【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24年３月15日**
【計算期間】	**第11期（自 平成22年12月21日 至 平成23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。

＜２０１０＞・・・西暦2010年、＜２０２０＞・・・西暦2020年

＜２０３０＞・・・西暦2030年、＜２０４０＞・・・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	年2回	日本		
大型株				
中小型株	年4回	北米		
債券			ファミリーファンド	あり
一般	年6回（隔月）	欧州		
公債				
社債	年12回（毎月）	アジア		
その他債券				
クレジット属性 （　　）	日々	オセアニア		
	その他 （　　）	中南米		
不動産投信			**ファンド・オブ・ファンズ**	**なし**
		アフリカ		
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））		中近東（中東）		
		エマージング		
資産複合 （　　）				
資産配分固定型				
資産配分変更型				

（注）当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

※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】

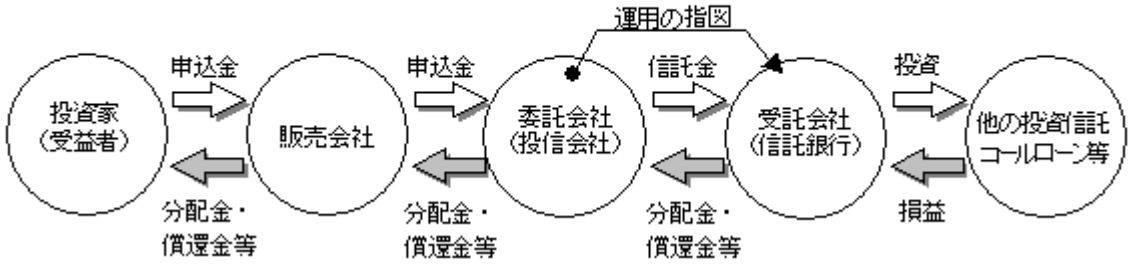
イ 当ファンドの関係法人とその役割

（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、その業務を行うに充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。
ただし、関係当局の認可等を前提に、平成24年４月１日付で中央三井信託銀行株式会社および住友信託銀行株式会社と合併し、新商号を三井住友信託銀行株式会社とする予定です。

（ハ）販売会社
委託会社との間で締結される販売契約（名称の如何を問いません。）に基づき、当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書（目論見書）の提供、受益者からの一部解約実行請求の受付け、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を行います。

運営の仕組み



ロ 委託会社の概況

（イ）資本金の額

2,000百万円（平成24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

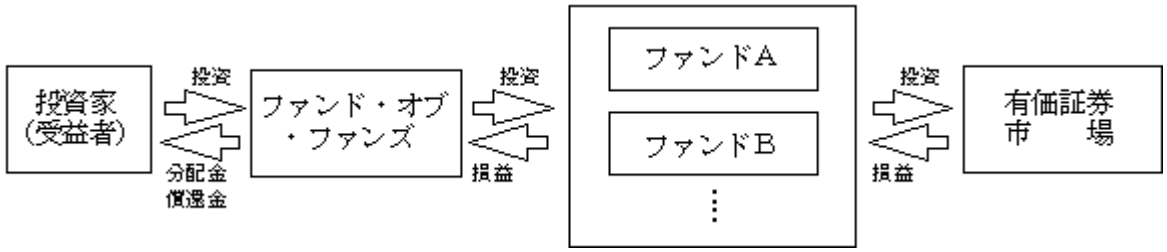
（平成24年１月31日現在）

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

ハ ファンドの運用形態（ファンド・オブ・ファンズによる運用）

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

〔ファンド・オブ・ファンズによる運用〕


投資家
(受益者)
投資
分配金
償還金
ファンド・オブ
・ファンズ
投資
損益
ファンドA
ファンドB
投資
損益
有価証券
市　　場

2【投資方針】

（1）【投資方針】

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

（イ）投資信託への投資を通じて、国内株式・国内債券・外国株式・外国債券への分散投資を行います（グローバル・バランス型ファンド）。

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

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

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

（ハ）期中の基本アロケーションとの乖離については、原則として四半期毎に見直し、必要に応じてリバランスを実施します。

（ニ）主要投資対象とする投資信託は、下記の通りとします。ただし、運用状況等により変更となる場合があります。

ａ．ＳＭＡＭ・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	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。

ｂ．ＳＭＡＭ・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	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。

ｃ．ＳＭＡＭ・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	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。

ｄ．ＳＭＡＭ・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．ＳＭＡＭ・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞

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

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

〔ファンドの特色〕

１．他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。
＜２０１０＞・・・西暦2010年、＜２０２０＞・・・西暦2020年
＜２０３０＞・・・西暦2030年、＜２０４０＞・・・西暦2040年

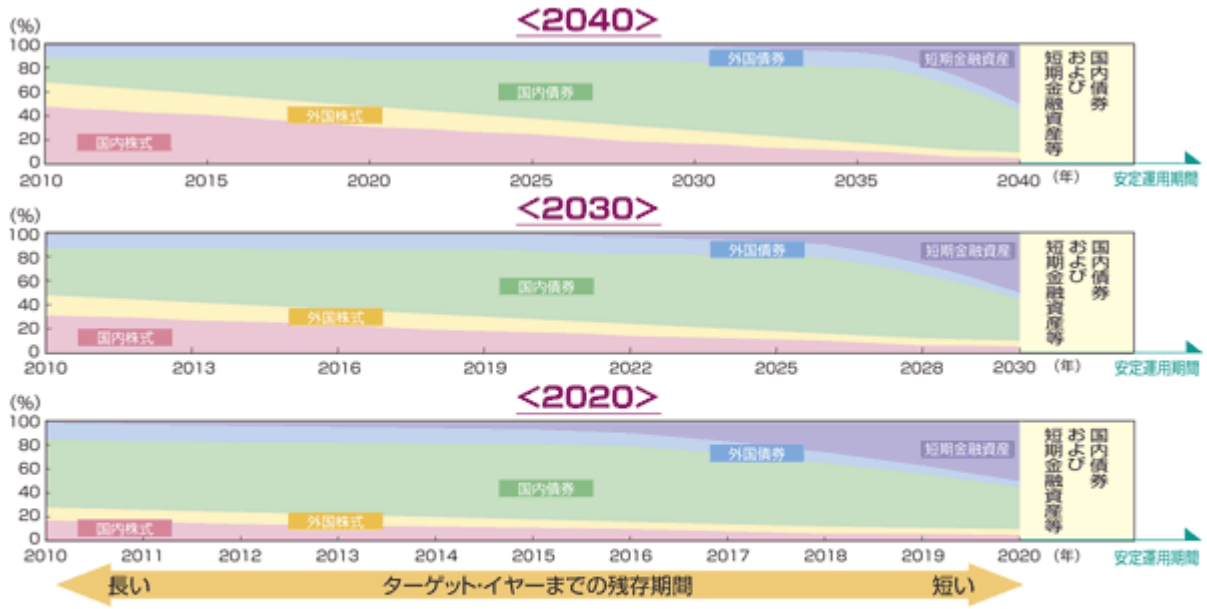
投資資産配分（基本アロケーション）は、国内外の経済・金融市場動向見通し等の分析を基に、各資産クラスの期待収益率等を予測した結果、ターゲット・イヤーに向けた信託財産の成長に最適と考えられる比率とし、原則として１年（計算期間）毎に見直します。
※各ファンドのターゲット・イヤーに近づくにつれ、安定資産等の比率を引き上げていきます。概ね、ターゲット・イヤーまでの期間が長いほど、リターン（収益）の高い運用を目指しますが、それに伴いリスク（損益の変動幅）が大きくなる傾向があります。
※ターゲット・イヤー到達後の安定運用期間においても国内債券および短期金融資産の他、国内外の株式および外国債券への配分が予定されています。

〔基本的な投資資産配分（基本アロケーション）〕

2012年１月末現在、各ファンドの基本アロケーションは以下の通りです。

	＜２０４０＞	＜２０３０＞	＜２０２０＞	＜２０１０＞
国内株式	46%	30%	16%	5%
外国株式	20%	16%	10%	5%
国内債券	22%	41%	57%	35%
外国債券	10%	11%	14%	5%
短期金融資産	2%	2%	3%	50%

〔基本資産配分のイメージ図〕

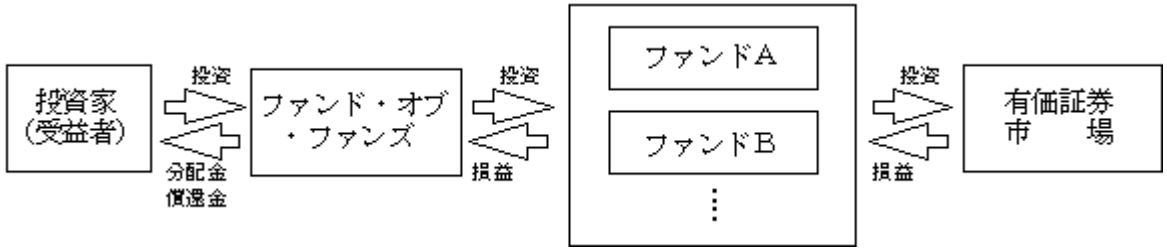


※上記の図は、各決算時点での基本資産配分を表しています。また、現時点で予定している基本資産配分をもとに作成したイメージ図であり、将来、実際に上記の通りの運用を行うことを保証するものではありません。

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

３．ファンド・オブ・ファンズという形態で運用されます。

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



〔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	ＳＭＡＭ・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	ＳＭＡＭ・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	ＳＭＡＭ・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	ＳＭＡＭ・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	ＳＭＡＭ・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞		－

※投資対象とする投資信託は、運用状況等により、変更される場合があります。

※資金動向、市況動向等によっては上記の運用ができないことがあります。

〔投資対象とする投資信託の運用プロセス〕

ＳＭＡＭ・国内株式パッシブ・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委託会社独自のリスクモデルを併用して、ファンド規模に応じデュレーション、満期構成、セクター（債券種別）配分、事業債の格付け構成および業種を可能な限りＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ（総合）に近づけたポートフォリオを構築します。なお事業債の銘柄選択については、委託会社クレジットアナリストの調査結果に基づき、将来的に格下げによりベンチマークから外れる可能性が高い銘柄については、組入対象から除外することがあります。ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ（総合）との連動性を随時チェックし、必要に応じてマルチファクターモデルおよび委託会社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委託会社独自のリスクモデルを併用して、通貨配分、国別配分、デュレーション、満期構成等を可能な限りベンチマークに近づけたポートフォリオを構築します。ベンチマークとの連動性を随時チェックし、必要に応じてマルチファクターモデルおよび委託会社独自のリスクモデルを使用してポートフォリオのリバランスを行います。

ＳＭＡＭ・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞

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

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

・ＴＯＰＩＸ（東証株価指数、配当込み）、ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ（総合）、ＭＳＣＩ－ＫＯＫＵＳＡＩインデックス、シティグループ世界国債インデックスは、それぞれ東京証券取引所、野村證券株式会社、ＭＳＣＩインク、シティグループ・グローバル・マーケッツ・インクが公表している指数で各社の知的財産です。

・指数を公表する各社は当ファンドの運用と何ら関係ありません。

（2）【投資対象】

イ 投資対象とする資産の種類

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

１．有価証券

２．金銭債権

３．約束手形

ロ 投資対象とする有価証券

委託会社は、信託金を、主として別に定める証券投資信託の受益証券ならびに次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

１．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等

２．外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、前号の性質を有するもの。

ハ 投資対象とする金融商品

委託会社は、信託金を、上記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。

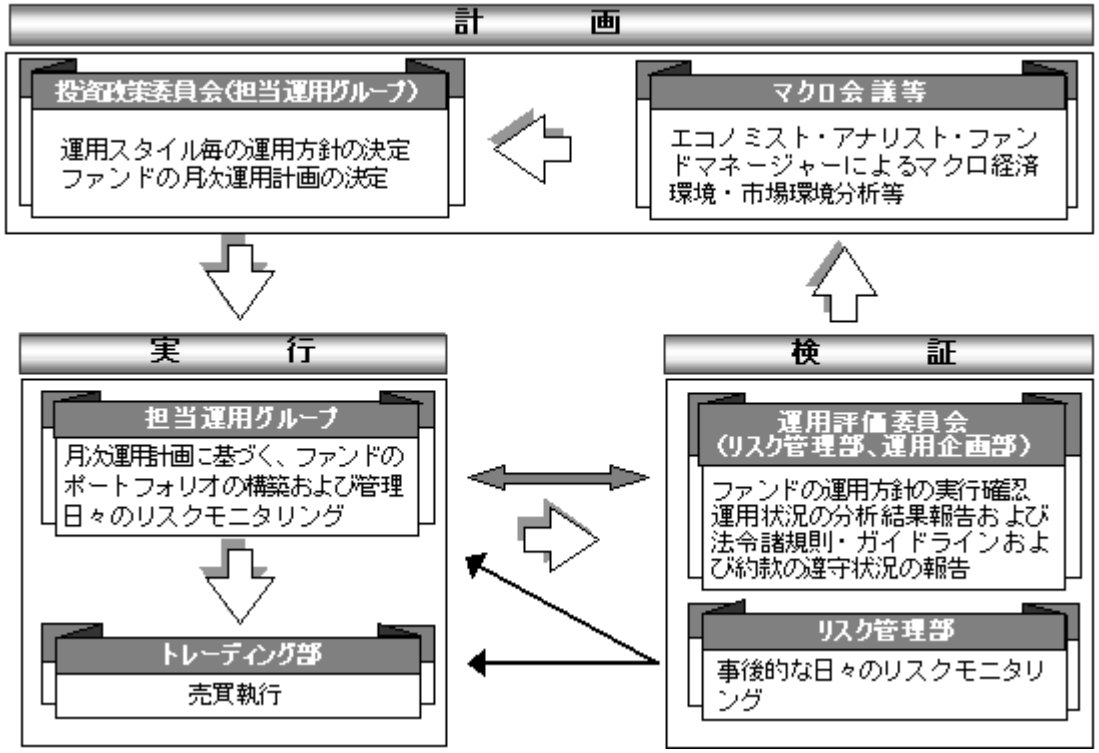
売買執行については、組織的に分離されたトレーディング部が、最良と思われる手法をもって売買を執行します。

（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７名程度、運用企画部は10名程度で構成されています。

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

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場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

ハ 留保益の運用については特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

（５）【投資制限】

Ⅰ 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。

ニ 資金の借入れ

（イ）委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

（ロ）一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が５営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。ただし、資金借入額は、借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

（ハ）収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

（ニ）借入金の利息は信託財産中より支弁します。

Ⅱ 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。

Ⅲ 法令に基づく投資制限

イ 同一法人の発行する株式への投資制限（投資信託及び投資法人に関する法律第９条）

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数（株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第３項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含みます。）が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図することが禁じられています。

ロ デリバティブ取引にかかる投資制限（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第１項第８号）

委託会社は、信託財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が当該信託財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引（新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含みます。）を行い、または継続することを受託会社に指図しないものとします。

〔参考情報：投資対象とする投資信託の概要（平成24年３月15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、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社およびその許諾者に帰属します。なお、野村證券株式会社およびその許諾者は、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、野村證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0.42（税抜き0.4）を乗じた率（下限は0%）
当該平均値が0.25%以上0.50%未満の場合	年0.105%（税抜き0.1%）

当該平均値が0.50%以上1.00%未満の場合	年0.147%（税抜き0.14%）
当該平均値が1.00%以上の場合	年0.189%（税抜き0.18%）

ロ 手数料　取得申込時および換金時には手数料はかかりません。

ハ 信託財産留保額　解約請求受付日の基準価額に対して0.01%

ニ 決算日　毎年１回（原則として４月13日）

ホ ベンチマーク　ありません。

3【投資リスク】

イ ファンドのもつリスクの特性

当ファンドは、投資信託を組み入れることにより運用を行います。当ファンドが組み入れる投資信託は、主として内外の株式や債券を投資対象としており、その価格は、保有する株式や債券の値動き、当該発行者の経営・財務状況の変化、為替相場の変動等の影響により上下します。当ファンドが組み入れる投資信託の価格の変動により、当ファンドの基準価額も上下します。基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

運用の結果としてファンドに生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。したがって、当ファンドは預貯金とは異なり、投資元本が保証されているものではなく、一定の投資成果を保証するものでもありません。また、当ファンドは、預貯金や保険契約と異なり、預金保険、貯金保険、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。登録金融機関は、投資者保護基金には加入しておりません。

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

（イ）株式市場リスク

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

（ロ）債券市場リスク

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

（ハ）為替変動リスク

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

（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。

（へ）市場流動性リスク

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

（ト）収益分配金に関する留意事項

分配金は、預貯金の利息とは異なり、ファンドの純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

ロ 投資リスクの管理体制

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

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

無手数料です。

（2）【換金（解約）手数料】

解約手数料はありません。

（3）【信託報酬等】

純資産総額に年0.5145%（税抜き0.49%）の率を乗じて得た金額が信託報酬として計算され、信託財産の費用として計上されます。なお、各ファンドのターゲット・イヤーに属する決算日の翌日以降年0.42%（税抜き0.4%）となります。

信託報酬は、毎計算期間の最初の６ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。

信託報酬の実質的配分は以下の通りです。

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

※（ ）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24年１月末現在）に従った場合、以下の通りとなります。なお、ＳMAM・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞は、信託報酬が変動するため、その上限額である年0.189%（税抜き0.18%）で計算しております。

＜２０１０＞年0.5439%（税抜き0.518%）程度、＜２０２０＞年0.57939%（税抜き0.5518%）程度

＜２０３０＞年0.58296%（税抜き0.5552%）程度、＜２０４０＞年0.588105%（税抜き0.5601%）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、その時々の取引内容等により金額が決定し、実務上、その発生もしくは請求のつど、信託財産の費用として認識され、その時点の信託財産で負担することとなります。したがって、あらかじめ、その金額、上限額、計算方法等を具体的に記載することはできません。

※ 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応じて負担することになります。なお、現在、当ファンドが投資を行っている他の投資信託については、取得時、換金時に手数料はかかりません。

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

（5）【課税上の取扱い】

イ 個別元本について

（イ）追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

（ロ）受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合については、各販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても同一受益者の顧客口座が複数存在する場合や、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」を併用するファンドの場合には、別々に個別元本の算出が行われることがあります。

（ハ）受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「元本払戻金（特別分配金）」については、下記の（収益分配金の課税について）を参照。）

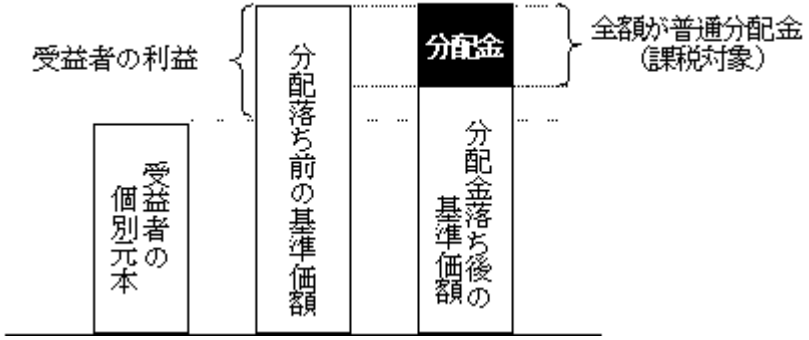
ロ 一部解約時および償還時の課税について

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

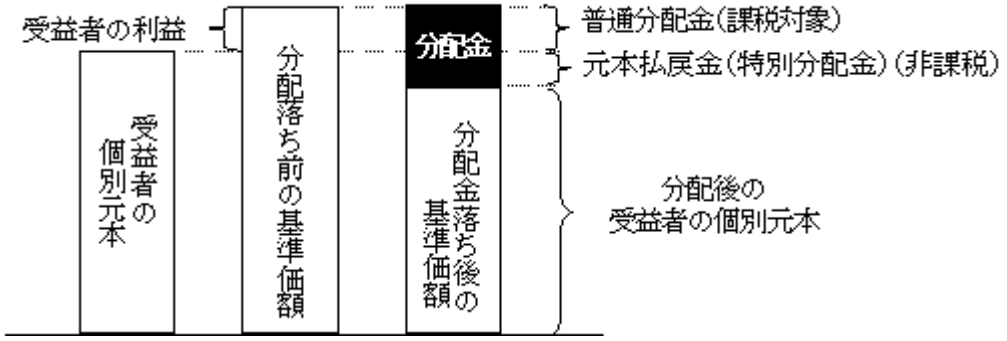
ハ 収益分配金の課税について

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

①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。


受益者の利益
分配金
全額が普通分配金
（課税対象）
受益者の
個別元本
分配落ち前の基準価額
分配金落ち後の
基準価額

②収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。なお、受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。



※上記①、②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。

ニ 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

ⅰ．収益分配時

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

時期	税率
平成24年12月31日まで	10%（所得税7%および地方税3%）
平成25年１月１日から 平成25年12月31日まで	10.147%（所得税7.147%および地方税3%）
平成26年１月１日以降	20.315%（所得税15.315%および地方税5%）

ⅱ．一部解約時および償還時

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

なお、一部解約時および償還時の損失については、確定申告により、収益分配金、上場株式等にかかる譲渡益との通算が可能です。

時期	税率
平成24年12月31日まで	10%（所得税7%および地方税3%）

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

（ロ）法人の受益者に対する課税

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

時期	税率
平成24年12月31日まで	7%（所得税のみ）
平成25年１月１日から 平成25年12月31日まで	7.147%（所得税のみ）
平成26年１月１日以降	15.315%（所得税のみ）

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

当ファンドは、受取配当にかかる益金不算入制度、配当控除の適用はありません。

※当ファンドの外貨建資産割合および非株式割合

外貨建資産への直接投資は行いません。

非株式割合に関する制限はありません（約款規定なし）。

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

※上記「(５)課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、平成24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24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	333,767,806	99.73
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		905,787	0.27
合計(純資産総額)		334,673,593	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（％）
ＳＭＡＭ・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	17,052,480	5.10
ＳＭＡＭ・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	116,696,445	34.87
ＳＭＡＭ・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	16,788,389	5.02
ＳＭＡＭ・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	16,545,449	4.94
ＳＭＡＭ・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞	国内債券	166,685,043	49.81

〔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24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	513,165,250	99.89
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		550,344	0.11
合計(純資産総額)		513,715,594	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（％）
ＳＭＡＭ・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	83,054,962	16.17
ＳＭＡＭ・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	292,219,625	56.88

ＳＭＡＭ・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**	51,803,980	10.08
SMAM・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**	71,531,040	13.92
ＳＭＡＭ・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞	**国内債券**	14,555,643	2.83

〔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24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	284,162,313	99.86
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		393,159	0.14
合計(純資産総額)		284,555,472	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（％）
ＳＭＡＭ・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	85,674,065	30.11
ＳＭＡＭ・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	116,599,588	40.98
ＳＭＡＭ・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	45,371,103	15.94
SMAM・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	31,188,478	10.96
ＳＭＡＭ・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞	国内債券	5,329,079	1.87

〔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24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	239,892,661	99.79
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		496,706	0.21
合計(純資産総額)		240,389,367	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（％）
ＳＭＡＭ・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	110,617,878	46.02
ＳＭＡＭ・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	52,940,635	22.02
ＳＭＡＭ・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	47,764,551	19.87
SMAM・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	23,919,884	9.95
ＳＭＡＭ・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞	国内債券	4,649,713	1.93

（２）【投資資産】

①【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24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	ＳＭＡＭ・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞	165,509,923	1.0069 166,668,405	1.0071 166,685,043	49.81
日本	投資信託受益証券	ＳＭＡＭ・年金国内債券パッシブファンド＜適格機関投資家限定＞	102,051,986	1.141 116,441,789	1.1435 116,696,445	34.87
日本	投資信託受益証券	ＳＭＡＭ・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	25,440,073	0.6338 16,124,274	0.6703 17,052,480	5.10
日本	投資信託受益証券	ＳＭＡＭ・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	18,059,799	0.8668 15,655,786	0.9296 16,788,389	5.02
日本	投資信託受益証券	ＳＭＡＭ・年金外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞	15,233,818	1.0901 16,607,050	1.0861 16,545,449	4.94

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

〔三井住友・ＤＣ年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020〕

平成24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	ＳＭＡＭ・年金国内債券パッシブファンド＜適格機関投資家限定＞	255,548,426	1.141 291,584,826	1.1435 292,219,625	56.88
日本	投資信託受益証券	ＳＭＡＭ・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	123,907,150	0.6336 78,514,385	0.6703 83,054,962	16.17
日本	投資信託受益証券	ＳＭＡＭ・年金外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞	65,860,455	1.0899 71,783,719	1.0861 71,531,040	13.92
日本	投資信託受益証券	ＳＭＡＭ・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	55,727,174	0.8664 48,282,469	0.9296 51,803,980	10.08

日本	投資信託受益証券	ＳＭＡＭ・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞	14,453,027	1.0069 14,553,751	1.0071 14,555,643	2.83

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

〔三井住友・ＤＣ年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030〕

平成24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	ＳＭＡＭ・年金国内債券パッシブファンド＜適格機関投資家限定＞	101,967,283	1.141 116,348,829	1.1435 116,599,588	40.98
日本	投資信託受益証券	ＳＭＡＭ・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	127,814,509	0.6336 80,991,580	0.6703 85,674,065	30.11
日本	投資信託受益証券	ＳＭＡＭ・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	48,807,125	0.8663 42,281,612	0.9296 45,371,103	15.94
日本	投資信託受益証券	ＳＭＡＭ・年金外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞	28,716,028	1.0896 31,291,259	1.0861 31,188,478	10.96
日本	投資信託受益証券	ＳＭＡＭ・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞	5,291,510	1.007 5,328,550	1.0071 5,329,079	1.87

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

〔三井住友・ＤＣ年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040〕

平成24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	ＳＭＡＭ・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	165,027,419	0.6336 104,571,769	0.6703 110,617,878	46.02
日本	投資信託受益証券	ＳＭＡＭ・年金国内債券パッシブファンド＜適格機関投資家限定＞	46,297,014	1.141 52,827,806	1.1435 52,940,635	22.02
日本	投資信託受益証券	ＳＭＡＭ・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	51,381,832	0.8663 44,512,081	0.9296 47,764,551	19.87
日本	投資信託受益証券	ＳＭＡＭ・年金外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞	22,023,648	1.0893 23,991,147	1.0861 23,919,884	9.95
日本	投資信託受益証券	ＳＭＡＭ・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞	4,616,933	1.007 4,649,259	1.0071 4,649,713	1.93

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

ロ 種類別の投資比率

〔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24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

〔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24年１月31日現在

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	99.89
合計	99.89

〔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24年１月31日現在

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	99.86
合計	99.86

〔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24年１月31日現在

種類	投資比率（%）
投資信託受益証券	99.79
合計	99.79

②【投資不動産物件】

各ファンドにつき、該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

各ファンドにつき、該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【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
第11期（平成23年12月20日）　（分配落）	329,392,588	10,818
第11期（平成23年12月20日）　（分配付）	329,392,588	10,818
平成23年１月末日	322,918,996	10,954
平成23年２月末日	328,581,700	10,973
平成23年３月末日	333,395,850	10,966
平成23年４月末日	337,785,578	10,980
平成23年５月末日	337,170,894	10,963
平成23年６月末日	338,547,343	10,967
平成23年７月末日	343,697,192	10,938
平成23年８月末日	333,997,387	10,854
平成23年９月末日	328,817,941	10,819
平成23年10月末日	333,137,115	10,900
平成23年11月末日	326,773,668	10,803
平成23年12月末日	331,478,931	10,836
平成24年１月末日	334,673,593	10,888

〔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
第11期（平成23年12月20日）　（分配落）	503,354,494	10,466
第11期（平成23年12月20日）　（分配付）	503,354,494	10,466
平成23年１月末日	473,339,778	10,911
平成23年２月末日	493,796,796	10,979
平成23年３月末日	495,803,767	10,933
平成23年４月末日	498,294,353	10,947
平成23年５月末日	500,668,951	10,880
平成23年６月末日	508,412,309	10,902
平成23年７月末日	508,080,803	10,832
平成23年８月末日	497,798,558	10,592
平成23年９月末日	496,839,732	10,509
平成23年10月末日	511,348,813	10,702
平成23年11月末日	501,146,577	10,454
平成23年12月末日	506,018,153	10,512
平成24年１月末日	513,715,594	10,644

〔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
第11期（平成23年12月20日）（分配落）	273,003,638	9,525
第11期（平成23年12月20日）（分配付）	273,003,638	9,525
平成23年１月末日	273,640,032	10,379
平成23年２月末日	276,819,335	10,499
平成23年３月末日	274,936,109	10,366
平成23年４月末日	275,582,082	10,341
平成23年５月末日	270,214,751	10,218
平成23年６月末日	275,492,129	10,259
平成23年７月末日	276,604,021	10,177
平成23年８月末日	269,943,690	9,745
平成23年９月末日	269,186,137	9,634
平成23年10月末日	278,743,341	9,901

平成23年11月末日	270,517,583	9,554
平成23年12月末日	275,895,157	9,603
平成24年１月末日	284,555,472	9,803

〔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
第11期（平成23年12月20日）（分配落）	230,424,744	8,586
第11期（平成23年12月20日）（分配付）	230,424,744	8,586
平成23年１月末日	235,393,973	9,814
平成23年２月末日	242,428,650	9,978
平成23年３月末日	236,084,205	9,740
平成23年４月末日	235,836,802	9,668
平成23年５月末日	233,192,305	9,497
平成23年６月末日	242,013,440	9,566

平成23年７月末日	242,747,438	9,481
平成23年８月末日	227,342,534	8,892
平成23年９月末日	228,059,679	8,773
平成23年10月末日	241,671,270	9,069
平成23年11月末日	230,998,774	8,651
平成23年12月末日	234,967,753	8,681
平成24年１月末日	240,389,367	8,934

②【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
第11期（平成22年12月21日～平成23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
第11期（平成22年12月21日～平成23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
第11期（平成22年12月21日～平成23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
第11期（平成22年12月21日～平成23年12月20日）	0

③【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
第11期	△1.1

（注）収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末分配落基準価額を控除した額を前期末分配落基準価額で除したものをいいます。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
第11期	△3.7

〔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
第11期	△7.6

〔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
第11期	△11.6

（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
第11期	50,688,810	43,023,358

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。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
第11期	87,891,359	30,227,601

〔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
第11期	47,890,237	20,123,017

〔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
第11期	49,611,557	20,043,137

〔参考情報：投資対象とする投資信託の現況〕

〔ＳＭＡＭ・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24年１月30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）	67,481,894,204	0.9779 65,990,544,343	1.0176 68,669,575,541	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・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。

平成24年１月30日現在

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〕	3,571,300	2,509.90 8,963,605,870	2,789.00 9,960,355,700	3.43
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ 〔銀行業〕	20,569,400	328.14 6,749,642,916	352.00 7,240,428,800	2.49
日本	株式	本田技研工業 〔輸送用機器〕	2,324,700	2,389.64 5,555,196,108	2,682.00 6,234,845,400	2.15
日本	株式	キヤノン 〔電気機器〕	1,710,100	3,420.32 5,849,089,232	3,435.00 5,874,193,500	2.02
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ 〔銀行業〕	2,055,800	2,090.12 4,296,868,696	2,389.00 4,911,306,200	1.69
日本	株式	日本電信電話 〔情報・通信業〕	1,252,200	3,775.52 4,727,706,144	3,860.00 4,833,492,000	1.66

日本	株式	みずほフィナンシャルグループ 〔銀行業〕	34,931,700	100.03 3,494,217,951	115.00 4,017,145,500	1.38
日本	株式	ファナック 〔電気機器〕	286,800	12,275.30 3,520,556,040	12,680.00 3,636,624,000	1.25
日本	株式	武田薬品工業 〔医薬品〕	1,080,000	3,145.61 3,397,258,800	3,325.00 3,591,000,000	1.24
日本	株式	三菱商事 〔卸売業〕	1,978,300	1,551.69 3,069,708,327	1,729.00 3,420,480,700	1.18
日本	株式	エヌ・ティ・ティ・ドコモ 〔情報・通信業〕	22,396	135,037.19 3,024,292,907	136,800.00 3,063,772,800	1.05
日本	株式	三井物産 〔卸売業〕	2,345,900	1,182.34 2,773,651,406	1,296.00 3,040,286,400	1.05
日本	株式	小松製作所 〔機械〕	1,365,900	1,895.77 2,589,432,243	2,128.00 2,906,635,200	1.00
日本	株式	ソフトバンク 〔情報・通信業〕	1,233,100	2,545.92 3,139,373,952	2,181.00 2,689,391,100	0.93
日本	株式	日立製作所 〔電気機器〕	6,177,000	423.04 2,613,118,080	428.00 2,643,756,000	0.91
日本	株式	日本たばこ産業 〔食料品〕	6,851	364,524.01 2,497,353,992	383,000.00 2,623,933,000	0.90
日本	株式	日産自動車 〔輸送用機器〕	3,480,200	690.09 2,401,651,218	726.00 2,526,625,200	0.87
日本	株式	セブン＆アイ・ホールディングス 〔小売業〕	1,137,300	2,127.23 2,419,298,679	2,147.00 2,441,783,100	0.84
日本	株式	ソニー 〔電気機器〕	1,719,300	1,372.12 2,359,085,916	1,388.00 2,386,388,400	0.82
日本	株式	三菱地所 〔不動産業〕	1,907,000	1,262.49 2,407,568,430	1,236.00 2,357,052,000	0.81
日本	株式	東日本旅客鉄道 〔陸運業〕	479,900	4,695.12 2,253,188,088	4,770.00 2,289,123,000	0.79
日本	株式	ＫＤＤＩ 〔情報・通信業〕	4,222	504,984.02 2,132,042,532	497,500.00 2,100,445,000	0.72

日本	株式	信越化学工業 〔化学〕	516,900	3,805.49 1,967,057,781	3,955.00 2,044,339,500	0.70
日本	株式	アステラス製薬 〔医薬品〕	640,600	2,938.65 1,882,499,190	3,130.00 2,005,078,000	0.69
日本	株式	東京海上ホールディングス 〔保険業〕	1,030,800	1,832.20 1,888,631,760	1,933.00 1,992,536,400	0.69
日本	株式	国際石油開発帝石 〔鉱業〕	3,749	504,118.35 1,889,939,694	526,000.00 1,971,974,000	0.68
日本	株式	パナソニック 〔電気機器〕	3,146,500	726.96 2,287,379,640	622.00 1,957,123,000	0.67
日本	株式	東芝 〔電気機器〕	5,799,000	346.95 2,011,963,050	329.00 1,907,871,000	0.66
日本	株式	伊藤忠商事 〔卸売業〕	2,167,900	763.25 1,654,649,675	830.00 1,799,357,000	0.62
日本	株式	三菱電機 〔電気機器〕	2,751,000	712.19 1,959,234,690	650.00 1,788,150,000	0.62

〔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24年１月30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	46,829,939,931	1.2101 56,669,172,742	1.2303 57,614,875,097	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。

平成24年１月30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253回利付国債（10年）	4,057,000,000	103.15 4,185,127,880	102.40 4,154,651,990	1.6 2013/9/20	2.59
日本	国債証券	第250回利付国債（10年）	4,019,000,000	100.66 4,045,733,350	100.52 4,039,979,180	0.5 2013/6/20	2.52
日本	国債証券	第263回利付国債（10年）	3,635,000,000	104.26 3,790,145,000	103.75 3,771,566,950	1.6 2014/9/20	2.35
日本	国債証券	第272回利付国債（10年）	3,290,000,000	104.40 3,434,823,000	104.15 3,426,699,500	1.4 2015/9/20	2.14
日本	国債証券	第256回利付国債（10年）	3,305,000,000	102.95 3,402,804,950	102.39 3,383,989,500	1.4 2013/12/20	2.11
日本	国債証券	第265回利付国債（10年）	3,145,000,000	104.15 3,275,542,000	103.75 3,262,968,950	1.5 2014/12/20	2.03
日本	国債証券	第258回利付国債（10年）	3,180,000,000	102.94 3,273,523,800	102.46 3,258,514,200	1.3 2014/3/20	2.03

日本	国債証券	第268回利付国債（10年）	3,010,000,000	104.41 3,142,981,800	104.02 3,131,062,200	1.5 2015/3/20	1.95
日本	国債証券	第260回利付国債（10年）	2,996,000,000	104.03 3,116,850,900	103.43 3,098,912,600	1.6 2014/6/20	1.93
日本	国債証券	第274回利付国債（10年）	2,818,000,000	105.03 2,959,869,700	104.76 2,952,193,160	1.5 2015/12/20	1.84
日本	国債証券	第282回利付国債（10年）	2,756,000,000	106.42 2,933,086,100	106.36 2,931,529,640	1.7 2016/9/20	1.83
日本	国債証券	第280回利付国債（10年）	2,723,000,000	107.37 2,923,940,600	106.96 2,912,520,800	1.9 2016/6/20	1.82
日本	国債証券	第277回利付国債（10年）	2,714,000,000	105.70 2,868,806,560	105.38 2,860,121,760	1.6 2016/3/20	1.78
日本	国債証券	第270回利付国債（10年）	2,603,000,000	103.87 2,703,736,100	103.60 2,696,812,120	1.3 2015/6/20	1.68
日本	国債証券	第315回利付国債（10年）	2,330,000,000	101.15 2,356,819,100	102.72 2,393,539,100	1.2 2021/6/20	1.49
日本	国債証券	第284回利付国債（10年）	2,170,000,000	106.70 2,315,602,600	106.63 2,313,871,000	1.7 2016/12/20	1.44
日本	国債証券	第305回利付国債（10年）	2,140,000,000	103.53 2,215,708,000	104.83 2,243,404,800	1.3 2019/12/20	1.40
日本	国債証券	第312回利付国債（10年）	2,090,000,000	101.33 2,117,797,000	103.18 2,156,608,300	1.2 2020/12/20	1.34
日本	国債証券	第310回利付国債（10年）	2,040,000,000	99.88 2,037,652,400	101.73 2,075,434,800	1 2020/9/20	1.29
日本	国債証券	第317回利付国債（10年）	2,040,000,000	100.45 2,049,282,000	101.59 2,072,476,800	1.1 2021/9/20	1.29
日本	国債証券	第306回利付国債（10年）	1,800,000,000	103.84 1,869,120,000	105.46 1,898,334,000	1.4 2020/3/20	1.18
日本	国債証券	第313回利付国債（10年）	1,800,000,000	101.98 1,835,676,500	103.81 1,868,598,000	1.3 2021/3/20	1.16
日本	国債証券	第303回利付国債（10年）	1,590,000,000	104.31 1,658,529,000	105.75 1,681,568,100	1.4 2019/9/20	1.05

