産総額に対する比率5.6%、合計に対する比率5.7%です。
ユーロ表示の株式については、263銘柄、信託財産純資産総額に対する比率14.4%、

合計に対する比率14.9%です。

英ポンド表示の株式については、103銘柄、信託財産純資産総額に対する比率10.5%、

合計に対する比率10.9%です。

スイスフラン表示の株式については、37銘柄、信託財産純資産総額に対する比率4.0%、

合計に対する比率4.1%です。

スウェーデンクローナ表示の株式については、34銘柄、信託財産純資産総額に対する比率1.6%、

合計に対する比率1.7%です。

ノルウェークローネ表示の株式については、9銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.4%、

合計に対する比率0.4%です。

デンマーククローネ表示の株式については、11銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.5%、

合計に対する比率0.5%です。

オーストラリアドル表示の株式については、60銘柄、信託財産純資産総額に対する比率4.0%、

合計に対する比率4.1%です。

ニュージーランドドル表示の株式については、5銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.1%、

合計に対する比率0.1%です。

香港ドル表示の株式については、41銘柄、信託財産純資産総額に対する比率1.4%、

合計に対する比率1.4%です。

シンガポールドル表示の株式については、29銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.8%、

合計に対する比率0.8%です。

イスラエルシェケル表示の株式については、14銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.4%、

合計に対する比率0.4%です。

(b) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	口数	評価額	備考
投資証券	米ドル			
	AMB PROPERTY CORP	22,450	688,092.50	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	80,400	1,453,632.00	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,857	1,182,870.15	
	BOSTON PROPERTIES INC	18,079	1,502,726.48	
	DUKE REALTY CORP	31,773	351,091.65	
	EQUITY RESIDENTIAL	37,486	1,867,927.38	
	FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	7,804	590,372.60	
	GENERAL GROWTH PROPERTIES	54,000	842,400.00	
	HCP,INC.	41,657	1,447,164.18	
	HEALTH CARE REIT INC	17,800	802,958.00	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	85,351	1,472,304.75	
	KIMCO REALTY CORPORATION	53,332	901,844.12	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	15,247	467,168.08	
	MACERICH COMPANY/THE	16,900	762,190.00	
	PLUM CREEK TIMBER COMPANY	20,607	733,403.13	
	PROLOGIS	71,652	1,000,978.44	
	PUBLIC STORAGE	18,593	1,825,832.60	
	RAYONIER INC	10,900	548,379.00	
	REGENCY CENTERS CORP	11,100	452,103.00	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	38,242	3,649,434.06	
	VENTAS INC	20,279	1,006,649.56	
	VORNADO REALTY TRUST	21,571	1,723,522.90	
	米ドル 小計	706,080	25,273,044.58	
	(邦貨換算額)		(2,124,957,588)	(単位 : 円)

	カナダドル			
	ARC ENERGY TRUST UNITS	18,000	416,520.00	
	BAYTEX ENERGY TRUST-UNITS	14,800	676,360.00	
	BONAVISTA ENERGY TRUST	8,300	235,388.00	
	CANADIAN OIL SANDS TRUST	30,559	770,392.39	
	ENERPLUS RESOURCES FUND	24,190	721,587.70	
	PENGROWTH ENERGY TRUST	44,000	566,280.00	
	PENN WEST ENERGY TRUST	60,767	1,426,809.16	
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	14,700	314,874.00	
	カナダドル 小計	215,316	5,128,211.25	
	(邦貨換算額)		(425,744,097)	(単位 : 円)
	ユーロ			
	CORIO NV	7,898	372,232.74	
	FONCIERE DES REGIONS	3,200	220,384.00	
	GECINA SA	2,430	197,000.10	
	ICADE	3,390	259,199.40	
	KLEPIERRE	12,532	336,734.84	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	12,091	1,762,263.25	
	ユーロ 小計	41,541	3,147,814.33	
	(邦貨換算額)		(347,550,180)	(単位 : 円)
	英ポンド			
	BRITISH LAND CO PLC	118,305	610,453.80	
	CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP PLC	65,855	275,010.48	
	HAMMERSON PLC	95,497	400,705.41	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	96,227	632,211.39	
	SEGRO PLC	98,434	289,888.13	
	英ポンド 小計	474,318	2,208,269.21	
	(邦貨換算額)		(287,604,981)	(単位 : 円)
	オーストラリアドル			
	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	265,612	476,773.54	
	DEXUS PROPERTY GROUP	599,804	479,843.20	
	GOODMAN GROUP	850,000	535,500.00	
	GPT GROUP	223,494	650,367.54	
	LEND LEASE GROUP	73,172	627,084.04	
	MAP GROUP	51,000	149,940.00	
	MIRVAC GROUP	436,710	532,786.20	
	SP AUSNET	90,000	81,450.00	
	STOCKLAND	303,614	1,089,974.26	
	TRANSURBAN GROUP	166,123	877,129.44	
	WESTFIELD GROUP	294,993	2,831,932.80	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	80,000	215,200.00	
	WESTFIELD RETAIL TRUST-N	294,993	793,531.17	

	オーストラリアドル 小計	3,729,515	9,341,512.19	
	(邦貨換算額)		(775,625,757)	(単位：円)
	香港ドル			
	LINK REIT	293,500	7,088,025.00	
	香港ドル 小計	293,500	7,088,025.00	
	(邦貨換算額)		(76,621,550)	(単位：円)
	シンガポールドル			
	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	218,000	438,180.00	
	CAPITAMALL TRUST	280,000	526,400.00	
	シンガポールドル 小計	498,000	964,580.00	
	(邦貨換算額)		(61,385,871)	(単位：円)
	合計		4,099,490,024	単位：円
	(外貨建有価証券邦貨換算額合計)		(4,099,490,024)	(単位：円)

(注)

- 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券にかかるもので、内書きであります。
- 米ドル表示の投資証券については、22銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.9%、合計に対する比率51.8%です。
カナダドル表示の投資証券については、8銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.2%、合計に対する比率10.4%です。
ユーロ表示の投資証券については、6銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.1%、合計に対する比率8.5%です。
英債券表示の投資証券については、5銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.1%、合計に対する比率7.0%です。
オーストラリアドル表示の投資証券については、13銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.3%、合計に対する比率18.9%です。
香港ドル表示の投資証券については、1銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.0%、合計に対する比率1.9%です。
シンガポールドル表示の投資証券については、2銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.0%、合計に対する比率1.5%です。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「(デリバティブ取引に関する注記) . 取引の時価等に関する事項」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<適格機関投資家限定>」の状況

(1) 貸借対照表

対象年月日	(平成21年12月21日現在)	(平成22年12月20日現在)
科目	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1	12
親投資信託受益証券	6,380,007,258	5,982,307,328
流動資産合計	6,380,007,259	5,982,307,340
資産合計	6,380,007,259	5,982,307,340
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	29,029	20,672
未払委託者報酬	14,513	10,335
流動負債合計	43,542	31,007
負債合計	43,542	31,007
純資産の部		
元本等		
1 元本		
元本	5,273,826,463	5,449,580,077
2 剰余金		
剰余金又は欠損金()	1,106,137,254	532,696,256
元本等合計	6,379,963,717	5,982,276,333
純資産合計	6,379,963,717	5,982,276,333
負債・純資産合計	6,380,007,259	5,982,307,340

(注)「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、毎年12月17日(ただし、休業日の場合は翌営業日)に決算を行います。上記の貸借対照表は平成21年12月21日および平成22年12月20日現在における同ファンドの状況です。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自平成21年12月18日 至平成21年12月21日	自平成22年12月18日 至平成22年12月20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（売買目的有価証券） 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	親投資信託受益証券（売買目的有価証券） 同左

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成21年12月21日現在)	(平成22年12月20日現在)
1. 受益権総数	平成21年12月21日現在における受益権の総数 5,273,826,463口	平成22年12月20日現在における受益権の総数 5,449,580,077口
2. 1単位当たり純資産額	1.2097円 (1万口 = 12,097円)	1.0977円 (1万口 = 10,977円)

(金融商品に関する注記)

(追加情報)

当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）および「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

・金融商品の状況に関する事項

項目	自平成22年12月18日 至平成22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、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。当ファンドにおける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・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、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。リスクを管理する部署では、各種リスクごとに定められた頻度で、測定項目が上下限值（リミットあるいは注意レベル）内に収まっているかどうかのモニタリングを行っております。上下限値を越えていることが発見された場合は、原則として速やかに修正を行うよう、リスク管理を行う部署から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ます。また、是正勧告あるいは報告を受けた関連運用グループでは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、リスク管理を行う部署は、上下限値に抵触した事実ならびにその後の対処結果あるいは関連運用グループの対処方針の決定に関し、必要に応じて、リスク管理を行う部署の担当役員、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する体制となっております。</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	自 平成22年12月18日 至 平成22年12月20日
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） 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」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）

．取引の状況に関する事項

項目	自平成21年12月18日 至平成21年12月21日
1．取引の内容	<p>当ファンドの行うことのできるデリバティブ取引は、次の通りです。</p> <p>a．わが国の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。</p> <p>b．わが国の取引所における通貨にかかる先物取引および通貨にかかるオプション取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引。</p> <p>c．わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。</p> <p>異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（「スワップ取引」）。</p> <p>金利先渡取引および為替先渡取引。</p> <p>外国為替の売買の予約取引。</p>
2．取引に対する取組方針	デリバティブ取引につきましては信託約款等に従っており、その制限を遵守しております。
3．取引の利用目的	信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため。
4．取引に係るリスクの内容	デリバティブ取引に伴いファンドに影響を与える主なリスクとしてマーケットリスクがあげられます。マーケットリスクについては、ポジションや時価、予想損失額の把握が重要だと考えております。
5．取引に係るリスクの管理体制	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・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理ならびに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。
6．取引の時価等に関する事項についての補足説明	該当事項はありません。