日本	国債証券	第297回利付国債（10年）	1,494,000,000	104.93 1,567,670,700	105.84 1,581,309,360	1.4 2018/12/20	0.99
日本	国債証券	第289回利付国債（10年）	1,288,000,000	105.78 1,362,446,400	106.25 1,368,590,160	1.5 2017/12/20	0.85
日本	国債証券	第293回利付国債（10年）	1,241,000,000	107.79 1,337,673,900	108.30 1,344,040,230	1.8 2018/6/20	0.84
日本	国債証券	第308回利付国債（10年）	1,280,000,000	102.77 1,315,456,000	104.45 1,337,075,200	1.3 2020/6/20	0.83
日本	国債証券	第290回利付国債（10年）	1,242,000,000	105.11 1,305,515,880	105.72 1,313,116,920	1.4 2018/3/20	0.82
日本	国債証券	第288回利付国債（10年）	1,213,000,000	107.02 1,298,152,600	107.24 1,300,893,980	1.7 2017/9/20	0.81
日本	国債証券	第285回利付国債（10年）	1,184,000,000	106.81 1,264,630,400	106.87 1,265,435,520	1.7 2017/3/20	0.79

〔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24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	36,043,908,778	1.1157 40,214,189,024	1.1940 43,036,427,080	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。

平成24年１月31日現在

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	APPLE INC 〔テクノロジー・ハードウェアおよび機器〕	120,674	28,513.41 3,440,828,179	34,600.90 4,175,429,465	1.94
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION 〔エネルギー〕	632,946	5,875.91 3,719,135,882	6,529.72 4,132,964,079	1.92
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP 〔ソフトウェア・サービス〕	155,406	13,820.19 2,147,741,566	14,703.14 2,284,957,728	1.06
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP 〔ソフトウェア・サービス〕	981,765	1,897.27 1,862,682,313	2,261.61 2,220,371,308	1.03
アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION 〔エネルギー〕	260,635	7,440.93 1,939,369,292	7,898.45 2,058,614,027	0.96
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO 〔資本財〕	1,379,345	1,140.35 1,572,940,760	1,443.58 1,991,197,613	0.93
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED 〔食品・飲料・タバコ〕	429,366	4,226.35 1,814,651,852	4,434.75 1,904,131,727	0.89

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〕	356,568	4,795.90 1,710,064,542	5,018.92 1,789,589,760	0.83
アメリカ	株式	AT&T INC 〔電気通信サービス〕	771,424	2,143.98 1,653,922,718	2,240.98 1,728,752,852	0.80
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO 〔家庭用品・パーソナル用品〕	357,725	4,776.04 1,708,509,409	4,827.97 1,727,089,073	0.80
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〕	1,015,901	1,481.77 1,505,333,656	1,648.28 1,674,489,706	0.78
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC 〔銀行〕	2,322,919	583.54 1,355,516,617	633.36 1,471,265,464	0.68
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A 〔ソフトウェア・サービス〕	33,077	44,543.28 1,473,358,350	44,123.96 1,459,488,297	0.68
アメリカ	株式	WELLS FARGO & COMPANY 〔銀行〕	653,019	1,839.99 1,201,551,172	2,234.11 1,458,919,543	0.68
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO 〔各種金融〕	507,385	2,181.41 1,106,816,133	2,826.82 1,434,287,993	0.67
アメリカ	株式	INTEL CORP 〔半導体・半導体製造装置〕	683,739	1,801.04 1,231,441,562	2,042.40 1,396,469,354	0.65
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE 〔食品・飲料・タバコ〕	268,887	5,056.35 1,359,588,395	5,152.59 1,385,465,757	0.64
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC 〔電気通信サービス〕	6,617,697	202.91 1,342,851,825	206.28 1,365,100,257	0.63
イギリス	株式	BP PLC 〔エネルギー〕	2,466,950	527.10 1,300,347,353	550.46 1,357,959,553	0.63
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC. 〔食品・飲料・タバコ〕	228,615	5,687.25 1,300,191,756	5,720.86 1,307,874,866	0.61
オーストラリア	株式	BHP BILLITON LTD 〔素材〕	417,957	2,837.46 1,185,938,693	3,056.54 1,277,503,877	0.59
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〕	303,840	4,070.46 1,236,771,240	4,152.99 1,261,846,061	0.59
イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS 〔エネルギー〕	471,113	2,571.89 1,211,655,242	2,676.36 1,260,868,130	0.59

アメリカ	株式	MERCK & CO. INC. 〔医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス〕	400,922	2,634.34 1,056,167,347	2,970.41 1,190,906,005	0.55
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〕	91,390	11,806.27 1,078,975,636	12,945.80 1,183,117,393	0.55
アメリカ	株式	WAL-MART STORES INC 〔食品・生活必需品小売り〕	246,628	4,443.02 1,095,774,271	4,682.09 1,154,735,479	0.54
アメリカ	株式	ORACLE CORPORATION 〔ソフトウェア・サービス〕	526,657	2,272.30 1,196,725,334	2,184.46 1,150,465,363	0.54
イギリス	株式	GLAXOSMITHKLINE PLC 〔医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス〕	660,453	1,641.35 1,084,039,088	1,713.99 1,132,015,946	0.53
フランス	株式	TOTAL SA 〔エネルギー〕	276,418	3,745.26 1,035,257,914	4,000.50 1,105,812,116	0.51
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC 〔テクノロジー・ハードウェアおよび機器〕	715,184	1,350.39 965,783,329	1,493.22 1,067,933,489	0.50

〔ＳＭＡＭ・年金外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞〕

投資有価証券の主要銘柄

主要投資銘柄

平成24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	5,459,065,457	1.0928 5,965,866,693	1.0917 5,959,661,759	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。

平成24年１月31日現在

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 2.625% 20/11/15	18,000,000	8,244.26 1,483,967,925	8,265.74 1,487,834,662	2.625 2020/11/15	0.60
アメリカ	国債証券	US T 3.625% 20/02/15	15,000,000	8,891.10 1,333,666,406	8,903.04 1,335,456,562	3.625 2020/2/15	0.54
アメリカ	国債証券	US T 3.5% 20/05/15	15,000,000	8,813.53 1,322,030,390	8,835.01 1,325,252,671	3.5 2020/5/15	0.54
アメリカ	国債証券	US T 2.625% 20/8/15	15,000,000	8,260.97 1,239,146,156	8,280.06 1,242,010,406	2.625 2020/8/15	0.50
アメリカ	国債証券	US T 3.625% 21/02/15	13,000,000	8,886.33 1,155,223,631	8,895.88 1,156,464,806	3.625 2021/2/15	0.47
アメリカ	国債証券	US T 4.75% 41/02/15	11,000,000	10,597.72 1,165,749,750	10,365.00 1,140,150,515	4.75 2041/2/15	0.46
アメリカ	国債証券	US T 4.375% 40/05/15	11,000,000	9,986.68 1,098,535,350	9,773.05 1,075,036,565	4.375 2040/5/15	0.44

アメリカ	国債証券	US T 4.25% 40/11/15	11,000,000	9,805.28 1,078,581,075	9,589.27 1,054,819,734	4.25 2040/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	US T 3.125% 19/05/15	12,000,000	8,583.20 1,029,984,300	8,610.65 1,033,278,187	3.125 2019/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	US T 4.625% 40/02/15	10,000,000	10,370.97 1,037,097,187	10,152.57 1,015,257,281	4.625 2040/2/15	0.41
イギリス	国債証券	UKT 2% 16/01/22	8,000,000	12,594.38 1,007,550,595	12,608.55 1,008,684,056	2 2016/1/22	0.41
アメリカ	国債証券	US T 3.875% 40/8/15	11,000,000	9,213.33 1,013,467,125	9,006.87 990,756,009	3.875 2040/8/15	0.40
イギリス	国債証券	UKT 3.75% 21/09/07	7,000,000	13,798.95 965,927,129	13,835.66 968,496,627	3.75 2021/9/7	0.39
アメリカ	国債証券	US T 3.375% 19/11/15	11,000,000	8,739.54 961,349,709	8,752.67 962,793,768	3.375 2019/11/15	0.39
フランス	国債証券	FRTR 3.0% 15/10/25	9,000,000	10,525.47 947,292,399	10,580.59 952,253,289	3 2015/10/25	0.39
アメリカ	国債証券	US T 3.125% 21/05/15	11,000,000	8,540.23 939,426,262	8,555.75 941,132,878	3.125 2021/5/15	0.38
アメリカ	国債証券	US T 4.375% 39/11/15	9,000,000	9,983.10 898,479,421	9,773.05 879,575,371	4.375 2039/11/15	0.36
フランス	国債証券	FRTR 5% 16/10/25	7,600,000	11,413.95 867,460,630	11,476.76 872,233,905	5 2016/10/25	0.35
フランス	国債証券	FRANCE 3.75% 17/04/25	8,000,000	10,819.73 865,578,654	10,902.16 872,172,808	3.75 2017/4/25	0.35
アメリカ	国債証券	US T 2.125% 21/08/15	11,000,000	7,845.65 863,022,393	7,859.97 864,597,731	2.125 2021/8/15	0.35
アメリカ	国債証券	US T 2.125% 14/11/30	10,500,000	8,033.62 843,530,579	8,030.64 843,217,298	2.125 2014/11/30	0.34
イギリス	国債証券	UKT 4.5% 13/03/07	6,700,000	12,615.63 845,247,533	12,545.15 840,525,300	4.5 2013/3/7	0.34
イギリス	国債証券	UKT 2.75% 15/01/22	6,500,000	12,824.55 833,596,180	12,799.46 831,965,030	2.75 2015/1/22	0.34

イギリス	**国債証券**	UKT 3.75% 19/09/07	6,000,000	13,790.03 827,402,370	13,844.07 830,644,260	3.75 2019/9/7	0.34
フランス	**国債証券**	FRTR 3.75% 21/04/25	7,700,000	10,644.40 819,619,050	10,672.54 821,785,614	3.75 2021/4/25	0.33
アメリカ	**国債証券**	US T 2.5% 15/04/30	10,000,000	8,166.09 816,609,613	8,168.48 816,848,300	2.5 2015/4/30	0.33
イギリス	**国債証券**	UKT 4.25% 40/12/07	5,500,000	14,484.04 796,622,425	14,732.58 810,292,395	4.25 2040/12/7	0.33
アメリカ	**国債証券**	US T 2.25% 15/01/31	10,000,000	8,078.97 807,897,519	8,078.97 807,897,519	2.25 2015/1/31	0.33
アメリカ	**国債証券**	US T 2.375% 14/09/30	10,000,000	8,068.83 806,883,093	8,061.67 806,167,031	2.375 2014/9/30	0.33
アメリカ	**国債証券**	US T 3.625% 19/08/15	9,000,000	8,868.43 798,159,065	8,882.75 799,447,978	3.625 2019/8/15	0.32

〔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24年１月30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	233,047,744	1.0084 235,006,706	1.0093 235,215,088	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。

平成24年１月30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237回利付国債（10年）	831,000,000	100.53 835,480,520	100.17 832,479,180	1.5 2012/3/20	47.88
日本	国債証券	第239回利付国債（10年）	303,000,000	101.12 306,403,880	100.49 304,487,730	1.4 2012/6/20	17.51
日本	国債証券	第244回利付国債（10年）	288,000,000	100.92 290,676,260	100.77 290,243,520	1 2012/12/20	16.69
日本	国債証券	第241回利付国債（10年）	288,000,000	101.24 291,586,340	100.75 290,165,760	1.3 2012/9/20	16.69

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2012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	10,888円
純資産総額	3億円

分配の推移

決算期	分配金
2011年12月	0円
2010年12月	0円
2009年12月	0円
2008年12月	0円
2007年12月	0円
設定来累計	0円

<2020>

基準価額	10,644円
純資産総額	5億円

分配の推移

決算期	分配金
2011年12月	0円
2010年12月	0円
2009年12月	0円
2008年12月	0円
2007年12月	0円
設定来累計	0円

<2030>

基準価額	9,803円
純資産総額	3億円

分配の推移

決算期	分配金
2011年12月	0円
2010年12月	0円
2009年12月	0円
2008年12月	0円
2007年12月	0円
設定来累計	0円

<2040>

※基準価額は、1万口当たり 信託報酬控除後です。

基準価額	8,934円
純資産総額	2億円

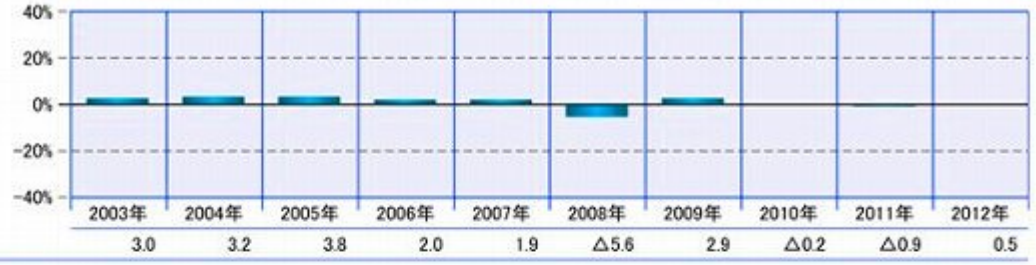
分配の推移

決算期	分配金
2011年12月	0円
2010年12月	0円
2009年12月	0円
2008年12月	0円
2007年12月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり 税引前です。
※直近5計算期間を記載しています。

年間収益率の推移（暦年ベース）

<2010>

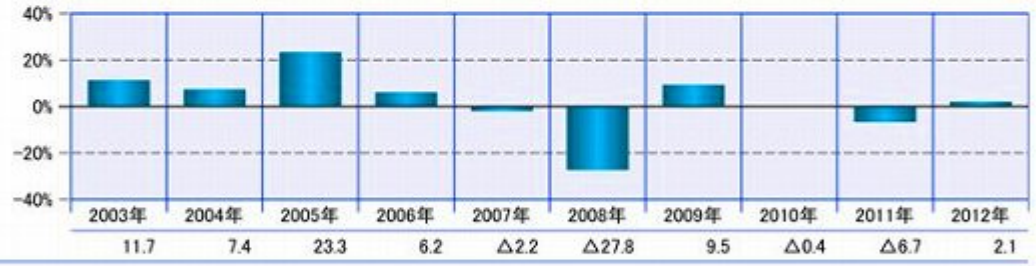


収益率(%)	2003年	2004年	2005年	2006年	2007年	2008年	2009年	2010年	2011年	2012年
ファンド	3.0	3.2	3.8	2.0	1.9	△5.6	2.9	△0.2	△0.9	0.5

<2020>

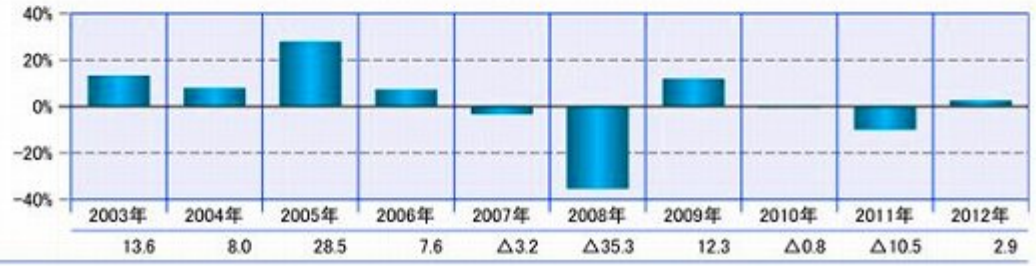
収益率(%)	2003年	2004年	2005年	2006年	2007年	2008年	2009年	2010年	2011年	2012年
ファンド	7.4	5.5	15.3	4.5	△0.5	△17.5	6.5	△0.4	△3.1	1.3

<2030>



収益率(%)	2003年	2004年	2005年	2006年	2007年	2008年	2009年	2010年	2011年	2012年
ファンド	11.7	7.4	23.3	6.2	△2.2	△27.8	9.5	△0.4	△6.7	2.1

<2040>



収益率(%)	2003年	2004年	2005年	2006年	2007年	2008年	2009年	2010年	2011年	2012年
ファンド	13.6	8.0	28.5	7.6	△3.2	△35.3	12.3	△0.8	△10.5	2.9

2012年のファンドの収益率は、年初から2012年1月31日までの騰落率を表示しています。
ファンドにはベンチマークはありません。

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

イ 申込方法

（イ）当ファンドの募集は、確定拠出年金および変額保険・変額年金の特別勘定による取得の申込みのみを対象とします。

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

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

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

なお、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得申込みの受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、受託会社がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。

ｂ．上記により受託会社が辞任し、または解任された場合は、委託会社は新受託会社を選任します。

ｃ．委託会社が新受託会社を選任できないとき、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。

ロ 収益分配金、償還金の支払い

（イ）収益分配金

ａ．分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。分配対象額が少額の場合等には委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

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

ただし、分配金自動再投資コースにかかる収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、累積投資契

約に基づいて、毎計算期間終了日の翌営業日に再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

（ロ）償還金

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

ハ 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。

ニ 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。

ヘ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

委託会社の事業の全部または一部の譲渡、もしくは分割承継により、当ファンドに関する事業が譲渡・承継

されることがあります。

ト 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

チ 運用にかかる報告書の開示方法

委託会社は毎決算後、投資信託及び投資法人に関する法律の規定に従い、期中の運用経過のほか、信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した「運用報告書」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ます。）に支払われます。

ただし、分配金自動再投資コースをお申込みの場合の収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、累積投資契約に基づき、毎計算期間終了日の翌営業日に再投資され、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ます。）に支払われます。

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

ハ 一部解約実行請求権

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

ニ 信託約款変更等に対する異議申立権および受益権の買取請求権

委託会社が、当ファンドの解約（監督官庁の命令による解約等の場合を除きます。）または重大な信託約款の変更を行おうとする場合において、当該解約または信託約款変更に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ときは、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、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買い取るべき旨の請求ができます。

ホ 帳簿閲覧・謄写請求権

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

第３【ファンドの経理状況】

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

２．当ファンドは、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づき、第10期（平成21年12月22日から平成22年12月20日まで）および第11期（平成22年12月21日から平成23年12月20日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【三井住友・ＤＣ年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）２０１０】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第10期 (平成22年12月20日現在)	第11期 (平成23年12月20日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,629,744	2,176,605
投資信託受益証券	324,173,010	327,923,116
未収利息	3	2
流動資産合計	326,802,757	330,099,723
資産合計	326,802,757	330,099,723
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,227,166	－
未払受託者報酬	66,847	70,195
未払委託者報酬	751,873	631,731
その他未払費用	4,946	5,209
流動負債合計	2,050,832	707,135
負債合計	2,050,832	707,135
純資産の部		
元本等		
元本	296,815,884	304,481,336
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	27,936,041	24,911,252
元本等合計	324,751,925	329,392,588
純資産合計	324,751,925	329,392,588
負債純資産合計	326,802,757	330,099,723

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第10期 自 平成21年12月22日 至 平成22年12月20日	第11期 自 平成22年12月21日 至 平成23年12月20日
営業収益		
受取利息	577	670
有価証券売買等損益	2,146,548	△2,445,894
営業収益合計	2,147,125	△2,445,224
営業費用		
受託者報酬	131,268	139,501
委託者報酬	1,476,535	1,255,366
その他費用	9,728	10,359
営業費用合計	1,617,531	1,405,226
営業利益又は営業損失（△）	529,594	△3,850,450
経常利益又は経常損失（△）	529,594	△3,850,450
当期純利益又は当期純損失（△）	529,594	△3,850,450
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	39,441	△194,569
期首剰余金又は期首欠損金（△）	25,434,121	27,936,041
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,290,062	4,681,534
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	5,290,062	4,681,534
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,278,295	4,050,442
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,278,295	4,050,442
分配金	―	―
期末剰余金又は期末欠損金（△）	27,936,041	24,911,252

（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10期 自 平成21年12月22日 至 平成22年12月20日	第11期 自 平成22年12月21日 至 平成23年12月20日
１．有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券（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に基づいて評価しております。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営業日の基準価額に基づいて評価し、「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、当日の基準価額に基づいて評価しております。	投資信託受益証券（売買目的有価証券） 同 左
２．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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。	―――――――――

（貸借対照表に関する注記）

項 目	第10期 （平成22年12月20日現在）	第11期 （平成23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 296,815,884口	当計算期間の末日における受益権の総数 304,481,336口
２．１単位当たり純資産額	1.0941円 （１万口＝10,941円）	1.0818円 （１万口＝10,818円）

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項 目	第10期 自 平成21年12月22日 至 平成22年12月20日	第11期 自 平成22年12月21日 至 平成23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（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）でありますが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（25,635,379円）、および分配準備積立金（6,922,226円）より、分配対象収益は32,557,605円（１万口当たり1,069.28円）でありますが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．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	第11期 自 平成22年12月21日 至 平成23年12月20日
	（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。	――――――
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。	同 左
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	（1）金融商品の内容 1）有価証券 同 左 2）デリバティブ取引 同 左 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。	（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 同 左
３．金融商品に係るリスク管理体制	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。 また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限値、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。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、測定項目が上下限値（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。	同 左

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。	同 左

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項 目	第10期 （平成22年12月20日現在）	第11期 （平成23年12月20日現在）
１．貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同 左
２．時価の算定方法	（1）有価証券（投資信託受益証券） 「重要な会計方針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） 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 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。	（1）有価証券（投資信託受益証券） 同 左 （2）派生商品評価勘定（デリバティブ取引） 同 左 （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 同 左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

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

第11期（自 平成22年12月21日 至 平成23年12月20日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	△2,242,142円
合 計	△2,242,142円

（デリバティブ取引に関する注記）

第10期（平成22年12月20日現在）

該当事項はありません。

第11期（平成23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。

第11期（自　平成22年12月21日　至　平成23年12月20日）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項 目	第10期 (平成22年12月20日現在)	第11期 (平成23年12月20日現在)
期首元本額	276,061,614円	296,815,884円
期中追加設定元本額	56,241,790円	50,688,810円
期中一部解約元本額	35,487,520円	43,023,358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	ＳＭＡＭ・国内株式パッシブ・ ファンド（適格機関投資家専用）	24,832,374	15,733,792	
投資信託 受益証券	ＳＭＡＭ・年金国内債券パッシブ ファンド＜適格機関投資家限定＞	101,227,606	115,500,698	
投資信託 受益証券	ＳＭＡＭ・外国株式パッシブ・ ファンド（適格機関投資家専用）	18,089,499	15,670,932	
投資信託 受益証券	ＳＭＡＭ・年金外国債券パッシブ・ ファンド＜適格機関投資家限定＞	15,064,707	16,425,050	
投資信託 受益証券	ＳＭＡＭ・マネーインカムファンド ＜適格機関投資家限定＞	163,448,505	164,592,644	
合 計			327,923,116	

【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10期 (平成22年12月20日現在)	第11期 (平成23年12月20日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,476,963	3,202,529
投資信託受益証券	458,795,865	501,454,578
未収利息	3	4
流動資産合計	461,272,831	504,657,111
資産合計	461,272,831	504,657,111
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	90,790	105,700
未払委託者報酬	1,021,279	1,189,055
その他未払費用	6,745	7,862
流動負債合計	1,118,814	1,302,617
負債合計	1,118,814	1,302,617
純資産の部		
元本等		
元本	423,280,286	480,944,044
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	36,873,731	22,410,450
元本等合計	460,154,017	503,354,494
純資産合計	460,154,017	503,354,494
負債純資産合計	461,272,831	504,657,111

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第10期 自 平成21年12月22日 至 平成22年12月20日	第11期 自 平成22年12月21日 至 平成23年12月20日
営業収益		
受取利息	1,083	948
有価証券売買等損益	6,263,967	△16,646,287
営業収益合計	6,265,050	△16,645,339
営業費用		
受託者報酬	171,731	208,000
委託者報酬	1,931,799	2,339,817
その他費用	12,749	15,463
営業費用合計	2,116,279	2,563,280
営業利益又は営業損失（△）	4,148,771	△19,208,619
経常利益又は経常損失（△）	4,148,771	△19,208,619
当期純利益又は当期純損失（△）	4,148,771	△19,208,619
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	87,642	△378,771
期首剰余金又は期首欠損金（△）	26,457,841	36,873,731
剰余金増加額又は欠損金減少額	8,456,300	7,001,974
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	8,456,300	7,001,974
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,101,539	2,635,407
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,101,539	2,635,407
分配金	―	―
期末剰余金又は期末欠損金（△）	36,873,731	22,410,450

（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10期 自 平成21年12月22日 至 平成22年12月20日	第11期 自 平成22年12月21日 至 平成23年12月20日
１．有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券（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に基づいて評価しております。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営業日の基準価額に基づいて評価し、「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、当日の基準価額に基づいて評価しております。	投資信託受益証券（売買目的有価証券） 同 左
２．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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。	―――――――――

（貸借対照表に関する注記）

項 目	第10期 （平成22年12月20日現在）	第11期 （平成23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 423,280,286口	当計算期間の末日における受益権の総数 480,944,044口
２．１単位当たり純資産額	1.0871円 （１万口＝10,871円）	1.0466円 （１万口＝10,466円）

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項 目	第10期 自 平成21年12月22日 至 平成22年12月20日	第11期 自 平成22年12月21日 至 平成23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（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）でありますが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（100,233,549円）、および分配準備積立金（13,574,975円）より、分配対象収益は113,808,524円（１万口当たり2,366.35円）でありますが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．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	第11期 自 平成22年12月21日 至 平成23年12月20日
	（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。	――――――
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。	同 左
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	（1）金融商品の内容 1）有価証券 同 左 2）デリバティブ取引 同 左 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。	（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 同 左
３．金融商品に係るリスク管理体制	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。 また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限値、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。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、測定項目が上下限値（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。	同 左

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。	同 左

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項 目	第10期 （平成22年12月20日現在）	第11期 （平成23年12月20日現在）
１．貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同 左
２．時価の算定方法	（1）有価証券（投資信託受益証券） 「重要な会計方針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） 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 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。	（1）有価証券（投資信託受益証券） 同 左 （2）派生商品評価勘定（デリバティブ取引） 同 左 （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 同 左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

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

第11期（自 平成22年12月21日 至 平成23年12月20日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	△16,436,929円
合 計	△16,436,929円

（デリバティブ取引に関する注記）

第10期（平成22年12月20日現在）

該当事項はありません。

第11期（平成23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。

第11期（自　平成22年12月21日　至　平成23年12月20日）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項 目	第10期 (平成22年12月20日現在)	第11期 (平成23年12月20日現在)
期首元本額	338,380,695円	423,280,286円
期中追加設定元本額	111,793,677円	87,891,359円
期中一部解約元本額	26,894,086円	30,227,601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	ＳＭＡＭ・国内株式パッシブ・ ファンド（適格機関投資家専用）	132,369,465	83,869,293	
投資信託 受益証券	ＳＭＡＭ・年金国内債券パッシブ ファンド＜適格機関投資家限定＞	252,244,477	287,810,948	
投資信託 受益証券	ＳＭＡＭ・外国株式パッシブ・ ファンド（適格機関投資家専用）	62,172,305	53,859,867	
投資信託 受益証券	ＳＭＡＭ・年金外国債券パッシブ・ ファンド＜適格機関投資家限定＞	60,406,053	65,860,719	
投資信託 受益証券	ＳＭＡＭ・マネーインカムファンド ＜適格機関投資家限定＞	9,983,864	10,053,751	
合 計			501,454,578	

【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10期 (平成22年12月20日現在)	第11期 (平成23年12月20日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,355,632	1,712,845
投資信託受益証券	265,763,399	272,120,615
未収利息	3	2
流動資産合計	268,119,034	273,833,462
資産合計	268,119,034	273,833,462
負債の部		
流動負債		
未払金	685,000	125,000
未払受託者報酬	51,552	57,196
未払委託者報酬	579,948	643,404
その他未払費用	3,802	4,224
流動負債合計	1,320,302	829,824
負債合計	1,320,302	829,824
純資産の部		
元本等		
元本	258,835,963	286,603,183
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	7,962,769	△13,599,545
元本等合計	266,798,732	273,003,638
純資産合計	266,798,732	273,003,638
負債純資産合計	268,119,034	273,833,462

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第10期 自 平成21年12月22日 至 平成22年12月20日	第11期 自 平成22年12月21日 至 平成23年12月20日
営業収益		
受取利息	508	541
有価証券売買等損益	4,853,930	△20,090,784
その他収益	1,672	－
営業収益合計	4,856,110	△20,090,243
営業費用		
受託者報酬	99,516	114,283
委託者報酬	1,119,431	1,285,632
その他費用	7,334	8,455
営業費用合計	1,226,281	1,408,370
営業利益又は営業損失（△）	3,629,829	△21,498,613
経常利益又は経常損失（△）	3,629,829	△21,498,613
当期純利益又は当期純損失（△）	3,629,829	△21,498,613
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	92,382	△282,606
期首剰余金又は期首欠損金（△）	3,534,086	7,962,769
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,077,329	269,067
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	269,067
剰余金減少額又は欠損金増加額	186,093	615,374
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	186,093	615,374
分配金	－	－
期末剰余金又は期末欠損金（△）	7,962,769	△13,599,545

（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10期 自 平成21年12月22日 至 平成22年12月20日	第11期 自 平成22年12月21日 至 平成23年12月20日
１．有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券（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に基づいて評価しております。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営業日の基準価額に基づいて評価し、「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、当日の基準価額に基づいて評価しております。	投資信託受益証券（売買目的有価証券） 同 左
２．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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。	―――――――――

（貸借対照表に関する注記）

項 目	第10期 （平成22年12月20日現在）	第11期 （平成23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 258,835,963口	当計算期間の末日における受益権の総数 286,603,183口
２．元本の欠損	―――――――――	「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の６第10号に規定する額 13,599,545円
３．１単位当たり純資産額	1.0308円 （１万口＝10,308円）	0.9525円 （１万口＝9,525円）

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項 目	第10期 自 平成21年12月22日 至 平成22年12月20日	第11期 自 平成22年12月21日 至 平成23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（1,567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）でありますが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（82,434,026円）、および分配準備積立金（10,712,802円）より、分配対象収益は93,146,828円（１万口当たり3,250.02円）でありますが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．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	第11期 自 平成22年12月21日 至 平成23年12月20日
	（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。	――――――
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。	同 左
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	（1）金融商品の内容 1）有価証券 同 左 2）デリバティブ取引 同 左 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。	（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 同 左
３．金融商品に係るリスク管理体制	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。 また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限値、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。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、測定項目が上下限値（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。	同 左

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。	同 左

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項 目	第10期 （平成22年12月20日現在）	第11期 （平成23年12月20日現在）
１．貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同 左
２．時価の算定方法	（1）有価証券（投資信託受益証券） 「重要な会計方針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） 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 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。	（1）有価証券（投資信託受益証券） 同 左 （2）派生商品評価勘定（デリバティブ取引） 同 左 （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 同 左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

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

第11期（自 平成22年12月21日 至 平成23年12月20日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	△19,978,754円
合 計	△19,978,754円

（デリバティブ取引に関する注記）

第10期（平成22年12月20日現在）

該当事項はありません。

第11期（平成23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。

第11期（自　平成22年12月21日　至　平成23年12月20日）
該当事項はありません。

（その他の注記）

項 目	第10期 (平成22年12月20日現在)	第11期 (平成23年12月20日現在)
期首元本額	210,515,040円	258,835,963円
期中追加設定元本額	58,503,162円	47,890,237円
期中一部解約元本額	10,182,239円	20,123,017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	ＳＭＡＭ・国内株式パッシブ・ ファンド（適格機関投資家専用）	130,885,555	82,929,087	
投資信託 受益証券	ＳＭＡＭ・年金国内債券パッシブ ファンド＜適格機関投資家限定＞	94,523,952	107,851,829	
投資信託 受益証券	ＳＭＡＭ・外国株式パッシブ・ ファンド（適格機関投資家専用）	52,794,327	45,735,725	
投資信託 受益証券	ＳＭＡＭ・年金外国債券パッシブ・ ファンド＜適格機関投資家限定＞	27,767,976	30,275,424	
投資信託 受益証券	ＳＭＡＭ・マネーインカムファンド ＜適格機関投資家限定＞	5,291,510	5,328,550	
合 計			272,120,615	

【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10期 (平成22年12月20日現在)	第11期 (平成23年12月20日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,528,948	1,472,142
投資信託受益証券	231,234,162	229,552,944
未収入金	－	341,000
未収利息	2	2
流動資産合計	232,763,112	231,366,088
資産合計	232,763,112	231,366,088
負債の部		
流動負債		
未払解約金	256,768	335,875
未払受託者報酬	44,655	49,138
未払委託者報酬	502,363	552,700
その他未払費用	3,285	3,631
流動負債合計	807,071	941,344
負債合計	807,071	941,344
純資産の部		
元本等		
元本	238,807,427	268,375,847
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△6,851,386	△37,951,103
元本等合計	231,956,041	230,424,744
純資産合計	231,956,041	230,424,744
負債純資産合計	232,763,112	231,366,088

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第10期 自 平成21年12月22日 至 平成22年12月20日	第11期 自 平成22年12月21日 至 平成23年12月20日
営業収益		
受取利息	417	496
有価証券売買等損益	4,822,423	△27,867,218
営業収益合計	4,822,840	△27,866,722
営業費用		
受託者報酬	87,210	98,504
委託者報酬	980,983	1,108,017
その他費用	6,409	7,281
営業費用合計	1,074,602	1,213,802
営業利益又は営業損失（△）	3,748,238	△29,080,524
経常利益又は経常損失（△）	3,748,238	△29,080,524
当期純利益又は当期純損失（△）	3,748,238	△29,080,524
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）	222,841	△1,013,324
期首剰余金又は期首欠損金（△）	△8,682,544	△6,851,386
剰余金増加額又は欠損金減少額	459,541	613,580
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	459,541	613,580
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,153,780	3,646,097
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,153,780	3,646,097
分配金	－	－
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△6,851,386	△37,951,103

（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10期 自 平成21年12月22日 至 平成22年12月20日	第11期 自 平成22年12月21日 至 平成23年12月20日
１．有価証券の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券（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に基づいて評価しております。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営業日の基準価額に基づいて評価し、「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、当日の基準価額に基づいて評価しております。	投資信託受益証券（売買目的有価証券） 同 左
２．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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。	―――――――――

（貸借対照表に関する注記）

項 目	第10期 （平成22年12月20日現在）	第11期 （平成23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 238,807,427口	当計算期間の末日における受益権の総数 268,375,847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 6,851,386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 37,951,103円
３．１単位当たり純資産額	0.9713円 （１万口＝9,713円）	0.8586円 （１万口＝8,586円）

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項 目	第10期 自 平成21年12月22日 至 平成22年12月20日	第11期 自 平成22年12月21日 至 平成23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（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）でありますが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（0円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（79,705,398円）、および分配準備積立金（8,401,106円）より、分配対象収益は88,106,504円（１万口当たり3,282.95円）でありますが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．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	第11期 自 平成22年12月21日 至 平成23年12月20日
	（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。	――――――
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。	同 左
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	（1）金融商品の内容 1）有価証券 同 左 2）デリバティブ取引 同 左 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。	（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 同 左
３．金融商品に係るリスク管理体制	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。 また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限値、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。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、測定項目が上下限値（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。	同 左

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。	同 左

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項 目	第10期 （平成22年12月20日現在）	第11期 （平成23年12月20日現在）
１．貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同 左
２．時価の算定方法	（1）有価証券（投資信託受益証券） 「重要な会計方針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） 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 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。	（1）有価証券（投資信託受益証券） 同 左 （2）派生商品評価勘定（デリバティブ取引） 同 左 （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 同 左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

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

第11期（自 平成22年12月21日 至 平成23年12月20日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	△27,692,955円
合 計	△27,692,955円

（デリバティブ取引に関する注記）

第10期（平成22年12月20日現在）

該当事項はありません。

第11期（平成23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。

第11期（自 平成22年12月21日 至 平成23年12月20日）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項 目	第10期 (平成22年12月20日現在)	第11期 (平成23年12月20日現在)
期首元本額	196,953,425円	238,807,427円
期中追加設定元本額	52,737,375円	49,611,557円
期中一部解約元本額	10,883,373円	20,043,137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	ＳＭＡＭ・国内株式パッシブ・ ファンド（適格機関投資家専用）	172,443,495	109,260,198	
投資信託 受益証券	ＳＭＡＭ・年金国内債券パッシブ ファンド＜適格機関投資家限定＞	40,694,145	46,432,019	
投資信託 受益証券	ＳＭＡＭ・外国株式パッシブ・ ファンド（適格機関投資家専用）	53,076,800	45,980,431	
投資信託 受益証券	ＳＭＡＭ・年金外国債券パッシブ・ ファンド＜適格機関投資家限定＞	21,517,965	23,461,037	
投資信託 受益証券	ＳＭＡＭ・マネーインカムファンド ＜適格機関投資家限定＞	4,388,540	4,419,259	
合 計			229,552,944	

（参考）

「ＳＭＡＭ・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）」の状況
「ＳＭＡＭ・年金国内債券パッシブファンド＜適格機関投資家限定＞」の状況
「ＳＭＡＭ・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）」の状況

「ＳＭＡＭ・年金外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞」の状況
「ＳＭＡＭ・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞」の状況