．取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

（平成21年12月21日現在）

平成21年12月21日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（平成22年12月20日現在）

平成22年12月20日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（関連当事者との取引に関する注記）

（自 平成21年12月18日 至 平成21年12月21日）

該当事項はありません。

（自 平成22年12月18日 至 平成22年12月20日）

該当事項はありません。

（その他の注記）

（平成21年12月21日現在）	
期首	平成21年12月18日
期首元本額	5,273,616,163円
期首より平成21年12月21日現在までの追加設定元本額	210,300円
期首より平成21年12月21日現在までの一部解約元本額	- 円

（平成22年12月20日現在）	
期首	平成22年12月18日
期首元本額	5,449,580,077円
期首より平成22年12月20日現在までの追加設定元本額	- 円
期首より平成22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

種類	銘柄名	元本額	評価額	
			単価	金額
親投資信託 受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	5,425,636,975円	1.1026円	5,982,307,328円

（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

対象年月日	（平成21年12月21日現在）	（平成22年12月20日現在）
科目	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	1,402,237,136	546,267,383
コール・ローン	676,055,991	1,587,684,297
国債証券	249,969,355,277	246,685,097,822
派生商品評価勘定	-	1,189,038
未収入金	-	2,135,730,000
未収利息	3,271,134,086	2,990,787,054
前払費用	304,871,821	143,784,393
流動資産合計	255,623,654,311	254,090,539,987
資産合計	255,623,654,311	254,090,539,987
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	13,228,373
未払金	-	2,636,047,241
未払解約金	545,208	1,992,045
流動負債合計	545,208	2,651,267,659
負債合計	545,208	2,651,267,659
純資産の部		
元本等		
1 元本		
元本	210,512,386,107	228,049,629,058
2 剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	45,110,722,996	23,389,643,270
元本等合計	255,623,109,103	251,439,272,328
純資産合計	255,623,109,103	251,439,272,328
負債・純資産合計	255,623,654,311	254,090,539,987

（注）「外国債券パッシブ・マザーファンド」は、毎年12月17日（ただし、休業日の場合は翌営業日）に決算を行います。上記の貸借対照表は平成21年12月21日および平成22年12月20日現在における同マザーファンドの状況です。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自平成21年12月18日 至平成21年12月21日	自平成22年12月18日 至平成22年12月20日
1. 有価証券の評価基準及び 評価方法	国債証券（売買目的有価証券） 個別法に基づき、時価で評価して おります。時価評価にあたっては、 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。	国債証券（売買目的有価証券） 同左
2. デリバティブの評価基準 及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時 価で評価しております。時価評価 にあたっては、原則として、わが 国における計算期間末日の対顧 客先物相場の仲値によっており ます。	為替予約取引 同左
3. その他財務諸表作成のため の基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する 規則」第60条および第61条に 基づいて処理しております。	外貨建資産等の会計処理 同左

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成21年12月21日現在)	(平成22年12月20日現在)
1. 受益権総数	平成21年12月21日現在における 受益権の総数 210,512,386,107口	平成22年12月20日現在における 受益権の総数 228,049,629,058口
2. 1単位当たり純資産額	1.2143円 (1万口 = 12,143円)	1.1026円 (1万口 = 11,026円)

(金融商品に関する注記)

(追加情報)

当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）および「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

. 金融商品の状況に関する事項

項目	自平成22年12月18日 至平成22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。

	<p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいておりません。当ファンドにおける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>当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、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。リスクを管理する部署では、各種リスクごとに定められた頻度で、測定項目が上下限值（リミットあるいは注意レベル）内に収まっているかどうかのモニタリングを行っております。上下限値を越えていることが発見された場合は、原則として速やかに修正を行うよう、リスク管理を行う部署から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ます。また、是正勧告あるいは報告を受けた関連運用グループでは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、リスク管理を行う部署は、上下限値に抵触した事実ならびにその後の対処結果あるいは関連運用グループの対処方針の決定に関し、必要に応じて、リスク管理を行う部署の担当役員、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する体制となっております。</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	自平成22年12月18日 至平成22年12月20日
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（国債証券） 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」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）

．取引の状況に関する事項

項目	自 平成21年12月18日 至 平成21年12月21日
1．取引の内容	<p>当ファンドの行うことのできるデリバティブ取引は、次の通りです。</p> <p>a．わが国の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。</p> <p>b．わが国の取引所における通貨にかかる先物取引および通貨にかかるオプション取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引。</p> <p>c．わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。</p> <p>異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（「スワップ取引」）。</p> <p>金利先渡取引および為替先渡取引。</p> <p>外国為替の売買の予約取引。</p>
2．取引に対する取組方針	<p>デリバティブ取引につきましては信託約款等に従っており、その制限を遵守しております。</p>
3．取引の利用目的	<p>信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため。</p>
4．取引に係るリスクの内容	<p>デリバティブ取引に伴いファンドに影響を与える主なリスクとしてマーケットリスクがあげられます。マーケットリスクについては、ポジションや時価、予想損失額の把握が重要だと考えております。</p>
5．取引に係るリスクの管理体制	<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・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理ならびに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>
6．取引の時価等に関する事項についての補足説明	<p>該当事項はありません。</p>

・取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

（平成21年12月21日現在）

平成21年12月21日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（平成22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	うち1年超	時価	評価損益
市場外取引	為替予約取引 買建				
	米ドル	993,462,322	-	994,651,360	1,189,038
	カナダドル	166,716,209	-	165,582,207	1,134,002
	ユーロ	1,225,678,980	-	1,215,773,290	9,905,690
	英ポンド	277,981,467	-	275,792,786	2,188,681
	買建 合計	2,663,838,978	-	2,651,799,643	12,039,335

（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

- 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。
- 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21年12月18日 至 平成21年12月21日）

該当事項はありません。

（自 平成22年12月18日 至 平成22年12月20日）

該当事項はありません。

(その他の注記)

(平成21年12月21日現在)	
期首	平成21年12月18日
期首元本額	210,429,966,868円
期首より平成21年12月21日現在までの追加設定元本額	85,497,691円
期首より平成21年12月21日現在までの一部解約元本額	3,078,452円
平成21年12月21日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	1,226,574,451円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	114,658,540円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	360,248,016円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	158,296,200円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	5,769,135円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	2,144,406円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	166,045円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	1,872,075円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	217,608円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	137,229円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	319,085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>	5,254,061,812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>	11,648,080,707円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	39,613,532,966円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	13,156,779,462円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	27,538,608,256円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	83,750,647円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	179,571,901円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	52,430,229円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	1,460,369,135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>	173,976,968円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,824,978,225円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,955,477,293円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	7,146,321,367円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	18,561,543,744円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,281,699,269円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	6,671,532,768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)	1,508,928,289円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	10,231,504,808円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	448,270,586円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	11,857,402,694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)	44,140,833,782円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	297,019,628円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	89,446,385円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	24,483,112円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	438,898,912円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	1,508,358,189円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	399,449,669円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	12,416,355円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	1,331,861円

SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	122,550円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	80,801,748円
合計	210,512,386,107円

(平成22年12月20日現在)

期首	平成22年12月18日
期首元本額	226,101,470,623円
期首より平成22年12月20日現在までの追加設定元本額	1,953,219,607円
期首より平成22年12月20日現在までの一部解約元本額	5,061,172円
平成22年12月20日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	2,056,156,241円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	169,663,853円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	530,562,135円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	246,043,836円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	13,362,434円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	3,916,977円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	569,120円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	2,678,285円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	523,589円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	484,438円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	715,787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>	5,425,636,975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>	12,526,169,077円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	40,453,671,792円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	13,287,695,758円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	27,721,129,903円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	91,524,028円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	193,593,879円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	53,062,846円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	1,506,240,891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>	192,098,908円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	2,558,763,329円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	3,665,207,979円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	7,453,104,486円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	18,051,360,729円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,353,591,991円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	13,318,916,485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)	2,280,885,323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)	10,740,031,910円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	464,916,609円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	11,859,320,187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)	46,049,330,828円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	313,637,724円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	95,671,896円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	26,239,054円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	448,238,106円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	1,602,265,874円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	421,550,044円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	270,103,707円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	65,186,953円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	8,392,672円

SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	2,435,232,800円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	92,179,620円
合計	228,049,629,058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	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル			
	US T 0.375% 12/08/31	5,000,000.00	4,985,937.50	
	US T 0.375% 12/09/30	5,000,000.00	4,982,421.90	
	US T 0.375% 12/10/31	5,000,000.00	4,979,296.90	
	US T 0.5% 12/11/30	4,000,000.00	3,991,562.52	
	US T 0.5% 13/10/15	5,000,000.00	4,943,750.00	
	US T 0.5% 13/11/15	7,000,000.00	6,908,671.91	
	US T 0.625% 12/07/31	10,000,000.00	10,017,968.80	
	US T 0.625% 2012/06/30	10,000,000.00	10,021,093.80	
	US T 0.75% 11/11/30	12,000,000.00	12,045,000.00	
	US T 0.75% 13/08/15	8,000,000.00	7,983,125.04	
	US T 0.75% 13/09/15	6,000,000.00	5,980,781.28	
	US T 0.75% 2012/05/31	10,000,000.00	10,042,187.50	
	US T 0.875% 12/01/31	12,000,000.00	12,067,500.00	
	US T 0.875% 12/02/29	8,000,000.00	8,046,250.00	
	US T 1% 12/03/31	11,000,000.00	11,085,078.18	
	US T 1% 12/04/30	10,000,000.00	10,077,343.80	
	US T 1% 13/07/15	8,000,000.00	8,038,750.00	
	US T 1.00% 2011/12/31	10,000,000.00	10,065,625.00	
	US T 1.125% 11/12/15	7,000,000.00	7,053,593.75	
	US T 1.125% 12/01/15	7,000,000.00	7,056,328.16	
	US T 1.125% 12/12/15	9,000,000.00	9,085,078.17	
	US T 1.125% 2013/06/15	6,000,000.00	6,049,218.78	
	US T 1.25% 15/08/31	5,000,000.00	4,865,234.40	
	US T 1.25% 15/09/30	4,000,000.00	3,884,062.52	
	US T 1.25% 15/10/31	5,000,000.00	4,842,578.15	
	US T 1.375% 12/03/15	7,000,000.00	7,087,500.00	
	US T 1.375% 12/04/15	8,000,000.00	8,102,500.00	
	US T 1.375% 12/05/15	8,500,000.00	8,611,562.50	
	US T 1.375% 12/09/15	7,000,000.00	7,096,796.91	
	US T 1.375% 12/10/15	8,000,000.00	8,111,875.04	
	US T 1.375% 12/11/15	10,000,000.00	10,142,187.50	
	US T 1.375% 12/2/15	8,000,000.00	8,093,750.00	
	US T 1.375% 13/02/15	10,000,000.00	10,143,750.00	
	US T 1.375% 13/03/15	8,000,000.00	8,120,625.04	
	US T 1.375% 13/05/15	8,000,000.00	8,115,625.04	
	US T 1.375% 2013/01/15	10,000,000.00	10,142,968.80	
	US T 1.5% 12/07/15	9,000,000.00	9,144,843.75	
	US T 1.5% 13/12/31	7,000,000.00	7,100,078.16	