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

〔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24年１月31日現在
Ⅰ 資産総額	334,947,640円
Ⅱ 負債総額	274,047円
Ⅲ 純資産総額(Ⅰ－Ⅱ)	334,673,593円
Ⅳ 発行済口数	307,381,308口
Ⅴ １口当たり純資産額(Ⅲ／Ⅳ)	1.0888円
（ １万口当たり純資産額	10,888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24年１月31日現在
Ⅰ 資産総額	514,017,664円
Ⅱ 負債総額	302,070円
Ⅲ 純資産総額(Ⅰ－Ⅱ)	513,715,594円
Ⅳ 発行済口数	482,620,343口
Ⅴ １口当たり純資産額(Ⅲ／Ⅳ)	1.0644円
（ １万口当たり純資産額	10,644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24年１月31日現在
Ⅰ 資産総額	284,928,856円
Ⅱ 負債総額	373,384円
Ⅲ 純資産総額(Ⅰ－Ⅱ)	284,555,472円
Ⅳ 発行済口数	290,284,149口
Ⅴ １口当たり純資産額(Ⅲ／Ⅳ)	0.9803円
（ １万口当たり純資産額	9,803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24年１月31日現在
Ⅰ 資産総額	241,557,737円
Ⅱ 負債総額	1,168,370円

Ⅲ 純資産総額(Ⅰ－Ⅱ)	240,389,367**円**
Ⅳ 発行済口数	269,062,879**口**
Ⅴ １口当たり純資産額(Ⅲ／Ⅳ)	0.8934**円**
（ １万口当たり純資産額	8,934**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24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。

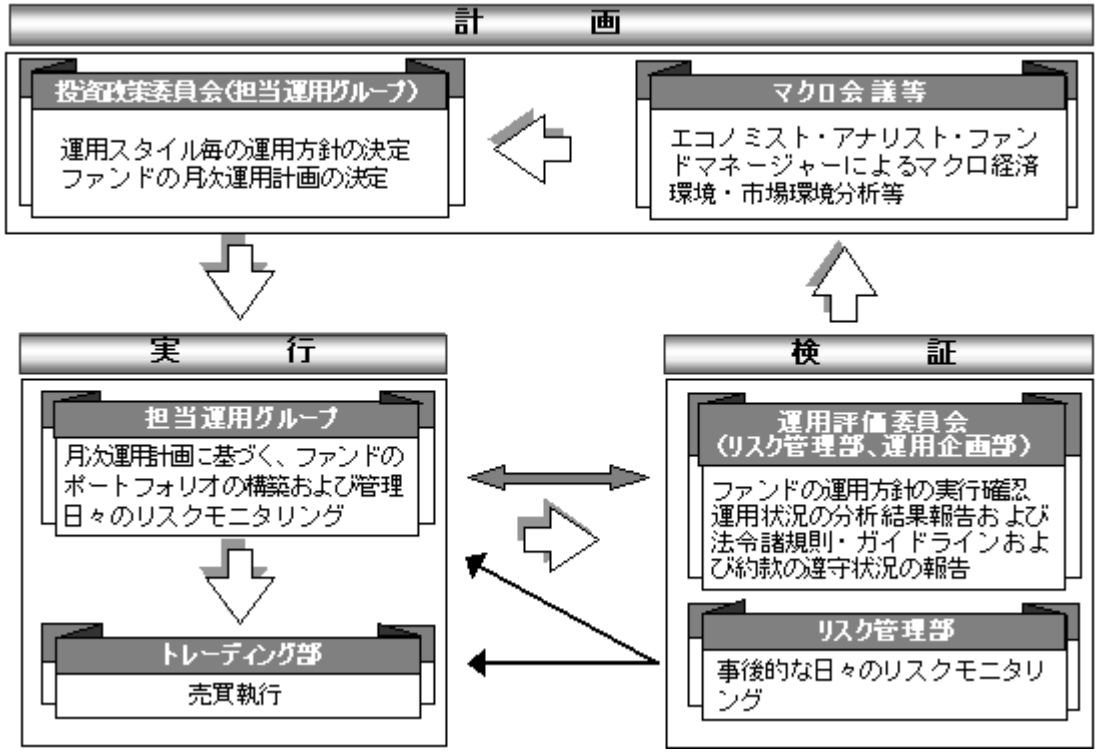
取締役の任期は、選任後１年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

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


計　　画
投資政策委員会(担当運用グループ)
運用スタイル毎の運用方針の決定
ファンドの月次運用計画の決定
マクロ会議等
エコノミスト・アナリスト・ファンドマネージャーによるマクロ経済環境・市場環境分析等
実　　行
担当運用グループ
月次運用計画に基づく、ファンドのポートフォリオの構築および管理
日々のリスクモニタリング
トレーディング部
売買執行
検　　証
運用評価委員会
(リスク管理部、運用企画部)
ファンドの運用方針の実行確認
運用状況の分析結果報告および法令諸規則・ガイドラインおよび約款の遵守状況の報告
リスク管理部
事後的な日々のリスクモニタリング

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24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24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	42 （ 2）	54,123 （ 5,170）
	追加型	303 （ 132）	4,485,907 （2,950,917）
	計	345 （ 134）	4,540,030 （2,956,087）
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		345 （ 134）	4,540,030 （2,956,087）

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

また、第27期中間会計期間(平成23年４月１日から平成23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 25 期 （平成22年３月31日現在）	第 26 期 （平成23年３月31日現在）
（資 産 の 部）			
流動資産			
現金及び預金	※２	15,484,883	17,127,600
有価証券		2,999,185	3,999,722
前払費用		248,594	264,910
未収入金		6,524	607,623
未収委託者報酬		3,405,895	3,712,698
未収運用受託報酬		456,672	326,523
未収投資助言報酬	※２	426,716	412,606
未収収益		7,020	27,051
繰延税金資産		244,770	241,975
その他の流動資産		1,392	1,299
流動資産計		23,281,654	26,722,012
固定資産			
有形固定資産	※１		
建物		173,574	148,698
器具備品		150,631	232,209
有形固定資産合計		324,206	380,907
無形固定資産	※１		
電話加入権		150	138
商標権		6,160	4,216
無形固定資産合計		6,310	4,354
投資その他の資産			
投資有価証券		6,923,150	4,980,828
関係会社株式		236,178	234,921
長期差入保証金		681,764	681,432
長期前払費用		7,822	10,561

会員権	20,113	20,113
繰延税金資産	524,820	606,449
投資その他の資産合計	8,393,850	6,534,307
固定資産計	8,724,367	6,919,569
資産合計	32,006,022	33,641,581

（単位：千円）

		第 25 期 （平成22年３月31日現在）	第 26 期 （平成23年３月31日現在）
（負 債 の 部）			
流動負債			
預り金		46,362	47,190
未払金			
未払収益分配金		943	681
未払償還金		18,453	21,638
未払手数料	※２	1,523,402	1,971,626
その他未払金		71,728	64,551
未払費用		869,497	824,240
未払消費税等		74,053	126,666
未払法人税等		1,264,485	1,004,164
賞与引当金		293,651	327,914
流動負債計		4,162,578	4,388,674
固定負債			
退職給付引当金		1,137,766	1,310,821
固定負債計		1,137,766	1,310,821
負債合計		5,300,344	5,699,496
（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	14,172,932	15,381,398
利益剰余金合計	15,994,137	17,202,602
株主資本計	26,623,121	27,831,586
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	82,556	110,498
評価・換算差額等計	82,556	110,498
純資産合計	26,705,677	27,942,085
負債・純資産合計	32,006,022	33,641,581

（2）【損益計算書】

（単位：千円）

	第　25　期 （自 平成21年４月１日 至 平成22年３月31日）	第　26　期 （自 平成22年４月１日 至 平成23年３月31日）
営業収益		
委託者報酬	21,113,167	27,350,519
運用受託報酬	2,492,177	2,113,027
投資助言報酬	1,893,038	1,828,087
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	43,853	35,635
サービス支援手数料	-	234,885
その他	12,348	26,930
営業収益計	25,559,586	31,594,086
営業費用		
支払手数料	9,706,627	14,161,927
広告宣伝費	420,508	482,728
公告費	2,339	4,634
調査費		
調査費	579,477	537,254
委託調査費	1,556,961	2,115,042
営業雑経費		
通信費	31,515	34,433
印刷費	278,539	266,803
協会費	19,271	23,235
諸会費	12,955	11,346
情報機器関連費	2,005,507	2,066,205
販売促進費	13,183	27,670
その他	66,833	79,571
営業費用計	14,693,722	19,810,852

一般管理費		
給料		
役員報酬	155,835	155,867
給料・手当	4,192,414	4,342,937
賞与	719,290	983,434
賞与引当金繰入額	293,651	327,914
交際費	19,087	21,460
寄付金	23	31
事務委託費	195,150	220,738
旅費交通費	197,842	219,278
租税公課	86,095	87,674
不動産賃借料	714,209	677,468
退職給付費用	197,352	199,545
固定資産減価償却費	97,916	100,356
諸経費	280,916	250,817
一般管理費計	7,149,786	7,587,526
営業利益	3,716,077	4,195,707

営業外収益			
受取配当金		1,710	34,115
有価証券利息		4,645	3,603
受取利息	※1	16,592	7,877
為替差益		-	4,753
時効成立分配金・償還金		3,492	3,076
原稿・講演料		3,255	3,485
還付加算金		37,708	1,645
雑収入		6,291	7,033
営業外収益計		73,696	65,590
営業外費用			
為替差損		5,113	-
時効成立後支払分配金・償還金		-	659
営業外費用計		5,113	659
経常利益		3,784,660	4,260,638
特別利益			
投資有価証券償還益		2,459	7
投資有価証券売却益		31,117	71,400
特別利益計		33,577	71,407
特別損失			
固定資産除却損	※2	5,302	17,318
投資有価証券償還損		-	2,679
投資有価証券評価損		51,557	-
投資有価証券売却損		2,724	20,822
関係会社株式評価損		-	1,256
特別損失計		59,583	42,077
税引前当期純利益		3,758,653	4,289,968
法人税、住民税及び事業税		1,817,726	1,852,053
法人税等調整額		△ 722,069	△ 93,549
法人税等合計		1,095,656	1,758,503
当期純利益		2,662,997	2,531,465

（３）【株主資本等変動計算書】

（単位：千円）

	第 25 期 （自 平成21年４月１日 至 平成22年３月31日）	第 26 期 （自 平成22年４月１日 至 平成23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	12,356,655	14,172,932
当期変動額		

剰余金の配当	△ 846,720	△ 1,323,000
当期純利益	2,662,997	2,531,465
当期変動額合計	1,816,277	1,208,465
当期末残高	14,172,932	15,381,398
利益剰余金合計		
前期末残高	14,177,860	15,994,137
当期変動額		
剰余金の配当	△ 846,720	△ 1,323,000
当期純利益	2,662,997	2,531,465
当期変動額合計	1,816,277	1,208,465
当期末残高	15,994,137	17,202,602
株主資本合計		
前期末残高	24,806,844	26,623,121
当期変動額		
剰余金の配当	△ 846,720	△ 1,323,000
当期純利益	2,662,997	2,531,465
当期変動額合計	1,816,277	1,208,465
当期末残高	26,623,121	27,831,586

評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
前期末残高	△ 5,805	82,556
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	88,361	27,941
当期変動額合計	88,361	27,941
当期末残高	82,556	110,498
評価・換算差額合計		
前期末残高	△ 5,805	82,556
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	88,361	27,941
当期変動額合計	88,361	27,941
当期末残高	82,556	110,498
純資産合計		
前期末残高	24,801,038	26,705,677
当期変動額		
剰余金の配当	△ 846,720	△ 1,323,000
当期純利益	2,662,997	2,531,465
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	88,361	27,941
当期変動額合計	1,904,639	1,236,407
当期末残高	26,705,677	27,942,085

重要な会計方針

項目	第25期 （自 平成21年４月１日 至 平成22年３月31日）	第26期 （自 平成22年４月１日 至 平成23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事業年度の負担額を計上しております。	同左

(2) 退職給付引当金	従業員の退職金支給に備えるため、当事業年度末における退職給付債務に基づき計上しております。 過去勤務債務については、その発生時において一時に費用処理しております。 数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。 （会計方針の変更） 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ん。	従業員の退職金支給に備えるため、当事業年度末における退職給付債務に基づき計上しております。 過去勤務債務については、その発生時において一時に費用処理しております。 数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。
４ その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理は税抜方式によっております。	同左

会計方針の変更

（会計処理の変更）

第25期 （自 平成21年４月１日 至 平成22年３月31日）	第26期 （自 平成22年４月１日 至 平成23年３月31日）
―	資産除去債務に関する会計基準 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。 これによる損益の影響はありません。

注 記 事 項

（貸借対照表関係）

第25期 (平成22年３月31日現在)	第26期 (平成23年３月31日現在)
※１ 有形固定資産の減価償却累計額 建　物　172,855千円 器具備品　863,358千円 無形固定資産の減価償却累計額 電話加入権　83千円 商標権　13,282千円	※１ 有形固定資産の減価償却累計額 建　物　191,415千円 器具備品　774,482千円 無形固定資産の減価償却累計額 電話加入権　95千円 商標権　15,226千円
※２ 関係会社に対する債権債務 現金及び預金　10,591,647千円 未収投資助言報酬　295,911千円 未払手数料　441,536千円	※２ 関係会社に対する債権債務 現金及び預金　11,201,422千円 未収投資助言報酬　293,061千円 未払手数料　469,104千円

3 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行１行と当座貸越契約を締結しております。 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。 当座貸越極度額の総額　10,000,000千円 借入実行残高　－千円 差引額　10,000,000千円	3 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行１行と当座貸越契約を締結しております。 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。 当座貸越極度額の総額　10,000,000千円 借入実行残高　－千円 差引額　10,000,000千円
4 当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York)Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成27年６月までの賃借料総額102,815千円の支払保証を行っております。	4 当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York)Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成27年６月までの賃借料総額74,617千円の支払保証を行っております。

（損益計算書関係）

第25期 （自 平成21年４月１日 至 平成22年３月31日）	第26期 （自 平成22年４月１日 至 平成23年３月31日）
※１ 関係会社との取引に係るもの 受取利息　　5,916千円	※１ 関係会社との取引に係るもの 受取利息　　3,867千円
※２ 固定資産除却損は、器具備品5,302千円であります。	※２ 固定資産除却損は、建物9,847千円、器具備品7,471千円であります。

（株主資本等変動計算書関係）

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

第26期(自 平成22年４月１日 至 平成23年３月31日)

１.発行済株式数に関する事項

	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22年６月24日定時株主総会	普通株式	1,323,000	75,000	平成22年３月31日	平成22年６月25日

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

平成23年６月24日開催の第26回定時株主総会において次の通り付議いたします。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額(千円)	一株当たり配当額(円)	基準日	効力発生日
平成23年６月24日定時株主総会	普通株式	利益剰余金	1,252,440	71,000	平成23年３月31日	平成23年６月27日

（リース取引関係）

第25期 （自 平成21年４月１日 至 平成22年３月31日）	第26期 （自 平成22年４月１日 至 平成23年３月31日）
１.オペレーティング・リース取引 (借主側) 未経過リース料(解約不能のもの)(単位:千円) １年以内　667,234 １年超　1,608,004 合計　2,275,239	１.オペレーティング・リース取引 (借主側) 未経過リース料(解約不能のもの)(単位:千円) １年以内　672,700 １年超　958,593 合計　1,631,293

（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

①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。

②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			
①満期保有目的の債券	2,999,185	2,999,100	△85
②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			
①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

①未払手数料

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

（注２）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：千円）

	貸借対照表計上額
その他有価証券	
非上場株式	298
投資証券	48,443
合計	48,741
子会社株式	
非上場株式	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)②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。

第26期(自 平成22年４月１日 至 平成23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

①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。

②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23年３月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれていません（（注２）参照）。

（単位：千円）

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

（注１）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資 産

(1) 現金及び預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収運用受託報酬及び(4) 未収投資助言報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

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

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

(6) 長期差入保証金

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

負 債

(1) 未払金

①未払手数料

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

（注２）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：千円）

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

その他有価証券については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであり、「(5)②その他有価証券」には含めておりません。

子会社株式については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであることから、時価開示の対象とはしておりません。また、上記の表中にある「貸借対照表計上額」は、減損処理後の帳簿価額です。当事業年度における減損処理額は、1,256千円です。

（注３）金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：千円）

区分	１年以内	１年超５年以内	５年超10年以内	10年超
現金及び預金	17,127,600	－	－	－
未収委託者報酬	3,712,698	－	－	－
未収運用受託報酬	326,523	－	－	－
未収投資助言報酬	412,606	－	－	－
有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券	4,000,000	－	－	－
その他有価証券のうち				
満期があるもの	－	－	－	－
長期差入保証金	13,841	667,590	－	－
合計	25,593,271	667,590	－	－

（有価証券関係）

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

子会社株式及び関連会社株式（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

第26期(平成23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	3,999,722	3,999,600	△122
小計	3,999,722	3,999,600	△122
合計	3,999,722	3,999,600	△122

２．子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（貸借対照表計上額 関係会社株式234,921千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。また、上記「貸借対照表計上額」は、減損処理後の帳簿価額です。当事業年度における減損処理額は、1,256千円です。

３．その他有価証券

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	3,047,395	2,801,036	246,358
小計	3,047,395	2,801,036	246,358
(2)貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	1,884,692	1,950,168	△65,476
小計	1,884,692	1,950,168	△65,476
合計	4,932,087	4,751,205	180,882

（注）非上場株式等（貸借対照表計上額 48,741千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

４．当事業年度中に売却したその他有価証券

（単位：千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額

4,845,387	71,400	20,822

（デリバティブ取引関係）

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。

第26期(自 平成22年４月１日 至 平成23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25期 （自 平成21年４月１日 至 平成22年３月31日）	第26期 （自 平成22年４月１日 至 平成23年３月31日）
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。**	**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。**
２．退職給付債務の額 **(単位：千円)** **退職給付債務** 1,137,766 **退職給付引当金** 1,137,766	**２．退職給付債務の額** **(単位：千円)** **退職給付債務** 1,310,821 **退職給付引当金** 1,310,821
３．退職給付費用の額 **(単位：千円)** **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** 15,677 **退職給付費用** 197,352	**３．退職給付費用の額** **(単位：千円)** **勤務費用** 160,751 **利息費用** 17,066 **数理計算上の差異の費用処理額** 6,439 **その他** 15,287 **退職給付費用** 199,545
（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。	**（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。**

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25期 (平成22年３月31日現在)	第26期 (平成23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** **繰延税金資産** **賞与引当金** 119,486 **未払社会保険料** 12,746 **未払事業税** 100,639 **未払事業所税** 6,089 **その他** 5,807 **繰延税金資産計** 244,770 **評価性引当額** － **繰延税金資産合計** 244,770 **繰延税金資産の純額** 244,770	(1) **流動の部** **繰延税金資産** **賞与引当金** 133,428 **未払社会保険料** 14,807 **未払事業税** 83,126 **未払事業所税** 6,378 **その他** 4,235 **繰延税金資産計** 241,975 **評価性引当額** － **繰延税金資産合計** 241,975 **繰延税金資産の純額** 241,975
(2) **固定の部** **繰延税金資産** **退職給付引当金** 462,957 **ソフトウェア償却** 111,245 **投資有価証券評価損** 73,440 **特定外国子会社留保金額** 213,896 **その他** 8,735 **繰延税金資産計** 870,274 **評価性引当額** △289,785 **繰延税金資産合計** 580,489 **繰延税金負債** **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) **固定の部** **繰延税金資産** **退職給付引当金** 533,373 **ソフトウェア償却** 141,119 **投資有価証券評価損** 71,023 **特定外国子会社留保金額** 247,489 **その他** 4,925 **繰延税金資産計** 997,931 **評価性引当額** △321,097 **繰延税金資産合計** 676,833 **繰延税金負債** **その他有価証券評価差額金** 70,383 **繰延税金負債合計** 70,383 **繰延税金資産の純額** 606,449

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	△0.2
税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.1

２．法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、記載を省略しております。

（資産除去債務関係）

第26期(自 平成22年４月１日 至 平成23年３月31日)

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

第26期(自 平成22年４月１日 至 平成23年３月31日)

１．セグメント情報

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

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

２．関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

（単位：千円）

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への売上高	27,350,519	2,113,027	1,828,087	302,451	31,594,086

(2) 地域ごとの情報

①売上高

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

②有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

（追加情報）

当事業年度より、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。

（関連当事者情報）

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㈱	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。

第26期(自 平成22年４月１日 至 平成23年３月31日)

１．親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等

（単位：千円）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の関係会社	住友生命保険(相)	大阪府大阪市中央区	210,000,000	生命保険業	(被所有)% 直接 40	当社の主要顧客	投資助言報酬	1,130,782	未収投資助言報酬	293,061
その他の関係会社	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	(被所有)% 直接 27.5	投信の販売委託役員の兼任	委託販売手数料	4,558,604	未払手数料	374,320

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

２．取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

２．その他の関係会社の子会社等

（単位：千円）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の関係会社の子会社	日興コーディアル証券㈱	東京都千代田区	10,000,000	証券業	－ %	投信の販売委託	委託販売手数料	2,174,385	未払手数料	110,182

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

２．取引条件及び取引条件の決定方針等

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

（１株当たり情報）

第25期 （自 平成21年４月１日 至 平成22年３月31日）	第26期 （自 平成22年４月１日 至 平成23年３月31日）
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おりません。 （１株当たり純資産額の算定上の基礎） 貸借対照表の純資産の部の合計額 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　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	１株当たり純資産額　1,584,018円42銭 １株当たり当期純利益　143,507円12銭 なお、潜在株式調整後１株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。 （１株当たり純資産額の算定上の基礎） 貸借対照表の純資産の部の合計額 27,942,085千円 普通株式に係る純資産額　27,942,085千円 普通株式の発行済株式数　17,640株 １株当たり純資産額の算定に用いられた普通株式の数 17,640株 （１株当たり当期純利益の算定上の基礎） 損益計算書上の当期純利益　2,531,465千円 普通株式に係る当期純利益　2,531,465千円 普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。 普通株式の期中平均株式数　17,640株

（重要な後発事象）

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。

第26期(自 平成22年４月１日 至 平成23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27期中間会計期間 （平成23年９月30日）
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		15,908,684
有価証券		3,999,550
前払費用		273,540
未収委託者報酬		3,692,782
未収運用受託報酬		419,703
未収投資助言報酬		408,845
未収収益		16,131
繰延税金資産		216,398
その他		698
流動資産合計		24,936,334
固定資産		
有形固定資産	※１	404,703
無形固定資産		149,325
投資その他の資産		
投資有価証券		5,686,023
その他		1,633,657
投資その他の資産合計		7,319,680
固定資産合計		7,873,709
資産合計		32,810,044
負債の部		
流動負債		
預り金		46,972
未払金		2,205,225

未払費用		834,591
未払法人税等		756,091
前受収益		8,761
賞与引当金		320,687
その他	※2	80,148
流動負債合計		4,252,478
固定負債		
退職給付引当金		1,396,073
固定負債合計		1,396,073
負債合計		5,648,551

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	15,201,075
利益剰余金合計	17,022,279
株主資本合計	27,651,263
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	△ 489,771
評価・換算差額等合計	△ 489,771
純資産合計	27,161,492
負債純資産合計	32,810,044

(2)中間損益計算書

（単位：千円）

		第27期中間会計期間 （自 平成23年４月１日 至 平成23年９月30日）
営業収益		
委託者報酬		13,337,108
運用受託報酬		991,578
投資助言報酬		879,806
その他の営業収益		107,846
営業収益計		15,316,340
営業費用		9,774,282
一般管理費	※１	3,826,719
営業利益		1,715,338
営業外収益	※２	32,554
経常利益		1,747,893
特別利益	※３	111,902
特別損失		29,977
税引前中間純利益		1,829,819
法人税、住民税及び事業税		744,821
法人税等調整額		12,881
法人税等合計		757,702
中間純利益		1,072,117

(3)中間株主資本等変動計算書

（単位：千円）

	第27期中間会計期間 （自 平成23年４月１日 至 平成23年９月30日）
株主資本	
資本金	
当期首残高	2,000,000
当中間期末残高	2,000,000
資本剰余金	
資本準備金	
当期首残高	8,628,984
当中間期末残高	8,628,984
資本剰余金合計	
当期首残高	8,628,984
当中間期末残高	8,628,984
利益剰余金	
利益準備金	
当期首残高	284,245
当中間期末残高	284,245
その他利益剰余金	
配当準備積立金	
当期首残高	60,000
当中間期末残高	60,000
別途積立金	
当期首残高	1,476,959
当中間期末残高	1,476,959
繰越利益剰余金	
当期首残高	15,381,398
当中間期変動額	
剰余金の配当	△ 1,252,440
中間純利益	1,072,117

当中間期変動額合計	△ 180,322
当中間期末残高	15,201,075
利益剰余金合計	
当期首残高	17,202,602
当中間期変動額	
剰余金の配当	△ 1,252,440
中間純利益	1,072,117
当中間期変動額合計	△ 180,322
当中間期末残高	17,022,279
株主資本合計	
当期首残高	27,831,586
当中間期変動額	
剰余金の配当	△ 1,252,440
中間純利益	1,072,117
当中間期変動額合計	△ 180,322
当中間期末残高	27,651,263

評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
当期首残高	110,498
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）	△ 600,269
当中間期変動額合計	△ 600,269
当中間期末残高	△ 489,771
評価・換算差額等合計	
当期首残高	110,498
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）	△ 600,269
当中間期変動額合計	△ 600,269
当中間期末残高	△ 489,771
純資産合計	
当期首残高	27,942,085
当中間期変動額	
剰余金の配当	△ 1,252,440
中間純利益	1,072,117
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	△ 600,269
当中間期変動額合計	△ 780,592
当中間期末残高	27,161,492

重要な会計方針

第27期中間会計期間
（自 平成23年４月１日 至 平成23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

・その他有価証券

時価のあるもの…中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

時価のないもの…移動平均法による原価法

２．固定資産の減価償却の方法

（1）有形固定資産

定率法によっております。但し、建物(建物附属設備を除く)については、定額法によっております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物　３～50年

器具備品　３～20年

（2）無形固定資産

定額法によっております。

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

３．引当金の計上基準

（1）賞与引当金

従業員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。

追加情報

第27期中間会計期間 （自 平成23年４月１日 至 平成23年９月30日）
会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準 当中間会計期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月４日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月４日）を適用しております。

注 記 事 項

（中間貸借対照表関係）

第27期中間会計期間 （平成23年９月30日）
※１．有形固定資産の減価償却累計額 812,990千円
※２．消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債のその他に含めて表示しております。
３． 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行１行と当座借越契約を締結しております。 当中間会計期間末における当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。 当座借越極度額の総額 10,000,000千円 借入実行残高 － 差引額 10,000,000千円
４． 当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York)Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成27年６月までの賃借料総額60,830千円の支払保証を行っております。

（中間損益計算書関係）

第27期中間会計期間 （自 平成23年４月１日 至 平成23年９月30日）
※１．減価償却実施額 有形固定資産 66,377千円 無形固定資産 4,380千円
※２．営業外収益のうち主要なもの 受取利息 3,030千円

受取配当金　17,068**千円**

為替差益　6,222**千円**

※３．特別利益のうち主要なもの

受取和解金　108,451**千円**

（中間株主資本等変動計算書関係）

第27期中間会計期間
（自 平成23年４月１日 至 平成23年９月30日）

１．発行済株式数に関する事項

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

２．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23年6月24日定時株主総会	普通株式	1,252,440	71,000	平成23年3月31日	平成23年6月27日

（リース取引関係）

第27期中間会計期間
（自 平成23年４月１日 至 平成23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	672,143千円
１年超	621,833千円
合　計	1,293,976千円

（金融商品関係）

１．金融商品の時価等に関する事項

平成23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27期中間会計期間 （平成23年９月30日）			
区分	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金及び預金	15,908,684	15,908,684	－
(2) 未収委託者報酬	3,692,782	3,692,782	－
(3) 未収運用受託報酬	419,703	419,703	－
(4) 未収投資助言報酬	408,845	408,845	－
(5) 有価証券及び投資有価証券			
①満期保有目的の債券	3,999,550	3,999,200	△350
②その他有価証券	5,637,282	5,637,282	－
(6) 投資その他の資産			
①長期差入保証金	680,723	680,723	－
資産計	30,747,572	30,747,222	△350
(1) 未払金			
①未払手数料	2,068,789	2,068,789	－
負債計	2,068,789	2,068,789	－

（注１）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資 産

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

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

（5）有価証券及び投資有価証券

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

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

（6）投資その他の資産

①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

①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27期中間会計期間 （平成23年９月30日）	
内容	**中間貸借対照表計上額**
(1) 子会社株式	234,921
合計	234,921
(2) その他有価証券	
①非上場株式	298
②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)②その他有価証券」には含めておりません。

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

（有価証券関係）

１．満期保有目的の債券

（単位：千円）

第27期中間会計期間 （平成23年９月30日）			
区分	**中間貸借対照表計上額**	**時価**	**差額**
(1)中間貸借対照表日の時価が中間貸借対照表計上額を超えるもの	―	―	―
小計	―	―	―
(2)中間貸借対照表日の時価が中間貸借対照表計上額を超えないもの	3,999,550	3,999,200	△350
小計	3,999,550	3,999,200	△350
合計	3,999,550	3,999,200	△350

２．子会社株式及び関連会社株式

第27期中間会計期間

（平成23年９月30日）
子会社株式及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額 234,921千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

３．その他有価証券

（単位：千円）

第27期中間会計期間 （平成23年９月30日）			
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	96,513	90,990	5,523
小計	96,513	90,990	5,523
(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	5,540,768	6,036,063	△495,294
小計	5,540,768	6,036,063	△495,294
合計	5,637,282	6,127,053	△489,771

（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。また、上記の表中にある「中間貸借対照表計上額」は、減損処理後の帳簿価額です。当中間会計期間における減損処理額は301千円です。

（デリバティブ取引関係）

第27期中間会計期間 （自 平成23年４月１日 至 平成23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27期中間会計期間 （自 平成23年４月１日 至 平成23年９月30日）
該当事項はありません。

（資産除去債務等）

第27期中間会計期間 （自 平成23年４月１日 至 平成23年９月30日）

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

第27期中間会計期間
（自 平成23年４月１日 至 平成23年９月30日）

（セグメント情報）

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

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

（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	13,337,108	991,578	879,806	107,846	15,316,340

２．地域ごとの情報

(1) 売上高

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

(2) 有形固定資産

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

３．主要な顧客ごとの情報

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

（１株当たり情報）

第27期中間会計期間 （自 平成23年４月１日 至 平成23年９月30日）
１株当たり純資産額　1,539,767円16銭 １株当たり中間純利益　60,777円60銭 なお、潜在株式調整後１株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

（注）１株当たり純資産額の算定上の基礎

中間貸借対照表の純資産の部の合計額	27,161,492千円
普通株式に係る純資産額	27,161,492千円
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	1,072,117千円
普通株式に係る中間純利益	1,072,117千円
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27期中間会計期間 （自 平成23年４月１日 至 平成23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23年６月24日に開催された定時株主総会において、監査体制の見直しにより監査役の員数を１名減員し４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23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。

※関係当局の認可等を前提に、平成24年４月１日付で中央三井信託銀行株式会社および住友信託銀行株式会社と合併し、新商号を三井住友信託銀行株式会社とする予定です。

〔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23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23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23年３月17日	有価証券報告書
平成23年３月17日	有価証券届出書
平成23年９月16日	半期報告書
平成23年９月16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22年12月17日現在）	（平成23年12月19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	23,246	23,605
親投資信託受益証券	81,060,739,056	65,679,813,487
未収入金	2,915,609,997	58,879,999
流動資産合計	83,976,372,299	65,738,717,091
資産合計	83,976,372,299	65,738,717,091
負債の部		
流動負債		
未払解約金	2,915,609,997	58,879,999
未払受託者報酬	1,613,662	1,477,407
未払委託者報酬	1,411,946	1,292,723
その他未払費用	28,237	31,483
流動負債合計	2,918,663,842	61,681,612
負債合計	2,918,663,842	61,681,612

純資産の部		
元本等		
元本		
元本	103,818,160,031	103,660,315,095
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	△22,760,451,574	△37,983,279,616
元本等合計	81,057,708,457	65,677,035,479
純資産合計	81,057,708,457	65,677,035,479
負債純資産合計	83,976,372,299	65,738,717,091

（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22年12月17日ならびに平成23年12月19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22年12月１日 至 平成22年12月17日	自 平成23年12月１日 至 平成23年12月19日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券（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22年12月17日現在）	（平成23年12月19日現在）
１．受益権総数	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	平成23年12月19日現在における受益権の総数 103,660,315,095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 22,760,451,574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 37,983,279,616円
３．１単位当たり純資産額	0.7808円 （１万口＝7,808円）	0.6336円 （１万口＝6,336円）

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．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	自 平成23年12月１日 至 平成23年12月19日
	（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。	―――――――
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。	同 左

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。**	**（1）金融商品の内容** **1）有価証券** **同 左** **2）デリバティブ取引** **同 左** **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** **同 左**

３．金融商品に係るリスク管理体制	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。 また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限値、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。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、測定項目が上下限値（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。	同 左
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。	同 左

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項 目	（平成22年12月17日現在）	（平成23年12月19日現在）
１．貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同 左
２．時価の算定方法	（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。 （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。	（1）有価証券（親投資信託受益証券） 同 左 （2）派生商品評価勘定（デリバティブ取引） 同 左 （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 同 左

（デリバティブ取引に関する注記）

（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。

（平成23年12月19日現在）
平成23年12月19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。

（自 平成23年12月１日 至 平成23年12月19日）
該当事項はありません。

（その他の注記）

（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

（平成23年12月19日現在）	
期　　首	平成23年12月１日
期首元本額	104,135,014,350円
期首より平成23年12月19日現在までの追加設定元本額	370,842円
期首より平成23年12月19日現在までの一部解約元本額	475,070,097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）	68,288,431,574円	0.9618円	65,679,813,487円

（参考情報）

ＳＭＡＭ・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）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22年12月17日現在）	（平成23年12月19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	7,566,222,997	3,287,701,548
株式	315,867,721,675	272,221,917,982
派生商品評価勘定	58,097,850	11,850
未収入金	7,055,182,755	－
未収配当金	32,801,400	37,951,750
未収利息	10,364	4,503
前払金	－	111,161,000
流動資産合計	330,580,037,041	275,658,748,633
資産合計	330,580,037,041	275,658,748,633
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	－	111,641,150
前受金	58,563,000	－
未払金	17,070,000	26,565,000
未払解約金	3,446,748,571	124,934,816
流動負債合計	3,522,381,571	263,140,966
負債合計	3,522,381,571	263,140,966

純資産の部		
元本等		
元本		
元本	276,186,779,522	286,335,972,380
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	50,870,875,948	△10,940,364,713
元本等合計	327,057,655,470	275,395,607,667
純資産合計	327,057,655,470	275,395,607,667
負債純資産合計	330,580,037,041	275,658,748,633

（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22年12月17日ならびに平成23年12月19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22年12月１日 至 平成22年12月17日	自 平成23年12月１日 至 平成23年12月19日
１．有価証券の評価基準及び評価方法	株式（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。	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22年12月17日現在）	（平成23年12月19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。 担保資産 金額 株式 4,882,500,000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。 担保資産 金額 株式 4,476,600,000円
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 10,940,364,713円
３．受益権総数	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	平成23年12月19日現在における受益権の総数 286,335,972,380口
４．１単位当たり純資産額	1.1842円 （１万口＝11,842円）	0.9618円 （１万口＝9,618円）

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．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	自 平成23年12月１日 至 平成23年12月19日
	（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。	――――――
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。	同 左
２．金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	（1）金融商品の内容 1）有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式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。 当計算期間については、先物取引を行っております。 3）コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 （2）金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。	（1）金融商品の内容 1）有価証券 同 左 2）デリバティブ取引 同 左 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 同 左

３．金融商品に係るリスク管理体制	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。 また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限値、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。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、測定項目が上下限値（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。	同 左
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。	同 左

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項 目	（平成22年12月17日現在）	（平成23年12月19日現在）
１．貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同 左

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。**	**（1）有価証券（株式）** **同 左** **（2）派生商品評価勘定（デリバティブ取引）** **同 左** **（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** **同 左**

（デリバティブ取引に関する注記）

（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	うち１年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 (ＴＯＰＩＸ先物) 買　建	6,300,537,000 （6,301,002,150）	－ （－）	6,359,100,000	58,563,000 （58,097,850）
	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。

（平成23年12月19日現在）

１．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち１年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引 (ＴＯＰＩＸ先物) 買　建	3,302,291,000 (3,302,759,300)	－ (－)	3,191,130,000	△111,161,000 (△111,629,300)
	買建 合計	3,302,291,000 (3,302,759,300)	－ (－)	3,191,130,000	△111,161,000 (△111,629,300)

（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。

（自 平成23年12月１日 至 平成23年12月19日）

該当事項はありません。

（その他の注記）

（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

（平成23年12月19日現在）	
期　首	平成23年12月１日
期首元本額	286,916,852,202円
期首より平成23年12月19日現在までの追加設定元本額	67,082,518円
期首より平成23年12月19日現在までの一部解約元本額	647,962,340円
平成23年12月19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	8,515,440,946円
三井住友・ＤＣ年金バランス30（債券重点型）	461,654,340円
三井住友・ＤＣ年金バランス50（標準型）	2,249,542,607円
三井住友・ＤＣ年金バランス70（株式重点型）	1,462,127,678円
スミセイ・ＤＣバランスファンド（機動的資産配分型）	45,430,269円
スミセイ・ＤＣターゲットイヤーファンド2020	5,325,867円
スミセイ・ＤＣターゲットイヤーファンド2025	5,409,703円
スミセイ・ＤＣターゲットイヤーファンド2030	5,401,009円
スミセイ・ＤＣターゲットイヤーファンド2035	6,117,586円
スミセイ・ＤＣターゲットイヤーファンド2040	1,570,275円
スミセイ・ＤＣターゲットイヤーファンド2045	4,230,422円
国内株式指数ファンド（ＴＯＰＩＸ）	825,172,039円
三井住友・ＤＣ日本株式インデックスファンドＳ	998,902円
ＳＭＡＭ・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	68,288,431,574円
バランスファンドＶＡ(安定運用型)＜適格機関投資家限定＞	787,323,597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＞	53,473,841,058円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	17,954,510,290円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	7,933,123,089円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	26,821,885,743円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞	197,775,267円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞	587,814,602円
世界６資産バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	99,687,814円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞	2,488,258,646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＞	129,331,048円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	1,101,683,601円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	3,367,732,096円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞	5,089,165,548円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	11,512,157,794円
ＳＭＡＭ・バランスＶＡ株４０Ｔ＜適格機関投資家限定＞	1,359,449,493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）	11,390,157,953円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	233,973,336円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２０＜適格機関投資家専用＞	3,056,147,834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）	47,781,377,894円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞	343,493,918円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞	172,682,388円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞	59,432,377円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞	897,300,155円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	1,588,626,538円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｔ＜適格機関投資家専用＞	604,501,867円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	393,741,487円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ２＜適格機関投資家専用＞	162,299,455円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	34,033,554円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３０Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	374,160,606円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	3,725,429,747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）	568,930,681円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｔ２＜適格機関投資家専用＞	142,715,283円
ＳＭＡＭ・ＦＧ新興国重視型バランス20ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	20,061,983円
ＳＭＡＭ・ＦＧグローバルバランス25ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	6,312,421円
合 計	286,335,972,380円

（３）附属明細表

①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	114,000	175	19,950,000	
日本水産	368,200	260	95,732,000	
マルハニチロホールディングス	628,000	135	84,780,000	
サカタのタネ	45,300	1,062	48,108,600	
ホクト	31,000	1,695	52,545,000	
住石ホールディングス	68,900	66	4,547,400	
日鉄鉱業	81,000	303	24,543,000	
三井松島産業	208,000	136	28,288,000	
国際石油開発帝石	3,799	471,500	1,791,228,500	
日本海洋掘削	8,500	2,248	19,108,000	
関東天然瓦斯開発	27,000	384	10,368,000	
石油資源開発	44,300	2,932	129,887,600	
ショーボンドホールディングス	26,000	1,686	43,836,000	
ミライト・ホールディングス	87,100	575	50,082,500	
ダイセキ環境ソリューション	37	153,800	5,690,600	
間組	122,500	164	20,090,000	
東急建設	111,140	189	21,005,460	
コムシスホールディングス	150,600	782	117,769,200	
ミサワホーム	33,600	617	20,731,200	
高松コンストラクショングループ	24,000	1,200	28,800,000	
東建コーポレーション	11,680	2,570	30,017,600	
ヤマウラ	15,000	225	3,375,000	
大成建設	1,581,000	188	297,228,000	
大林組	939,000	320	300,480,000	
清水建設	958,000	307	294,106,000	

長谷工コーポレーション	1,974,500	51	100,699,500	
松井建設	34,000	303	10,302,000	
鹿島建設	1,470,000	226	332,220,000	
不動テトラ	231,400	142	32,858,800	
鉄建建設	193,000	87	16,791,000	
安藤建設	116,000	95	11,020,000	
太平工業	56,000	417	23,352,000	
西松建設	417,000	128	53,376,000	
三井住友建設	232,200	50	11,610,000	
大豊建設	94,000	93	8,742,000	
前田建設工業	194,000	271	52,574,000	
佐田建設	136,000	59	8,024,000	
ナカノフドー建設	25,000	162	4,050,000	
奥村組	295,000	306	90,270,000	
大和小田急建設	19,500	199	3,880,500	
東鉄工業	40,000	622	24,880,000	
イチケン	43,000	125	5,375,000	
淺沼組	118,000	60	7,080,000	
戸田建設	332,000	268	88,976,000	
熊谷組	242,000	66	15,972,000	
青木あすなろ建設	22,500	396	8,910,000	
北野建設	72,000	177	12,744,000	
植木組	47,000	169	7,943,000	
三井ホーム	42,000	382	16,044,000	
矢作建設工業	38,000	391	14,858,000	
ピーエス三菱	24,500	216	5,292,000	
大東建託	118,800	6,630	787,644,000	
新日本建設	38,800	197	7,643,600	
ＮＩＰＰＯ	71,000	742	52,682,000	
東亜道路工業	64,000	140	8,960,000	
前田道路	87,000	805	70,035,000	

日本道路	91,000	202	18,382,000	
東亜建設工業	276,000	127	35,052,000	
東洋建設	492,000	67	32,964,000	
五洋建設	402,000	222	89,244,000	
大林道路	38,000	172	6,536,000	
世紀東急工業	122,000	45	5,490,000	
福田組	55,000	228	12,540,000	
住友林業	214,800	662	142,197,600	
日本基礎技術	38,600	229	8,839,400	
日成ビルド工業	103,000	179	18,437,000	
エス・バイ・エル	164,000	179	29,356,000	
巴コーポレーション	40,700	274	11,151,800	
パナホーム	115,000	530	60,950,000	
大和ハウス工業	780,000	907	707,460,000	
ライト工業	66,700	385	25,679,500	
積水ハウス	879,000	674	592,446,000	
日特建設	95,000	97	9,215,000	
北陸電気工事	18,000	208	3,744,000	
ユアテック	42,000	370	15,540,000	
西部電気工業	28,000	342	9,576,000	
四電工	28,000	328	9,184,000	
中電工	44,000	808	35,552,000	
関電工	142,000	354	50,268,000	
きんでん	204,000	615	125,460,000	
東京エネシス	34,000	426	14,484,000	
トーエネック	46,000	406	18,676,000	
住友電設	25,700	436	11,205,200	
日本電設工業	55,000	730	40,150,000	
協和エクシオ	100,700	721	72,604,700	
新日本空調	25,900	419	10,852,100	
日本電話施設	49,000	250	12,250,000	

九電工	55,000	458	25,190,000	
三機工業	68,000	386	26,248,000	
日揮	291,000	1,773	515,943,000	
中外炉工業	103,000	265	27,295,000	
ヤマト	29,000	303	8,787,000	
太平電業	41,000	588	24,108,000	
高砂熱学工業	86,900	654	56,832,600	
三晃金属工業	41,000	220	9,020,000	
朝日工業社	31,000	330	10,230,000	
大氣社	48,000	1,615	77,520,000	
ダイダン	41,000	510	20,910,000	
日比谷総合設備	36,800	758	27,894,400	
東芝プラントシステム	51,000	738	37,638,000	
東洋エンジニアリング	168,000	269	45,192,000	
千代田化工建設	249,000	769	191,481,000	
新興プランテック	63,600	629	40,004,400	
日本製粉	187,000	332	62,084,000	
日清製粉グループ本社	284,000	920	261,280,000	
日東富士製粉	23,000	291	6,693,000	
昭和産業	121,000	237	28,677,000	
鳥越製粉	25,600	692	17,715,200	
協同飼料	125,000	89	11,125,000	
中部飼料	27,400	473	12,960,200	
日本配合飼料	120,000	109	13,080,000	
東洋精糖	63,000	94	5,922,000	
日本甜菜製糖	167,000	148	24,716,000	
三井製糖	116,000	268	31,088,000	
森永製菓	297,000	178	52,866,000	
中村屋	74,000	376	27,824,000	
江崎グリコ	112,000	847	94,864,000	
名糖産業	14,400	971	13,982,400	

不二家	193,000	160	30,880,000	
山崎製パン	229,000	1,014	232,206,000	
第一屋製パン	71,000	83	5,893,000	
モロゾフ	45,000	266	11,970,000	
カルビー	17,300	3,600	62,280,000	
森永乳業	267,000	289	77,163,000	
ヤクルト本社	168,400	2,341	394,224,400	
明治ホールディングス	92,400	3,140	290,136,000	
雪印メグミルク	68,000	1,464	99,552,000	
プリマハム	185,000	117	21,645,000	
日本ハム	238,000	946	225,148,000	
伊藤ハム	176,000	303	53,328,000	
林兼産業	139,000	65	9,035,000	
丸大食品	144,000	273	39,312,000	
米久	27,000	717	19,359,000	
Ｓ Ｆｏｏｄｓ	16,500	632	10,428,000	
サッポロホールディングス	519,000	300	155,700,000	
アサヒグループホールディングス	586,000	1,689	989,754,000	
キリンホールディングス	1,254,000	916	1,148,664,000	
宝ホールディングス	264,000	480	126,720,000	
オエノンホールディングス	84,000	188	15,792,000	
養命酒製造	23,000	712	16,376,000	
三国コカ・コーラボトリング	27,900	685	19,111,500	
コカ・コーラウエスト	106,400	1,329	141,405,600	
コカ・コーラ セントラル ジャパン	34,000	1,002	34,068,000	
ダイドードリンコ	14,300	3,055	43,686,500	
伊藤園	94,800	1,304	123,619,200	
キーコーヒー	27,300	1,384	37,783,200	
ジャパンフーズ	4,700	755	3,548,500	
日清オイリオグループ	122,000	314	38,308,000	
不二製油	75,700	1,093	82,740,100	

Ｊ－オイルミルズ	120,000	212	25,440,000	
キッコーマン	255,000	865	220,575,000	
味の素	825,000	915	754,875,000	
キユーピー	155,600	1,080	168,048,000	
ハウス食品	109,000	1,451	158,159,000	
カゴメ	119,300	1,502	179,188,600	
焼津水産化学工業	12,500	702	8,775,000	
アリアケジャパン	29,200	1,431	41,785,200	
ニチレイ	352,000	367	129,184,000	
東洋水産	135,000	1,863	251,505,000	
日清食品ホールディングス	121,800	2,967	361,380,600	
永谷園	28,000	864	24,192,000	
フジッコ	30,000	943	28,290,000	
ロック・フィールド	13,900	1,258	17,486,200	
日本たばこ産業	6,921	364,000	2,519,244,000	
わらべや日洋	16,900	972	16,426,800	
なとり	12,300	815	10,024,500	
ミヨシ油脂	109,000	104	11,336,000	
片倉工業	38,000	703	26,714,000	
グンゼ	211,000	219	46,209,000	
東洋紡績	1,232,000	104	128,128,000	
ユニチカ	679,000	42	28,518,000	
富士紡ホールディングス	129,000	160	20,640,000	
日清紡ホールディングス	185,000	655	121,175,000	
倉敷紡績	295,000	145	42,775,000	
シキボウ	200,000	103	20,600,000	
日本毛織	98,000	527	51,646,000	
トーア紡コーポレーション	151,000	56	8,456,000	
ダイドーリミテッド	35,100	654	22,955,400	
帝国繊維	28,000	510	14,280,000	
帝人	1,194,000	233	278,202,000	

東レ	2,119,000	540	1,144,260,000	
サカイオーベックス	96,000	116	11,136,000	
住江織物	89,000	134	11,926,000	
日本フエルト	12,000	379	4,548,000	
イチカワ	26,000	144	3,744,000	
日本バイリーン	36,000	330	11,880,000	
日東製網	53,000	145	7,685,000	
芦森工業	77,000	105	8,085,000	
アツギ	219,000	91	19,929,000	
ダイニック	61,000	133	8,113,000	
セーレン	73,500	454	33,369,000	
小松精練	39,000	332	12,948,000	
ワコールホールディングス	173,000	993	171,789,000	
ホギメディカル	18,000	3,215	57,870,000	
レナウン	79,800	140	11,172,000	
クラウディア	3,700	999	3,696,300	
ＴＳＩホールディングス	129,600	359	46,526,400	
三陽商会	148,000	192	28,416,000	
オンワードホールディングス	181,000	534	96,654,000	
ルック	55,000	189	10,395,000	
ゴールドウイン	69,000	288	19,872,000	
デサント	72,000	402	28,944,000	
ヤマトインターナショナル	16,300	352	5,737,600	
特種東海製紙	184,000	168	30,912,000	
王子製紙	1,287,000	380	489,060,000	
三菱製紙	430,000	71	30,530,000	
北越紀州製紙	179,500	512	91,904,000	
中越パルプ工業	107,000	128	13,696,000	
巴川製紙所	56,000	165	9,240,000	
大王製紙	124,000	523	64,852,000	
日本製紙グループ本社	141,300	1,591	224,808,300	

レンゴー	236,000	549	129,564,000	
トーモク	88,000	199	17,512,000	
ザ・パック	16,400	1,150	18,860,000	
クラレ	464,000	1,070	496,480,000	
旭化成	1,698,000	447	759,006,000	
共和レザー	15,400	264	4,065,600	
コープケミカル	56,000	108	6,048,000	
昭和電工	1,823,000	157	286,211,000	
住友化学	2,008,000	284	570,272,000	
日本化成	61,000	134	8,174,000	
住友精化	56,000	327	18,312,000	
日産化学工業	221,000	720	159,120,000	
クレハ	191,000	356	67,996,000	
テイカ	50,000	279	13,950,000	
石原産業	512,000	89	45,568,000	
片倉チッカリン	24,000	189	4,536,000	
日本曹達	175,000	335	58,625,000	
東ソー	783,000	209	163,647,000	
トクヤマ	458,000	251	114,958,000	
セントラル硝子	281,000	353	99,193,000	
東亞合成	359,000	316	113,444,000	
ダイソー	117,000	240	28,080,000	
関東電化工業	69,000	276	19,044,000	
電気化学工業	614,000	281	172,534,000	
信越化学工業	523,700	3,650	1,911,505,000	
日本カーバイド工業	108,000	109	11,772,000	
堺化学工業	93,000	285	26,505,000	
エア・ウォーター	236,000	986	232,696,000	
大陽日酸	384,000	531	203,904,000	
日本化学工業	116,000	129	14,964,000	
日本パーカライジング	70,000	934	65,380,000	

高圧ガス工業	42,000	451	18,942,000	
チタン工業	35,000	384	13,440,000	
四国化成工業	42,000	414	17,388,000	
戸田工業	39,000	636	24,804,000	
ステラ ケミファ	14,500	2,293	33,248,500	
保土谷化学工業	63,000	234	14,742,000	
日本触媒	221,000	803	177,463,000	
大日精化工業	106,000	322	34,132,000	
カネカ	362,000	406	146,972,000	
三菱瓦斯化学	504,000	430	216,720,000	
三井化学	1,243,000	242	300,806,000	
ＪＳＲ	266,700	1,378	367,512,600	
東京応化工業	52,200	1,525	79,605,000	
三菱ケミカルホールディングス	1,823,000	420	765,660,000	
日本合成化学工業	59,000	420	24,780,000	
ダイセル	380,000	434	164,920,000	
住友ベークライト	252,000	430	108,360,000	
積水化学工業	608,000	616	374,528,000	
日本ゼオン	274,000	623	170,702,000	
アイカ工業	77,100	1,024	78,950,400	
宇部興産	1,226,000	200	245,200,000	
積水樹脂	39,000	710	27,690,000	
タキロン	66,000	265	17,490,000	
旭有機材工業	96,000	199	19,104,000	
日立化成工業	126,600	1,341	169,770,600	
ニチバン	28,000	245	6,860,000	
リケンテクノス	48,000	214	10,272,000	
大倉工業	74,000	240	17,760,000	
積水化成品工業	73,000	282	20,586,000	
群栄化学工業	77,000	192	14,784,000	
タイガースポリマー	18,200	291	5,296,200	

日本カーリット	23,400	384	8,985,600	
日本化薬	201,000	749	150,549,000	
日本精化	24,800	497	12,325,600	
ＡＤＥＫＡ	124,600	722	89,961,200	
日油	233,000	374	87,142,000	
ハリマ化成	25,700	600	15,420,000	
花王	774,900	2,007	1,555,224,300	
第一工業製薬	57,000	215	12,255,000	
三洋化成工業	89,000	487	43,343,000	
大日本塗料	183,000	79	14,457,000	
日本ペイント	274,000	547	149,878,000	
関西ペイント	330,000	687	226,710,000	
中国塗料	90,000	473	42,570,000	
日本特殊塗料	22,500	299	6,727,500	
藤倉化成	39,400	366	14,420,400	
太陽ホールディングス	23,900	1,915	45,768,500	
ＤＩＣ	1,125,000	127	142,875,000	
サカタインクス	58,000	323	18,734,000	
東洋インキＳＣホールディングス	257,000	278	71,446,000	
富士フイルムホールディングス	623,600	1,767	1,101,901,200	
資生堂	485,700	1,370	665,409,000	
ライオン	331,000	450	148,950,000	
高砂香料工業	95,000	352	33,440,000	
マンダム	29,500	1,938	57,171,000	
ミルボン	15,300	2,395	36,643,500	
ファンケル	72,900	1,049	76,472,100	
コーセー	46,800	1,819	85,129,200	
ドクターシーラボ	177	397,500	70,357,500	
ポーラ・オルビスホールディングス	30,500	2,015	61,457,500	
エステー	20,000	953	19,060,000	
コニシ	20,600	1,003	20,661,800	

長谷川香料	36,600	1,127	41,248,200	
小林製薬	40,300	3,900	157,170,000	
荒川化学工業	22,700	679	15,413,300	
メック	26,400	258	6,811,200	
日本高純度化学	83	214,800	17,828,400	
荏原ユージライト	5,000	1,890	9,450,000	
アース製薬	18,400	2,911	53,562,400	
イハラケミカル工業	49,000	275	13,475,000	
北興化学工業	29,000	212	6,148,000	
大成ラミック	6,700	2,389	16,006,300	
クミアイ化学工業	69,000	284	19,596,000	
日本農薬	67,000	315	21,105,000	
アキレス	231,000	103	23,793,000	
有沢製作所	52,400	288	15,091,200	
日東電工	241,000	2,802	675,282,000	
レック	9,400	1,100	10,340,000	
きもと	25,500	512	13,056,000	
藤森工業	21,700	1,065	23,110,500	
前澤化成工業	20,400	773	15,769,200	
ＪＳＰ	18,500	1,064	19,684,000	
エフピコ	13,000	5,170	67,210,000	
天馬	22,600	709	16,023,400	
信越ポリマー	57,800	323	18,669,400	
東リ	78,000	137	10,686,000	
ニフコ	64,900	2,067	134,148,300	
日本バルカー工業	114,000	194	22,116,000	
ユニ・チャーム	161,100	3,695	595,264,500	
協和発酵キリン	397,000	918	364,446,000	
武田薬品工業	1,093,500	3,225	3,526,537,500	
アステラス製薬	647,900	3,025	1,959,897,500	
大日本住友製薬	207,200	847	175,498,400	

塩野義製薬	457,300	965	441,294,500	
田辺三菱製薬	291,500	1,210	352,715,000	
わかもと製薬	40,000	234	9,360,000	
あすか製薬	36,000	463	16,668,000	
日本新薬	61,000	895	54,595,000	
中外製薬	338,500	1,248	422,448,000	
科研製薬	113,000	1,021	115,373,000	
エーザイ	359,700	3,065	1,102,480,500	
ロート製薬	123,000	961	118,203,000	
小野薬品工業	142,400	4,025	573,160,000	
久光製薬	90,100	3,150	283,815,000	
有機合成薬品工業	32,000	169	5,408,000	
持田製薬	98,000	844	82,712,000	
参天製薬	98,200	2,969	291,555,800	
扶桑薬品工業	99,000	204	20,196,000	
日本ケミファ	51,000	284	14,484,000	
ツムラ	79,800	2,210	176,358,000	
日医工	49,900	1,792	89,420,800	
キッセイ薬品工業	52,500	1,525	80,062,500	
生化学工業	54,900	803	44,084,700	
栄研化学	23,100	991	22,892,100	
日水製薬	8,100	670	5,427,000	
鳥居薬品	19,100	1,392	26,587,200	
東和薬品	15,100	3,210	48,471,000	
沢井製薬	19,300	7,750	149,575,000	
ゼリア新薬工業	42,000	1,271	53,382,000	
第一三共	982,400	1,456	1,430,374,400	
キョーリン製薬ホールディングス	71,000	1,348	95,708,000	
大幸薬品	14,800	785	11,618,000	
ダイト	9,300	1,127	10,481,100	
大塚ホールディングス	579,800	2,140	1,240,772,000	

大正製薬ホールディングス	70,100	5,680	398,168,000	
日本コークス工業	248,500	97	24,104,500	
昭和シェル石油	261,100	529	138,121,900	
コスモ石油	804,000	212	170,448,000	
ニチレキ	38,000	363	13,794,000	
東燃ゼネラル石油	436,000	865	377,140,000	
ユシロ化学工業	17,400	837	14,563,800	
ビーピー・カストロール	11,500	342	3,933,000	
ＡＯＣホールディングス	69,900	462	32,293,800	
ＭＯＲＥＳＣＯ	8,000	709	5,672,000	
出光興産	34,600	8,080	279,568,000	
ＪＸホールディングス	3,239,100	450	1,457,595,000	
横浜ゴム	353,000	424	149,672,000	
東洋ゴム工業	224,000	176	39,424,000	
ブリヂストン	914,700	1,686	1,542,184,200	
住友ゴム工業	227,700	891	202,880,700	
藤倉ゴム工業	19,000	287	5,453,000	
オカモト	103,000	298	30,694,000	
フコク	12,700	685	8,699,500	
ニッタ	29,400	1,336	39,278,400	
東海ゴム工業	54,700	869	47,534,300	
三ツ星ベルト	76,000	377	28,652,000	
バンドー化学	105,000	292	30,660,000	
日東紡績	214,000	289	61,846,000	
旭硝子	1,437,000	639	918,243,000	
日本板硝子	1,253,000	143	179,179,000	
石塚硝子	40,000	137	5,480,000	
日本山村硝子	111,000	190	21,090,000	
日本電気硝子	561,000	733	411,213,000	
オハラ	11,100	756	8,391,600	
住友大阪セメント	596,000	215	128,140,000	

太平洋セメント	1,705,000	141	240,405,000	
デイ・シイ	33,900	212	7,186,800	
日本ヒューム	23,000	280	6,440,000	
日本コンクリート工業	48,000	171	8,208,000	
東海カーボン	251,000	404	101,404,000	
日本カーボン	135,000	216	29,160,000	
東洋炭素	16,400	3,235	53,054,000	
ノリタケカンパニーリミテド	151,000	219	33,069,000	
ＴＯＴＯ	450,000	582	261,900,000	
日本碍子	380,000	871	330,980,000	
日本特殊陶業	251,000	930	233,430,000	
ＭＡＲＵＷＡ	8,800	3,615	31,812,000	
品川リフラクトリーズ	70,000	213	14,910,000	
黒崎播磨	66,000	231	15,246,000	
東京窯業	30,000	180	5,400,000	
ニッカトー	11,000	474	5,214,000	
フジミインコーポレーテッド	26,000	845	21,970,000	
エーアンドエーマテリアル	81,000	69	5,589,000	
ニチアス	131,000	413	54,103,000	
ニチハ	33,500	800	26,800,000	
新日本製鐵	7,665,000	185	1,418,025,000	
住友金属工業	5,417,000	134	725,878,000	
神戸製鋼所	4,059,000	118	478,962,000	
日新製鋼	1,044,000	109	113,796,000	
中山製鋼所	172,000	71	12,212,000	
合同製鐵	172,000	186	31,992,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	692,200	1,384	958,004,800	
東京製鐵	150,100	632	94,863,200	
共英製鋼	32,100	1,382	44,362,200	
大和工業	66,700	2,047	136,534,900	
東京鐵鋼	63,000	218	13,734,000	

大阪製鐵	18,400	1,318	24,251,200	
淀川製鋼所	206,000	327	67,362,000	
東洋鋼鈑	73,000	259	18,907,000	
住友鋼管	21,300	605	12,886,500	
丸一鋼管	89,700	1,658	148,722,600	
モリ工業	46,000	258	11,868,000	
大同特殊鋼	488,000	472	230,336,000	
日本高周波鋼業	131,000	83	10,873,000	
日本冶金工業	100,500	120	12,060,000	
山陽特殊製鋼	145,000	403	58,435,000	
愛知製鋼	155,000	357	55,335,000	
日立金属	192,000	804	154,368,000	
日本金属	85,000	136	11,560,000	
大平洋金属	207,000	371	76,797,000	
日本電工	105,000	347	36,435,000	
栗本鐵工所	151,000	152	22,952,000	
日本鋳鉄管	42,000	150	6,300,000	
三菱製鋼	179,000	200	35,800,000	
日亜鋼業	49,000	201	9,849,000	
日本精線	22,000	381	8,382,000	
シンニッタン	30,300	317	9,605,100	
新家工業	71,000	118	8,378,000	
日本軽金属	664,000	99	65,736,000	
大紀アルミニウム工業所	49,000	313	15,337,000	
三井金属鉱業	789,000	195	153,855,000	
東邦亜鉛	162,000	279	45,198,000	
三菱マテリアル	1,813,000	203	368,039,000	
住友金属鉱山	754,000	962	725,348,000	
ＤＯＷＡホールディングス	347,000	471	163,437,000	
古河機械金属	499,000	63	31,437,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	29,100	3,360	97,776,000	

東邦チタニウム	48,700	1,275	62,092,500	
住友軽金属工業	722,000	71	51,262,000	
古河スカイ	121,000	173	20,933,000	
古河電気工業	920,000	176	161,920,000	
住友電気工業	1,029,800	802	825,899,600	
フジクラ	435,000	224	97,440,000	
昭和電線ホールディングス	385,000	70	26,950,000	
タツタ電線	57,000	322	18,354,000	
日立電線	234,000	158	36,972,000	
沖電線	41,000	147	6,027,000	
平河ヒューテック	7,800	704	5,491,200	
リョービ	163,000	282	45,966,000	
アサヒホールディングス	40,400	1,503	60,721,200	
稲葉製作所	15,700	913	14,334,100	
宮地エンジニアリンググループ	109,000	152	16,568,000	
三協・立山ホールディングス	408,000	102	41,616,000	
トーカロ	17,500	1,579	27,632,500	
アルファＣｏ	10,700	834	8,923,800	
ＳＵＭＣＯ	157,200	566	88,975,200	
川田テクノロジーズ	8,100	1,005	8,140,500	
東洋製罐	203,400	1,026	208,688,400	
ホッカンホールディングス	74,000	218	16,132,000	
コロナ	14,600	1,284	18,746,400	
横河ブリッジホールディングス	59,000	487	28,733,000	
駒井ハルテック	67,000	176	11,792,000	
高田機工	30,000	180	5,400,000	
三和ホールディングス	293,000	229	67,097,000	
文化シヤッター	80,000	256	20,480,000	
住生活グループ	380,500	1,423	541,451,500	
日本フイルコン	27,100	387	10,487,700	
ノーリツ	58,000	1,382	80,156,000	

長府製作所	27,200	1,904	51,788,800	
リンナイ	46,500	5,240	243,660,000	
ダイニチ工業	16,000	713	11,408,000	
日東精工	46,000	210	9,660,000	
三洋工業	49,000	142	6,958,000	
岡部	55,200	391	21,583,200	
中国工業	69,000	85	5,865,000	
東プレ	56,500	719	40,623,500	
高周波熱錬	39,700	544	21,596,800	
東京製綱	188,000	151	28,388,000	
パイオラックス	12,300	1,719	21,143,700	
日本発條	212,100	669	141,894,900	
中央発條	44,000	252	11,088,000	
三益半導体工業	28,700	625	17,937,500	
アタカ大機	19,000	230	4,370,000	
日本製鋼所	451,000	507	228,657,000	
日立ツール	20,700	797	16,497,900	
三浦工業	42,800	2,146	91,848,800	
タクマ	104,000	321	33,384,000	
ツガミ	74,000	465	34,410,000	
オークマ	177,000	516	91,332,000	
東芝機械	162,000	369	59,778,000	
アマダ	410,000	463	189,830,000	
アイダエンジニアリング	77,200	344	26,556,800	
牧野フライス製作所	148,000	488	72,224,000	
オーエスジー	129,400	907	117,365,800	
ダイジェット工業	43,000	144	6,192,000	
旭ダイヤモンド工業	71,700	972	69,692,400	
森精機製作所	155,400	686	106,604,400	
ディスコ	29,700	3,975	118,057,500	
日東工器	15,900	1,700	27,030,000	

豊和工業	175,000	68	11,900,000	
島精機製作所	38,100	1,304	49,682,400	
日阪製作所	37,000	826	30,562,000	
やまびこ	12,500	809	10,112,500	
ペガサスミシン製造	31,800	202	6,423,600	
ナブテスコ	121,100	1,443	174,747,300	
三井海洋開発	24,700	1,258	31,072,600	
レオン自動機	27,000	177	4,779,000	
ＳＭＣ	87,100	12,080	1,052,168,000	
新川	24,000	381	9,144,000	
ホソカワミクロン	49,000	367	17,983,000	
ユニオンツール	15,700	1,333	20,928,100	
オイレス工業	32,300	1,442	46,576,600	
サトーホールディングス	29,800	928	27,654,400	
日本エアーテック	9,100	355	3,230,500	
日精樹脂工業	24,000	286	6,864,000	
ワイエイシイ	15,200	626	9,515,200	
小松製作所	1,382,800	1,798	2,486,274,400	
住友重機械工業	745,000	421	313,645,000	
日立建機	149,200	1,281	191,125,200	
日工	44,000	270	11,880,000	
巴工業	10,800	1,302	14,061,600	
井関農機	300,000	165	49,500,000	
ＴＯＷＡ	27,800	370	10,286,000	
丸山製作所	71,000	167	11,857,000	
北川鉄工所	146,000	133	19,418,000	
クボタ	1,336,000	616	822,976,000	
荏原実業	8,200	1,200	9,840,000	
三菱化工機	87,000	128	11,136,000	
月島機械	43,000	620	26,660,000	
帝国電機製作所	10,600	1,282	13,589,200	

新東工業	64,400	638	41,087,200	
澁谷工業	17,100	748	12,790,800	
アイチ コーポレーション	49,700	298	14,810,600	
小森コーポレーション	84,200	488	41,089,600	
鶴見製作所	22,000	552	12,144,000	
住友精密工業	44,000	497	21,868,000	
酒井重工業	55,000	135	7,425,000	
荏原製作所	480,000	265	127,200,000	
石井鐵工所	50,000	144	7,200,000	
酉島製作所	32,600	1,003	32,697,800	
ダイキン工業	355,300	2,099	745,774,700	
オルガノ	55,000	567	31,185,000	
トーヨーカネツ	166,000	142	23,572,000	
栗田工業	160,500	1,955	313,777,500	
椿本チエイン	148,000	400	59,200,000	
大同工業	64,000	125	8,000,000	
日本コンベヤ	106,000	74	7,844,000	
木村化工機	29,800	305	9,089,000	
アネスト岩田	47,000	304	14,288,000	
ダイフク	128,500	388	49,858,000	
加藤製作所	69,000	214	14,766,000	
油研工業	61,000	155	9,455,000	
タダノ	137,000	470	64,390,000	
フジテック	81,000	425	34,425,000	
シーケーディ	78,300	536	41,968,800	
キトー	141	55,900	7,881,900	
平和	60,500	1,335	80,767,500	
理想科学工業	20,700	1,076	22,273,200	
ＳＡＮＫＹＯ	84,500	3,830	323,635,000	
日本金銭機械	26,200	597	15,641,400	
マースエンジニアリング	15,200	1,319	20,048,800	

福島工業	7,900	897	7,086,300	
オーイズミ	17,000	270	4,590,000	
ダイコク電機	13,400	720	9,648,000	
アマノ	81,500	684	55,746,000	
ＪＵＫＩ	96,000	175	16,800,000	
サンデン	151,000	212	32,012,000	
蛇の目ミシン工業	296,000	53	15,688,000	
マックス	42,000	926	38,892,000	
グローリー	82,600	1,569	129,599,400	
大和冷機工業	41,000	388	15,908,000	
セガサミーホールディングス	300,400	1,640	492,656,000	
日本ピストンリング	110,000	149	16,390,000	
リケン	102,000	291	29,682,000	
ＴＰＲ	32,100	882	28,312,200	
ホシザキ電機	55,800	1,815	101,277,000	
大豊工業	19,100	660	12,606,000	
日本精工	621,000	481	298,701,000	
ＮＴＮ	647,000	296	191,512,000	
ジェイテクト	267,200	708	189,177,600	
不二越	282,000	323	91,086,000	
日本トムソン	90,000	429	38,610,000	
ＴＨＫ	186,100	1,492	277,661,200	
ユーシン精機	14,200	1,395	19,809,000	
前澤給装工業	11,300	1,031	11,650,300	
イーグル工業	36,000	594	21,384,000	
前澤工業	26,200	175	4,585,000	
日本ピラー工業	30,000	512	15,360,000	
キッツ	119,100	307	36,563,700	
日立工機	70,600	578	40,806,800	
マキタ	181,700	2,418	439,350,600	
日立造船	1,100,500	97	106,748,500	

三菱重工業	4,672,000	320	1,495,040,000	
ＩＨＩ	1,906,000	180	343,080,000	
イビデン	183,500	1,617	296,719,500	
コニカミノルタホールディングス	737,000	569	419,353,000	
ブラザー工業	360,000	940	338,400,000	
ミネベア	418,000	316	132,088,000	
日立製作所	6,258,000	403	2,521,974,000	
東芝	5,871,000	314	1,843,494,000	
三菱電機	2,786,000	704	1,961,344,000	
富士電機	843,000	212	178,716,000	
東洋電機製造	52,000	289	15,028,000	
安川電機	329,000	637	209,573,000	
シンフォニアテクノロジー	177,000	159	28,143,000	
明電舎	276,000	262	72,312,000	
オリジン電気	44,000	220	9,680,000	
デンヨー	27,000	1,026	27,702,000	
東芝テック	167,000	264	44,088,000	
芝浦メカトロニクス	55,000	204	11,220,000	
マブチモーター	37,200	3,260	121,272,000	
日本電産	150,800	6,500	980,200,000	
高岳製作所	118,000	169	19,942,000	
ダイヘン	165,000	268	44,220,000	
ＪＶＣケンウッド	173,400	284	49,245,600	
第一精工	7,100	2,177	15,456,700	
日新電機	57,000	422	24,054,000	
大崎電気工業	41,000	725	29,725,000	
オムロン	311,000	1,551	482,361,000	
日東工業	42,200	839	35,405,800	
ＩＤＥＣ	36,700	767	28,148,900	
エルピーダメモリ	374,000	364	136,136,000	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	535,000	408	218,280,000	

サクサホールディングス	73,000	111	8,103,000	
メルコホールディングス	16,000	2,067	33,072,000	
日本電気	3,833,000	157	601,781,000	
富士通	2,686,000	396	1,063,656,000	
沖電気工業	1,098,000	68	74,664,000	
岩崎通信機	139,000	69	9,591,000	
電気興業	89,000	339	30,171,000	
サンケン電気	147,000	250	36,750,000	
ナカヨ通信機	26,000	245	6,370,000	
アイホン	15,700	1,431	22,466,700	
ルネサスエレクトロニクス	75,400	470	35,438,000	
セイコーエプソン	190,200	1,001	190,390,200	
ワコム	561	120,000	67,320,000	
アルバック	51,900	960	49,824,000	
アクセル	13,100	1,571	20,580,100	
ナナオ	23,700	1,520	36,024,000	
日本信号	65,800	447	29,412,600	
京三製作所	57,000	304	17,328,000	
能美防災	37,000	516	19,092,000	
ホーチキ	25,000	372	9,300,000	
日本無線	64,000	177	11,328,000	
パナソニック	3,184,800	649	2,066,935,200	
シャープ	1,347,000	695	936,165,000	
アンリツ	132,000	833	109,956,000	
富士通ゼネラル	66,000	426	28,116,000	
日立国際電気	65,000	627	40,755,000	
ソニー	1,739,800	1,319	2,294,796,200	
ＴＤＫ	145,600	3,355	488,488,000	
帝国通信工業	62,000	119	7,378,000	
ミツミ電機	100,000	570	57,000,000	
タムラ製作所	91,000	185	16,835,000	

アルプス電気	221,700	520	115,284,000	
パイオニア	394,000	335	131,990,000	
日本電波工業	22,300	938	20,917,400	
日本トリム	3,550	1,873	6,649,150	
ローランド ディー．ジー．	12,800	851	10,892,800	
フォスター電機	26,500	1,045	27,692,500	
クラリオン	64,000	126	8,064,000	
ＳＭＫ	89,000	244	21,716,000	
ヨコオ	22,600	386	8,723,600	
東光	130,000	141	18,330,000	
ホシデン	75,200	524	39,404,800	
ヒロセ電機	48,400	6,690	323,796,000	
日本航空電子工業	65,000	526	34,190,000	
ＴＯＡ	33,000	469	15,477,000	
ユニデン	86,000	257	22,102,000	
アルパイン	54,600	820	44,772,000	
スミダコーポレーション	18,700	505	9,443,500	
アイコム	14,800	1,932	28,593,600	
船井電機	25,900	1,658	42,942,200	
横河電機	304,300	695	211,488,500	
新電元工業	101,000	312	31,512,000	
山武	71,000	1,595	113,245,000	
日本光電工業	55,500	1,785	99,067,500	
チノー	50,000	188	9,400,000	
共和電業	31,000	239	7,409,000	
日本電子材料	12,100	357	4,319,700	
堀場製作所	51,600	2,272	117,235,200	
アドバンテスト	208,400	757	157,758,800	
小野測器	36,000	206	7,416,000	
エスペック	29,300	456	13,360,800	
パナソニック電工ＳＵＮＸ	26,300	380	9,994,000	