	US T 1.75% 12/08/15	10,000,000.00	10,199,218.80	
	US T 1.75% 13/04/15	10,000,000.00	10,234,375.00	
	US T 1.75% 14/01/31	6,500,000.00	6,636,093.75	
	US T 1.75% 14/03/31	8,000,000.00	8,153,750.00	
	US T 1.75% 15/7/31	5,000,000.00	4,987,500.00	
	US T 1.875% 12/06/15	8,000,000.00	8,165,625.04	
	US T 1.875% 14/02/28	6,000,000.00	6,142,968.78	
	US T 1.875% 14/04/30	8,000,000.00	8,192,500.00	
	US T 1.875% 17/08/31	3,000,000.00	2,867,343.75	
	US T 1.875% 17/09/30	6,000,000.00	5,719,687.50	
	US T 1.875% 17/10/31	6,000,000.00	5,706,562.50	
	US T 1.875% 2015/06/30	7,000,000.00	7,032,812.50	
	US T 11.25% 15/02/15	2,000,000.00	2,777,187.50	
	US T 2% 13/11/30	7,000,000.00	7,206,171.91	
	US T 2.125% 14/11/30	10,500,000.00	10,761,679.74	
	US T 2.125% 2015/05/31	8,000,000.00	8,130,625.04	
	US T 2.25% 14/05/31	9,000,000.00	9,320,625.00	
	US T 2.25% 15/01/31	8,000,000.00	8,220,625.04	
	US T 2.375% 14/08/31	8,000,000.00	8,294,375.04	
	US T 2.375% 14/09/30	10,000,000.00	10,360,156.30	
	US T 2.375% 14/10/31	8,000,000.00	8,280,625.04	
	US T 2.375% 15/02/28	11,000,000.00	11,344,609.43	
	US T 2.375% 16/03/31	5,500,000.00	5,573,046.87	
	US T 2.375% 17/7/31	5,000,000.00	4,936,718.75	
	US T 2.5% 13/03/31	4,500,000.00	4,687,382.83	
	US T 2.5% 15/03/31	9,000,000.00	9,323,437.50	
	US T 2.5% 15/04/30	10,000,000.00	10,346,875.00	
	US T 2.50% 2017/06/30	5,000,000.00	4,988,281.25	
	US T 2.625% 14/06/30	9,000,000.00	9,431,015.67	
	US T 2.625% 14/07/31	10,000,000.00	10,473,437.50	
	US T 2.625% 16/02/29	5,000,000.00	5,136,718.75	
	US T 2.625% 16/04/30	5,000,000.00	5,120,312.50	
	US T 2.625% 20/11/15	3,000,000.00	2,821,406.25	
	US T 2.625% 20/8/15	15,000,000.00	14,175,000.00	
	US T 2.625% 2014/12/31	8,000,000.00	8,350,000.00	
	US T 2.75% 13/02/28	3,700,000.00	3,868,812.50	
	US T 2.75% 13/10/31	5,500,000.00	5,781,875.00	
	US T 2.75% 16/11/30	7,000,000.00	7,149,843.75	
	US T 2.75% 19/02/15	15,000,000.00	14,751,562.50	
	US T 2.75% 2017/05/31	7,000,000.00	7,101,718.75	
	US T 2.875% 13/01/31	4,000,000.00	4,190,000.00	
	US T 3% 16/08/31	7,000,000.00	7,269,062.50	
	US T 3% 16/09/30	7,000,000.00	7,261,406.25	
	US T 3% 17/02/28	7,000,000.00	7,227,500.00	
	US T 3.125% 13/04/30	4,500,000.00	4,755,234.37	
	US T 3.125% 13/08/31	5,500,000.00	5,840,312.50	

	US T 3.125% 13/09/30	6,500,000.00	6,903,710.97	
	US T 3.125% 16/10/31	6,000,000.00	6,258,750.00	
	US T 3.125% 17/01/31	7,000,000.00	7,277,812.50	
	US T 3.125% 17/04/30	7,000,000.00	7,262,500.00	
	US T 3.125% 19/05/15	16,000,000.00	16,122,500.00	
	US T 3.25% 16/05/31	4,000,000.00	4,221,250.00	
	US T 3.25% 16/06/30	6,000,000.00	6,329,062.50	
	US T 3.25% 16/07/31	5,000,000.00	5,265,625.00	
	US T 3.25% 17/03/31	8,000,000.00	8,371,250.00	
	US T 3.25% 2016/12/31	8,000,000.00	8,390,000.00	
	US T 3.375% 12/11/30	3,000,000.00	3,162,890.64	
	US T 3.375% 13/06/30	5,000,000.00	5,328,515.65	
	US T 3.375% 13/07/31	5,500,000.00	5,872,539.09	
	US T 3.375% 19/11/15	15,000,000.00	15,271,875.00	
	US T 3.5% 13/05/31	5,000,000.00	5,334,375.00	
	US T 3.5% 18/02/15	8,500,000.00	8,932,968.75	
	US T 3.5% 20/05/15	15,000,000.00	15,311,718.75	
	US T 3.5% 39/02/15	6,000,000.00	5,113,593.78	
	US T 3.625 12/12/31	3,500,000.00	3,711,914.08	
	US T 3.625% 13/05/15	3,650,000.00	3,903,789.06	
	US T 3.625% 19/08/15	16,000,000.00	16,672,500.00	
	US T 3.625% 20/02/15	15,000,000.00	15,513,281.25	
	US T 3.75% 18/11/15	13,000,000.00	13,788,125.00	
	US T 3.875% 12/10/31	3,000,000.00	3,185,390.64	
	US T 3.875% 13/02/15	3,800,000.00	4,065,406.25	
	US T 3.875% 18/05/15	6,000,000.00	6,446,250.00	
	US T 3.875% 40/8/15	9,000,000.00	8,202,656.25	
	US T 4% 12/11/15	5,000,000.00	5,327,343.75	
	US T 4% 14/02/15	6,500,000.00	7,085,000.00	
	US T 4% 18/08/15	8,000,000.00	8,651,250.00	
	US T 4% 2015/02/15	7,700,000.00	8,449,546.87	
	US T 4.125 15/05/15	7,200,000.00	7,942,500.00	
	US T 4.125% 12/08/31	2,500,000.00	2,651,757.82	
	US T 4.25% 12/09/30	3,000,000.00	3,197,343.75	
	US T 4.25% 13/08/15	7,000,000.00	7,628,906.25	
	US T 4.25% 13/11/15	6,900,000.00	7,560,890.62	
	US T 4.25% 14/08/15	5,400,000.00	5,969,531.25	
	US T 4.25% 14/11/15	6,100,000.00	6,753,843.75	
	US T 4.25% 15/08/15	7,600,000.00	8,427,687.50	
	US T 4.25% 17/11/15	5,000,000.00	5,516,015.65	
	US T 4.25% 39/05/15	9,000,000.00	8,782,031.25	
	US T 4.25% 40/11/15	2,000,000.00	1,947,187.50	
	US T 4.375% 12/08/15	3,700,000.00	3,935,875.00	
	US T 4.375% 38/02/15	4,200,000.00	4,201,312.50	
	US T 4.375% 39/11/15	9,000,000.00	8,957,812.50	
	US T 4.375% 40/05/15	11,000,000.00	10,938,125.00	

	US T 4.5 15/11/15	5,800,000.00	6,504,156.25
	US T 4.5% 11/11/30	3,800,000.00	3,950,515.64
	US T 4.5% 12/03/31	3,500,000.00	3,684,023.45
	US T 4.5% 12/04/30	3,000,000.00	3,168,750.00
	US T 4.5% 160215	5,400,000.00	6,059,812.50
	US T 4.5% 17/05/15	5,000,000.00	5,599,218.75
	US T 4.5% 36/02/15	5,500,000.00	5,638,359.37
	US T 4.5% 38/05/15	4,500,000.00	4,594,218.75
	US T 4.5% 39/08/15	9,000,000.00	9,150,468.75
	US T 4.625% 11/12/31	3,500,000.00	3,653,125.00
	US T 4.625% 12/02/29	2,500,000.00	2,626,171.87
	US T 4.625% 12/07/31	3,000,000.00	3,200,625.00
	US T 4.625% 16/11/15	5,200,000.00	5,868,687.50
	US T 4.625% 17/02/15	5,000,000.00	5,635,937.50
	US T 4.625% 40/02/15	10,000,000.00	10,368,750.00
	US T 4.75% 12/01/31	3,000,000.00	3,145,546.89
	US T 4.75% 12/05/31	3,500,000.00	3,719,023.45
	US T 4.75% 14/05/15	6,400,000.00	7,156,000.00
	US T 4.75% 17/08/15	5,000,000.00	5,677,343.75
	US T 4.75% 37/02/15	4,000,000.00	4,258,750.00
	US T 4.875% 12/02/15	5,820,000.00	6,121,912.50
	US T 4.875% 12/06/30	3,500,000.00	3,735,156.25
	US T 4.875% 16/08/15	4,900,000.00	5,590,593.75
	US T 5% 37/05/15	4,000,000.00	4,419,375.00
	US T 5.125% 16/05/15	5,700,000.00	6,577,265.62
	US T 5.25% 28/11/15	3,000,000.00	3,417,656.25
	US T 5.25% 29/02/15	2,000,000.00	2,278,750.00
	US T 5.375% 31/02/15	4,020,000.00	4,658,175.00
	US T 5.5% 28/08/15	2,000,000.00	2,343,125.00
	US T 6% 26/02/15	3,000,000.00	3,689,531.25
	US T 6.125% 27/11/15	4,000,000.00	4,998,750.00
	US T 6.125% 29/08/15	2,420,000.00	3,041,637.50
	US T 6.25% 23/08/15	4,500,000.00	5,625,703.12
	US T 6.25% 30/05/15	3,000,000.00	3,830,625.00
	US T 6.375% 27/08/15	2,000,000.00	2,561,875.00
	US T 6.5% 26/11/15	2,000,000.00	2,585,625.00
	US T 6.625% 27/02/15	2,000,000.00	2,618,437.50
	US T 6.75% 26/08/15	1,000,000.00	1,321,875.00
	US T 6.875% 25/08/15	2,000,000.00	2,661,562.50
	US T 7.125% 23/02/15	3,400,000.00	4,545,906.25
	US T 7.25% 16/05/15	4,000,000.00	5,053,125.00
	US T 7.25% 22/08/15	2,500,000.00	3,367,578.12
	US T 7.5% 16/11/15	3,400,000.00	4,379,093.75
	US T 7.5% 24/11/15	2,000,000.00	2,789,062.50
	US T 7.625% 25/02/15	2,000,000.00	2,822,187.50
	US T 7.875% 21/02/15	2,000,000.00	2,783,125.00

	US T 8% 21/11/15	2,800,000.00	3,949,750.00	
	US T 8.125% 19/08/15	3,300,000.00	4,590,093.75	
	US T 8.125% 21/05/15	2,000,000.00	2,830,937.50	
	US T 8.125% 21/08/15	2,000,000.00	2,841,562.50	
	US T 8.75% 17/05/15	3,000,000.00	4,123,593.75	
	US T 8.75% 20/08/15	3,000,000.00	4,377,187.50	
	US T 8.875% 17/08/15	2,000,000.00	2,782,187.50	
	US T 8.875% 190215	2,100,000.00	3,017,109.37	
	US T-BOND 8.5% 20/02/15	2,000,000.00	2,859,062.50	
	米ドル 小計	1,154,910,000.00	1,211,401,468.72	
	(邦貨換算額)		(101,854,635,489)	(単位：円)
	カナダドル			
	CAN 1% 11/09/01	3,500,000.00	3,494,225.00	
	CAN 1.5% 12/06/01	1,000,000.00	1,000,130.00	
	CAN 1.5% 12/12/01	3,000,000.00	2,992,800.00	
	CAN 1.5% 2012/03/01	1,000,000.00	1,000,990.00	
	CAN 1.75% 2013/03/01	2,000,000.00	2,002,100.00	
	CAN 2% 12/09/01	3,000,000.00	3,021,660.00	
	CAN 2% 14/12/01	4,000,000.00	3,978,560.00	
	CAN 2.5% 13/09/01	1,000,000.00	1,017,370.00	
	CAN 2.5% 2015/06/01	1,000,000.00	1,010,230.00	
	CAN 3% 14/06/01	4,500,000.00	4,645,980.00	
	CAN 3% 15/12/01	2,000,000.00	2,058,000.00	
	CAN 3.5% 13/06/01	4,500,000.00	4,685,940.00	
	CAN 3.5% 20/06/01	3,000,000.00	3,078,000.00	
	CAN 3.75% 11/09/01	2,000,000.00	2,034,600.00	
	CAN 3.75% 12/06/01	2,000,000.00	2,064,640.00	
	CAN 3.75% 19/06/01	5,000,000.00	5,237,500.00	
	CAN 4% 16/06/01	3,000,000.00	3,228,660.00	
	CAN 4% 17/06/01	3,000,000.00	3,230,910.00	
	CAN 4% 41/06/01	3,000,000.00	3,223,500.00	
	CAN 4.25% 18/06/01	2,500,000.00	2,721,250.00	
	CAN 4.5% 15/06/01	3,000,000.00	3,284,940.00	
	CAN 5% 14/06/01	2,500,000.00	2,748,300.00	
	CAN 5% 37/06/01	4,000,000.00	4,905,960.00	
	CAN 5.25% 12/06/01	2,620,000.00	2,760,956.00	
	CAN 5.25% 13/06/01	2,000,000.00	2,166,520.00	
	CAN 5.75% 29/06/01	2,800,000.00	3,617,096.00	
	CAN 5.75% 33/06/01	3,000,000.00	3,965,370.00	
	CAN 8% 23/06/01	980,000.00	1,437,385.60	
	CAN 8% 27/06/01	2,000,000.00	3,110,460.00	
	CAN 9% 25/06/01	1,480,000.00	2,409,691.60	
	CANADA-GOV'T 1.25 111201	1,000,000.00	999,240.00	
	カナダドル 小計	79,380,000.00	87,132,964.20	
	(邦貨換算額)		(7,233,778,687)	(単位：円)

	メキシコペソ			
	MEX BONOS 8% 200611	50,000,000.00	53,221,250.00	
	MEX BONOS 8.5% 290531	50,000,000.00	52,879,350.00	
	MEX BONOS 8.5% 381118	30,000,000.00	31,303,410.00	
	MEX BONOS 9% 121220	100,000,000.00	107,322,200.00	
	MEX BONOS 9.5% 141218	80,000,000.00	89,665,040.00	
	メキシコペソ 小計	310,000,000.00	334,391,250.00	
	(邦貨換算額)		(2,260,484,850)	(単位 : 円)
	ユーロ			
	BGB 2% 12/3/28	1,500,000.00	1,500,000.00	
	BGB 2.75% 16/03/28	1,000,000.00	970,400.00	
	BGB 3.25% 16/09/28	3,500,000.00	3,454,150.00	
	BGB 3.5% 15/03/28	1,500,000.00	1,524,600.00	
	BGB 3.75% 15/09/28	3,300,000.00	3,374,910.00	
	BGB 3.75% 20/09/28	4,000,000.00	3,920,400.00	
	BGB 4% 13/03/28	2,800,000.00	2,903,320.00	
	BGB 4% 14/03/28	3,200,000.00	3,328,000.00	
	BGB 4% 17/03/28	2,500,000.00	2,559,000.00	
	BGB 4% 18/03/28	2,500,000.00	2,546,250.00	
	BGB 4% 19/03/28	3,000,000.00	3,030,600.00	
	BGB 4% 2022/03/28	3,000,000.00	2,968,200.00	
	BGB 4.25% 13/09/28	3,000,000.00	3,140,400.00	
	BGB 4.25% 14/09/28	3,500,000.00	3,670,800.00	
	BGB 4.25% 2041/03/28	1,000,000.00	960,000.00	
	BGB 5% 12/09/28	3,700,000.00	3,884,630.00	
	BGB 5% 35/03/28	4,000,000.00	4,330,800.00	
	BGB 5.5% 17/09/28	1,740,000.00	1,932,444.00	
	BGB 5.5% 28/03/28	3,000,000.00	3,403,500.00	
	BGB 8% 12/12/24	1,600,000.00	1,779,200.00	
	BGB 8% 15/03/28	2,000,000.00	2,387,400.00	
	BTNS 0.75% 12/09/20	1,700,000.00	1,688,780.00	
	BTNS 2% 15/07/12	4,000,000.00	3,946,600.00	
	BTNS 2.5% 14/01/12	6,500,000.00	6,668,025.00	
	BTNS 2.5% 15/01/15	5,500,000.00	5,582,225.00	
	BTNS 3% 14/07/12	4,500,000.00	4,678,650.00	
	BTNS 3.75% 12/01/12	5,000,000.00	5,152,500.00	
	BTNS 3.75% 13/01/12	5,000,000.00	5,249,750.00	
	BTNS 4.5% 12/07/12	5,900,000.00	6,196,770.00	
	BTNS 4.5% 13/07/12	3,500,000.00	3,767,400.00	
	BTPS 2% 12/12/15	5,000,000.00	4,946,500.00	
	BTPS 2% 13/06/01	4,000,000.00	3,928,800.00	
	BTPS 2.5% 12/07/01	4,000,000.00	4,006,440.00	
	BTPS 3% 12/03/01	4,500,000.00	4,539,690.00	
	BTPS 3% 15/04/15	5,000,000.00	4,912,500.00	