キーエンス	62,200	18,270	1,136,394,000	
日置電機	13,700	1,326	18,166,200	
シスメックス	97,900	2,480	242,792,000	
メガチップス	23,300	1,164	27,121,200	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	21,500	888	19,092,000	
日本電産コパル電子	27,100	457	12,384,700	
ミヤチテクノス	15,500	633	9,811,500	
東京電波	11,600	353	4,094,800	
コーセル	39,700	1,065	42,280,500	
日立メディコ	21,000	752	15,792,000	
オプテックス	18,600	983	18,283,800	
千代田インテグレ	13,000	949	12,337,000	
東光電気	21,000	307	6,447,000	
スタンレー電気	186,800	1,082	202,117,600	
岩崎電気	109,000	163	17,767,000	
ウシオ電機	168,900	1,135	191,701,500	
岡谷電機産業	15,500	335	5,192,500	
ヘリオス テクノ ホールディング	32,700	140	4,578,000	
日本セラミック	17,900	1,403	25,113,700	
新神戸電機	22,000	1,703	37,466,000	
日本デジタル研究所	24,600	712	17,515,200	
古河電池	21,000	354	7,434,000	
双信電機	17,900	332	5,942,800	
図研	17,100	542	9,268,200	
日本電子	105,000	192	20,160,000	
カシオ計算機	266,500	467	124,455,500	
ファナック	290,200	11,830	3,433,066,000	
日本シイエムケイ	63,000	247	15,561,000	
エンプラス	14,800	1,447	21,415,600	
ローム	137,300	3,425	470,252,500	
浜松ホトニクス	107,800	2,662	286,963,600	

三井ハイテック	37,100	322	11,946,200	
新光電気工業	95,200	537	51,122,400	
京セラ	231,500	6,270	1,451,505,000	
太陽誘電	127,300	594	75,616,200	
村田製作所	292,700	3,990	1,167,873,000	
ユーシン	39,700	635	25,209,500	
双葉電子工業	46,400	1,209	56,097,600	
北陸電気工業	120,000	106	12,720,000	
ニチコン	88,000	810	71,280,000	
日本ケミコン	158,000	257	40,606,000	
ＫＯＡ	34,500	663	22,873,500	
市光工業	77,000	127	9,779,000	
小糸製作所	139,000	1,027	142,753,000	
ミツバ	52,000	556	28,912,000	
スター精密	46,300	694	32,132,200	
大日本スクリーン製造	266,000	589	156,674,000	
キヤノン電子	25,000	1,948	48,700,000	
キヤノン	1,731,200	3,395	5,877,424,000	
リコー	838,000	650	544,700,000	
日本電産サンキョー	64,000	483	30,912,000	
ＭＵＴＯＨホールディングス	33,000	194	6,402,000	
東京エレクトロン	234,600	3,835	899,691,000	
トヨタ紡織	98,200	777	76,301,400	
鬼怒川ゴム工業	65,000	655	42,575,000	
ユニプレス	44,100	2,102	92,698,200	
豊田自動織機	251,900	2,024	509,845,600	
モリタホールディングス	44,000	405	17,820,000	
三櫻工業	35,600	503	17,906,800	
デンソー	688,200	2,032	1,398,422,400	
東海理化電機製作所	64,700	1,114	72,075,800	
三井造船	1,081,000	117	126,477,000	

佐世保重工業	184,000	125	23,000,000	
川崎重工業	2,030,000	191	387,730,000	
日本車輌製造	98,000	285	27,930,000	
日本輸送機	40,000	207	8,280,000	
近畿車輛	42,000	231	9,702,000	
日産自動車	3,520,700	682	2,401,117,400	
いすゞ自動車	1,765,000	347	612,455,000	
トヨタ自動車	3,580,600	2,487	8,904,952,200	※
日野自動車	398,000	445	177,110,000	
三菱自動車工業	6,254,000	90	562,860,000	
エフテック	10,500	846	8,883,000	
武蔵精密工業	26,600	1,606	42,719,600	
トヨタ車体	46,400	1,117	51,828,800	
日産車体	78,000	733	57,174,000	
関東自動車工業	44,600	620	27,652,000	
新明和工業	123,000	313	38,499,000	
極東開発工業	48,400	488	23,619,200	
日信工業	50,300	1,038	52,211,400	
トピー工業	211,000	189	39,879,000	
ティラド	103,000	239	24,617,000	
曙ブレーキ工業	144,500	319	46,095,500	
タチエス	34,800	1,199	41,725,200	
ＮＯＫ	135,700	1,281	173,831,700	
フタバ産業	82,600	425	35,105,000	
カヤバ工業	195,000	340	66,300,000	
シロキ工業	63,000	215	13,545,000	
大同メタル工業	44,000	813	35,772,000	
プレス工業	131,000	356	46,636,000	
カルソニックカンセイ	168,000	428	71,904,000	
太平洋工業	58,000	358	20,764,000	
ケーヒン	57,800	1,214	70,169,200	

河西工業	36,000	391	14,076,000	
アイシン精機	229,000	2,106	482,274,000	
富士機工	34,000	205	6,970,000	
マツダ	2,320,000	132	306,240,000	
ダイハツ工業	258,000	1,335	344,430,000	
愛知機械工業	62,000	271	16,802,000	
今仙電機製作所	20,400	861	17,564,400	
本田技研工業	2,351,000	2,247	5,282,697,000	
スズキ	582,300	1,558	907,223,400	
富士重工業	881,000	447	393,807,000	
ヤマハ発動機	455,600	969	441,476,400	
ショーワ	61,000	415	25,315,000	
ＴＢＫ	30,000	354	10,620,000	
エクセディ	38,100	2,118	80,695,800	
豊田合成	78,000	1,190	92,820,000	
愛三工業	29,500	587	17,316,500	
ヨロズ	16,300	1,638	26,699,400	
エフ・シー・シー	45,300	1,487	67,361,100	
シマノ	105,400	3,590	378,386,000	
タカタ	50,500	1,485	74,992,500	
テイ・エス テック	58,300	1,087	63,372,100	
日本電産トーソク	14,000	848	11,872,000	
テルモ	219,600	3,695	811,422,000	
クリエートメディック	7,000	813	5,691,000	
日機装	95,000	628	59,660,000	
島津製作所	336,000	628	211,008,000	
ＪＭＳ	49,000	238	11,662,000	
長野計器	23,200	734	17,028,800	
ブイ・テクノロジー	43	328,000	14,104,000	
東京計器	118,000	148	17,464,000	
愛知時計電機	42,000	269	11,298,000	

東京精密	52,000	1,469	76,388,000	
ニコン	486,900	1,671	813,609,900	
トプコン	72,600	356	25,845,600	
オリンパス	277,900	915	254,278,500	
理研計器	27,400	546	14,960,400	
タムロン	25,400	1,893	48,082,200	
ＨＯＹＡ	679,600	1,599	1,086,680,400	
ノーリツ鋼機	31,200	343	10,701,600	
エー・アンド・デイ	35,000	262	9,170,000	
日本電産コパル	24,500	846	20,727,000	
シチズンホールディングス	338,400	430	145,512,000	
リズム時計工業	157,000	140	21,980,000	
大研医器	8,000	806	6,448,000	
セイコーホールディングス	176,000	168	29,568,000	
ニプロ	114,900	629	72,272,100	
パラマウントベッドホールディングス	24,200	2,059	49,827,800	
ＳＨＯ－ＢＩ	6,100	449	2,738,900	
ＳＲＩスポーツ	15,700	846	13,282,200	
バンダイナムコホールディングス	299,800	1,079	323,484,200	
共立印刷	44,900	213	9,563,700	
フランスベッドホールディングス	198,000	125	24,750,000	
パイロットコーポレーション	239	155,500	37,164,500	
トッパン・フォームズ	57,600	566	32,601,600	
フジシールインターナショナル	31,500	1,271	40,036,500	
タカラトミー	91,600	535	49,006,000	
タカノ	10,600	411	4,356,600	
プロネクサス	29,500	382	11,269,000	
ホクシン	33,200	146	4,847,200	
ウッドワン	52,000	250	13,000,000	
大建工業	117,000	225	26,325,000	
凸版印刷	844,000	553	466,732,000	

大日本印刷	845,000	738	623,610,000	
図書印刷	56,000	126	7,056,000	
共同印刷	91,000	179	16,289,000	
日本写真印刷	48,700	958	46,654,600	
光村印刷	26,000	240	6,240,000	
宝印刷	12,700	559	7,099,300	
アシックス	261,300	854	223,150,200	
ツツミ	14,100	1,800	25,380,000	
ローランド	28,600	669	19,133,400	
小松ウオール工業	9,300	797	7,412,100	
ヤマハ	204,700	697	142,675,900	
河合楽器製作所	113,000	140	15,820,000	
クリナップ	33,800	464	15,683,200	
ピジョン	24,800	2,966	73,556,800	
兼松日産農林	58,000	148	8,584,000	
キングジム	23,100	547	12,635,700	
リンテック	53,300	1,367	72,861,100	
イトーキ	63,900	168	10,735,200	
任天堂	159,500	10,590	1,689,105,000	
三菱鉛筆	22,900	1,364	31,235,600	
タカラスタンダード	126,000	561	70,686,000	
コクヨ	140,900	543	76,508,700	
ナカバヤシ	71,000	191	13,561,000	
グローブライド	156,000	90	14,040,000	
岡村製作所	100,000	527	52,700,000	
美津濃	138,000	378	52,164,000	
アデランス	36,600	936	34,257,600	
東京電力	2,025,600	230	465,888,000	
中部電力	922,000	1,434	1,322,148,000	
関西電力	1,140,800	1,148	1,309,638,400	
中国電力	388,200	1,320	512,424,000	

北陸電力	275,300	1,402	385,970,600	
東北電力	702,900	753	529,283,700	
四国電力	257,800	2,117	545,762,600	
九州電力	619,500	1,080	669,060,000	
北海道電力	263,600	1,088	286,796,800	
沖縄電力	17,500	3,330	58,275,000	
電源開発	175,200	1,956	342,691,200	
東京瓦斯	3,375,000	351	1,184,625,000	
大阪瓦斯	2,713,000	304	824,752,000	
東邦瓦斯	716,000	484	346,544,000	
北海道瓦斯	66,000	261	17,226,000	
西部瓦斯	325,000	205	66,625,000	
静岡瓦斯	77,000	501	38,577,000	
東武鉄道	1,586,000	381	604,266,000	
相鉄ホールディングス	441,000	234	103,194,000	
東京急行電鉄	1,643,000	378	621,054,000	
京浜急行電鉄	717,000	678	486,126,000	
小田急電鉄	889,000	729	648,081,000	
京王電鉄	774,000	534	413,316,000	
京成電鉄	444,000	563	249,972,000	
富士急行	79,000	442	34,918,000	
新京成電鉄	38,000	347	13,186,000	
東日本旅客鉄道	485,100	4,835	2,345,458,500	
西日本旅客鉄道	242,800	3,270	793,956,000	
東海旅客鉄道	2,421	643,000	1,556,703,000	
西日本鉄道	352,000	373	131,296,000	
ハマキョウレックス	8,400	2,372	19,924,800	
サカイ引越センター	6,000	1,612	9,672,000	
近畿日本鉄道	2,524,000	296	747,104,000	
阪急阪神ホールディングス	1,869,000	319	596,211,000	
南海電気鉄道	576,000	330	190,080,000	

京阪電気鉄道	622,000	365	227,030,000	
名糖運輸	10,600	591	6,264,600	
名古屋鉄道	961,000	200	192,200,000	
日本通運	1,105,000	290	320,450,000	
ヤマトホールディングス	567,000	1,252	709,884,000	
山九	341,000	276	94,116,000	
丸運	17,800	187	3,328,600	
丸全昭和運輸	90,000	242	21,780,000	
センコー	114,000	303	34,542,000	
トナミホールディングス	64,000	157	10,048,000	
日本梱包運輸倉庫	83,200	765	63,648,000	
日本石油輸送	39,000	184	7,176,000	
福山通運	165,000	448	73,920,000	
セイノーホールディングス	214,000	555	118,770,000	
神奈川中央交通	36,000	414	14,904,000	
日立物流	58,300	1,276	74,390,800	
日本郵船	2,222,000	187	415,514,000	
商船三井	1,470,000	272	399,840,000	
川崎汽船	882,000	132	116,424,000	
ＮＳユナイテッド海運	141,000	112	15,792,000	
乾汽船	43,300	265	11,474,500	
飯野海運	140,900	334	47,060,600	
共栄タンカー	48,000	121	5,808,000	
第一中央汽船	52,000	100	5,200,000	
全日本空輸	3,704,000	220	814,880,000	
パスコ	30,000	264	7,920,000	
国際航業ホールディングス	25,000	200	5,000,000	
日新	105,000	177	18,585,000	
三菱倉庫	196,000	818	160,328,000	
三井倉庫	131,000	274	35,894,000	
住友倉庫	203,000	354	71,862,000	

澁澤倉庫	72,000	210	15,120,000	
東陽倉庫	46,000	165	7,590,000	
日本トランスシティ	61,000	249	15,189,000	
ケイヒン	79,000	87	6,873,000	
安田倉庫	23,500	457	10,739,500	
東洋埠頭	85,000	119	10,115,000	
宇徳	26,600	238	6,330,800	
上組	306,000	648	198,288,000	
サンリツ	9,300	506	4,705,800	
キユーソー流通システム	9,700	860	8,342,000	
郵船ロジスティクス	23,100	956	22,083,600	
近鉄エクスプレス	25,000	2,270	56,750,000	
東海運	18,400	192	3,532,800	
ＮＥＣネッツエスアイ	26,200	1,128	29,553,600	
システナ	347	52,900	18,356,300	
新日鉄ソリューションズ	18,800	1,586	29,816,800	
コア	10,000	647	6,470,000	
ソフトクリエイト	4,100	1,048	4,296,800	
デジタルハーツ	28	154,000	4,312,000	
ＩＴホールディングス	85,000	918	78,030,000	
グリー	120,900	2,469	298,502,100	
コーエーテクモホールディングス	57,100	625	35,687,500	
三菱総合研究所	11,400	1,380	15,732,000	
ボルテージ	3,900	948	3,697,200	
ドワンゴ	145	124,000	17,980,000	
マクロミル	34,400	800	27,520,000	
ティーガイア	183	142,700	26,114,100	
GMOペイメントゲートウェイ	64	321,500	20,576,000	
ザッパラス	170	74,300	12,631,000	
インターネットイニシアティブ	167	273,000	45,591,000	
ソネットエンタテインメント	155	272,200	42,191,000	

ＳＲＡホールディングス	12,600	780	9,828,000	
ＪＢＩＳホールディングス	31,800	229	7,282,200	
朝日ネット	19,000	366	6,954,000	
パナソニック電工インフォメーションシステムズ	6,000	1,959	11,754,000	
フェイス	917	8,100	7,427,700	
野村総合研究所	156,300	1,709	267,116,700	
インテージ	8,100	1,396	11,307,600	
シンプレクス・ホールディングス	509	27,150	13,819,350	
クレスコ	8,700	643	5,594,100	
フジ・メディア・ホールディングス	2,865	112,100	321,166,500	
オービック	8,640	14,250	123,120,000	
ティーディーシーソフトウェアエンジニアリング	6,400	740	4,736,000	
ヤフー	20,223	23,900	483,329,700	
トレンドマイクロ	122,100	2,379	290,475,900	
日本オラクル	45,100	2,594	116,989,400	
アルファシステムズ	8,300	1,165	9,669,500	
フューチャーアーキテクト	325	30,850	10,026,250	
シーエーシー	19,700	631	12,430,700	
ソフトバンク・テクノロジー	7,300	598	4,365,400	
トーセ	7,700	516	3,973,200	
オービックビジネスコンサルタント	7,250	3,625	26,281,250	
伊藤忠テクノソリューションズ	32,900	3,350	110,215,000	
アイティフォー	36,500	266	9,709,000	
大塚商会	22,100	5,270	116,467,000	
サイボウズ	653	24,300	15,867,900	
電通国際情報サービス	18,200	761	13,850,200	
ウェザーニューズ	8,300	2,109	17,504,700	
ＣＩＪ	27,100	322	8,726,200	
WOWOW	84	175,700	14,758,800	
ネットワンシステムズ	626	188,800	118,188,800	
アルゴグラフィックス	9,400	993	9,334,200	

エイベックス・グループ・ホールディングス	52,600	947	49,812,200	
日本ユニシス	67,600	492	33,259,200	
兼松エレクトロニクス	17,300	778	13,459,400	
東京放送ホールディングス	164,500	946	155,617,000	
日本テレビ放送網	24,050	11,260	270,803,000	
テレビ朝日	685	122,300	83,775,500	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	2,117	38,050	80,551,850	
テレビ東京ホールディングス	17,300	994	17,196,200	
アイ・ティー・シーネットワーク	24,500	480	11,760,000	
イー・アクセス	2,216	17,690	39,201,040	
ＮＥＣモバイリング	9,400	2,437	22,907,800	
日本電信電話	1,266,300	3,860	4,887,918,000	
ＫＤＤＩ	4,271	486,000	2,075,706,000	
光通信	25,800	1,902	49,071,600	
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	22,668	136,100	3,085,114,800	
GMOインターネット	37,800	289	10,924,200	
学研ホールディングス	89,000	138	12,282,000	
ゼンリン	39,800	661	26,307,800	
昭文社	16,300	580	9,454,000	
角川グループホールディングス	26,500	2,661	70,516,500	
インプレスホールディングス	43,400	94	4,079,600	
アイネット	14,200	452	6,418,400	
松竹	181,000	722	130,682,000	
東宝	194,100	1,341	260,288,100	
東映	115,000	344	39,560,000	
葵プロモーション	14,500	390	5,655,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	1,703	241,800	411,785,400	
ＤＴＳ	28,500	868	24,738,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	91,100	1,532	139,565,200	
シーイーシー	16,300	356	5,802,800	
カプコン	53,800	1,799	96,786,200	

ジャステック	18,000	436	7,848,000	
ＳＣＳＫ	57,500	1,221	70,207,500	
日本システムウエア	10,200	298	3,039,600	
アイネス	34,600	515	17,819,000	
ＴＫＣ	21,000	1,551	32,571,000	
富士ソフト	37,100	1,312	48,675,200	
ＮＳＤ	52,800	598	31,574,400	
コナミ	125,000	2,274	284,250,000	
福井コンピュータ	8,200	337	2,763,400	
ＪＢＣＣホールディングス	20,600	515	10,609,000	
ソフトバンク	1,245,900	2,310	2,878,029,000	
ホウスイ	39,000	106	4,134,000	
インターニックス	14,500	363	5,263,500	
高千穂交易	9,400	809	7,604,600	
伊藤忠食品	6,500	2,697	17,530,500	
エレマテック	23,600	1,266	29,877,600	
ＪＡＬＵＸ	9,200	717	6,596,400	
トーメンデバイス	3,500	1,655	5,792,500	
双日	1,841,400	118	217,285,200	
アルフレッサ ホールディングス	72,000	3,110	223,920,000	
横浜冷凍	56,500	611	34,521,500	
神栄	43,000	159	6,837,000	
山下医科器械	2,200	941	2,070,200	
ラサ商事	13,100	335	4,388,500	
アルコニックス	7,800	1,488	11,606,400	
あい ホールディングス	45,800	338	15,480,400	
ダイワボウホールディングス	268,000	176	47,168,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	52,500	560	29,400,000	
ＵＫＣホールディングス	16,700	707	11,806,900	
ＴＯＫＡＩホールディングス	136,700	370	50,579,000	
ミタチ産業	8,800	373	3,282,400	

ＪＦＥ商事ホールディングス	185,000	310	57,350,000	
シップヘルスケアホールディングス	36,200	1,674	60,598,800	
富士興産	126,000	69	8,694,000	
協栄産業	42,000	148	6,216,000	
小野建	22,500	607	13,657,500	
佐鳥電機	21,000	455	9,555,000	
エコートレーディング	3,400	692	2,352,800	
伯東	14,800	727	10,759,600	
コンドーテック	9,200	896	8,243,200	
ナガイレーベン	36,300	976	35,428,800	
三菱食品	25,600	2,053	52,556,800	
松田産業	20,300	1,160	23,548,000	
メディパルホールディングス	298,100	785	234,008,500	
アドヴァン	17,300	650	11,245,000	
ＳＰＫ	5,900	1,300	7,670,000	
アズワン	17,800	1,544	27,483,200	
スズデン	6,200	492	3,050,400	
尾家産業	9,700	798	7,740,600	
シモジマ	17,200	979	16,838,800	
ドウシシャ	12,800	2,145	27,456,000	
高速	15,900	608	9,667,200	
黒田電気	33,100	798	26,413,800	
丸文	22,400	303	6,787,200	
ハピネット	15,600	679	10,592,400	
トーメンエレクトロニクス	12,700	896	11,379,200	
エクセル	12,000	716	8,592,000	
マルカキカイ	9,100	648	5,896,800	
ガリバーインターナショナル	8,910	3,010	26,819,100	
日本エム・ディ・エム	30,400	163	4,955,200	
進和	17,400	835	14,529,000	
ダイトエレクトロン	15,600	458	7,144,800	

シークス	18,200	975	17,745,000	
田中商事	12,900	401	5,172,900	
オーハシテクニカ	17,500	563	9,852,500	
マクニカ	14,700	1,629	23,946,300	
白銅	9,600	745	7,152,000	
伊藤忠商事	2,194,000	767	1,682,798,000	
丸紅	2,407,000	462	1,112,034,000	
高島	58,000	192	11,136,000	
Ｆ＆Ａアクアホールディングス	21,200	739	15,666,800	
長瀬産業	153,700	815	125,265,500	
蝶理	174,000	85	14,790,000	
豊田通商	305,500	1,312	400,816,000	
三共生興	44,800	252	11,289,600	
兼松	604,000	70	42,280,000	
ツカモトコーポレーション	75,000	85	6,375,000	
三井物産	2,374,600	1,160	2,754,536,000	
日本紙パルプ商事	136,000	271	36,856,000	
日立ハイテクノロジーズ	84,100	1,571	132,121,100	
カメイ	37,000	729	26,973,000	
東都水産	60,000	134	8,040,000	
スターゼン	85,000	227	19,295,000	
山善	107,000	540	57,780,000	
椿本興業	28,000	204	5,712,000	
住友商事	1,623,300	1,013	1,644,402,900	
内田洋行	69,000	207	14,283,000	
三菱商事	2,003,200	1,520	3,044,864,000	
第一実業	63,000	310	19,530,000	
キヤノンマーケティングジャパン	93,000	882	82,026,000	
西華産業	99,000	210	20,790,000	
佐藤商事	23,600	434	10,242,400	
菱洋エレクトロ	28,900	840	24,276,000	

東京産業	20,500	243	4,981,500	
ユアサ商事	291,000	111	32,301,000	
神鋼商事	62,000	176	10,912,000	
阪和興業	273,000	327	89,271,000	
カナデン	28,000	515	14,420,000	
菱電商事	34,000	431	14,654,000	
フルサト工業	16,700	598	9,986,600	
岩谷産業	302,000	252	76,104,000	
すてきナイスグループ	125,000	154	19,250,000	
昭光通商	107,000	127	13,589,000	
ニチモウ	46,000	161	7,406,000	
極東貿易	45,000	209	9,405,000	
イワキ	42,000	195	8,190,000	
三愛石油	63,000	318	20,034,000	
稲畑産業	71,200	452	32,182,400	
ＧＳＩクレオス	77,000	103	7,931,000	
明和産業	26,900	208	5,595,200	
東邦ホールディングス	89,700	1,019	91,404,300	
サンゲツ	48,000	1,936	92,928,000	
ミツウロコグループホールディングス	44,500	428	19,046,000	
シナネン	54,000	340	18,360,000	
伊藤忠エネクス	58,600	425	24,905,000	
サンリオ	70,000	3,735	261,450,000	
サンワテクノス	15,200	709	10,776,800	
リョーサン	44,300	1,595	70,658,500	
新光商事	29,000	598	17,342,000	
トーホー	52,000	303	15,756,000	
三信電気	38,600	590	22,774,000	
東陽テクニカ	38,600	765	29,529,000	
モスフードサービス	32,400	1,509	48,891,600	
加賀電子	29,100	793	23,076,300	

ソーダニッカ	24,000	334	8,016,000	
立花エレテック	16,800	676	11,356,800	
Ｐａｌｔａｃ	20,200	1,453	29,350,600	
太平洋興発	115,000	73	8,395,000	
ヤマタネ	155,000	109	16,895,000	
丸紅建材リース	43,000	142	6,106,000	
日鐵商事	56,000	198	11,088,000	
トラスコ中山	33,900	1,387	47,019,300	
オートバックスセブン	32,600	3,530	115,078,000	
加藤産業	39,500	1,464	57,828,000	
イノテック	19,100	511	9,760,100	
イエローハット	27,100	1,229	33,305,900	
富士エレクトロニクス	14,700	1,038	15,258,600	
ＪＫホールディングス	25,200	341	8,593,200	
日伝	10,600	2,617	27,740,200	
北沢産業	32,000	153	4,896,000	
杉本商事	14,600	684	9,986,400	
因幡電機産業	31,700	2,144	67,964,800	
住金物産	126,000	181	22,806,000	
ミスミグループ本社	102,000	1,674	170,748,000	
アルテック	23,600	194	4,578,400	
タキヒヨー	43,000	416	17,888,000	
スズケン	106,300	2,058	218,765,400	
ジェコス	20,800	296	6,156,800	
ローソン	86,600	4,575	396,195,000	
サンエー	8,800	3,035	26,708,000	
キリン堂	12,900	500	6,450,000	
カワチ薬品	19,400	1,518	29,449,200	
エービーシー・マート	39,400	2,857	112,565,800	
ハードオフコーポレーション	11,700	513	6,002,100	
アスクル	23,500	1,135	26,672,500	

ゲオホールディングス	471	77,800	36,643,800	
ポイント	23,830	3,275	78,043,250	
シー・ヴイ・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	980	14,602,000	
キャンドゥ	125	82,400	10,300,000	
パル	8,350	2,950	24,632,500	
エディオン	111,400	624	69,513,600	
サーラコーポレーション	25,000	465	11,625,000	
あみやき亭	34	186,200	6,330,800	
ひらまつ	120	62,800	7,536,000	
ゲンキー	2,800	1,734	4,855,200	
ハニーズ	25,810	1,159	29,913,790	
アルペン	17,600	1,363	23,988,800	
ビックカメラ	1,056	41,350	43,665,600	
ＤＣＭホールディングス	145,000	586	84,970,000	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	17,200	815	14,018,000	
Ｊ．フロント リテイリング	652,000	351	228,852,000	
ドトール・日レスホールディングス	42,500	986	41,905,000	
マツモトキヨシホールディングス	50,800	1,536	78,028,800	
物語コーポレーション	3,000	1,309	3,927,000	
ココカラファイン	28,300	2,013	56,967,900	
三越伊勢丹ホールディングス	547,500	778	425,955,000	
クリエイトＳＤホールディングス	10,000	1,567	15,670,000	
丸善ＣＨＩホールディングス	19,100	210	4,011,000	
ブックオフコーポレーション	18,300	688	12,590,400	
あさひ	16,100	1,605	25,840,500	
サークルKサンクス	59,300	1,237	73,354,100	
日本調剤	3,880	2,590	10,049,200	
コスモス薬品	13,900	3,805	52,889,500	
セブン&アイ・ホールディングス	1,150,400	2,096	2,411,238,400	
ツルハホールディングス	24,600	4,315	106,149,000	

サンマルクホールディングス	8,100	2,963	24,000,300	
フェリシモ	8,100	981	7,946,100	
トリドール	25,500	752	19,176,000	
クスリのアオキ	4,900	1,320	6,468,000	
メディカルシステムネットワーク	6,200	777	4,817,400	
総合メディカル	6,700	2,535	16,984,500	
はるやま商事	13,800	373	5,147,400	
カッパ・クリエイト	19,250	1,800	34,650,000	
ライトオン	23,800	589	14,018,200	
良品計画	29,700	3,600	106,920,000	
三城ホールディングス	36,200	591	21,394,200	
コナカ	37,300	538	20,067,400	
イオン北海道	18,000	333	5,994,000	
コジマ	39,200	508	19,913,600	
コーナン商事	28,900	1,230	35,547,000	
エコス	10,000	455	4,550,000	
ワタミ	32,600	1,820	59,332,000	
ドン・キホーテ	53,800	2,620	140,956,000	
メガネトップ	40,200	840	33,768,000	
西松屋チェーン	61,100	569	34,765,900	
ゼンショーホールディングス	105,400	1,017	107,191,800	
幸楽苑	14,400	1,180	16,992,000	
ハークスレイ	7,500	528	3,960,000	
サイゼリヤ	41,000	1,253	51,373,000	
ポプラ	7,100	446	3,166,600	
ユナイテッドアローズ	31,300	1,473	46,104,900	
ハイデイ日高	10,400	1,215	12,636,000	
京都きもの友禅	18,500	890	16,465,000	
コロワイド	90,500	523	47,331,500	
壱番屋	9,200	2,257	20,764,400	
トップカルチャー	9,200	358	3,293,600	

スギホールディングス	49,000	2,250	110,250,000	
スクロール	37,700	274	10,329,800	
ファミリーマート	84,700	3,035	257,064,500	
木曽路	30,800	1,443	44,444,400	
千趣会	49,500	517	25,591,500	
タカキュー	32,000	130	4,160,000	
ケーヨー	50,300	470	23,641,000	
上新電機	58,000	841	48,778,000	
日本瓦斯	27,000	1,120	30,240,000	
ベスト電器	91,000	186	16,926,000	
マルエツ	52,000	281	14,612,000	
ロイヤルホールディングス	44,900	920	41,308,000	
東天紅	27,000	112	3,024,000	
いなげや	28,800	890	25,632,000	
島忠	61,700	1,730	106,741,000	
チヨダ	36,800	1,307	48,097,600	
ライフコーポレーション	17,900	1,399	25,042,100	
カスミ	49,900	485	24,201,500	
リンガーハット	25,400	1,038	26,365,200	
さが美	40,000	88	3,520,000	
テンアライド	23,500	260	6,110,000	
ＡＯＫＩホールディングス	25,900	1,166	30,199,400	
オークワ	39,000	1,194	46,566,000	
コメリ	38,200	2,276	86,943,200	
青山商事	76,600	1,342	102,797,200	
しまむら	32,000	7,440	238,080,000	
ＣＦＳコーポレーション	25,500	333	8,491,500	
高島屋	374,000	574	214,676,000	
松屋	58,900	442	26,033,800	
エイチ・ツー・オー リテイリング	145,000	599	86,855,000	
ニッセンホールディングス	59,700	354	21,133,800	

パルコ	51,200	574	29,388,800	
丸井グループ	360,900	570	205,713,000	
原信ナルスホールディングス	14,900	1,250	18,625,000	
ダイエー	174,350	278	48,469,300	
イズミヤ	96,000	408	39,168,000	
イオン	970,400	1,055	1,023,772,000	
ユニー	206,500	681	140,626,500	
イズミ	83,000	1,255	104,165,000	
東武ストア	29,000	258	7,482,000	
平和堂	49,200	951	46,789,200	
フジ	30,800	1,811	55,778,800	
ヤオコー	11,900	2,593	30,856,700	
ゼビオ	33,800	1,770	59,826,000	
ケーズホールディングス	68,900	3,020	208,078,000	
Ｏｌｙｍｐｉｃ	17,900	699	12,512,100	
日産東京販売ホールディングス	53,000	136	7,208,000	
アインファーマシーズ	15,200	3,515	53,428,000	
元気寿司	9,700	933	9,050,100	
ヤマダ電機	134,170	5,440	729,884,800	
アークランドサカモト	18,700	1,445	27,021,500	
ニトリホールディングス	54,400	7,030	382,432,000	
グルメ杵屋	22,000	411	9,042,000	
愛眼	24,600	345	8,487,000	
吉野家ホールディングス	746	103,800	77,434,800	
松屋フーズ	11,400	1,524	17,373,600	
サガミチェーン	37,000	521	19,277,000	
プレナス	29,800	1,241	36,981,800	
ミニストップ	18,800	1,401	26,338,800	
アークス	35,866	1,412	50,642,792	
バロー	55,500	1,151	63,880,500	
ベルク	12,100	1,114	13,479,400	

大庄	13,000	976	12,688,000	
ファーストリテイリング	64,400	13,250	853,300,000	
サンドラッグ	52,000	2,289	119,028,000	
ヤマザワ	6,400	1,331	8,518,400	
やまや	5,800	1,014	5,881,200	
ベルーナ	36,250	573	20,771,250	
新生銀行	2,168,000	77	166,936,000	
あおぞら銀行	869,000	208	180,752,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	20,821,000	325	6,766,825,000	
りそなホールディングス	2,402,800	339	814,549,200	
三井住友トラスト・ホールディングス	5,399,000	228	1,230,972,000	
三井住友フィナンシャルグループ	2,080,500	2,160	4,493,880,000	
第四銀行	349,000	245	85,505,000	
北越銀行	286,000	151	43,186,000	
西日本シティ銀行	968,000	217	210,056,000	
札幌北洋ホールディングス	417,800	273	114,059,400	
千葉銀行	1,087,000	496	539,152,000	
横浜銀行	1,769,000	367	649,223,000	
常陽銀行	1,058,000	333	352,314,000	
群馬銀行	627,000	414	259,578,000	
武蔵野銀行	44,200	2,543	112,400,600	
千葉興業銀行	55,700	401	22,335,700	
筑波銀行	119,800	267	31,986,600	
東京都民銀行	53,300	896	47,756,800	
七十七銀行	435,000	330	143,550,000	
青森銀行	205,000	229	46,945,000	
秋田銀行	185,000	217	40,145,000	
山形銀行	165,000	367	60,555,000	
岩手銀行	18,800	3,225	60,630,000	
東邦銀行	236,000	217	51,212,000	
東北銀行	156,000	118	18,408,000	

みちのく銀行	145,000	141	20,445,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	1,116,000	330	368,280,000	
静岡銀行	830,000	797	661,510,000	
十六銀行	344,000	246	84,624,000	
スルガ銀行	270,000	690	186,300,000	
八十二銀行	505,000	447	225,735,000	
山梨中央銀行	167,000	312	52,104,000	
大垣共立銀行	358,000	247	88,426,000	
福井銀行	235,000	234	54,990,000	
北國銀行	326,000	265	86,390,000	
清水銀行	9,200	2,865	26,358,000	
滋賀銀行	255,000	515	131,325,000	
南都銀行	256,000	420	107,520,000	
百五銀行	243,000	305	74,115,000	
京都銀行	489,000	665	325,185,000	
三重銀行	113,000	172	19,436,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	1,930,000	148	285,640,000	
広島銀行	807,000	360	290,520,000	
山陰合同銀行	162,000	569	92,178,000	
中国銀行	223,000	1,049	233,927,000	
鳥取銀行	88,000	148	13,024,000	
伊予銀行	292,000	757	221,044,000	
百十四銀行	302,000	345	104,190,000	
四国銀行	200,000	281	56,200,000	
阿波銀行	238,000	520	123,760,000	
鹿児島銀行	172,000	532	91,504,000	
大分銀行	180,000	222	39,960,000	
宮崎銀行	185,000	192	35,520,000	
肥後銀行	210,000	447	93,870,000	
佐賀銀行	165,000	192	31,680,000	
十八銀行	178,000	190	33,820,000	

沖縄銀行	20,800	3,360	69,888,000	
琉球銀行	58,200	947	55,115,400	
八千代銀行	15,100	1,886	28,478,600	
みずほフィナンシャルグループ	35,361,000	104	3,677,544,000	
紀陽ホールディングス	1,083,000	117	126,711,000	
山口フィナンシャルグループ	273,000	726	198,198,000	
長野銀行	96,000	153	14,688,000	
名古屋銀行	252,000	237	59,724,000	
愛知銀行	9,900	4,305	42,619,500	
第三銀行	160,000	159	25,440,000	
中京銀行	116,000	197	22,852,000	
東日本銀行	136,000	160	21,760,000	
大光銀行	102,000	243	24,786,000	
愛媛銀行	174,000	223	38,802,000	
トマト銀行	112,000	126	14,112,000	
みなと銀行	255,000	145	36,975,000	
京葉銀行	222,000	379	84,138,000	
関西アーバン銀行	395,000	126	49,770,000	
栃木銀行	138,000	277	38,226,000	
北日本銀行	9,500	1,829	17,375,500	
東和銀行	293,000	92	26,956,000	
大東銀行	204,000	62	12,648,000	
トモニホールディングス	214,600	324	69,530,400	
フィデアホールディングス	165,500	194	32,107,000	
池田泉州ホールディングス	1,154,400	112	129,292,800	
ＳＢＩホールディングス	29,255	5,650	165,290,750	
ジャフコ	34,100	1,256	42,829,600	
大和証券グループ本社	2,727,000	240	654,480,000	
野村ホールディングス	5,960,100	245	1,460,224,500	
岡三証券グループ	236,000	232	54,752,000	
丸三証券	94,900	226	21,447,400	

東洋証券	110,000	103	11,330,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	315,000	210	66,150,000	
光世証券	85,000	56	4,760,000	
水戸証券	93,000	95	8,835,000	
いちよし証券	64,200	347	22,277,400	
松井証券	163,100	375	61,162,500	
だいこう証券ビジネス	19,500	241	4,699,500	
マネックスグループ	2,242	11,870	26,612,540	
カブドットコム証券	120,000	226	27,120,000	
極東証券	37,300	400	14,920,000	
岩井コスモホールディングス	28,800	232	6,681,600	
ＮＫＳＪホールディングス	575,600	1,482	853,039,200	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	821,900	1,415	1,162,988,500	
ソニーフィナンシャルホールディングス	264,000	1,138	300,432,000	
第一生命保険	14,702	77,300	1,136,464,600	
東京海上ホールディングス	1,044,000	1,739	1,815,516,000	
Ｔ＆Ｄホールディングス	1,003,300	713	715,352,900	
クレディセゾン	226,600	1,517	343,752,200	
芙蓉総合リース	27,400	2,632	72,116,800	
興銀リース	39,900	1,660	66,234,000	
東京センチュリーリース	74,000	1,446	107,004,000	
日本証券金融	121,800	342	41,655,600	
大阪証券金融	61,800	150	9,270,000	
ポケットカード	39,500	257	10,151,500	
リコーリース	20,800	1,672	34,777,600	
イオンクレジットサービス	124,700	1,183	147,520,100	
アコム	44,140	1,375	60,692,500	
プロミス	143,900	783	112,673,700	
ジャックス	186,000	240	44,640,000	
オリエントコーポレーション	430,500	70	30,135,000	
日立キャピタル	57,900	1,045	60,505,500	

オリックス	143,520	6,310	905,611,200	
三菱ＵＦＪリース	70,210	2,897	203,398,370	
ＮＥＣキャピタルソリューション	11,600	1,080	12,528,000	
日本駐車場開発	3,495	3,530	12,337,350	
昭栄	53,600	544	29,158,400	
野村不動産ホールディングス	132,300	1,124	148,705,200	
常和ホールディングス	6,400	1,239	7,929,600	
ヒューリック	89,700	828	74,271,600	
パーク２４	143,100	1,032	147,679,200	
三井不動産	1,221,000	1,132	1,382,172,000	
三菱地所	1,926,000	1,197	2,305,422,000	
平和不動産	267,500	156	41,730,000	
東京建物	528,000	233	123,024,000	
ダイビル	82,700	474	39,199,800	
サンケイビル	51,800	300	15,540,000	
東急不動産	555,000	292	162,060,000	
京阪神ビルディング	34,200	333	11,388,600	
住友不動産	660,000	1,390	917,400,000	
東宝不動産	31,800	393	12,497,400	
大京	432,000	150	64,800,000	
テーオーシー	109,700	342	37,517,400	
東京楽天地	48,000	271	13,008,000	
レオパレス２１	140,500	154	21,637,000	
フジ住宅	38,200	359	13,713,800	
空港施設	34,600	301	10,414,600	
住友不動産販売	10,330	2,995	30,938,350	
ゴールドクレスト	25,770	1,178	30,357,060	
東栄住宅	20,400	751	15,320,400	
日本エスリード	13,300	639	8,498,700	
東急リバブル	27,600	597	16,477,200	
飯田産業	33,600	574	19,286,400	

日神不動産	18,800	431	8,102,800	
アーネストワン	48,000	786	37,728,000	
タカラレーベン	23,800	462	10,995,600	
サンヨーハウジング名古屋	125	73,100	9,137,500	
イオンモール	125,500	1,665	208,957,500	
タクトホーム	171	61,700	10,550,700	
トーセイ	352	19,080	6,716,160	
エヌ・ティ・ティ都市開発	1,735	51,200	88,832,000	
日本空港ビルデング	89,200	979	87,326,800	
日本工営	94,000	275	25,850,000	
ネクスト	15,900	288	4,579,200	
日本M&Aセンター	61	421,500	25,711,500	
ノバレーゼ	55	52,000	2,860,000	
アコーディア・ゴルフ	1,210	56,500	68,365,000	
パソナグループ	289	72,800	21,039,200	
テンプホールディングス	40,000	680	27,200,000	
学情	14,000	252	3,528,000	
スタジオアリス	14,500	1,198	17,371,000	
シミック	10,400	1,259	13,093,600	
ＮＥＣフィールディング	22,600	954	21,560,400	
綜合警備保障	105,600	804	84,902,400	
カカクコム	45,800	2,840	130,072,000	
ルネサンス	20,300	377	7,653,100	
新日本科学	29,100	191	5,558,100	
エムスリー	232	337,000	78,184,000	
ベストブライダル	83	69,800	5,793,400	
ディー・エヌ・エー	131,100	2,250	294,975,000	
博報堂ＤＹホールディングス	36,690	4,270	156,666,300	
ぐるなび	21,800	829	18,072,200	
ジェイコムホールディングス	7,100	696	4,941,600	
ＰＧＭホールディングス	751	52,000	39,052,000	

イーピーエス	157	149,500	23,471,500	
アミューズ	7,000	970	6,790,000	
ＴＡＣ	24,600	165	4,059,000	
ケネディクス	3,305	11,200	37,016,000	
電通	264,700	2,251	595,839,700	
テイクアンドギヴ・ニーズ	1,506	4,725	7,115,850	
ぴあ	10,200	779	7,945,800	
イオンファンタジー	10,200	1,200	12,240,000	
みらかホールディングス	75,800	2,928	221,942,400	
アルプス技研	12,700	719	9,131,300	
サニックス	49,500	219	10,840,500	
オリエンタルランド	78,800	7,950	626,460,000	
ダスキン	88,300	1,490	131,567,000	
明光ネットワークジャパン	27,300	655	17,881,500	
ファルコＳＤホールディングス	16,800	852	14,313,600	
田谷	3,500	653	2,285,500	
ラウンドワン	94,900	470	44,603,000	
リゾートトラスト	45,800	1,088	49,830,400	
ビー・エム・エル	18,900	1,856	35,078,400	
ワタベウェディング	10,000	659	6,590,000	
もしもしホットライン	48,800	715	34,892,000	
東急コミュニティー	8,000	2,351	18,808,000	
リソー教育	3,317	4,460	14,793,820	
ウェアハウス	11,200	227	2,542,400	
ユー・エス・エス	38,000	6,800	258,400,000	
東京個別指導学院	22,200	135	2,997,000	
テー・オー・ダブリュー	6,400	474	3,033,600	
セントラルスポーツ	8,300	977	8,109,100	
リゾートソリューション	34,000	139	4,726,000	
エイチ・アイ・エス	30,100	1,999	60,169,900	
共立メンテナンス	14,300	1,377	19,691,100	

イチネンホールディングス	29,000	386	11,194,000	
建設技術研究所	16,600	530	8,798,000	
燦ホールディングス	3,200	1,371	4,387,200	
東京テアトル	134,000	103	13,802,000	
ホリプロ	9,100	758	6,897,800	
よみうりランド	61,000	239	14,579,000	
東京都競馬	233,000	105	24,465,000	
常磐興産	116,000	81	9,396,000	
カナモト	38,000	554	21,052,000	
東京ドーム	240,000	180	43,200,000	
トランス・コスモス	38,900	906	35,243,400	
乃村工藝社	59,000	223	13,157,000	
藤田観光	77,000	256	19,712,000	
日本管財	10,700	1,381	14,776,700	
トーカイ	11,900	1,647	19,599,300	
白洋舎	32,000	214	6,848,000	
セコム	282,500	3,455	976,037,500	
セントラル警備保障	11,600	781	9,059,600	
丹青社	36,000	197	7,092,000	
メイテック	46,500	1,423	66,169,500	
アサツー ディ・ケイ	51,100	2,015	102,966,500	
応用地質	30,600	865	26,469,000	
船井総合研究所	28,800	540	15,552,000	
進学会	10,600	284	3,010,400	
ベネッセホールディングス	90,300	3,565	321,919,500	
イオンディライト	32,800	1,545	50,676,000	
ナック	7,800	1,448	11,294,400	
ニチイ学館	56,700	886	50,236,200	
ダイセキ	47,000	1,322	62,134,000	
合 計	424,489,474		272,221,917,982	

※差入委託証拠金代用有価証券1,800,000株

（b）株式以外の有価証券

該当事項はありません。

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

「ＳＭＡＭ・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22年12月17日現在）	（平成23年12月19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	15,957	1,121
親投資信託受益証券	62,564,927,758	57,881,543,430
未収入金	3,385,000	999,999
流動資産合計	62,568,328,715	57,882,544,550
資産合計	62,568,328,715	57,882,544,550
負債の部		
流動負債		
未払解約金	3,399,999	999,999
未払受託者報酬	8,172,909	7,513,513
未払委託者報酬	8,172,848	7,513,448
流動負債合計	19,745,756	16,026,960
負債合計	19,745,756	16,026,960
純資産の部		
元本等		
元本		
元本	56,148,785,611	50,715,253,763
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	6,399,797,348	7,151,263,827
元本等合計	62,548,582,959	57,866,517,590
純資産合計	62,548,582,959	57,866,517,590
負債純資産合計	62,568,328,715	57,882,544,550

（注）「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、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22年12月17日ならびに平成23年12月19

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22年６月22日 至 平成22年12月17日	自 平成23年６月21日 至 平成23年12月19日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券（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22年12月17日現在）	（平成23年12月19日現在）
１．受益権総数	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	平成23年12月19日現在における受益権の総数 50,715,253,763口
２．１単位当たり純資産額	1.1140円 （１万口＝11,140円）	1.1410円 （１万口＝11,410円）

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．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	自 平成23年６月21日 至 平成23年12月19日
	（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。	―――――――――
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。	同 左
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。	（1）金融商品の内容 1）有価証券 同 左

	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）デリバティブ取引 同 左 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。	（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 同 左
３．金融商品に係るリスク管理体制	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。 また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限値、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。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、測定項目が上下限値（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。	同 左

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。	同 左

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項 目	（平成22年12月17日現在）	（平成23年12月19日現在）
１．貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同 左
２．時価の算定方法	（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。 （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。	（1）有価証券（親投資信託受益証券） 同 左 （2）派生商品評価勘定（デリバティブ取引） 同 左 （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 同 左

（デリバティブ取引に関する注記）

（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。

（平成23年12月19日現在）

平成23年12月19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。

（自 平成23年６月21日 至 平成23年12月19日）

該当事項はありません。

（その他の注記）

（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

（平成23年12月19日現在）	
期　　首	平成23年６月21日
期首元本額	51,507,648,326円
期首より平成23年12月19日現在までの追加設定元本額	706,769,420円
期首より平成23年12月19日現在までの一部解約元本額	1,499,163,983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	47,154,006,868円	1.2275円	57,881,543,430円

（参考情報）

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－ＢＰＩ）マザーファンド」の状況

（１）貸借対照表

対象年月日	（平成22年12月17日現在）	（平成23年12月19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	776,997,904	798,175,675
国債証券	124,035,347,180	117,806,840,450
地方債証券	11,479,099,285	11,278,048,365
特殊債券	18,242,063,795	17,509,670,506
社債券	14,565,665,810	11,093,670,940
未収入金	77,007,000	303,226,900
未収利息	820,887,736	788,434,329
前払費用	37,342,127	32,677,605
流動資産合計	170,034,410,837	159,610,744,770
資産合計	170,034,410,837	159,610,744,770
負債の部		
流動負債		
未払金	706,532,200	303,207,000
未払解約金	32,431,842	17,086,815
流動負債合計	738,964,042	320,293,815
負債合計	738,964,042	320,293,815
純資産の部		

元本等		
元本		
元本	141,333,052,840	129,763,047,142
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	27,962,393,955	29,527,403,813
元本等合計	169,295,446,795	159,290,450,955
純資産合計	169,295,446,795	159,290,450,955
負債純資産合計	170,034,410,837	159,610,744,770

（注）「国内債券（ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ）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22年12月17日ならびに平成23年12月19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22年６月22日 至 平成22年12月17日	自 平成23年６月21日 至 平成23年12月19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22年12月17日現在）	（平成23年12月19日現在）
１．受益権総数	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	平成23年12月19日現在における受益権の総数 129,763,047,142口
２．１単位当たり純資産額	1.1978円 （１万口＝11,978円）	1.2275円 （１万口＝12,275円）

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．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	自 平成23年６月21日 至 平成23年12月19日
	（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。	―
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。	同 左

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。**	**（1）金融商品の内容** **1）有価証券** **同 左** **2）デリバティブ取引** **同 左** **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** **同 左**

３．金融商品に係るリスク管理体制	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。 また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限値、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。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、測定項目が上下限値（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。	同 左
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。	同 左

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項 目	（平成22年12月17日現在）	（平成23年12月19日現在）
１．貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同 左

２．時価の算定方法	（1）有価証券（国債証券、地方債証券、特殊債券および社債券） 「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。 （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。	（1）有価証券（国債証券、地方債証券、特殊債券および社債券） 同 左 （2）派生商品評価勘定（デリバティブ取引） 同 左 （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 同 左

（デリバティブ取引に関する注記）

（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。

（平成23年12月19日現在）
平成23年12月19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。

（自 平成23年６月21日 至 平成23年12月19日）
該当事項はありません。

（その他の注記）

（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
ＳＭＡＭ・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
ＳＭＡＭ・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

（平成23年12月19日現在）	
期　首	平成23年６月21日
期首元本額	135,996,949,897円
期首より平成23年12月19日現在までの追加設定元本額	3,900,386,158円
期首より平成23年12月19日現在までの一部解約元本額	10,134,288,913円
平成23年12月19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	16,983,321,285円
ＳＭＡＭ・国内債券インデックス・ファンド	64,539,856,245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＞	1,085,862,744円
ＳＭＡＭ・年金国内債券パッシブファンド＜適格機関投資家限定＞	47,154,006,868円
合 計	129,763,047,142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）	155,000,000	167,849,500	
	第２回利付国債（４０年）	250,000,000	257,102,500	
	第３回利付国債（４０年）	260,000,000	266,643,000	
	第４回利付国債（４０年）	290,000,000	296,556,900	
	第２４７回利付国債（１０年）	745,000,000	751,272,900	
	第２５０回利付国債（１０年）	4,019,000,000	4,041,747,540	
	第２５３回利付国債（１０年）	4,057,000,000	4,161,548,890	
	第２５６回利付国債（１０年）	3,155,000,000	3,235,010,800	
	第２５８回利付国債（１０年）	3,180,000,000	3,262,393,800	
	第２６０回利付国債（１０年）	2,996,000,000	3,103,496,480	
	第２６３回利付国債（１０年）	3,635,000,000	3,777,019,450	
	第２６５回利付国債（１０年）	2,645,000,000	2,748,155,000	
	第２６８回利付国債（１０年）	3,010,000,000	3,134,975,200	
	第２７０回利付国債（１０年）	2,853,000,000	2,958,760,710	
	第２７２回利付国債（１０年）	3,290,000,000	3,430,384,300	
	第２７４回利付国債（１０年）	2,818,000,000	2,954,954,800	
	第２７７回利付国債（１０年）	2,714,000,000	2,862,944,320	
	第２８０回利付国債（１０年）	2,723,000,000	2,916,142,390	
	第２８２回利付国債（１０年）	2,756,000,000	2,933,762,000	
	第２８４回利付国債（１０年）	1,490,000,000	1,589,517,100	
	第２８５回利付国債（１０年）	1,284,000,000	1,372,506,120	
	第２８６回利付国債（１０年）	975,000,000	1,049,490,000	
	第２８８回利付国債（１０年）	1,213,000,000	1,301,185,100	
	第２８９回利付国債（１０年）	1,388,000,000	1,474,347,480	
	第２９０回利付国債（１０年）	1,242,000,000	1,312,818,840	
	第２９３回利付国債（１０年）	1,241,000,000	1,344,139,510	
	第２９６回利付国債（１０年）	1,066,000,000	1,134,437,200	

	第２９７回利付国債（１０年）	1,344,000,000	1,421,898,240	
	第３００回利付国債（１０年）	1,110,000,000	1,182,605,100	
	第３０１回利付国債（１０年）	338,000,000	359,811,140	
	第３０３回利付国債（１０年）	1,590,000,000	1,678,547,100	
	第３０５回利付国債（１０年）	2,140,000,000	2,238,889,400	
	第３０６回利付国債（１０年）	1,800,000,000	1,893,744,000	
	第３０８回利付国債（１０年）	1,540,000,000	1,605,696,400	
	第３０９回利付国債（１０年）	1,000,000,000	1,025,890,000	
	第３１０回利付国債（１０年）	2,040,000,000	2,070,804,000	
	第３１２回利付国債（１０年）	2,140,000,000	2,202,573,600	
	第３１３回利付国債（１０年）	1,800,000,000	1,864,602,000	
	第３１５回利付国債（１０年）	2,330,000,000	2,386,945,200	
	第３１７回利付国債（１０年）	2,040,000,000	2,068,213,200	
	第２回利付国債（３０年）	150,000,000	167,005,500	
	第４回利付国債（３０年）	160,000,000	191,169,600	
	第５回利付国債（３０年）	110,000,000	118,718,600	
	第７回利付国債（３０年）	180,000,000	197,109,000	
	第１０回利付国債（３０年）	210,000,000	185,274,600	
	第１１回利付国債（３０年）	150,000,000	148,134,000	
	第１２回利付国債（３０年）	170,000,000	179,795,400	
	第１４回利付国債（３０年）	250,000,000	277,792,500	
	第１５回利付国債（３０年）	130,000,000	147,041,700	
	第１６回利付国債（３０年）	270,000,000	305,680,500	
	第１８回利付国債（３０年）	240,000,000	262,675,200	
	第１９回利付国債（３０年）	170,000,000	186,029,300	
	第２１回利付国債（３０年）	212,000,000	231,508,240	
	第２２回利付国債（３０年）	209,000,000	236,483,500	
	第２３回利付国債（３０年）	111,000,000	125,811,840	
	第２４回利付国債（３０年）	200,000,000	226,292,000	
	第２５回利付国債（３０年）	295,000,000	322,370,100	
	第２６回利付国債（３０年）	299,000,000	332,733,180	

	第２７回利付国債（３０年）	356,000,000	403,746,720	
	第２８回利付国債（３０年）	411,000,000	466,431,570	
	第２９回利付国債（３０年）	570,000,000	635,179,500	
	第３０回利付国債（３０年）	410,000,000	447,879,900	
	第３１回利付国債（３０年）	470,000,000	502,462,900	
	第３２回利付国債（３０年）	610,000,000	663,997,200	
	第３３回利付国債（３０年）	640,000,000	653,107,200	
	第３４回利付国債（３０年）	670,000,000	711,794,600	
	第３５回利付国債（３０年）	290,000,000	294,669,000	
	第２３回利付国債（２０年）	10,000,000	10,936,900	
	第２５回利付国債（２０年）	50,000,000	54,429,500	
	第２８回利付国債（２０年）	350,000,000	404,162,500	
	第３０回利付国債（２０年）	450,000,000	507,834,000	
	第３２回利付国債（２０年）	150,000,000	171,514,500	
	第３３回利付国債（２０年）	230,000,000	267,598,100	
	第３５回利付国債（２０年）	315,000,000	363,103,650	
	第３７回利付国債（２０年）	230,000,000	265,024,400	
	第３９回利付国債（２０年）	223,000,000	252,181,780	
	第４０回利付国債（２０年）	492,000,000	549,603,360	
	第４２回利付国債（２０年）	400,000,000	457,260,000	
	第４３回利付国債（２０年）	710,000,000	830,245,600	
	第４６回利付国債（２０年）	289,000,000	322,477,760	
	第４８回利付国債（２０年）	368,000,000	420,329,600	
	第５０回利付国債（２０年）	223,000,000	242,864,840	
	第５２回利付国債（２０年）	210,000,000	232,686,300	
	第５４回利付国債（２０年）	275,000,000	307,076,000	
	第５６回利付国債（２０年）	270,000,000	296,060,400	
	第５８回利付国債（２０年）	200,000,000	217,148,000	
	第５９回利付国債（２０年）	290,000,000	308,577,400	
	第６１回利付国債（２０年）	150,000,000	148,276,500	
	第６３回利付国債（２０年）	216,000,000	231,426,720	

	第６４回利付国債（２０年）	280,000,000	302,512,000	
	第６５回利付国債（２０年）	340,000,000	367,070,800	
	第７０回利付国債（２０年）	490,000,000	555,086,700	
	第７２回利付国債（２０年）	530,000,000	581,765,100	
	第７４回利付国債（２０年）	418,000,000	458,228,320	
	第７５回利付国債（２０年）	490,000,000	536,403,000	
	第７８回利付国債（２０年）	390,000,000	416,859,300	
	第８２回利付国債（２０年）	583,000,000	637,014,950	
	第８４回利付国債（２０年）	604,000,000	651,359,640	
	第８５回利付国債（２０年）	762,000,000	829,764,660	
	第８８回利付国債（２０年）	589,000,000	655,633,570	
	第９０回利付国債（２０年）	498,000,000	547,361,760	
	第９２回利付国債（２０年）	475,000,000	514,928,500	
	第９３回利付国債（２０年）	577,000,000	616,611,050	
	第９５回利付国債（２０年）	606,000,000	672,011,580	
	第９７回利付国債（２０年）	540,000,000	590,398,200	
	第９９回利付国債（２０年）	674,000,000	726,160,860	
	第１００回利付国債（２０年）	633,000,000	689,963,670	
	第１０２回利付国債（２０年）	600,000,000	670,950,000	
	第１０５回利付国債（２０年）	627,000,000	672,846,240	
	第１０７回利付国債（２０年）	763,000,000	817,791,030	
	第１０９回利付国債（２０年）	780,000,000	811,621,200	
	第１１１回利付国債（２０年）	653,000,000	707,995,660	
	第１１３回利付国債（２０年）	970,000,000	1,035,591,400	
	第１１４回利付国債（２０年）	913,000,000	973,376,690	
	第１１６回利付国債（２０年）	880,000,000	951,192,000	
	第１１８回利付国債（２０年）	280,000,000	293,468,000	
	第１１９回利付国債（２０年）	700,000,000	711,851,000	
	第１２１回利付国債（２０年）	690,000,000	711,638,400	
	第１２２回利付国債（２０年）	400,000,000	405,972,000	
	第１２３回利付国債（２０年）	80,000,000	85,083,200	

	第１２４回利付国債（２０年）	780,000,000	816,527,400	
	第１２５回利付国債（２０年）	170,000,000	183,385,800	
	第１２６回利付国債（２０年）	140,000,000	146,407,800	
	第１２７回利付国債（２０年）	360,000,000	370,976,400	
	第１２８回利付国債（２０年）	370,000,000	380,552,400	
	第１２９回利付国債（２０年）	420,000,000	425,523,000	
	第１３０回利付国債（２０年）	520,000,000	526,130,800	
	第１３１回利付国債（２０年）	440,000,000	437,734,000	
	国債証券 小計	111,721,000,000	117,806,840,450	
地方債証券	第１回東京都公募公債（２０年）	200,000,000	206,776,000	
	第７回東京都公募公債（２０年）	100,000,000	108,950,000	
	第８回東京都公募公債（３０年）	100,000,000	104,379,000	
	第５８６回東京都公募公債	41,000,000	41,264,040	
	第５９７回東京都公募公債	200,000,000	201,210,000	
	第５９８回東京都公募公債	100,000,000	100,491,000	
	第５９９回東京都公募公債	100,000,000	101,473,000	
	第６０３回東京都公募公債	100,000,000	102,544,000	
	第６２９回東京都公募公債	100,000,000	104,439,000	
	第６５６回東京都公募公債	300,000,000	318,069,000	
	第６６０回東京都公募公債	200,000,000	213,062,000	
	第６６８回東京都公募公債	200,000,000	212,690,000	
	第６８１回東京都公募公債	200,000,000	209,526,000	
	平成１３年度第４回北海道公募公債	130,000,000	130,289,900	
	平成１６年度第１１回北海道公募公債	100,000,000	102,993,000	
	平成１９年度第９回北海道公募公債	200,000,000	213,062,000	
	第７回神奈川県公募公債（２０年）	200,000,000	217,342,000	
	第１２０回神奈川県公募公債	100,000,000	100,597,000	
	第１４７回神奈川県公募公債	200,000,000	216,484,000	
	第３１回大阪府公募公債（５年）	100,000,000	100,811,000	
	第４４回大阪府公募公債（５年）	200,000,000	204,072,000	

	第２６３回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	102,241,000	
	第２７３回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	103,213,000	
	第２９７回大阪府公募公債（１０年）	100,000,000	106,525,000	
	第３１１回大阪府公募公債（１０年）	250,000,000	266,442,500	
	平成１４年度第２回京都府公募公債	100,000,000	100,816,000	
	平成１５年度第３回京都府公募公債	100,000,000	102,627,000	
	第９回兵庫県公募公債（２０年）	100,000,000	106,749,000	
	平成１６年度第５回兵庫県公募公債	100,000,000	103,305,000	
	平成１６年度第１３回兵庫県公募公債	100,000,000	103,055,000	
	平成１７年度第４回兵庫県公募公債	200,000,000	206,546,000	
	平成１９年度第１８回兵庫県公募公債	100,000,000	106,030,000	
	平成１４年度第２回静岡県公募公債	100,000,000	100,763,000	
	平成１５年度第３回静岡県公募公債	100,000,000	102,239,000	
	平成１９年度第７回静岡県公募公債	100,000,000	107,621,000	
	平成２０年度第１回静岡県公募公債	100,000,000	109,055,000	
	平成２１年度第７回愛知県公募公債（１０年）	200,000,000	212,250,000	
	平成１６年度第２回広島県公募公債	100,000,000	103,911,000	
	平成１４年度第３回埼玉県公募公債	100,000,000	100,852,000	
	平成１７年度第４回埼玉県公募公債	200,000,000	207,906,000	
	平成１９年度第２回埼玉県公募公債	100,000,000	107,978,000	
	平成２１年度第２回埼玉県公募公債	146,000,000	155,430,140	
	平成１７年度第５回福岡県公募公債	100,000,000	104,677,000	
	平成２１年度第１３回福岡県公募公債	200,000,000	201,382,000	
	平成１７年度第１回千葉県公募公債	100,000,000	103,412,000	
	平成１８年度第２回新潟県公募公債	100,000,000	107,050,000	
	第１回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,692,000	
	第４回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,457,000	
	第１４回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,099,000	
	第１７回共同発行市場公募地方債	200,000,000	208,370,000	
	第２０回共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,280,000	
	第２３回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,237,000	

	第３０回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,630,000	
	第３１回共同発行市場公募地方債	100,500,000	104,984,310	
	第３６回共同発行市場公募地方債	200,000,000	210,456,000	
	第３８回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,128,000	
	第４０回共同発行市場公募地方債	200,000,000	215,590,000	
	第４７回共同発行市場公募地方債	300,000,000	321,000,000	
	第５１回共同発行市場公募地方債	200,000,000	215,650,000	
	第６６回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,281,000	
	第７５回共同発行市場公募地方債	300,000,000	320,820,000	
	平成１４年度第３回大阪市公募公債	125,000,000	125,771,250	
	平成１７年度第１０回大阪市公募公債	192,500,000	200,887,225	
	平成１９年度第７回大阪市公募公債	100,000,000	107,112,000	
	平成２１年度第４回大阪市公募公債	200,000,000	212,308,000	
	第１２回こ号名古屋市公募公債	100,000,000	100,520,000	
	第１２回あ号名古屋市公募公債	100,000,000	100,778,000	
	第４６４回名古屋市公募公債（１０年）	100,000,000	106,693,000	
	平成２１年度第１回京都市公募公債	100,000,000	106,005,000	
	平成１５年度第５回横浜市公募公債	100,000,000	102,383,000	
	第１６回横浜市公募公債（２０年）	100,000,000	109,549,000	
	平成１７年度第４回横浜市公募公債	300,000,000	314,049,000	
	平成１４年度第７回札幌市公募公債	100,000,000	100,677,000	
	平成１６年度第２回札幌市公募公債	100,000,000	103,315,000	
	平成１５年度第２回北九州市公募公債	100,000,000	102,596,000	
	平成１６年度第６回福岡市公募公債	100,000,000	103,185,000	
	平成１８年度第４回福岡市公募公債	100,000,000	106,616,000	
	平成１６年度第１回広島市公募公債	100,000,000	103,330,000	
	地方債証券 小計	10,785,000,000	11,278,048,365	
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	527,025,000	
	第７回政府保証日本政策投資銀行債券	103,000,000	105,505,990	
	第７回日本政策投資銀行債券	100,000,000	100,646,000	

	第１５回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	109,197,000	
	第１６回日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,300,000	
	第２２回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	110,608,000	
	第３９回日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,721,000	
	第４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,480,000	
	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	105,269,000	
	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	217,066,000	
	第１０回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	322,245,000	
	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	203,110,000	
	第１６回道路債券	200,000,000	201,792,000	
	第２２回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	201,876,000	
	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	214,302,000	
	第２７回道路債券	100,000,000	111,186,000	
	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	320,049,000	
	第３２回道路債券	100,000,000	111,197,000	
	第３７回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,722,000	
	第４２回道路債券	100,000,000	108,379,000	
	第４８回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	320,793,000	
	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	106,640,000	
	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	322,170,000	
	第７９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,995,000	
	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	105,699,000	
	第３１４回政府保証道路債券	100,000,000	100,845,000	
	第３２３回政府保証道路債券	100,000,000	102,654,000	
	第３２６回政府保証道路債券	100,000,000	102,741,000	
	第３２７回政府保証道路債券	150,000,000	154,611,000	
	第３２８回政府保証道路債券	100,000,000	103,179,000	
	第３３１回政府保証道路債券	200,000,000	208,542,000	
	第３３７回政府保証道路債券	100,000,000	103,324,000	
	第１回公営企業債券（５年）	100,000,000	100,925,000	
	第３回政府保証地方公共団体金融機構債券	700,000,000	742,315,000	

	第４回公営企業債券（２０年）	200,000,000	217,110,000	
	第９回公営企業債券	100,000,000	102,967,000	
	第１８回公営企業債券（２０年）	100,000,000	113,202,000	
	第１９回公営企業債券	100,000,000	106,830,000	
	第２２回公営企業債券（２０年）	200,000,000	218,574,000	
	第２８回公営企業債券	100,000,000	107,807,000	
	第８０９回政府保証公営企業債券	20,000,000	20,001,400	
	第８２０回政府保証公営企業債券	3,000,000	3,029,250	
	第８２３回政府保証公営企業債券	100,000,000	100,716,000	
	第８２４回政府保証公営企業債券	200,000,000	201,534,000	
	第８２８回政府保証公営企業債券	100,000,000	100,507,000	
	第８３１回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,532,000	
	第８４０回政府保証公営企業債券	200,000,000	206,968,000	
	第８５１回政府保証公営企業債券	400,000,000	414,000,000	
	第８５８回政府保証公営企業債券	100,000,000	104,699,000	
	第８６０回政府保証公営企業債券	300,000,000	315,735,000	
	第８６１回政府保証公営企業債券	100,000,000	105,311,000	
	第８６３回政府保証公営企業債券	400,000,000	429,012,000	
	第８７５回政府保証公営企業債券	300,000,000	320,439,000	
	第８７６回政府保証公営企業債券	101,000,000	109,037,580	
	第８８２回政府保証公営企業債券	100,000,000	106,647,000	
	第７回首都高速道路債券	100,000,000	102,286,000	
	第１９３回政府保証首都高速道路債券	200,000,000	207,076,000	
	第１９５回政府保証首都高速道路債券	200,000,000	207,082,000	
	第４回阪神高速道路債券	100,000,000	100,832,000	
	第１３６回政府保証阪神高速道路債券	100,000,000	102,430,000	
	第１２回中小企業債券	100,000,000	105,170,000	
	第１７６回政府保証中小企業債券	100,000,000	102,488,000	
	第１８４回政府保証中小企業債券	100,000,000	103,469,000	
	第１２回国際協力銀行債券	100,000,000	102,973,000	
	第２９回国際協力銀行債券	100,000,000	106,948,000	

	第３４１回東京交通債券	100,000,000	103,727,000	
	第１３回関西国際空港株式会社社債	100,000,000	106,030,000	
	第６回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	107,038,000	
	第１回貸付債権担保住宅金融公庫債券	46,886,000	48,793,791	
	第１回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	35,857,000	36,779,242	
	第１回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	48,973,000	51,564,651	
	第２回貸付債権担保住宅金融公庫債券	23,564,000	24,540,492	
	第２回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	37,151,000	38,259,957	
	第３回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	37,116,000	38,632,559	
	第５回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	39,237,000	40,756,256	
	第６回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	42,390,000	45,013,517	
	第７回貸付債権担保住宅金融公庫債券	32,045,000	33,288,986	
	第７回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	43,007,000	45,585,699	
	第８回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	43,989,000	46,411,914	
	第９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	34,263,000	35,158,292	
	第９回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	43,878,000	46,484,353	
	第１０回貸付債権担保住宅金融公庫債券	36,481,000	37,168,302	
	第１０回貸付債権担保Ｓ種住宅金融公庫債券	45,456,000	48,081,993	
	第１２回貸付債権担保住宅金融公庫債券	42,089,000	43,330,625	
	第１４回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	68,420,000	71,322,376	
	第１８回貸付債権担保住宅金融公庫債券	45,602,000	47,376,373	
	第２９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,362,000	87,002,418	
	第３０回貸付債権担保住宅金融公庫債券	59,744,000	61,137,827	
	第３２回貸付債権担保住宅金融公庫債券	63,935,000	65,436,833	
	第３２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,741,000	89,726,625	
	第３５回貸付債権担保住宅金融公庫債券	64,757,000	66,673,807	
	第３７回貸付債権担保住宅金融公庫債券	63,227,000	65,449,429	
	第３７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,878,000	94,176,787	
	第４０回貸付債権担保住宅金融公庫債券	62,872,000	65,303,888	
	第４２回貸付債権担保住宅金融公庫債券	62,364,000	66,496,238	
	第４３回貸付債権担保住宅金融公庫債券	61,722,000	65,595,672	

	第４３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,431,000	97,317,670	
	第４４回貸付債権担保住宅金融公庫債券	59,942,000	63,789,077	
	第４５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,022,000	99,244,498	
	第４８回貸付債権担保住宅金融公庫債券	63,838,000	67,938,314	
	第４９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,722,000	100,584,277	
	第５１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,561,000	100,546,018	
	第５５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,025,000	
	第２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,837,000	69,384,297	
	第３回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	51,601,000	54,149,573	
	第１２回政府保証国民生活債券	137,000,000	140,723,660	
	第５回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	103,261,000	
	い第６９７号商工債	100,000,000	101,908,000	
	い第６９８号商工債	200,000,000	204,016,000	
	い第７０７号商工債	100,000,000	102,531,000	
	い第７２３号商工債	100,000,000	100,456,000	
	い第６８８号農林債	400,000,000	403,416,000	
	い第６９８号農林債	100,000,000	101,959,000	
	い第７０４号農林債	100,000,000	102,125,000	
	い第７０７号農林債	200,000,000	204,920,000	
	い第７０９号農林債	100,000,000	102,100,000	
	い第７１２号農林債	100,000,000	101,578,000	
	い第７２０号農林債	200,000,000	201,796,000	
	第５８９回あおぞら債	200,000,000	200,034,000	
	第２４３回信金中金債（５年）	100,000,000	101,120,000	
	第２１９回信金中金債（５年）	200,000,000	202,256,000	
	第２２３回信金中金債（５年）	200,000,000	203,786,000	
	第２２５回信金中金債（５年）	200,000,000	203,528,000	
	第２３０回信金中金債（５年）	100,000,000	102,063,000	
	第２３６回信金中金債（５年）	200,000,000	203,144,000	
	第２３７回信金中金債（５年）	100,000,000	101,879,000	
	第２回韓国中小企業銀行	100,000,000	100,067,000	

	第１６回政府保証東日本高速道路債券	200,000,000	209,450,000	
	第１回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	205,630,000	
	第５回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	207,080,000	
	特殊債券 小計	16,779,960,000	17,509,670,506	
社債券	第12回ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポレーション	100,000,000	101,130,000	
	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	98,399,000	
	第１１回シティグループ・インク円貨社債（２００３）	100,000,000	98,523,000	
	第１５回シティグループ・インク円貨債券	100,000,000	99,631,000	
	第６回ザ・ベアー・スターンズ・カンパニーズ・インク	100,000,000	99,859,000	
	第4回バークレイズ・バンク・ピーエルシー円貨社債（2010）	100,000,000	97,480,000	
	第5回オーストラリア・コモンウェルス銀行円貨社債（2011）	100,000,000	98,381,000	
	第8回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	100,000,000	98,506,000	
	第10回コーペラティブ・セントラル・ライファイゼン・ボエレン	200,000,000	195,310,000	
	第4回ウォルマート・ストアーズ・インク円貨社債（2010）	100,000,000	100,815,000	
	ＨＳＢＣ銀行 ＰＬＣ 第１回円貨社債	100,000,000	98,697,000	
	ＨＳＢＣ銀行 ＰＬＣ 第２回円貨社債	100,000,000	96,401,000	
	第４回日本たばこ産業株式会社社債	100,000,000	100,855,000	
	第２３回住友化学工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,184,000	
	第３３回三菱化学株式会社無担保社債	100,000,000	106,177,000	
	第３８回三井化学株式会社無担保社債	100,000,000	100,426,000	
	第３０回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	114,584,000	
	第４６回株式会社神戸製鋼所無担保社債	100,000,000	107,178,000	
	第５０回株式会社東芝無担保社債	100,000,000	100,687,000	
	第４５回日本電気株式会社無担保社債	100,000,000	100,044,000	
	第１０回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	201,986,000	
	第２５回シャープ株式会社無担保社債	100,000,000	102,668,000	
	第２０回三洋電機株式会社無担保社債	100,000,000	104,278,000	
	第２２回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	107,950,000	
	第1回日本生命2011基金特定目的会社特定社債第1回－B	100,000,000	100,351,000	
	第５４回日産自動車株式会社無担保社債	100,000,000	101,137,000	

	第１回トヨタ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	114,277,000	
	第３回凸版印刷株式会社無担保社債	100,000,000	102,300,000	
	第４９回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	109,520,000	
	第５３回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	103,707,000	
	第３３回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	106,353,000	
	第６４回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	106,848,000	
	第６９回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	107,863,000	
	第３８回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	100,307,000	
	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	106,674,000	
	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	102,388,000	
	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	204,378,000	
	第２５回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債	100,000,000	99,486,000	
	第５７回株式会社東京三菱銀行無担保社債	100,000,000	109,586,000	
	第７２回株式会社東京三菱銀行無担保社債	100,000,000	102,309,000	
	第９２回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債	100,000,000	101,031,000	
	第１０４回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債	300,000,000	307,374,000	
	第６回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債	100,000,000	103,368,000	
	第４回株式会社りそな銀行無担保社債	100,000,000	109,013,000	
	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	101,956,000	
	第９回三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	101,768,000	
	第４回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	102,882,000	
	第８回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	103,774,000	
	第２０回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	107,402,000	
	第４２回株式会社三井住友銀行無担保社債	200,000,000	201,830,000	
	第４７回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	101,563,000	
	第８回株式会社みずほ銀行無担保社債	100,000,000	104,984,000	
	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	100,513,000	
	第２７回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	106,659,000	
	第４１回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,527,000	
	第１１３回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	104,572,000	
	第１１８回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	103,321,000	