	BTPS 3% 15/06/15	4,000,000.00	3,924,800.00	
	BTPS 3% 15/11/01	1,000,000.00	972,000.00	
	BTPS 3.5% 14/06/01	5,000,000.00	5,050,000.00	
	BTPS 3.75% 13/12/15	5,000,000.00	5,107,000.00	
	BTPS 3.75% 15/08/01	7,200,000.00	7,272,000.00	
	BTPS 3.75% 16/08/01	7,000,000.00	7,008,400.00	
	BTPS 3.75% 21/03/01	2,000,000.00	1,866,200.00	
	BTPS 3.75% 21/08/01	6,300,000.00	5,904,990.00	
	BTPS 4% 12/04/15	4,500,000.00	4,599,450.00	
	BTPS 4% 17/02/01	6,000,000.00	6,027,000.00	
	BTPS 4% 20/09/01	4,500,000.00	4,329,000.00	
	BTPS 4% 37/02/01	5,500,000.00	4,592,500.00	
	BTPS 4.25 12/10/15	4,000,000.00	4,121,600.00	
	BTPS 4.25 13/08/01	5,810,000.00	6,018,579.00	
	BTPS 4.25 19/02/01	6,400,000.00	6,387,200.00	
	BTPS 4.25% 13/04/15	4,500,000.00	4,655,250.00	
	BTPS 4.25% 14/08/01	6,900,000.00	7,134,600.00	
	BTPS 4.25% 15/02/01	6,000,000.00	6,202,800.00	
	BTPS 4.25% 19/09/01	6,000,000.00	5,944,800.00	
	BTPS 4.25% 20/03/01	6,000,000.00	5,899,200.00	
	BTPS 4.5% 18/02/01	6,000,000.00	6,133,200.00	
	BTPS 4.5% 18/08/01	5,000,000.00	5,075,500.00	
	BTPS 4.5% 19/03/01	5,000,000.00	5,056,000.00	
	BTPS 4.5% 20/02/01	5,500,000.00	5,523,100.00	
	BTPS 4.5% 26/03/01	2,000,000.00	1,912,400.00	
	BTPS 4.75% 13/02/01	5,300,000.00	5,525,780.00	
	BTPS 4.75% 23/08/01	4,500,000.00	4,504,500.00	
	BTPS 5% 12/02/01	7,400,000.00	7,631,250.00	
	BTPS 5% 25/03/01	4,000,000.00	4,037,600.00	
	BTPS 5% 34/08/01	4,970,000.00	4,810,463.00	
	BTPS 5% 39/08/01	5,000,000.00	4,799,000.00	
	BTPS 5% 40/09/01	4,000,000.00	3,811,600.00	
	BTPS 5.25 17/08/01	5,000,000.00	5,345,500.00	
	BTPS 5.25% 29/11/01	7,200,000.00	7,293,600.00	
	BTPS 5.75% 33/02/01	3,700,000.00	3,922,000.00	
	BTPS 6% 31/05/01	7,900,000.00	8,621,270.00	
	BTPS 6.5% 27/11/01	5,960,000.00	6,880,820.00	
	BTPS 7.25% 26/11/01	2,000,000.00	2,470,000.00	
	BTPS 9.00% 23/11/01	3,000,000.00	4,175,100.00	
	BUNDESSCHATZ 0.5% 120615	2,500,000.00	2,486,275.00	
	BUNDESSCHATZ 0.75% 120914	4,000,000.00	3,984,080.00	
	BUNDESSCHATZ 1% 12/03/16	5,000,000.00	5,013,450.00	
	BUNDESSCHATZ 1.25 111216	4,400,000.00	4,424,904.00	
	DBR 2.25% 20/09/04	4,000,000.00	3,762,400.00	
	DBR 3% 20/07/04	5,000,000.00	4,993,000.00	
	DBR 3.25% 15/07/04	5,500,000.00	5,804,150.00	

	DBR 3.25% 20/01/04	5,500,000.00	5,613,850.00
	DBR 3.25% 42/07/04	1,000,000.00	952,500.00
	DBR 3.5% 160104	5,200,000.00	5,529,680.00
	DBR 3.5% 19/07/04	6,000,000.00	6,258,600.00
	DBR 3.75% 13/07/04	5,800,000.00	6,168,300.00
	DBR 3.75% 15/01/04	6,000,000.00	6,449,400.00
	DBR 3.75% 17/01/04	5,000,000.00	5,367,000.00
	DBR 3.75% 19/01/04	6,000,000.00	6,387,000.00
	DBR 4% 18/01/04	5,000,000.00	5,425,500.00
	DBR 4% 37/01/04	6,200,000.00	6,676,160.00
	DBR 4.00% 16/07/04	5,900,000.00	6,415,955.00
	DBR 4.25% 14/01/04	5,700,000.00	6,182,220.00
	DBR 4.25% 14/07/04	6,500,000.00	7,089,550.00
	DBR 4.25% 17/07/04	5,000,000.00	5,509,500.00
	DBR 4.25% 18/07/04	5,200,000.00	5,722,080.00
	DBR 4.25% 39/07/04	3,500,000.00	3,962,700.00
	DBR 4.5% 13/01/04	6,700,000.00	7,164,310.00
	DBR 4.75% 28/07/04	3,000,000.00	3,471,600.00
	DBR 4.75% 34/07/04	4,600,000.00	5,447,780.00
	DBR 4.75% 40/07/04	4,000,000.00	4,904,400.00
	DBR 5% 12/01/04	7,000,000.00	7,314,580.00
	DBR 5% 12/07/04	7,220,000.00	7,670,528.00
	DBR 5.5% 31/01/04	4,300,000.00	5,463,150.00
	DBR 5.625% 28/01/04	3,980,000.00	5,032,710.00
	DBR 6% 16/06/20	890,000.00	1,053,537.50
	DBR 6.25% 24/01/04	2,700,000.00	3,542,670.00
	DBR 6.25% 300104	2,200,000.00	3,019,500.00
	DBR 6.5% 27/07/04	3,000,000.00	4,124,700.00
	FINNISH GO 3.875% 170915	2,000,000.00	2,138,000.00
	FRANCE 3.75% 17/04/25	5,000,000.00	5,281,000.00
	FRANCE 3.75% 19/10/25	5,000,000.00	5,180,500.00
	FRANCE O.A.T.3.5% 150425	4,600,000.00	4,847,020.00
	FRANCE O.A.T.3.5% 200425	6,000,000.00	6,067,800.00
	FRANCE O.A.T.4% 600425	2,000,000.00	2,025,600.00
	FRANCE O.A.T.5% 12/04/25	4,700,000.00	4,953,330.00
	FRANCE OAT4% 141025	5,000,000.00	5,373,500.00
	FRTR 2.5% 20/10/25	1,000,000.00	925,100.00
	FRTR 3.0% 15/10/25	8,000,000.00	8,228,000.00
	FRTR 3.25% 16/04/25	6,700,000.00	6,945,890.00
	FRTR 3.5% 26/04/25	3,000,000.00	2,902,500.00
	FRTR 3.75% 21/04/25	7,700,000.00	7,904,820.00
	FRTR 4% 13/04/25	5,700,000.00	6,044,280.00
	FRTR 4% 13/10/25	5,060,000.00	5,405,598.00
	FRTR 4% 14/04/25	5,300,000.00	5,685,310.00
	FRTR 4% 18/04/25	6,000,000.00	6,391,800.00
	FRTR 4% 38/10/25	6,500,000.00	6,597,500.00

	FRTR 4% 55/04/25	4,170,000.00	4,258,821.00
	FRTR 4.25% 17/10/25	4,500,000.00	4,877,550.00
	FRTR 4.25% 18/10/25	5,000,000.00	5,408,000.00
	FRTR 4.25% 19/04/25	6,900,000.00	7,436,820.00
	FRTR 4.25% 23/10/25	5,000,000.00	5,336,500.00
	FRTR 4.5% 41/04/25	3,000,000.00	3,295,200.00
	FRTR 4.75% 12/10/25	5,800,000.00	6,178,740.00
	FRTR 4.75% 35/04/25	4,600,000.00	5,203,520.00
	FRTR 5% 16/10/25	6,200,000.00	6,986,160.00
	FRTR 5.5% 29/04/25	5,000,000.00	6,078,500.00
	FRTR 5.75% 32/10/25	4,700,000.00	5,977,930.00
	FRTR 6.00% 25/10/25	3,500,000.00	4,416,300.00
	FRTR 8.5% 12/12/26	1,000,000.00	1,144,400.00
	FRTR 8.5% 19/10/25	2,550,000.00	3,582,240.00
	FRTR 8.5% 23/04/25	3,200,000.00	4,786,880.00
	IRISH 3.9% 12/03/05	1,000,000.00	995,000.00
	IRISH 4% 14/01/15	2,500,000.00	2,312,500.00
	IRISH 4.4% 19/06/18	1,500,000.00	1,178,400.00
	IRISH 4.5% 18/10/18	2,000,000.00	1,610,000.00
	IRISH 4.5% 20/04/18	2,490,000.00	1,883,436.00
	IRISH 4.6% 16/04/18	2,800,000.00	2,434,040.00
	IRISH 5% 13/04/18	2,000,000.00	1,980,000.00
	IRISH 5% 2020/10/18	2,000,000.00	1,590,000.00
	IRISH 5.4% 25/03/13	2,000,000.00	1,476,200.00
	IRISH 5.9% 19/10/18	2,000,000.00	1,720,000.00
	ITALY 5.75% 16/07/25	1,000,000.00	1,081,700.00
	NETHERLANDS 2.5% 120115	4,000,000.00	4,070,400.00
	NETHERLANDS 2.75 150115	3,500,000.00	3,612,000.00
	NETHERLANDS 3.25% 150715	3,100,000.00	3,247,870.00
	NETHERLANDS 3.5% 200715	4,000,000.00	4,080,400.00
	NETHERLANDS 3.75% 140715	3,400,000.00	3,638,680.00
	NETHERLANDS 3.75% 230115	2,000,000.00	2,066,800.00
	NETHERLANDS 3.75% 420115	2,000,000.00	2,049,200.00
	NETHERLANDS 4% 16/07/15	3,300,000.00	3,561,030.00
	NETHERLANDS 4% 18/07/15	3,500,000.00	3,744,300.00
	NETHERLANDS 4% 19/07/15	3,500,000.00	3,727,850.00
	NETHERLANDS 4.25% 130715	4,400,000.00	4,725,160.00
	NETHERLANDS 4.5% 170715	3,600,000.00	3,975,480.00
	NETHERLANDS 5% 12/07/15	4,000,000.00	4,246,800.00
	NETHERLANDS 5.5% 280115	3,000,000.00	3,708,600.00
	NETHERLANDS 7.5% 230115	1,000,000.00	1,407,400.00
	NETHERLANDS G1.75%130115	2,000,000.00	2,024,000.00
	NETHERLANDS GOVT4%370115	3,000,000.00	3,186,900.00
	OBL 2.25% 14/04/11	5,000,000.00	5,129,750.00
	OBL 2.25% 15/04/10	4,000,000.00	4,061,800.00
	OBL 2.5% 14/10/10	4,000,000.00	4,123,400.00

	OBL 2.5% 15/02/27	4,500,000.00	4,616,775.00	
	OBL 3.5% 13/04/12	4,500,000.00	4,743,675.00	
	OBL 4% 12/04/13	4,000,000.00	4,166,120.00	
	OBL 4% 13/10/11	4,000,000.00	4,296,800.00	
	OBL 4.25% 12/10/12	4,000,000.00	4,231,720.00	
	PGB 3.35% 15/10/15	2,000,000.00	1,804,000.00	
	PGB 3.6% 14/10/15	1,000,000.00	939,500.00	
	PGB 3.85% 21/04/15	2,000,000.00	1,607,400.00	
	PGB 4.10% 37/04/15	2,000,000.00	1,400,400.00	
	PGB 4.2% 16/10/15	1,000,000.00	905,000.00	
	PGB 4.35% 17/10/16	1,400,000.00	1,252,300.00	
	PGB 4.375% 14/06/16	2,000,000.00	1,939,400.00	
	PGB 4.45% 18/06/15	2,000,000.00	1,785,400.00	
	PGB 4.75% 19/06/14	2,000,000.00	1,757,000.00	
	PGB 4.8% 20/06/15	1,000,000.00	890,000.00	
	PGB 4.95% 23/10/25	2,000,000.00	1,641,800.00	
	PGB 5% 12/06/15	1,500,000.00	1,507,650.00	
	PGB 5.45% 13/09/23	2,000,000.00	2,020,000.00	
	RAGB 3.2% 17/02/20	1,000,000.00	1,017,100.00	
	RAGB 3.4% 14/10/20	3,000,000.00	3,127,500.00	
	RAGB 3.5% 15/07/15	2,200,000.00	2,294,600.00	
	RAGB 3.5% 21/09/15	3,000,000.00	2,980,500.00	
	RAGB 3.8% 13/10/20	3,000,000.00	3,175,500.00	
	RAGB 3.9% 20/07/15	3,500,000.00	3,615,500.00	
	RAGB 4% 16/09/15	3,000,000.00	3,183,000.00	
	RAGB 4.15% 37/03/15	2,000,000.00	2,059,000.00	
	RAGB 4.3% 14/07/15	2,400,000.00	2,578,800.00	
	RAGB 4.3% 17/09/15	1,500,000.00	1,610,250.00	
	RAGB 4.35% 19/03/15	2,200,000.00	2,357,300.00	
	RAGB 4.65% 18/01/15	3,000,000.00	3,283,500.00	
	RAGB 4.85% 26/03/15	1,000,000.00	1,113,500.00	
	RAGB 5% 12/07/15	3,000,000.00	3,169,500.00	
	RAGB 6.25% 27/07/15	2,000,000.00	2,578,000.00	
	RFGB 3.125% 14/09/15	1,500,000.00	1,574,550.00	
	RFGB 3.375% 20/04/15	1,000,000.00	1,010,700.00	
	RFGB 4% 25/07/04	1,000,000.00	1,050,300.00	
	RFGB 4.25% 12/09/15	2,000,000.00	2,105,000.00	
	RFGB 4.25% 15/07/04	1,300,000.00	1,417,390.00	
	RFGB 4.375% 19/07/04	1,000,000.00	1,092,500.00	
	RFGB 5.375% 13/07/04	1,500,000.00	1,650,450.00	
	SPGB 2.3% 2013/04/30	4,500,000.00	4,356,000.00	
	SPGB 2.5% 13/10/31	2,000,000.00	1,908,000.00	
	SPGB 2.75% 12/04/30	3,500,000.00	3,466,750.00	
	SPGB 3% 15/04/30	3,000,000.00	2,826,000.00	
	SPGB 3.15% 16/01/31	3,800,000.00	3,534,000.00	
	SPGB 3.3% 14/10/31	3,000,000.00	2,896,800.00	

	SPGB 3.8% 17/01/31	4,000,000.00	3,726,000.00	
	SPGB 3.9% 12/10/31	3,500,000.00	3,517,500.00	
	SPGB 4% 20/04/30	4,000,000.00	3,570,800.00	
	SPGB 4.1% 18/07/30	4,000,000.00	3,687,200.00	
	SPGB 4.2% 13/07/30	3,500,000.00	3,512,950.00	
	SPGB 4.2% 37/01/31	3,250,000.00	2,412,475.00	
	SPGB 4.25% 14/01/31	3,500,000.00	3,517,850.00	
	SPGB 4.3% 19/10/31	3,000,000.00	2,749,500.00	
	SPGB 4.4% 15/01/31	3,800,000.00	3,800,000.00	
	SPGB 4.6% 19/07/30	3,500,000.00	3,279,500.00	
	SPGB 4.65% 25/07/30	2,500,000.00	2,164,250.00	
	SPGB 4.7% 41/07/30	1,000,000.00	790,000.00	
	SPGB 4.75% 14/07/30	3,500,000.00	3,564,400.00	
	SPGB 4.8% 24/01/31	3,300,000.00	2,999,700.00	
	SPGB 4.85% 20/10/31	2,000,000.00	1,881,000.00	
	SPGB 4.9% 40/07/30	4,000,000.00	3,324,000.00	
	SPGB 5% 12/07/30	3,100,000.00	3,183,700.00	
	SPGB 5.5% 17/07/30	4,280,000.00	4,375,016.00	
	SPGB 5.75% 32/07/30	3,700,000.00	3,578,640.00	
	SPGB 6% 29/01/31	4,900,000.00	4,795,630.00	
	SPGB 6.15% 13/01/31	3,600,000.00	3,768,120.00	
	ユーロ 小計	901,670,000.00	935,016,771.50	
	(邦貨換算額)		(103,235,201,741)	(単位:円)
	英ポンド			
	UKT 2.25% 14/03/07	7,000,000.00	7,121,100.00	
	UKT 2.75% 15/01/22	5,500,000.00	5,643,550.00	
	UKT 3.25% 11/12/07	4,400,000.00	4,505,336.00	
	UKT 3.75% 19/09/07	6,000,000.00	6,116,040.00	
	UKT 3.75% 20/09/07	3,000,000.00	3,020,700.00	
	UKT 4% 16/09/07	4,800,000.00	5,151,552.00	
	UKT 4% 22/03/07	2,000,000.00	2,029,140.00	
	UKT 4% 60/01/22	2,000,000.00	1,884,520.00	
	UKT 4.25% 27/12/07	3,800,000.00	3,826,600.00	
	UKT 4.25% 32/06/07	3,800,000.00	3,762,076.00	
	UKT 4.25% 36/03/07	4,800,000.00	4,702,896.00	
	UKT 4.25% 39/09/07	3,500,000.00	3,433,500.00	
	UKT 4.25% 40/12/07	2,000,000.00	1,943,940.00	
	UKT 4.25% 46/12/07	3,900,000.00	3,824,223.00	
	UKT 4.25% 49/12/07	3,500,000.00	3,426,500.00	
	UKT 4.25% 55/12/07	5,000,000.00	4,959,000.00	
	UKT 4.5% 13/03/07	6,700,000.00	7,185,080.00	
	UKT 4.5% 19/03/07	5,200,000.00	5,621,720.00	
	UKT 4.5% 34/09/07	3,000,000.00	3,046,800.00	
	UKT 4.5% 42/12/07	5,000,000.00	5,109,600.00	
	UKT 4.75% 15/09/07	4,400,000.00	4,877,840.00	