	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	103,625,000	
	第１５回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,997,000	
	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	99,961,000	
	第２７回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	106,630,000	
	第６５回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	99,864,000	
	第２９回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	107,927,000	
	第２２回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	115,148,000	
	第７回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	115,269,000	
	第１９回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	111,541,000	
	第２４回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	104,960,000	
	第３２回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	109,850,000	
	第１０回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	107,657,000	
	第７回東海旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	109,949,000	
	第１３回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,260,000	
	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	102,143,000	
	第４８回日本電信電話株式会社電信電話債券	200,000,000	207,090,000	
	第５３回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	105,599,000	
	第１６回株式会社エヌ・ティ・ティ・ドコモ無担保社債	100,000,000	102,025,000	
	第４５７回東京電力株式会社社債	100,000,000	63,826,000	
	第５２８回東京電力株式会社社債	200,000,000	123,762,000	
	第５３６回東京電力株式会社社債	100,000,000	63,763,000	
	第５４１回東京電力株式会社社債	200,000,000	180,510,000	
	第５４７回東京電力株式会社社債	100,000,000	60,172,000	
	第４０６回中部電力株式会社社債	100,000,000	110,425,000	
	第４６９回中部電力株式会社社債	300,000,000	306,858,000	
	第４３３回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,797,000	
	第４４８回関西電力株式会社社債	100,000,000	106,820,000	
	第３０６回中国電力株式会社社債	100,000,000	112,939,000	
	第３３７回中国電力株式会社社債	43,000,000	43,270,040	
	第２７９回北陸電力株式会社社債	270,000,000	278,091,900	
	第３８３回東北電力株式会社社債	200,000,000	221,124,000	

	第２５３回四国電力株式会社社債	100,000,000	92,560,000	
	第３４３回九州電力株式会社社債	100,000,000	111,059,000	
	第３８８回九州電力株式会社社債	100,000,000	105,363,000	
	第２９２回北海道電力株式会社社債	100,000,000	105,841,000	
	第１０回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,796,000	
	第１２回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,827,000	
	第２０回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	103,692,000	
	第１９回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	107,510,000	
	社債券 小計	10,913,000,000	11,093,670,940	
合 計			157,688,230,261	

「ＳＭＡＭ・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）」の状況

（１）貸借対照表

対象年月日	（平成22年12月20日現在）	（平成23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	334,198	1,083,251
親投資信託受益証券	49,098,541,502	41,681,936,739
未収入金	17,449,998	－
未収利息	－	1
流動資産合計	49,116,325,698	41,683,019,991
資産合計	49,116,325,698	41,683,019,991
負債の部		
流動負債		
未払解約金	17,449,998	－
未払受託者報酬	1,572,342	1,356,075
未払委託者報酬	571,753	493,115
その他未払費用	34,920	34,820
流動負債合計	19,629,013	1,884,010
負債合計	19,629,013	1,884,010
純資産の部		
元本等		
元本		
元本	49,010,188,864	48,111,346,857
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	86,507,821	△6,430,210,876
元本等合計	49,096,696,685	41,681,135,981
純資産合計	49,096,696,685	41,681,135,981
負債純資産合計	49,116,325,698	41,683,019,991

（注）「ＳＭＡＭ・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22年12月20日ならびに平成23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22年12月１日 至 平成22年12月20日	自 平成23年12月１日 至 平成23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22年12月20日現在）	（平成23年12月20日現在）
１．受益権総数	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	平成23年12月20日現在における受益権の総数 48,111,346,857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 6,430,210,876円
３．１単位当たり純資産額	1.0018円 （１万口＝10,018円）	0.8663円 （１万口＝8,663円）

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．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	自 平成23年12月１日 至 平成23年12月20日
	（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。	――――――
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。	同 左

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。**	**（1）金融商品の内容** **1）有価証券** **同 左** **2）デリバティブ取引** **同 左** **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** **同 左**

３．金融商品に係るリスク管理体制	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。 また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限値、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。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、測定項目が上下限値（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。	同 左
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。	同 左

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項 目	（平成22年12月20日現在）	（平成23年12月20日現在）
１．貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同 左

２．時価の算定方法	（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。 （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。	（1）有価証券（親投資信託受益証券） 同 左 （2）派生商品評価勘定（デリバティブ取引） 同 左 （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 同 左

（デリバティブ取引に関する注記）

（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。

（平成23年12月20日現在）
平成23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。

（自 平成23年12月１日 至 平成23年12月20日）
該当事項はありません。

（その他の注記）

（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

（平成23年12月20日現在）	
期　首	平成23年12月１日

期首元本額	48,392,577,055**円**
期首より平成23年12月20日現在までの追加設定元本額	13,125,843**円**
期首より平成23年12月20日現在までの一部解約元本額	294,356,041**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	37,460,175,015円	1.1127円	41,681,936,739円

（参考情報）

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22年12月20日現在）	（平成23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	664,129,905	2,270,802,578
コール・ローン	887,588,956	371,330,601
株式	231,704,878,175	200,471,870,776
投資証券	4,099,490,024	3,897,818,124
派生商品評価勘定	18,787,057	591,987
未収入金	4,995,392,722	987,870,228
未収配当金	367,816,069	374,411,927
未収利息	1,215	508
差入委託証拠金	621,421,054	541,490,176
流動資産合計	243,359,505,177	208,916,186,905
資産合計	243,359,505,177	208,916,186,905
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	15,963,678	50,732,547
未払金	17,471,958	－
未払解約金	3,386,139,717	26,280,250
流動負債合計	3,419,575,353	77,012,797
負債合計	3,419,575,353	77,012,797

純資産の部		
元本等		
元本		
元本	186,633,553,887	187,695,103,314
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	53,306,375,937	21,144,070,794
元本等合計	239,939,929,824	208,839,174,108
純資産合計	239,939,929,824	208,839,174,108
負債純資産合計	243,359,505,177	208,916,186,905

（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22年12月20日ならびに平成23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22年12月１日 至 平成22年12月20日	自 平成23年12月１日 至 平成23年12月20日
１．有価証券の評価基準及び評価方法	株式および投資証券（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、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22年12月20日現在）	（平成23年12月20日現在）
１．受益権総数	平成22年12月20日現在における受益権の総数	平成23年12月20日現在における受益権の総数

	186,633,553,887口	187,695,103,314口
２．１単位当たり純資産額	1.2856円 （１万口＝12,856円）	1.1127円 （１万口＝11,127円）

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．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	自 平成23年12月１日 至 平成23年12月20日
	（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。	――――――
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。	同 左
２．金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	（1）金融商品の内容 1）有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式および投資証券を組み入れております。 2）デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。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。 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。	（1）金融商品の内容 1）有価証券 同 左 2）デリバティブ取引 同 左 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 同 左

３．金融商品に係るリスク管理体制	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。 また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限値、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。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、測定項目が上下限値（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。	同 左
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。	同 左

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項 目	（平成22年12月20日現在）	（平成23年12月20日現在）
１．貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同 左

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。**	**（1）有価証券（株式および投資証券）** **同 左** **（2）派生商品評価勘定（デリバティブ取引）** **同 左** **（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** **同 左**

（デリバティブ取引に関する注記）

（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

①株式関連

（単位：円）

区 分	種 類	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買 建				
	ＳＰ５００	2,574,016,712	―	2,577,085,632	3,068,920
		(30,613,900米ドル)	(―)	(30,650,400米ドル)	(36,500米ドル)
	ＤＪ ＥＵＲ	1,013,989,983	―	1,002,211,443	△ 11,778,540
		(9,183,860ユーロ)	(―)	(9,077,180ユーロ)	(△106,680ユーロ)
	ＦＴＳＥ	509,212,352	―	508,512,312	△ 700,040
		(3,909,800英ポンド)	(―)	(3,904,425英ポンド)	(△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。

②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	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。

①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。

②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。

（平成23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

①株式関連

（単位：円）

区 分	種 類	契約額等	うち1年超	時 価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買 建				
	ＳＰ５００	2,979,512,152	―	2,947,076,055	△ 32,436,097
		(38,184,188米ドル)	(―)	(37,768,500米ドル)	(△415,688米ドル)
	ＤＪ ＥＵＲ	981,912,231	―	968,228,655	△ 13,683,576
		(9,678,780ユーロ)	(―)	(9,543,900ユーロ)	(△134,880ユーロ)
	ＦＴＳＥ	551,720,054	―	547,896,374	△ 3,823,680
		(4,557,410英ポンド)	(―)	(4,525,825英ポンド)	(△31,585英ポンド)
	買建 合計	4,513,144,437	―	4,463,201,084	△ 49,943,353

（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。

②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	39,010,500	―	39,010,000	△500
	ユーロ	121,729,200	―	121,728,000	△1,200
	英ポンド	72,631,500	―	72,630,000	△1,500

	売建				
	米ドル	556,789,273	—	556,932,040	△142,767
	カナダドル	57,839,772	—	57,847,466	△7,694
	ユーロ	126,886,396	—	126,886,396	0
	英ポンド	100,944,406	—	100,952,746	△8,340
	スイスフラン	35,959,246	—	35,976,526	△17,280
	スウェーデンクローナ	10,344,542	—	10,340,865	3,677
	ノルウェークローネ	9,845,006	—	9,849,510	△4,504
	デンマーククローネ	6,161,455	—	6,162,358	△903
	オーストラリアドル	40,713,328	—	40,729,099	△15,771
	香港ドル	10,306,188	—	10,303,103	3,085
	シンガポールドル	10,476,884	—	10,480,394	△3,510
	買建 合計	233,371,200	—	233,368,000	△3,200
	売建 合計	966,266,496	—	966,460,503	△194,007

（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。

①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。

②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。

（自　平成23年12月１日　至　平成23年12月20日）

該当事項はありません。

（その他の注記）

（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

（平成23年12月20日現在）	
期　首	平成23年12月１日
期首元本額	189,363,992,089円
期首より平成23年12月20日現在までの追加設定元本額	70,274,955円
期首より平成23年12月20日現在までの一部解約元本額	1,739,163,730円
平成23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	4,065,453,257円
三井住友・ＤＣ年金バランス30（債券重点型）	205,195,689円
三井住友・ＤＣ年金バランス50（標準型）	861,698,617円
三井住友・ＤＣ年金バランス70（株式重点型）	517,877,772円
スミセイ・ＤＣバランスファンド（機動的資産配分型）	13,982,682円
スミセイ・ＤＣターゲットイヤーファンド2020	2,301,836円
スミセイ・ＤＣターゲットイヤーファンド2025	2,713,442円
スミセイ・ＤＣターゲットイヤーファンド2030	3,322,743円
スミセイ・ＤＣターゲットイヤーファンド2035	4,001,352円
スミセイ・ＤＣターゲットイヤーファンド2040	1,052,833円
スミセイ・ＤＣターゲットイヤーファンド2045	3,158,727円
外国株式指数ファンド	228,914,537円
三井住友・ＤＣ全海外株式インデックスファンド	613,025円
ＳＭＡＭ・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	37,460,175,015円
バランスファンドＶＡ(安定運用型)＜適格機関投資家限定＞	339,596,905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＞	23,205,219,511円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	10,415,119,754円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	6,051,621,545円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	23,618,769,140円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞	87,226,050円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞	345,472,031円
世界６資産バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	66,240,675円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞	2,479,308,267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＞	173,383,175円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	647,812,823円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	2,921,869,841円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞	4,491,186,641円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	7,504,757,323円
ＳＭＡＭ・バランスＶＡ株４０Ｔ＜適格機関投資家限定＞	1,212,761,933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）	3,250,383,386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）	10,090,110,422円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	626,882,095円

ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２０＜適格機関投資家専用＞	2,667,157,476**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）	42,534,027,497**円**
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞	98,746,082**円**
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞	59,771,274**円**
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞	22,090,718**円**
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞	259,142,780**円**
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	601,524,933**円**
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｔ＜適格機関投資家専用＞	525,099,194**円**
ＳＭＡＭ・ＦＧ新興国重視型バランス20ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	17,961,610**円**
ＳＭＡＭ・ＦＧグローバルバランス25ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	11,398,706**円**
合　計	187,695,103,314**円**

（３）附属明細表

①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	29,580	18.20	538,356.00	
ANADARKO PETROLEUM CORP	66,839	71.40	4,772,304.60	
APACHE CORPORATION	51,389	85.76	4,407,120.64	
ARCH COAL INC	29,777	13.68	407,349.36	
BAKER HUGHES INC	57,934	44.93	2,602,974.62	
CABOT OIL & GAS CORPORATION	13,600	72.05	979,880.00	
CAMERON INTERNATIONAL CORP	32,453	45.55	1,478,234.15	
CHESAPEAKE ENERGY CORPORATION	86,823	22.06	1,915,315.38	
CHEVRON CORPORATION	267,507	99.72	26,675,798.04	
CIMAREX ENERGY CO	10,950	59.80	654,810.00	
CONCHO RESOURCES INC	12,800	90.93	1,163,904.00	
CONOCOPHILLIPS	173,990	67.85	11,805,221.50	
CONSOL ENERGY INC	29,962	35.10	1,051,666.20	
CONTINENTAL RESOURCES, INC.	6,000	62.81	376,860.00	
DENBURY RESOURCES INC	51,246	14.36	735,892.56	
DEVON ENERGY CORPORATION	53,134	59.05	3,137,562.70	
DIAMOND OFFSHORE DRILLING,INC.	9,256	53.12	491,678.72	
EL PASO CORPORATION	101,718	25.13	2,556,173.34	
EOG RESOURCES INC	35,550	95.57	3,397,513.50	
EXXON MOBIL CORPORATION	649,162	79.53	51,627,853.86	
FMC TECHNOLOGIES INC	32,490	49.19	1,598,183.10	
HALLIBURTON CO	122,738	30.80	3,780,330.40	
HELMERICH & PAYNE INC	13,700	54.44	745,828.00	
HESS CORPORATION	41,315	53.08	2,193,000.20	
HOLLYFRONTIER CORP	28,400	21.94	623,096.00	

KINDER MORGAN INC	15,000	29.79	446,850.00	
KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	11,128	73.76	820,801.28	
MARATHON OIL CORP	94,903	26.45	2,510,184.35	
MARATHON PETROLEUM CORPORATION	48,189	31.94	1,539,156.66	
MURPHY OIL CORPORATION	24,397	50.85	1,240,587.45	
NABORS INDUSTRIES LTD	39,784	16.23	645,694.32	
NATIONAL-OILWELL VARCO INC.	56,807	63.84	3,626,558.88	
NEWFIELD EXPLORATION CO	17,287	35.89	620,430.43	
NOBLE CORPORATION	35,418	29.96	1,061,123.28	
NOBLE ENERGY INC	23,509	87.78	2,063,620.02	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	108,207	87.32	9,448,635.24	
PEABODY ENERGY CORP	36,753	31.33	1,151,471.49	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	14,235	81.34	1,157,874.90	
PLAINS EXPLORATION & PRODUCTION COMPANY	19,500	32.25	628,875.00	
RANGE RESOURCES CORPORATION	21,182	59.45	1,259,269.90	
ROWAN COMPANIES INC	17,745	29.12	516,734.40	
SCHLUMBERGER LTD	179,941	65.07	11,708,760.87	
SOUTHWESTERN ENERGY COMPANY	46,961	32.66	1,533,746.26	
SPECTRA ENERGY CORPORATION	86,763	29.19	2,532,611.97	
SUNOCO INC	16,794	38.66	649,256.04	
ULTRA PETROLEUM CORP	19,748	28.68	566,372.64	
VALERO ENERGY CORP	77,021	19.89	1,531,947.69	
WEATHERFORD INTL LTD	102,786	13.00	1,336,218.00	
WHITING PETROLEUM CORP	16,200	43.93	711,666.00	
WILLIAMS COS INC	78,047	30.79	2,403,067.13	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	28,949	81.40	2,356,448.60	
AIRGAS INC	9,800	76.24	747,152.00	
ALCOA INC	138,599	8.53	1,182,249.47	
ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	13,580	42.85	581,903.00	
BALL CORPORATION	20,906	34.58	722,929.48	
CELANESE CORPORATION	21,123	40.96	865,198.08	

CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	9,608	129.87	1,247,790.96	
CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	19,835	59.71	1,184,347.85	
CROWN HOLDINGS INC	19,100	32.49	620,559.00	
DOW CHEMICAL	157,356	25.74	4,050,343.44	
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	124,310	43.24	5,375,164.40	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	17,854	35.80	639,173.20	
ECOLAB INC	39,500	54.11	2,137,345.00	
FMC CORPORATION	9,300	83.24	774,132.00	
FREEPORT-MCMORAN COPPER-B	126,946	35.74	4,537,050.04	
INTERNATIONAL PAPER CO	56,038	27.35	1,532,639.30	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	10,692	51.31	548,606.52	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	38,400	31.20	1,198,080.00	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,943	73.85	438,890.55	
MEADWESTVACO CORP	23,215	28.15	653,502.25	
MONSANTO CO	71,555	67.45	4,826,384.75	
MOSAIC CO/THE	40,064	47.38	1,898,232.32	
NEWMONT MINING CORP	65,889	61.05	4,022,523.45	
NUCOR CORP	42,809	38.22	1,636,159.98	
OWENS-ILLINOIS INC	23,139	17.65	408,403.35	
PPG INDUSTRIES INC	21,313	79.13	1,686,497.69	
PRAXAIR INC	39,998	103.06	4,122,193.88	
ROCK-TENN COMPANY CL A	9,700	56.06	543,782.00	
SEALED AIR CORP	21,938	16.67	365,706.46	
SIGMA-ALDRICH	15,756	62.91	991,209.96	
UNITED STATES STEEL CORPORATION	20,109	23.85	479,599.65	
VULCAN MATERIALS CO	17,253	38.13	657,856.89	
WALTER ENERGY INC	8,300	58.60	486,380.00	
WEYERHAEUSER CO	71,393	16.29	1,162,991.97	
3M COMPANY	90,327	77.82	7,029,247.14	
AGCO CORP	11,954	40.32	481,985.28	
AMETEK INC	22,340	39.75	888,015.00	

BOEING CO	94,258	70.16	6,613,141.28	
CATERPILLAR INC	86,611	87.25	7,556,809.75	
COOPER INDUSTRIES PLC-CL-A	21,657	50.96	1,103,640.72	
CUMMINS INC	24,428	85.82	2,096,410.96	
DANAHER CORP	78,825	46.21	3,642,503.25	
DEERE & CO	55,233	73.56	4,062,939.48	
DOVER CORP	24,774	55.17	1,366,781.58	
EATON CORP	43,869	41.76	1,831,969.44	
EMERSON ELECTRIC CO	99,557	47.92	4,770,771.44	
FASTENAL COMPANY	36,768	41.48	1,525,136.64	
FIRST SOLAR,INC.	7,420	30.50	226,310.00	
FLOWSERVE CORPORATION	7,719	96.44	744,420.36	
FLUOR CORP	23,701	47.06	1,115,369.06	
GENERAL DYNAMICS CORP	41,017	62.46	2,561,921.82	
GENERAL ELECTRIC CO	1,415,345	16.86	23,862,716.70	
GOODRICH CORPORATION	16,406	122.86	2,015,641.16	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	98,613	52.29	5,156,473.77	
ILLINOIS TOOL WORKS	59,048	45.62	2,693,769.76	
INGERSOLL-RAND PLC	44,179	29.82	1,317,417.78	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	16,090	38.53	619,947.70	
JOY GLOBAL INC	13,780	73.05	1,006,629.00	
KBR,INC.	21,185	23.99	508,228.15	
L-3 COMMUNICATIONS HLDGS INC	13,910	64.05	890,935.50	
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	38,213	76.82	2,935,522.66	
MASCO CORP	44,766	9.02	403,789.32	
NORTHROP GRUMMAN CORP	34,713	55.16	1,914,769.08	
PACCAR INC	44,398	35.50	1,576,129.00	
PALL CORPORATION	15,876	55.47	880,641.72	
PARKER HANNIFIN CORPORATIOM	21,071	73.87	1,556,514.77	
PENTAIR INC	14,050	32.62	458,311.00	
PRECISION CASTPARTS CORP	19,147	156.00	2,986,932.00	

QUANTA SERVICES INC	26,059	20.50	534,209.50	
RAYTHEON COMPANY	46,677	45.58	2,127,537.66	
ROCKWELL AUTOMATION INC	18,698	72.09	1,347,938.82	
ROCKWELL COLLINS INC.	21,044	53.19	1,119,330.36	
ROPER INDUSTRIES INC	13,200	82.97	1,095,204.00	
SPX CORP	7,268	56.54	410,932.72	
TEXTRON INC	38,818	17.19	667,281.42	
TYCO INTERNATIONAL LTD	62,210	44.53	2,770,211.30	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	115,718	71.75	8,302,766.50	
URS CORPORATION	11,300	33.84	382,392.00	
WW GRAINGER INC	7,950	181.71	1,444,594.50	
XYLEM INC	24,566	24.25	595,725.50	
AVERY DENNISON CORP	13,362	26.80	358,101.60	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	4,180	317.77	1,328,278.60	
CINTAS CORP	14,713	30.67	451,247.71	
DUN & BRADSTREET CORP	7,001	70.36	492,590.36	
EQUIFAX INC	15,742	37.45	589,537.90	
IHS INC-CLASS A	5,400	82.95	447,930.00	
IRON MOUNTAIN INC	24,522	30.03	736,395.66	
MANPOWERGROUP	10,992	33.84	371,969.28	
NETFLIX INC	6,598	67.15	443,055.70	
NIELSEN HOLDINGS NV	12,400	28.35	351,540.00	
PITNEY BOWES INC	25,773	18.02	464,429.46	
REPUBLIC SERVICES INC	41,294	26.42	1,090,987.48	
ROBERT HALF INTL INC	17,591	26.65	468,800.15	
RR DONNELLEY & SONS CO	25,698	13.78	354,118.44	
STERICYCLE,INC.	11,071	76.38	845,602.98	
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	16,100	39.07	629,027.00	
WASTE MANAGEMENT INC	60,483	31.05	1,877,997.15	
C.H.ROBINSON WORLDWIDE,INC.	21,522	65.44	1,408,399.68	
CSX CORPORATION	146,418	20.24	2,963,500.32	

DELTA AIR LINES INC	29,020	8.51	246,960.20	
EXPEDITORS INTL WASH INC	28,778	39.28	1,130,399.84	
FEDEX CORP	39,904	81.35	3,246,190.40	
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	35,175	10.70	376,372.50	
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	12,900	43.53	561,537.00	
KANSAS CITY SOUTHERN	14,500	62.82	910,890.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	45,957	69.19	3,179,764.83	
SOUTHWEST AIRLINES	24,000	8.30	199,200.00	
UNION PACIFIC CORP	65,441	98.49	6,445,284.09	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	11,000	20.30	223,300.00	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	97,838	70.80	6,926,930.40	
AUTOLIV INC	11,200	48.23	540,176.00	
BORGWARNER INC	15,000	62.11	931,650.00	
FORD MOTOR COMPANY	474,219	10.02	4,751,674.38	
GENERAL MOTORS CO	105,873	19.05	2,016,880.65	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	31,234	13.11	409,477.74	
HARLEY-DAVIDSON INC	31,386	36.37	1,141,508.82	
JOHNSON CONTROLS INC	90,058	28.39	2,556,746.62	
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	14,000	28.89	404,460.00	
BEAM INC	18,802	48.77	916,973.54	
COACH INC	38,105	56.92	2,168,936.60	
D.R.HORTON INC	35,448	11.76	416,868.48	
FOSSIL INC	6,970	80.51	561,154.70	
GARMIN LTD	15,016	38.02	570,908.32	
HASBRO INC	16,914	32.78	554,440.92	
LEGGETT & PLATT INC	17,715	21.87	387,427.05	
LULULEMON ATHLETICA INC	13,880	45.11	626,126.80	
MATTEL INC	45,193	27.19	1,228,797.67	
MOHAWK INDUSTRIES INC	7,383	53.57	395,507.31	
NEWELL RUBBERMAID INC	39,644	14.67	581,577.48	
NIKE INC -CL B	47,928	93.38	4,475,516.64	

RALPH LAUREN CORPORATION	8,458	135.98	1,150,118.84	
STANLEY BLACK & DECKER INC	21,761	62.51	1,360,280.11	
TOLL BROTHERS INC	20,739	19.26	399,433.14	
VF CORP	11,625	129.49	1,505,321.25	
WHIRLPOOL CORP	10,584	45.37	480,196.08	
APOLLO GROUP INC-CL A	15,823	50.31	796,055.13	
CARNIVAL CORP	61,388	32.80	2,013,526.40	
DARDEN RESTAURANTS INC	18,340	43.13	791,004.20	
DEVRY INC	8,300	33.89	281,287.00	
H&R BLOCK INC	42,392	15.17	643,086.64	
INTL GAME TECHNOLOGY	38,160	15.46	589,953.60	
LAS VEGAS SANDS CORP	48,813	40.46	1,974,973.98	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	38,347	27.99	1,073,332.53	
MCDONALD’S CORPORATION	137,680	97.24	13,388,003.20	
MGM MIRAGE	43,400	9.02	391,468.00	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	18,071	24.63	445,088.73	
STARBUCKS CORP	100,123	43.63	4,368,366.49	
STARWOOD HOTELS & RESORTS	25,764	44.32	1,141,860.48	
WYNN RESORTS LTD	10,764	102.20	1,100,080.80	
YUM! BRANDS INC	62,624	57.60	3,607,142.40	
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	29,120	13.00	378,560.00	
CBS CORP-CL B	83,993	24.63	2,068,747.59	
COMCAST CORP-CL A	280,035	22.85	6,398,799.75	
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	87,291	22.71	1,982,378.61	
DIRECTV-CLASS A	98,498	41.68	4,105,396.64	
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-A	18,430	39.40	726,142.00	
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-C	16,530	36.18	598,055.40	
DISH NETWORK CORP.	28,664	25.14	720,612.96	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	63,525	9.03	573,630.75	
LIBERTY GLOBAL INC-A	19,340	38.86	751,552.40	
LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	14,963	37.96	567,995.48	

LIBERTY MEDIA CORP-CAPITAL	14,600	75.08	1,096,168.00	
MCGRAW-HILL COMPANIES INC	39,827	42.27	1,683,487.29	
NEWS CORP-CL A	244,205	16.76	4,092,875.80	
NEWS CORPORATION-CLASS B	60,131	17.33	1,042,070.23	
OMNICOM GROUP	37,569	41.16	1,546,340.04	
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	12,700	41.19	523,113.00	
SIRIUS XM RADIO INC	495,000	1.81	895,950.00	
THE WALT DISNEY CO.	234,638	34.75	8,153,670.50	
TIME WARNER CABLE,INC.	42,877	60.91	2,611,638.07	
TIME WARNER INC	139,547	33.54	4,680,406.38	
VIACOM INC-CLASS B	70,444	42.08	2,964,283.52	
VIRGIN MEDIA INC	40,677	20.66	840,386.82	
WASHINGTON POST CO B	667	350.53	233,803.51	
ABERCROMBIE & FITCH CO -CL A	11,471	45.14	517,800.94	
ADVANCE AUTO PARTS	10,138	66.99	679,144.62	
AMAZON.COM INC	48,317	179.49	8,672,418.33	
AUTOZONE INC	3,248	324.96	1,055,470.08	
BED BATH & BEYOND INC	33,407	60.68	2,027,136.76	
BEST BUY COMPANY INC	42,716	22.56	963,672.96	
CARMAX INC	30,922	30.14	931,989.08	
DOLLAR GENERAL CORP	22,500	40.47	910,575.00	
DOLLAR TREE INC	16,550	81.33	1,346,011.50	
EXPEDIA INC	26,183	27.57	721,865.31	
FAMILY DOLLAR STORES	15,636	57.16	893,753.76	
GAMESTOP CORP-CL A	18,347	22.67	415,926.49	
GAP INC/THE	53,905	17.76	957,352.80	
GENUINE PARTS CO	21,284	57.70	1,228,086.80	
HOME DEPOT INC	209,773	40.20	8,432,874.60	
J.C.PENNEY CO INC (HLDG CO)	21,097	32.28	681,011.16	
KOHLS CORP	35,198	48.14	1,694,431.72	
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION	74,772	15.25	1,140,273.00	

LIMITED BRANDS	34,473	37.70	1,299,632.10	
LOWE’S COMPANIES INC	167,937	24.72	4,151,402.64	
MACY’S INC	57,376	30.57	1,753,984.32	
NORDSTROM INC	23,535	46.90	1,103,791.50	
O’REILLY AUTOMOTIVE INC NEW	18,040	78.97	1,424,618.80	
ORCHARD SUPPLY HARDWARE-CL A-N	239	—	—	
ORCHARD SUPPLY-PFD-N	239	—	—	
PETSMART INC	15,091	50.34	759,680.94	
PRICELINE.COM INC	6,574	459.73	3,022,265.02	
ROSS STORES INC	16,036	46.25	741,665.00	
ROSS STORES INC NEW	16,036	46.25	741,665.00	
SEARS HOLDINGS CORP	5,310	45.15	239,746.50	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	12,210	84.30	1,029,303.00	
STAPLES INC	96,076	13.80	1,325,848.80	
TARGET CORP	86,138	51.45	4,431,800.10	
TIFFANY & CO	16,307	62.43	1,018,046.01	
TJX COMPANIES INC	50,625	61.52	3,114,450.00	
URBAN OUTFITTERS,INC.	16,700	26.14	436,538.00	
COSTCO WHOLESALE CORP	58,507	82.11	4,804,009.77	
CVS CAREMARK CORPORATION	180,431	36.56	6,596,557.36	
KROGER CO	75,287	23.50	1,769,244.50	
SAFEWAY INC	45,149	20.37	919,685.13	
SYSCO CORP	78,899	28.59	2,255,722.41	
WAL-MART STORES INC	253,028	57.78	14,619,957.84	
WALGREEN CO	120,982	32.75	3,962,160.50	
WHOLE FOODS MARKET INC	20,400	66.06	1,347,624.00	
ALTRIA GROUP INC	275,493	29.34	8,082,964.62	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	89,503	27.27	2,440,746.81	
BROWN-FORMAN CORPORATION	11,115	77.50	861,412.50	
BUNGE LIMITED	19,010	55.86	1,061,898.60	
CAMPBELL SOUP CO	25,679	32.51	834,824.29	

COCA-COLA CO/THE	275,787	67.37	18,579,770.19	
COCA-COLA ENTERPRISES INC	41,304	25.16	1,039,208.64	
CONAGRA FOODS INC	54,933	25.17	1,382,663.61	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	24,323	19.51	474,541.73	
DR.PEPPER SNAPPLE GROUP,INC	29,737	38.53	1,145,766.61	
GENERAL MILLS INC	85,790	39.59	3,396,426.10	
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTERS, INC.	16,550	45.97	760,803.50	
HANSEN NATURAL CORPORATION	10,400	95.27	990,808.00	
HJ HEINZ CO	43,653	52.90	2,309,243.70	
HORMEL FOODS CORPORATION	19,800	28.65	567,270.00	
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	15,500	76.62	1,187,610.00	
KELLOGG CO	34,428	48.73	1,677,676.44	
KRAFT FOODS INC-A	225,104	36.22	8,153,266.88	
LORILLARD INC	18,255	108.84	1,986,874.20	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	16,330	48.82	797,230.60	
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	26,880	73.12	1,965,465.60	
MOLSON COORS BREWING COMPANY	21,725	41.84	908,974.00	
PEPSICO INC	211,267	64.37	13,599,256.79	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	234,615	76.20	17,877,663.00	
RALCORP HOLDINGS INC	7,350	84.09	618,061.50	
REYNOLDS AMERICAN INC	47,063	40.52	1,906,992.76	
SARA LEE CORP	75,111	18.37	1,379,789.07	
THE HERSHEY COMPANY	21,810	59.60	1,299,876.00	
TYSON FOODS INC-CL A	41,400	20.20	836,280.00	
AVON PRODUCTS INC	58,590	16.47	964,977.30	
CHURCH & DWIGHT CO INC	18,470	44.98	830,780.60	
CLOROX COMPANY	18,061	64.98	1,173,603.78	
COLGATE-PALMOLIVE CO	65,201	89.91	5,862,221.91	
ENERGIZER HOLDINGS INC	9,227	72.84	672,094.68	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	15,964	107.50	1,716,130.00	
HERBALIFE LTD	15,500	51.45	797,475.00	

KIMBERLY-CLARK CORP	52,575	71.19	3,742,814.25	
PROCTER & GAMBLE CO	366,925	64.95	23,831,778.75	
AETNA INC	50,468	40.16	2,026,794.88	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	24,970	67.24	1,678,982.80	
AMERISOURCEBERGEN CORP	35,218	36.47	1,284,400.46	
BARD(C.R.) INC	11,540	85.28	984,131.20	
BAXTER INTERNATIONAL INC	76,016	47.65	3,622,162.40	
BECTON DICKINSON & CO	29,158	70.66	2,060,304.28	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	208,125	5.09	1,059,356.25	
CARDINAL HEALTH INC	45,997	40.34	1,855,518.98	
CAREFUSION CORPORATION	29,745	23.95	712,392.75	
CERNER CORP	19,560	57.73	1,129,198.80	
CIGNA CORP	38,838	40.85	1,586,532.30	
COVENTRY HEALTH CARE INC	20,413	30.16	615,656.08	
COVIDIEN PLC	65,917	42.82	2,822,565.94	
DAVITA INC	11,978	73.12	875,831.36	
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	18,359	34.48	633,018.32	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	15,210	67.60	1,028,196.00	
EXPRESS SCRIPTS INC	61,441	43.12	2,649,335.92	
HCA HOLDINGS, INC.	24,300	21.23	515,889.00	
HENRY SCHEIN INC	12,250	61.92	758,520.00	
HOLOGIC INC	35,380	16.49	583,416.20	
HOSPIRA INC	21,533	28.64	616,705.12	
HUMANA INC.	22,993	84.67	1,946,817.31	
INTUITIVE SURGICAL INC	5,235	432.19	2,262,514.65	
LABORATORY CRP OF AMR HLDGS	13,633	81.62	1,112,725.46	
MCKESSON CORP	32,454	76.61	2,486,300.94	
MEDCO HEALTH SOLUTIONS INC	51,093	54.41	2,779,970.13	
MEDTRONIC INC	141,783	35.10	4,976,583.30	
OMNICARE INC	14,795	33.36	493,561.20	
PATTERSON COS INC	12,732	28.22	359,297.04	

QUEST DIAGNOSTICS	20,866	55.64	1,160,984.24	
ST JUDE MEDICAL INC	43,977	32.16	1,414,300.32	
STRYKER CORP	39,121	45.78	1,790,959.38	
UNITEDHEALTH GROUP INC	142,961	48.97	7,000,800.17	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	16,067	63.20	1,015,434.40	
WELLPOINT INC	47,940	63.64	3,050,901.60	
ZIMMER HOLDINGS INC	25,637	47.70	1,222,884.90	
ABBOTT LABORATORIES	207,431	54.35	11,273,874.85	
ALLERGAN INC	41,120	84.68	3,482,041.60	
AMGEN INC	105,869	60.17	6,370,137.73	
BIOGEN IDEC INC	30,593	109.99	3,364,924.07	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	228,814	34.27	7,841,455.78	
CELGENE CORP	60,640	64.58	3,916,131.20	
COVANCE INC	8,460	44.59	377,231.40	
ELI LILLY & CO	139,486	40.74	5,682,659.64	
FOREST LABORATORIES,INC.	37,530	28.78	1,080,113.40	
GILEAD SCIENCES INC	102,645	37.47	3,846,108.15	
ILLUMINA INC	16,789	26.17	439,368.13	
JOHNSON & JOHNSON	365,807	63.53	23,239,718.71	
LIFE TECHNOLOGIES CORPORATION	23,277	38.04	885,457.08	
MERCK & CO. INC.	411,239	36.47	14,997,886.33	
MYLAN INC	56,000	20.61	1,154,160.00	
PERRIGO CO	11,000	98.03	1,078,330.00	
PFIZER INC	1,041,901	21.15	22,036,206.15	
PHARMASSET INC	9,000	124.60	1,121,400.00	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	50,837	43.54	2,213,442.98	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	27,808	33.21	923,503.68	
WARNER CHILCOTT PLC	20,000	13.74	274,800.00	
WATERS CORP	12,321	71.72	883,662.12	
WATSON PHARMACEUTICALS INC	18,250	59.65	1,088,612.50	
BB & T CORPORATION	92,907	23.56	2,188,888.92	

COMERICA INC	28,150	24.13	679,259.50	
FIFTH THIRD BANCORP	123,338	11.84	1,460,321.92	
HUDSON CITY BANCORP INC	59,969	5.96	357,415.24	
KEYCORP	124,915	7.14	891,893.10	
M & T BANK CORP	15,478	71.30	1,103,581.40	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	58,068	11.75	682,299.00	
PEOPLE’S UNITED FINANCIAL INC	51,500	12.18	627,270.00	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	70,505	54.38	3,834,061.90	
REGIONS FINANCIAL CORPORATION	175,522	3.82	670,494.04	
SUNTRUST BANKS INC	71,637	15.80	1,131,864.60	
US BANCORP	257,507	25.56	6,581,878.92	
WELLS FARGO & COMPANY	669,801	25.31	16,952,663.31	
AMERICAN EXPRESS COMPANY	143,359	46.04	6,600,248.36	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	30,857	46.38	1,431,147.66	
BANK OF AMERICA CORP	1,358,871	4.99	6,780,766.29	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP(THE)	165,841	18.59	3,082,984.19	
BLACKROCK INC	12,575	165.60	2,082,420.00	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	61,922	41.56	2,573,478.32	
CIT GROUP INC	25,900	34.02	881,118.00	
CITIGROUP INC	388,719	24.82	9,648,005.58	
CME GROUP INC.	8,367	242.00	2,024,814.00	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	72,681	23.57	1,713,091.17	
EATON VANCE CORP	15,000	22.22	333,300.00	
FRANKLIN RESOURCES INC	20,544	92.77	1,905,866.88	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	64,418	87.70	5,649,458.60	
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	9,678	116.19	1,124,486.82	
INVESCO LIMITED	61,439	18.67	1,147,066.13	
JPMORGAN CHASE & CO	520,512	30.70	15,979,718.40	
LEGG MASON INC	18,803	22.95	431,528.85	
LEUCADIA NATIONAL CORPORATION	27,584	21.29	587,263.36	
MOODY’S CORP	27,468	32.39	889,688.52	