	UKT 4.75% 20/03/07	5,200,000.00	5,686,096.00	
	UKT 4.75% 30/12/07	3,800,000.00	4,015,764.00	
	UKT 4.75% 38/12/07	4,500,000.00	4,783,500.00	
	UKT 5% 12/03/07	7,560,000.00	7,940,116.80	
	UKT 5% 14/09/07	5,500,000.00	6,104,835.00	
	UKT 5% 18/03/07	3,500,000.00	3,942,820.00	
	UKT 5% 25/03/07	4,400,000.00	4,846,468.00	
	UKT 5.25% 12/06/07	5,500,000.00	5,847,050.00	
	UKT 6.0% 281207	3,000,000.00	3,677,700.00	
	UKT 8% 13/09/27	2,500,000.00	2,956,500.00	
	UKT 8% 15/12/07	1,900,000.00	2,394,798.00	
	UKT 8% 21/06/07	2,620,000.00	3,618,220.00	
	UKT 8.75% 17/08/25	2,300,000.00	3,137,200.00	
	英ポンド 小計	141,580,000.00	150,142,780.80	
	(邦貨換算額)		(19,554,595,771)	(単位：円)
	スイスフラン			
	SWITZERLAND 2.5% 160312	2,000,000.00	2,130,800.00	
	SWITZERLAND 2.75% 120610	1,500,000.00	1,550,850.00	
	SWITZERLAND 3% 180108	1,000,000.00	1,098,700.00	
	SWITZERLAND 3% 19/05/12	2,000,000.00	2,206,000.00	
	SWITZERLAND 4% 13/02/11	2,000,000.00	2,147,200.00	
	SWITZERLAND 4% 280408	900,000.00	1,144,800.00	
	SWITZERLAND 4% 230211	1,000,000.00	1,215,000.00	
	SWITZERLAND 4.25% 140106	800,000.00	882,480.00	
	SWITZERLAND 4.25% 170605	2,000,000.00	2,343,400.00	
	スイスフラン 小計	13,200,000.00	14,719,230.00	
	(邦貨換算額)		(1,275,568,471)	(単位：円)
	スウェーデンクローナ			
	SGB 3% 16/07/12	17,000,000.00	17,015,300.00	
	SGB 3.5% 39/03/30	10,000,000.00	9,343,400.00	
	SGB 3.75% 17/08/12	13,200,000.00	13,747,800.00	
	SGB 4.25% 19/03/12	20,000,000.00	21,487,600.00	
	SGB 4.5% 15/08/12	13,000,000.00	13,984,100.00	
	SGB 5% 20/12/01	15,000,000.00	17,184,000.00	
	SGB 5.5% 12/10/08	16,000,000.00	17,016,000.00	
	SGB 6.75% 14/05/05	19,100,000.00	21,724,340.00	
	スウェーデンクローナ 小計	123,300,000.00	131,502,540.00	
	(邦貨換算額)		(1,613,536,165)	(単位：円)
	ノルウェークローネ			
	NORWAY GOV 4.25% 170519	10,000,000.00	10,512,000.00	
	NORWAY GOV 4.5% 19/05/22	6,000,000.00	6,404,400.00	
	NORWAY GOV 5% 150515	10,000,000.00	10,845,000.00	
	NORWAY GOV 6.5% 130515	16,000,000.00	17,465,600.00	

	ノルウェークローネ 小計	42,000,000.00	45,227,000.00	
	(邦貨換算額)		(633,630,270)	(単位：円)
	デンマーククローネ			
	DGB 4% 12/11/15	10,000,000.00	10,508,000.00	
	DGB 4% 15/11/15	16,000,000.00	17,275,200.00	
	DGB 4% 17/11/15	15,000,000.00	16,236,000.00	
	DGB 4% 19/11/15	15,000,000.00	16,023,000.00	
	DGB 4.5% 39/11/15	27,000,000.00	31,857,300.00	
	DGB 5% 13/11/15	20,820,000.00	22,863,483.00	
	DGB 6% 11/11/15	13,000,000.00	13,585,000.00	
	DGB 7% 24/11/10	5,080,000.00	7,090,664.00	
	デンマーククローネ 小計	121,900,000.00	135,438,647.00	
	(邦貨換算額)		(2,007,200,748)	(単位：円)
	ポーランドズロチ			
	POLGB 0% 11/07/25	5,000,000.00	4,881,000.00	
	POLGB 0% 12/01/25	5,000,000.00	4,776,000.00	
	POLGB 0% 12/10/25	6,000,000.00	5,538,600.00	
	POLGB 4.75% 12/04/25	7,000,000.00	7,051,800.00	
	POLGB 5.00% 13/10/24	6,500,000.00	6,516,900.00	
	POLGB 5.25% 13/04/25	5,000,000.00	5,051,000.00	
	POLGB 5.25% 17/10/25	8,000,000.00	7,834,400.00	
	POLGB 5.25% 2020/10/25	5,000,000.00	4,749,500.00	
	POLGB 5.5% 19/10/25	6,000,000.00	5,793,000.00	
	POLGB 5.5% 2015/04/25	5,000,000.00	5,010,000.00	
	POLGB 5.75% 14/04/25	8,000,000.00	8,144,000.00	
	POLGB 5.75% 22/09/23	5,200,000.00	5,083,000.00	
	POLGB 6.25% 15/10/24	7,500,000.00	7,777,500.00	
	ポーランドズロチ 小計	79,200,000.00	78,206,700.00	
	(邦貨換算額)		(2,170,235,925)	(単位：円)
	オーストラリアドル			
	ACGB 4.5% 20/04/15	3,000,000.00	2,765,622.00	
	ACGB 4.75% 12/11/15	2,000,000.00	1,986,596.00	
	ACGB 4.75% 16/06/15	2,000,000.00	1,937,040.00	
	ACGB 5.25% 19/03/15	3,000,000.00	2,938,875.00	
	ACGB 5.75% 11/06/15	2,000,000.00	2,009,874.00	
	ACGB 5.75% 12/04/15	3,000,000.00	3,027,000.00	
	ACGB 5.75% 21/05/15	2,000,000.00	2,021,200.00	
	ACGB 5.75% 22/07/15	2,000,000.00	2,014,200.00	
	ACGB 6% 17/02/15	3,300,000.00	3,391,888.50	
	ACGB 6.25% 14/06/15	3,000,000.00	3,094,170.00	
	ACGB 6.25% 15/04/15	3,000,000.00	3,105,717.00	
	ACGB 6.5% 13/05/15	3,540,000.00	3,646,472.58	
	オーストラリアドル 小計	31,840,000.00	31,938,655.08	

	(邦貨換算額)		(2,651,866,531)	(単位:円)
	シンガポールドル			
	SIGB 2.25% 13/07/01	1,000,000.00	1,042,841.00	
	SIGB 3.125% 11/02/01	1,000,000.00	1,003,257.00	
	SIGB 3.125% 22/09/01	1,000,000.00	1,034,749.00	
	SIGB 3.25% 20/09/01	2,000,000.00	2,105,684.00	
	SIGB 3.5% 12/07/01	1,000,000.00	1,047,595.00	
	SIGB 3.5% 27/03/01	1,000,000.00	1,048,367.00	
	SIGB 3.625 140701	2,500,000.00	2,758,012.50	
	SIGB 3.625% 11/07/01	2,000,000.00	2,034,768.00	
	SIGB 3.75% 160901	1,000,000.00	1,108,673.00	
	SIGB 4% 18/09/01	1,200,000.00	1,341,154.80	
	シンガポールドル 小計	13,700,000.00	14,525,101.30	
	(邦貨換算額)		(924,377,446)	(単位:円)
	マレーシアリングット			
	MALAYSIAN 2.509 12/08/27	6,000,000.00	5,957,292.00	
	MALAYSIAN 3.502 27/05/31	4,000,000.00	3,714,868.00	
	MALAYSIAN 3.702 13/02/25	8,000,000.00	8,111,648.00	
	MALAYSIAN 3.718 12/06/15	8,000,000.00	8,094,032.00	
	MALAYSIAN 3.756 11/04/28	5,000,000.00	5,021,810.00	
	MALAYSIAN 3.814% 17/02/15	2,000,000.00	2,022,950.00	
	MALAYSIAN 4.24 18/02/07	5,000,000.00	5,140,540.00	
	MALAYSIAN 4.262 16/09/15	3,000,000.00	3,109,734.00	
	MALAYSIAN 5.094 14/04/30	6,000,000.00	6,356,532.00	
	マレーシアリングット 小計	47,000,000.00	47,529,406.00	
	(邦貨換算額)		(1,269,985,728)	(単位:円)
	合計		246,685,097,822	単位:円
	(外貨建有価証券邦貨換算額合計)		(246,685,097,822)	(単位:円)

(注)

- 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券にかかるもので、内書きであります。
- 米ドル表示の債券については、185銘柄、信託財産純資産総額に対する比率40.5%、合計に対する比率41.3%です。
カナダドル表示の債券については、31銘柄、信託財産純資産総額に対する比率2.9%、合計に対する比率2.9%です。
メキシコペソ表示の債券については、5銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.9%、合計に対する比率0.9%です。
ユーロ表示の債券については、240銘柄、信託財産純資産総額に対する比率41.1%、合計に対する比率41.8%です。
英ポンド表示の債券については、34銘柄、信託財産純資産総額に対する比率7.8%、合計に対する比率7.9%です。
スイスフラン表示の債券については、9銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.5%、合計に対する比率0.5%です。
スウェーデンクローナ表示の債券については、8銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.6%、合計に対する比率0.7%です。
ノルウェークローネ表示の債券については、4銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.3%、

合計に対する比率0.3%です。

デンマーククローネ表示の債券については、8銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.8%、

合計に対する比率0.8%です。

ポーランドズロチ表示の債券については、13銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.9%、

合計に対する比率0.9%です。

オーストラリアドル表示の債券については、12銘柄、信託財産純資産総額に対する比率1.1%、

合計に対する比率1.1%です。

シンガポールドル表示の債券については、10銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.4%、

合計に対する比率0.4%です。

マレーシアリングgit表示の債券については、9銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.5%、

合計に対する比率0.5%です。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「（デリバティブ取引に関する注記） . 取引の時価等に関する事項」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 ・ マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>」の状況

(1) 貸借対照表

対象年月日	(平成21年12月18日現在)	(平成22年12月17日現在)
科目	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1	1
親投資信託受益証券	114,413,225	182,288,608
流動資産合計	114,413,226	182,288,609
資産合計	114,413,226	182,288,609
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	970	1,241
未払委託者報酬	8,749	11,118
流動負債合計	9,719	12,359
負債合計	9,719	12,359
純資産の部		
元本等		
1 元本		
元本	113,772,408	181,181,446
2 剰余金		
剰余金又は欠損金()	631,099	1,094,804
元本等合計	114,403,507	182,276,250
純資産合計	114,403,507	182,276,250
負債・純資産合計	114,413,226	182,288,609

(注)「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、毎年4月13日(ただし、休業日の場合は翌営業日)に決算を行います。上記の貸借対照表は平成21年12月18日および平成22年12月17日現在における同ファンドの状況です。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自平成21年4月14日 至平成21年12月18日	自平成22年4月14日 至平成22年12月17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（売買目的有価証券） 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	親投資信託受益証券（売買目的有価証券） 同左

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成21年12月18日現在)	(平成22年12月17日現在)
1. 受益権総数	平成21年12月18日現在における受益権の総数 113,772,408口	平成22年12月17日現在における受益権の総数 181,181,446口
2. 1単位当たり純資産額	1.0055円 (1万口 = 10,055円)	1.0060円 (1万口 = 10,060円)

(金融商品に関する注記)

(追加情報)

当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）および「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

・金融商品の状況に関する事項

項目	自平成22年4月14日 至平成22年12月17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。当ファンドにおける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、および価格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・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、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。リスクを管理する部署では、各種リスクごとに定められた頻度で、測定項目が上下限值(リミットあるいは注意レベル)内に収まっているかどうかのモニタリングを行っております。上下限値を越えていることが発見された場合は、原則として速やかに修正を行うよう、リスク管理を行う部署から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ます。また、是正勧告あるいは報告を受けた関連運用グループでは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、リスク管理を行う部署は、上下限値に抵触した事実ならびにその後の対処結果あるいは関連運用グループの対処方針の決定に関し、必要に応じて、リスク管理を行う部署の担当役員、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する体制となっております。</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	自平成22年4月14日 至平成22年12月17日
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」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）

．取引の状況に関する事項

項目	自平成21年4月14日 至平成21年12月18日
1．取引の内容	当ファンドの行うことのできるデリバティブ取引は、次の通りです。 a．わが国の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。 b．わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。 異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（「スワップ取引」）。 金利先渡し取引。
2．取引に対する取組方針	デリバティブ取引につきましては信託約款等に従っており、その制限を遵守しております。
3．取引の利用目的	信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため。
4．取引に係るリスクの内容	デリバティブ取引に伴いファンドに影響を与える主なリスクとしてマーケットリスクがあげられます。マーケットリスクについては、ポジションや時価、予想損失額の把握が重要だと考えております。
5．取引に係るリスクの管理体制	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・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理ならびに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。
6．取引の時価等に関する事項についての補足説明	該当事項はありません。

．取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

（平成21年12月18日現在）

平成21年12月18日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（平成22年12月17日現在）

平成22年12月17日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（関連当事者との取引に関する注記）

（自平成21年4月14日 至 平成21年12月18日）

該当事項はありません。

（自平成22年4月14日 至 平成22年12月17日）

該当事項はありません。

(その他の注記)

(平成21年12月18日現在)	
期首	平成21年4月14日
期首元本額	20,000,000円
期首より平成21年12月18日現在までの追加設定元本額	146,674,071円
期首より平成21年12月18日現在までの一部解約元本額	52,901,663円

(平成22年12月17日現在)	
期首	平成22年4月14日
期首元本額	152,033,524円
期首より平成22年12月17日現在までの追加設定元本額	34,988,743円
期首より平成22年12月17日現在までの一部解約元本額	5,840,821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	銘柄名	元本額	評価額	
			単価	金額
親投資信託 受益証券	マネーインカム・マザーファンド	180,859,816円	1.0079円	182,288,608円

(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

対象年月日	(平成21年12月18日現在)	(平成22年12月17日現在)
科目	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	6,222,311	5,643,274
国債証券	126,013,650	239,514,820
未収入金	-	48,000
未収利息	548,157	519,219
前払費用	350,348	602,799
流動資産合計	133,134,466	246,328,112
資産合計	133,134,466	246,328,112
負債の部		
流動負債		
流動負債合計	-	-
負債合計	-	-
純資産の部		
元本等		
1 元本		
元本	132,213,024	244,394,027
2 剰余金		
剰余金又は欠損金()	921,442	1,934,085
元本等合計	133,134,466	246,328,112
純資産合計	133,134,466	246,328,112
負債・純資産合計	133,134,466	246,328,112

(注) 「マネーインカム・マザーファンド」は、毎年4月13日(ただし、休業日の場合は翌営業日)に決算を行います。上記の貸借対照表は平成21年12月18日および平成22年12月17日現在における同マザーファンドの状況です。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自平成21年4月14日 至平成21年12月18日	自平成22年4月14日 至平成22年12月17日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券（売買目的有価証券） 個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、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。	国債証券（売買目的有価証券） 同左

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成21年12月18日現在)	(平成22年12月17日現在)
1. 受益権総数	平成21年12月18日現在における受益権の 総数 132,213,024口	平成22年12月17日現在における受益権の 総数 244,394,027口
2. 1単位当たり純資産額	1.0070円 (1万口 = 10,070円)	1.0079円 (1万口 = 10,079円)

(金融商品に関する注記)

(追加情報)

当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）および「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

・金融商品の状況に関する事項

項目	自平成22年4月14日 至平成22年12月17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。当ファンドにおける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、および価格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・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、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。リスクを管理する部署では、各種リスクごとに定められた頻度で、測定項目が上下限值（リミットあるいは注意レベル）内に収まっているかどうかのモニタリングを行っております。上下限値を越えていることが発見された場合は、原則として速やかに修正を行うよう、リスク管理を行う部署から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ます。また、是正勧告あるいは報告を受けた関連運用グループでは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、リスク管理を行う部署は、上下限値に抵触した事実ならびにその後の対処結果あるいは関連運用グループの対処方針の決定に関し、必要に応じて、リスク管理を行う部署の担当役員、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する体制となっております。</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	自 平成22年4月14日 至 平成22年12月17日
1．貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2．時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（国債証券） 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」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）

．取引の状況に関する事項

項目	自平成21年4月14日 至平成21年12月18日
1．取引の内容	当ファンドの行うことのできるデリバティブ取引は、次の通りです。 a．わが国の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。 b．わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。 異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（「スワップ取引」）。 金利先渡し取引。
2．取引に対する取組方針	デリバティブ取引につきましては信託約款等に従っており、その制限を遵守しております。
3．取引の利用目的	信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため。
4．取引に係るリスクの内容	デリバティブ取引に伴いファンドに影響を与える主なリスクとしてマーケットリスクがあげられます。マーケットリスクについては、ポジションや時価、予想損失額の把握が重要だと考えております。
5．取引に係るリスクの管理体制	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・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理ならびに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。
6．取引の時価等に関する事項についての補足説明	該当事項はありません。

．取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

（平成21年12月18日現在）

平成21年12月18日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（平成22年12月17日現在）

平成22年12月17日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（関連当事者との取引に関する注記）

（自平成21年4月14日 至平成21年12月18日）

該当事項はありません。

（自平成22年4月14日 至平成22年12月17日）

該当事項はありません。

(その他の注記)

(平成21年12月18日現在)	
期首	平成21年4月14日
期首元本額	21,902,962円
期首より平成21年12月18日現在までの追加設定元本額	163,808,521円
期首より平成21年12月18日現在までの一部解約元本額	53,498,459円
平成21年12月18日現在における元本の内訳	
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	3,674,276円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	275,447円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	18,994円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	225,244円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	25,945円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	17,004円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	48,106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)	4,370,806円
S M A M円高期待ファンド(米ドル安型)	4,370,806円
S M A M円高期待ファンド(ユーロ安型)	4,569,495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>	113,617,900円
合計	132,213,024円

(平成22年12月17日現在)	
期首	平成22年4月14日
期首元本額	172,477,387円
期首より平成22年12月17日現在までの追加設定元本額	88,671,254円
期首より平成22年12月17日現在までの一部解約元本額	16,754,614円
平成22年12月17日現在における元本の内訳	
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	3,426,185円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	1,085,486円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	61,686円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	291,762円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	56,716円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	52,733円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	90,791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)	8,340,735円
S M A M円高期待ファンド(米ドル安型)	8,343,887円
S M A M円高期待ファンド(ユーロ安型)	6,056,607円
アジア高成長国CBファンド	29,767,812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>	180,859,816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>	4,960,810円
合計	244,394,027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227回利付国債(10年)	118,000,000	118,423,620	
	第231回利付国債(10年)	40,000,000	40,228,400	
	第234回利付国債(10年)	40,000,000	40,370,400	
	第235回利付国債(10年)	40,000,000	40,492,400	
	国債証券 小計	238,000,000	239,514,820	
	合計		239,514,820	

独立監査人の監査報告書

平成23年2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
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）2010の平成21年12月22日から平成22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。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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22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。

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23年2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

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21年12月22日から平成22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。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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22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。

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23年2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
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21年12月22日から平成22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。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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22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。

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23年2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

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21年12月22日から平成22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。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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22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。

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。

[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22年2月16日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あずさ監査法人

指 定 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20年12月23日から平成21年12月21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。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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21年12月21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。

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22年2月16日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あずさ監査法人

指 定 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20年12月23日から平成21年12月21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。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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21年12月21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。

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22年2月16日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あずさ監査法人

指 定 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20年12月23日から平成21年12月21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。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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21年12月21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。

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22年2月16日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あずさ監査法人

指 定 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）2040の平成20年12月23日から平成21年12月21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。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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21年12月21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。

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。

[委託会社の監査報告書（前期）へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成22年 6月18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

あずさ監査法人

指 定 社 員 公認会計士 鈴木 敏夫 印
業務執行社員指 定 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21年4月1日から平成22年3月31日までの第25期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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22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。

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](#)

独立監査人の監査報告書

平成21年 6月26日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あずさ監査法人

指 定 社 員 公認会計士 鈴木 敏夫 印
業務執行社員指 定 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20年4月1日から平成21年3月31日までの第24期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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21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。

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。

独立監査人の中間監査報告書

平成22年12月16日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 鈴木 敏夫 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 辰巳 幸久 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友アセットマネジメント株式会社の平成22年4月1日から平成23年3月31日までの第26期事業年度の中間会計期間（平成22年4月1日から平成22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、中間損益計算書及び中間株主資本等変動計算書について中間監査を行った。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は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、我が国におけ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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。中間監査は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を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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22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22年4月1日から平成22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。

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、中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。