MORGAN STANLEY	191,754	14.16	2,715,236.64	
NASDAQ STOCK MARKET INC	16,080	23.61	379,648.80	
NORTHERN TRUST CORP	29,605	38.29	1,133,575.45	
NYSE EURONEXT	34,729	25.16	873,781.64	
SCHWAB (CHARLES) CORP	142,090	10.78	1,531,730.20	
SEI INVESTMENTS COMPANY	21,524	15.98	343,953.52	
SLM CORPORATION	67,361	13.10	882,429.10	
STATE STREET CORP	67,121	39.03	2,619,732.63	
T ROWE PRICE GROUP INC	34,222	53.68	1,837,036.96	
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	28,894	14.89	430,231.66	
ACE LIMITED	45,665	66.29	3,027,132.85	
AFLAC INC	61,512	39.66	2,439,565.92	
ALLSTATE CORP	69,694	26.10	1,819,013.40	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	63,357	22.36	1,416,662.52	
AON CORPORATION	38,399	44.58	1,711,827.42	
ARCH CAPITAL GROUP LTD.	17,100	36.48	623,808.00	
ASSURANT INC	13,289	38.64	513,486.96	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	17,303	30.97	535,873.91	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	120,589	74.04	8,928,409.56	
CHUBB CORP	37,917	66.51	2,521,859.67	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	20,026	29.12	583,157.12	
EVEREST RE GROUP LTD	7,003	78.49	549,665.47	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL INC-CL A	28,761	15.20	437,167.20	
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	60,800	5.75	349,600.00	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	55,186	14.98	826,686.28	
LINCOLN NATIONAL CORP	42,927	17.84	765,817.68	
LOEWS CORPORATION	43,788	36.53	1,599,575.64	
MARSH & MCLENNAN COS	71,792	30.29	2,174,579.68	
METLIFE INC	141,797	29.03	4,116,366.91	
PARTNERRE LTD	8,143	61.44	500,305.92	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	40,428	22.93	927,014.04	

PROGRESSIVE CORP	80,283	18.37	1,474,798.71	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	64,849	46.98	3,046,606.02	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	6,763	71.78	485,448.14	
TORCHMARK CORPORATION	14,908	41.61	620,321.88	
TRAVELERS COS INC(THE)	55,786	56.71	3,163,624.06	
UNUM GROUP	42,070	19.91	837,613.70	
W.R.BERKLEY CORPORATION	16,784	33.00	553,872.00	
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	22,098	37.78	834,862.44	
XL GROUP PLC	38,800	19.21	745,348.00	
CBRE GROUP INC-A	40,600	14.33	581,798.00	
ACCENTURE PLC-CL A	86,403	53.50	4,622,560.50	
ACTIVISION BLIZZARD INC	68,620	11.65	799,423.00	
ADOBE SYSTEMS INC	65,696	27.50	1,806,640.00	
AKAMAI TECHNOLOGIES	24,306	26.56	645,567.36	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	6,660	102.80	684,648.00	
AUTODESK INC	30,634	30.20	925,146.80	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	65,135	51.45	3,351,195.75	
BMC SOFTWARE INC	23,878	32.93	786,302.54	
CA INC	54,513	19.88	1,083,718.44	
CITRIX SYSTEMS INC	25,598	61.52	1,574,788.96	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATION	39,992	64.15	2,565,486.80	
COMPUTER SCIENCES CORP	20,262	25.00	506,550.00	
EBAY INC	153,664	29.77	4,574,577.28	
ELECTRONIC ARTS INC	42,481	19.84	842,823.04	
F5 NETWORKS INC	10,981	102.48	1,125,332.88	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	33,712	25.02	843,474.24	
FISERV INC	18,385	56.45	1,037,833.25	
GOOGLE INC-CL A	33,919	621.83	21,091,851.77	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	159,435	182.89	29,159,067.15	
INTUIT INC	38,967	51.02	1,988,096.34	
MASTERCARD INC-CL A	14,472	358.74	5,191,685.28	

MICROSOFT CORP	1,007,065	25.52	25,700,298.80	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	31,300	23.98	750,574.00	
ORACLE CORPORATION	540,318	28.62	15,463,901.16	
PAYCHEX INC	44,144	29.60	1,306,662.40	
RED HAT INC	25,600	46.05	1,178,880.00	
SAIC INC	37,400	11.95	446,930.00	
SALESFORCE.COM,INC.	16,661	103.47	1,723,913.67	
SYMANTEC CORPORATION	98,014	15.29	1,498,634.06	
SYNOPSYS INC	19,084	26.49	505,535.16	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	21,919	18.96	415,584.24	
VERISIGN INC	20,118	34.80	700,106.40	
VISA INC	69,870	98.58	6,887,784.60	
VMWARE INC	11,750	84.34	990,995.00	
WESTERN UNION COMPANY	81,813	17.55	1,435,818.15	
YAHOO! INC	158,808	14.63	2,323,361.04	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	46,636	33.23	1,549,714.28	
AMPHENOL CORPORATION -CL A	22,978	41.09	944,166.02	
APPLE INC	123,802	382.21	47,318,362.42	
ARROW ELECTRONICS INC	16,290	34.02	554,185.80	
AVAGO TECHNOLOGIES LTD.	29,100	27.55	801,705.00	
AVNET INC	21,300	28.55	608,115.00	
CISCO SYSTEMS INC	733,942	17.70	12,990,773.40	
CORNING INC	211,494	12.57	2,658,479.58	
DELL INC	218,045	14.70	3,205,261.50	
DOLBY LABORATORIES INC-CL A	8,000	30.33	242,640.00	
EMC CORP/MASS	276,722	21.95	6,074,047.90	
FLEXTRONICS INTL LTD	102,331	5.72	585,333.32	
FLIR SYSTEMS INC	21,640	24.73	535,157.20	
HARRIS CORP	15,050	33.84	509,292.00	
HEWLETT-PACKARD CO	276,034	25.13	6,936,734.42	
JUNIPER NETWORKS INC	69,327	18.12	1,256,205.24	

MOTOROLA MOBILITY HOLDINGS INC	37,797	38.70	1,462,743.90	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	41,050	46.16	1,894,868.00	
NETAPP INC	48,883	35.16	1,718,726.28	
QUALCOMM INC	223,825	51.91	11,618,755.75	
SANDISK CORP	31,577	46.92	1,481,592.84	
SEAGATE TECHNOLOGY	55,968	15.07	843,437.76	
TE CONNECTIVITY LTD	58,468	29.77	1,740,592.36	
TERADATA CORP	22,777	48.98	1,115,617.46	
WESTERN DIGITAL CORP	31,623	30.64	968,928.72	
XEROX CORP	188,149	7.72	1,452,510.28	
AMERICAN TOWER CORPORATION -CL A	53,276	57.18	3,046,321.68	
AT&T INC	791,224	28.74	22,739,777.76	
CENTURYLINK INC	81,555	34.93	2,848,716.15	
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	37,667	42.42	1,597,834.14	
FRONTIER COMMUNICATIONS CORPORATION	133,153	4.83	643,128.99	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	20,666	17.12	353,801.92	
METROPCS COMMUNICATIONS INC.	31,031	7.95	246,696.45	
NII HOLDINGS INC	23,789	19.78	470,546.42	
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	15,000	39.57	593,550.00	
SPRINT NEXTEL CORP	398,323	2.16	860,377.68	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	377,917	38.63	14,598,933.71	
WINDSTREAM CORPORATION	79,100	11.51	910,441.00	
AES CORPORATION	88,566	11.48	1,016,737.68	
ALLIANT ENERGY CORP	14,548	41.79	607,960.92	
AMEREN CORPORATION	31,924	31.49	1,005,286.76	
AMERICAN ELECTRIC POWER	63,751	39.29	2,504,776.79	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	24,200	30.96	749,232.00	
CALPINE CORP	43,100	15.00	646,500.00	
CENTERPOINT ENERGY INC	53,209	19.10	1,016,291.90	
CONSOLIDATED EDISON INC	38,832	59.60	2,314,387.20	
CONSTELLATION ENERGY GROUP	25,923	38.28	992,332.44	

DOMINION RESOURCES INC/VA	75,236	50.36	3,788,884.96	
DTE ENERGY COMPANY	22,973	52.23	1,199,879.79	
DUKE ENERGY CORP	178,059	20.97	3,733,897.23	
EDISON INTERNATIONAL	40,473	38.98	1,577,637.54	
ENERGEN CORPORATION	10,200	47.20	481,440.00	
ENTERGY CORP	23,491	70.99	1,667,626.09	
EQT CORPORATION	19,380	53.30	1,032,954.00	
EXELON CORP	88,962	42.05	3,740,852.10	
FIRSTENERGY CORP	56,276	42.48	2,390,604.48	
INTEGRYS ENERGY GROUP,INC.	10,700	51.38	549,766.00	
MDU RESOURCES GROUP INC	26,700	20.44	545,748.00	
NEXTERA ENERGY INC	53,815	57.55	3,097,053.25	
NISOURCE INC	37,192	22.13	823,058.96	
NORTHEAST UTILITIES	24,200	34.51	835,142.00	
NRG ENERGY INC	32,925	17.57	578,492.25	
NSTAR	13,500	45.47	613,845.00	
ONEOK INC	13,500	82.54	1,114,290.00	
P G & E CORPORATION	52,734	39.47	2,081,410.98	
PEPCO HOLDINGS INC	28,234	19.32	545,480.88	
PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	15,044	46.26	695,935.44	
PPL CORPORATION	76,762	28.36	2,176,970.32	
PROGRESS ENERGY INC	39,918	53.36	2,130,024.48	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	68,213	30.64	2,090,046.32	
QEP RESOURCES INC	24,566	27.77	682,197.82	
SCANA CORP	16,663	42.51	708,344.13	
SEMPRA ENERGY	30,519	52.06	1,588,819.14	
SOUTHERN CO	114,804	44.56	5,115,666.24	
WISCONSIN ENERGY CORP	30,232	33.70	1,018,818.40	
XCEL ENERGY INC	64,635	26.32	1,701,193.20	
ADVANCED MICRO DEVICES	73,485	4.86	357,137.10	
ALTERA CORPORATION	43,108	34.06	1,468,258.48	

ANALOG DEVICES	39,301	33.46	1,315,011.46	
APPLIED MATERIALS INC	178,965	10.14	1,814,705.10	
BROADCOM CORP-CL A	64,536	27.74	1,790,228.64	
CREE INC	14,800	20.35	301,180.00	
INTEL CORP	700,939	23.10	16,191,690.90	
KLA-TENCOR CORPORATION	22,824	45.19	1,031,416.56	
LAM RESEARCH CORP	16,564	34.86	577,421.04	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	31,254	28.43	888,551.22	
LSI CORPORATION	78,857	5.43	428,193.51	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	67,474	13.23	892,681.02	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	39,400	24.90	981,060.00	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	24,708	34.01	840,319.08	
MICRON TECHNOLOGY INC	125,682	5.45	684,966.90	
NVIDIA CORP	80,994	13.15	1,065,071.10	
TEXAS INSTRUMENTS INC	154,259	27.95	4,311,539.05	
XILINX INC	36,353	30.61	1,112,765.33	
米ドル 小計	40,371,629		1,485,615,283.29	
（邦貨換算額）			(115,922,560,555)	**（単位：円）**
カナダドル				
ARC RESOURCES LTD	37,900	25.08	950,532.00	
ATHABASCA OIL SANDS CORP	41,300	11.99	495,187.00	
BAYTEX ENERGY CORPORATION	15,707	54.69	859,015.83	
BONAVISTA ENERGY CORPORATION	20,500	25.61	525,005.00	
CAMECO CORP	52,343	17.81	932,228.83	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	147,219	35.12	5,170,331.28	
CANADIAN OIL SANDS LTD	63,742	21.65	1,380,014.30	
CENOVUS ENERGY INC	101,333	31.39	3,180,842.87	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	32,345	43.17	1,396,333.65	
ENBRIDGE INC	97,662	36.52	3,566,616.24	
ENCANA CORP	97,844	18.56	1,815,984.64	

ENERPLUS CORP	24,590	24.77	609,094.30	
HUSKY ENERGY INC	44,542	23.95	1,066,780.90	
IMPERIAL OIL LTD	38,898	42.47	1,651,998.06	
MEG ENERGY CORPORATION	16,400	39.90	654,360.00	
NEXEN INC	71,608	15.00	1,074,120.00	
NIKO RESOURCES LTD	5,880	43.48	255,662.40	
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORPORATION	33,700	18.75	631,875.00	
PEMBINA PIPELINE CORP	22,000	30.15	663,300.00	
PENGROWTH ENERGY CORPORATION	50,200	10.55	529,610.00	
PENN WEST PETROLEUM LTD	61,853	19.48	1,204,896.44	
PRECISION DRILLING CORP	33,800	9.67	326,846.00	
PROGRESS ENERGY RESOURCES CORP	26,900	12.75	342,975.00	
SUNCOR ENERGY INC	209,201	27.51	5,755,119.51	
TALISMAN ENERGY INC	137,207	11.75	1,612,182.25	
TOURMALINE OIL CORP	14,700	26.85	394,695.00	
TRANSCANADA CORP	93,992	43.44	4,083,012.48	
VERMILION ENERGY INC	13,000	44.01	572,130.00	
AGNICO-EAGLE MINES	22,950	37.69	864,985.50	
AGRIUM INC	21,073	68.20	1,437,178.60	
BARRICK GOLD CORP	133,701	46.30	6,190,356.30	
CENTERRA GOLD INC	21,000	19.16	402,360.00	
ELDORADO GOLD CORPORATION	71,431	13.46	961,461.26	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	64,710	18.27	1,182,251.70	
FRANCO-NEVADA CORPORATION	17,400	38.44	668,856.00	
GOLDCORP INC	108,156	46.14	4,990,317.84	
IAMGOLD CORP	50,500	16.35	825,675.00	
INMET MINING CORPORATION	6,322	61.72	390,193.84	
IVANHOE MINES LTD	38,466	16.54	636,227.64	
KINROSS GOLD CORP	148,527	12.08	1,794,206.16	
NEW GOLD INC	54,000	9.97	538,380.00	
OSISKO MINING CORPORATION	47,600	9.93	472,668.00	

PAN AMERICAN SILVER CORP	14,272	22.22	317,123.84	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	114,477	39.98	4,576,790.46	
SILVER WHEATON CORPORATION	48,045	29.39	1,412,042.55	
SINO-FOREST CORPORATION-CL A	30,871	4.81	148,489.51	
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	77,905	34.21	2,665,130.05	
YAMANA GOLD INC	100,590	14.59	1,467,608.10	
BOMBARDIER INC ’B’	200,459	3.53	707,620.27	
CAE INC	32,614	9.74	317,660.36	
FINNING INTERNATIONAL INC	22,295	22.30	497,178.50	
SNC-LAVALIN GROUP INC	19,981	47.61	951,295.41	
RITCHIE BROS. AUCTIONEERS	12,400	21.37	264,988.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	60,301	75.75	4,567,800.75	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	22,451	63.86	1,433,720.86	
MAGNA INTERNATIONAL INC	28,186	32.94	928,446.84	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	16,000	19.30	308,800.00	
TIM HORTONS INC	21,600	48.89	1,056,024.00	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	50,571	19.66	994,225.86	
THOMSON REUTERS CORP	50,278	26.36	1,325,328.08	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	10,078	64.40	649,023.20	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B	16,200	30.51	494,262.00	
EMPIRE CO LTD A	3,300	57.80	190,740.00	
LOBLAW COMPANIES LTD	14,553	36.00	523,908.00	
METRO INC -A	13,900	52.27	726,553.00	
SHOPPERS DRUG MART CORP	29,360	42.19	1,238,698.40	
WESTON (GEORGE) LTD	7,480	64.83	484,928.40	
SAPUTO INC	18,840	38.40	723,456.00	
VITERRA INC	52,200	10.37	541,314.00	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	37,664	46.04	1,734,050.56	
BANK OF MONTREAL	84,933	54.67	4,643,287.11	
BANK OF NOVA SCOTIA	145,536	49.18	7,157,460.48	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	53,994	72.43	3,910,785.42	

NATIONAL BANK OF CANADA	22,137	70.97	1,571,062.89	
ROYAL BANK OF CANADA	191,329	48.70	9,317,722.30	
TORONTO-DOMINION BANK	118,308	73.37	8,680,257.96	
CI FINANCIAL CORP	23,200	20.71	480,472.00	
IGM FINANCIAL INC	15,801	44.55	703,934.55	
ONEX CORPORATION	12,723	32.60	414,769.80	
TMX GROUP INC	9,421	41.47	390,688.87	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,682	417.98	1,121,022.36	
GREAT-WEST LIFECO INC	38,204	19.35	739,247.40	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANC	11,000	25.97	285,670.00	
INTACT FINANCIAL CORPORATION	17,000	58.94	1,001,980.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	237,295	10.25	2,432,273.75	
POWER CORP OF CANADA	45,760	22.26	1,018,617.60	
POWER FINANCIAL CORP	33,330	24.81	826,917.30	
SUN LIFE FINANCIAL INC	76,533	18.50	1,415,860.50	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	73,690	27.33	2,013,947.70	
BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES	31,763	15.72	499,314.36	
CGI GROUP INC - CL A	30,887	19.18	592,412.66	
OPEN TEXT CORPORATION	7,600	52.72	400,672.00	
RESEARCH IN MOTION	64,255	13.37	859,089.35	
BCE INC	33,720	40.63	1,370,043.60	
BELL ALIANT INC.	9,950	27.96	278,202.00	
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	56,650	37.79	2,140,803.50	
TELUS CORPORATION	4,400	55.84	245,696.00	
TELUS CORPORATION -NON VOTE	22,597	53.48	1,208,487.56	
CANADIAN UTILITIES LIMITED	12,080	59.80	722,384.00	
FORTIS INC	25,140	32.07	806,239.80	
TRANSALTA CORP	27,068	20.48	554,352.64	
カナダドル 小計	5,078,059		152,106,749.28	
（邦貨換算額）			(11,438,427,545)	**（単位：円）**

ユーロ				
COMPAGNIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE-VERITA	17,750	16.19	287,461.25	
ENI SPA	322,348	15.13	4,877,125.24	
FUGRO NV-CVA	8,595	41.33	355,231.35	
GALP ENERGIA SGPS S.A	30,100	11.40	343,140.00	
NESTE OIL OYJ	16,085	7.17	115,329.45	
OMV AG	22,729	23.22	527,881.02	
REPSOL YPF SA	106,518	22.17	2,362,036.65	
SAIPEM	34,815	31.17	1,085,183.55	
SBM OFFSHORE NV	23,687	15.47	366,437.89	
TECHNIP S.A.	13,369	67.59	903,610.71	
TENARIS S.A.	61,674	13.51	833,215.74	
TOTAL SA	283,418	36.52	10,351,842.45	
ACERINOX SA	13,536	9.53	128,998.08	
AIR LIQUIDE	38,110	89.62	3,415,418.20	
AKZO NOBEL	31,095	33.88	1,053,654.07	
ARCELOR MITTAL	113,277	13.07	1,480,530.39	
ARKEMA	7,930	47.65	377,864.50	
BASF SE	122,344	51.15	6,257,895.60	
CIMPOR-CIMENTOS DE PORTUGAL	30,160	5.02	151,584.16	
CRH PLC	97,080	13.80	1,339,704.00	
HEIDELBERGCEMENT AG	19,300	29.75	574,175.00	
IMERYS SA	4,515	31.95	144,276.82	
K+S AG	22,820	34.02	776,336.40	
KONINKLIJKE DSM NV	19,731	33.75	665,921.25	
LAFARGE SA	26,761	25.16	673,306.76	
LANXESS	11,200	36.82	412,440.00	
LINDE AG	22,666	110.85	2,512,526.10	
SALZGITTER AG	4,539	36.53	165,809.67	
SOLVAY SA	8,105	62.08	503,158.40	
STORA ENSO OYJ-R SHS	82,712	4.11	340,608.01	

THYSSENKRUPP AG	52,226	16.92	883,663.92	
UMICORE	14,850	30.25	449,286.75	
UPM-KYMMENE OYJ	70,316	7.71	542,136.36	
VOESTALPINE AG	13,953	19.89	277,594.93	
WACKER CHEMIE AG	2,140	57.49	123,028.60	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	18,435	22.55	415,801.42	
ALSTOM RGPT	27,713	22.00	609,686.00	
BEKAERT NV	5,000	24.73	123,675.00	
BOSKALIS WESTMINSTER NV	8,900	25.49	226,861.00	
BOUYGUES SA	25,331	23.22	588,312.47	
BRENNTAG AG	4,320	70.10	302,832.00	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	54,124	27.21	1,472,714.04	
EIFFAGE SA	5,600	16.81	94,136.00	
EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	53,956	22.80	1,230,196.80	
FINMECCANICA SPA	59,089	2.62	154,813.18	
FOMENTO DE CONSTRUC Y CONTRA	5,733	18.70	107,207.10	
GEA GROUP AG	22,600	20.25	457,763.00	
HOCHTIEF AG	5,337	42.33	225,915.21	
KONE OYJ-B	20,900	38.37	801,933.00	
LEGRAND SA	30,251	22.96	694,562.96	
MAN SE	8,508	62.68	533,281.44	
METSO OYJ	16,595	25.34	420,517.30	
PHILIPS ELECTRONICS NV	133,841	14.65	1,960,770.65	
PRYSMIAN SPA	25,400	9.60	243,840.00	
SAFRAN SA	22,819	21.50	490,722.59	
SCHNEIDER ELECTRIC SA	65,592	37.28	2,445,597.72	
SIEMENS AG-REG	110,251	71.25	7,855,383.75	
THALES SA	12,675	22.09	280,054.12	
VALLOUREC	14,500	45.41	658,445.00	
VINCI S.A.	61,161	31.49	1,926,265.69	
WARTSILA OYJ-B SHARES	22,402	21.08	472,234.16	

WENDEL	3,900	45.80	178,620.00	
ZARDOYA OTIS SA	20,700	10.23	211,761.00	
BIC	4,200	66.43	279,006.00	
BUREAU VERITAS SA	7,450	54.13	403,268.50	
EDENRED	19,767	18.03	356,497.84	
RANDSTAD HOLDING NV	16,298	21.69	353,503.62	
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	53,910	11.96	644,763.60	
AEROPORTS DE PARIS (ADP)	4,600	51.69	237,774.00	
ATLANTIA SPA	43,067	11.62	500,438.54	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	32,979	8.88	293,117.35	
DEUTSCHE POST AG-REG	112,084	11.19	1,254,780.38	
FERROVIAL SA	47,368	9.19	435,501.39	
FRAPORT AG	5,220	37.92	197,968.50	
GROUPE EUROTUNNEL SA	74,000	5.08	376,512.00	
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP	139,344	1.68	235,073.32	
RYANAIR HOLDINGS PLC	1,656	3.77	6,254.71	
TNT EXPRESS NV	46,593	5.65	263,669.78	
VOPAK	10,300	39.84	410,403.50	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	44,497	50.07	2,227,964.79	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE(BMW)AG-PFD	6,640	35.28	234,259.20	
CONTINENTAL AG	10,678	46.40	495,459.20	
DAIMLER AG	119,999	31.34	3,761,368.65	
FIAT INDUSTRIAL SPA	104,404	6.22	649,392.88	
FIAT SPA	99,416	3.36	334,037.76	
MICHELIN (CGDE)-B	23,825	42.74	1,018,399.62	
NOKIAN RENKAAT OYJ	15,383	22.71	349,347.93	
PEUGEOT SA	19,455	11.74	228,498.97	
PIRELLI & C.	32,902	6.26	206,131.03	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PREF	20,465	39.75	813,483.75	
RENAULT SA	26,225	25.20	660,870.00	
VOLKSWAGEN AG	3,804	103.30	392,953.20	

VOLKSWAGEN AG PFD	19,418	115.20	2,236,953.60	
ADIDAS AG	27,999	47.95	1,342,692.04	
CHRISTIAN DIOR SA	7,010	88.93	623,399.30	
LUXOTTICA GROUP SPA	15,130	20.48	309,862.40	
LVMH MOET HENNESSY LOUI V SA	34,038	104.50	3,556,971.00	
ACCOR SA	20,367	18.19	370,577.56	
AUTOGRILL SPA	12,900	7.23	93,331.50	
OPAP SA	31,906	6.54	208,665.24	
SODEXO	12,906	53.04	684,534.24	
AXEL SPRINGER AG	5,400	31.69	171,153.00	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	13,600	28.65	389,640.00	
JC DECAUX S.A.	7,300	17.18	125,414.00	
KABEL DEUTSCHLAND HOLDINGS AG	12,500	39.10	488,750.00	
LAGARDERE S.C.A.	16,771	17.76	297,852.96	
MEDIASET SPA	104,634	1.97	206,861.41	
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-PFD	10,000	13.38	133,850.00	
PUBLICIS GROUPE	19,650	33.75	663,187.50	
REED ELSEVIER NV	92,746	8.56	793,905.76	
SANOMA OYJ	10,500	8.22	86,310.00	
SES	39,996	18.05	722,127.78	
TELEVISION FRANCAISE (T.F.1)	13,876	7.12	98,880.37	
WOLTERS KLUWER-CVA	39,815	12.73	506,844.95	
INDITEX	29,123	62.50	1,820,187.50	
PPR	10,079	106.00	1,068,374.00	
CARREFOUR SA	77,233	16.59	1,281,295.47	
CASINO GUICHARD PERRACHON	7,660	61.22	468,945.20	
COLRUYT NV	10,445	28.39	296,585.77	
DELHAIZE GROUP	12,898	42.48	547,907.04	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	71,633	3.23	231,517.85	
JERONIMO MARTINS SGPS S.A.	30,900	12.81	395,983.50	
KESKO OYJ-B SHS	8,334	23.66	197,182.44	

KONINKLIJKE AHOLD NV	155,447	9.64	1,499,752.65	
METRO AG	17,848	28.22	503,670.56	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	107,494	45.15	4,853,891.57	
COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	29,629	12.75	377,769.75	
DANONE	77,637	47.04	3,652,044.48	
HEINEKEN HOLDING NV	15,439	29.97	462,784.02	
HEINEKEN NV	33,900	34.54	1,171,075.50	
KERRY GROUP PLC-A	19,698	27.64	544,551.21	
PERNOD-RICARD SA	26,254	67.62	1,775,295.48	
SUEDZUCKER AG	8,500	24.42	207,570.00	
UNILEVER NV-CVA	218,334	25.38	5,542,408.59	
BEIERSDORF AG	13,590	42.50	577,575.00	
HENKEL AG & CO KGAA	17,400	36.60	636,927.00	
HENKEL AG & CO KGAA	23,783	43.86	1,043,122.38	
L’OREAL	32,003	77.71	2,486,953.13	
CELESIO AG	11,704	11.72	137,170.88	
ESSILOR INTERNATIONAL	26,803	52.16	1,398,044.48	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	28,190	51.19	1,443,046.10	
FRESENIUS SE & CO KGAA	14,750	69.21	1,020,847.50	
BAYER AG	109,758	44.75	4,911,670.50	
ELAN CORPORATION PLC	76,166	9.44	719,007.04	
GRIFOLS S.A.	19,550	12.48	244,081.75	
MERCK KGAA	8,869	73.39	650,895.91	
ORION OYJ	10,798	14.45	156,031.10	
QIAGEN N.V.	32,000	10.27	328,640.00	
SANOFI	152,804	53.66	8,199,462.64	
UCB SA	12,847	31.18	400,633.69	
BANCA CARIGE S.P.A	84,000	1.32	111,300.00	
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	553,414	0.25	140,677.83	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	610,615	6.20	3,785,813.00	
BANCO DE SABADELL SA	152,475	3.13	478,466.55	

BANCO ESPIRITO SANTO,S.A(BES)	72,900	1.04	75,816.00	
BANCO POPOLARE SPA	249,182	1.02	256,408.27	
BANCO POPULAR ESPANOL	125,047	3.43	428,911.21	
BANCO SANTANDER SA	1,131,707	5.60	6,337,559.20	
BANKIA SAU	111,000	3.60	399,600.00	
BANKINTER,S.A.	29,000	4.56	132,501.00	
BNP PARIBAS	129,622	28.42	3,684,505.35	
COMMERZBANK AG	476,990	1.27	606,254.29	
CREDIT AGRICOLE SA	126,158	4.04	510,056.79	
ERSTE GROUP BANK AG	25,083	12.05	302,250.15	
INTESA SANPAOLO	1,355,240	1.22	1,653,392.80	
INTESA SANPAOLO-RSP	108,503	0.97	106,224.43	
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	96,000	0.00	96.00	
KBC GROUPE SA	23,251	9.91	230,417.41	
NATIXIS	120,051	1.93	232,298.68	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	7,550	19.18	144,846.75	
SOCIETE GENERALE	87,848	16.45	1,445,099.60	
UNICREDIT SPA	1,831,122	0.69	1,274,460.91	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	115,494	3.14	362,882.14	
AGEAS	303,000	1.16	352,995.00	
CAIXABANK	103,507	3.88	401,607.16	
DEUTSCHE BANK AG -REG	123,183	27.16	3,346,266.19	
DEUTSCHE BOERSE AG-NEW	26,517	40.19	1,065,850.81	
EURAZEO	3,570	25.62	91,463.40	
EXOR SPA	7,897	14.31	113,006.07	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	11,155	49.41	551,224.32	
ING GROEP NV-CVA	511,977	5.13	2,628,489.91	
MEDIOBANCA SPA	74,143	4.60	341,206.08	
POHJOLA BANK PLC	17,903	7.15	128,095.96	
AEGON NV	234,288	2.87	673,109.42	
ALLIANZ SE-REG	60,718	72.23	4,385,661.14	

ASSICURAZIONI GENERALI	154,173	11.11	1,712,862.03	
AXA SA	234,573	9.97	2,339,631.10	
CNP ASSURANCES	19,484	9.73	189,598.80	
DELTA LLOYD NV	12,600	12.45	156,870.00	
HANNOVER RUECKVERSICHERUNGS AG	7,300	36.50	266,450.00	
MAPFRE SA	93,649	2.45	229,440.05	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	24,375	89.99	2,193,506.25	
SAMPO OYJ-A SHS	56,654	18.19	1,030,536.26	
SCOR SE	24,458	17.95	439,021.10	
VIENNA INSURANCE GROUP AG WIENER VERSICH	4,800	28.27	135,720.00	
IMMOFINANZ AG	127,200	2.20	280,730.40	
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	44,350	11.81	523,995.25	
ATOS	7,181	33.38	239,737.68	
CAP GEMINI SA	18,704	24.02	449,270.08	
DASSAULT SYSTEMES SA	8,083	58.18	470,268.94	
INDRA SISTEMAS SA	11,428	9.79	111,937.26	
SAP AG	123,153	42.14	5,189,667.42	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	12,300	13.62	167,587.50	
ALCATEL-LUCENT	300,385	1.10	332,826.58	
NEOPOST SA	4,518	50.31	227,300.58	
NOKIA OYJ	507,280	3.56	1,809,975.04	
BELGACOM SA	19,931	23.21	462,598.51	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	377,014	8.89	3,352,408.48	
ELISA OYJ	17,422	15.60	271,783.20	
FRANCE TELECOM SA	247,001	11.71	2,893,616.71	
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	57,349	2.61	149,680.89	
ILIAD SA	2,500	90.05	225,125.00	
KONINKLIJKE KPN NV	197,258	8.93	1,761,513.94	
MOBISTAR SA	4,149	38.72	160,649.28	
PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	89,052	4.54	404,563.23	
TELECOM ITALIA SPA	1,283,901	0.79	1,024,552.99	

TELECOM ITALIA-RNC	776,811	0.66	516,967.72	
TELEFONICA S.A.	547,111	12.89	7,054,996.34	
TELEKOM AUSTRIA AG	43,354	8.82	382,555.69	
VIVENDI SA	165,975	15.99	2,654,770.12	
A2A S.P.A.	131,000	0.69	91,503.50	
ACCIONA S.A.	3,430	63.91	219,211.30	
E.ON AG	239,815	16.06	3,851,428.90	
EDP RENOVAVEIS SA	27,000	4.53	122,553.00	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	256,624	2.37	608,198.88	
ELECTRICITE DE FRANCE(EDF)	32,549	17.87	581,813.37	
ENAGAS	24,500	14.05	344,347.50	
ENEL GREEN POWER SPA	246,000	1.56	384,990.00	
ENEL SPA	884,534	3.01	2,662,447.34	
FORTUM OYJ	60,111	15.85	952,759.35	
GAS NATURAL SDG SA	47,446	12.85	609,918.33	
GDF SUEZ	165,129	19.52	3,223,318.08	
IBERDROLA SA	507,807	4.72	2,396,849.04	
RED ELECTRICA CORPORATION S.A.	14,500	32.29	468,277.50	
RWE AG	64,330	26.01	1,673,544.95	
RWE AG-NON VTG PFD	6,413	23.94	153,559.28	
SNAM RETE GAS	211,376	3.33	705,150.33	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	40,400	8.62	348,530.80	
TERNA SPA	155,846	2.54	395,848.84	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	45,030	7.93	357,087.90	
VERBUND AG	9,870	18.85	186,049.50	
ASML HOLDING NV	57,952	30.26	1,753,627.52	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	146,349	5.60	820,871.54	
STMICROELECTRONICS NV	81,901	4.17	341,690.97	
ユーロ 小計	24,096,076		253,672,788.13	
（邦貨換算額）			(25,735,104,355)	**（単位：円）**

英ポンド				
AMEC PLC	44,435	8.65	384,362.75	
BG GROUP PLC	450,686	13.14	5,922,014.04	
BP PLC	2,529,059	4.37	11,068,426.71	
CAIRN ENERGY PLC	188,286	2.59	487,849.02	
ESSAR ENERGY PLC	42,000	1.80	75,810.00	
PETROFAC LIMITED	35,900	14.09	505,831.00	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	483,237	22.59	10,918,740.01	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	358,066	23.33	8,353,679.78	
TULLOW OIL PLC	122,494	12.99	1,591,197.06	
ANGLO AMERICAN PLC	176,966	22.74	4,025,091.67	
ANTOFAGASTA PLC	53,370	11.50	613,755.00	
BHP BILLITON PLC	280,644	18.16	5,097,898.26	
EURASIAN NATURAL RESOURCES CORPORATION	34,987	6.08	212,720.96	
FRESNILLO PLC	24,500	15.14	370,930.00	
GLENCORE INTERNATIONAL PLC	112,500	3.84	433,068.75	
JOHNSON MATTHEY PLC	29,401	17.61	517,751.61	
KAZAKHMYS PLC	25,600	8.51	217,856.00	
LONMIN PLC	22,856	9.41	215,074.96	
RANDGOLD RESOURCES LTD	12,192	64.95	791,870.40	
REXAM PLC	117,549	3.38	397,903.36	
RIO TINTO PLC	187,522	30.27	5,676,290.94	
VEDANTA RESOURCES PLC	14,200	10.46	148,532.00	
XSTRATA PLC	276,637	9.56	2,646,586.17	
BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	48,600	7.00	340,443.00	
BAE SYSTEMS PLC	444,673	2.69	1,198,838.40	
BALFOUR BEATTY PLC	86,839	2.48	215,794.91	
BUNZL PLC	46,608	8.43	392,905.44	
COBHAM PLC	145,074	1.68	245,029.98	
INVENSYS PLC	99,258	1.98	197,027.13	
MEGGITT PLC	100,000	3.37	337,300.00	

ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	248,603	7.15	1,777,511.45	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-C ENTITLEMENT	17,602,107	0.00	17,602.10	
SMITHS GROUP PLC	50,466	8.81	444,857.79	
WEIR GROUP PLC/THE	28,400	19.18	544,712.00	
WOLSELEY PLC	39,307	19.35	760,590.45	
AGGREKO PLC	36,193	18.48	668,846.64	
CAPITA GROUP PLC	82,099	6.19	508,603.30	
EXPERIAN PLC	132,194	8.35	1,103,819.90	
G4S PLC	195,927	2.57	503,728.31	
INTERTEK GROUP PLC	22,000	19.00	418,000.00	
SERCO GROUP PLC	69,528	4.59	319,272.57	
GKN PLC	199,000	1.70	338,698.00	
BURBERRY GROUP PLC	60,037	11.51	691,025.87	
CARNIVAL PLC	23,847	21.36	509,371.92	
COMPASS GROUP PLC	253,245	5.86	1,485,281.92	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	40,249	10.82	435,494.18	
TUI TRAVEL PLC	62,000	1.53	95,232.00	
WHITBREAD PLC	24,656	15.29	376,990.24	
BRITISH SKY BROADCASTING PLC	151,821	7.09	1,076,410.89	
ITV PLC	488,592	0.60	297,796.82	
PEARSON PLC	107,353	11.45	1,229,191.85	
REED ELSEVIER PLC	163,148	4.99	815,413.70	
WPP PLC	166,050	6.39	1,061,059.50	
KINGFISHER PLC	309,225	2.39	739,975.42	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	219,699	3.07	675,794.12	
NEXT PLC	22,494	26.14	587,993.16	
SAINSBURY (J) PLC	163,638	2.88	471,604.71	
TESCO PLC	1,073,866	3.83	4,122,034.64	
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	289,042	3.16	914,817.93	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	47,500	11.00	522,500.00	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	263,707	29.72	7,838,690.57	

DIAGEO PLC	336,057	13.54	4,550,211.78	
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	134,876	23.55	3,176,329.80	
SABMILLER PLC	127,314	21.76	2,770,352.64	
TATE & LYLE PLC	58,000	6.78	393,240.00	
UNILEVER PLC	171,807	20.96	3,601,074.72	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	82,824	31.84	2,637,116.16	
SMITH & NEPHEW PLC	118,283	5.76	681,310.08	
ASTRAZENECA PLC	180,161	29.49	5,312,947.89	
GLAXOSMITHKLINE PLC	677,253	14.50	9,820,168.50	
SHIRE PLC	75,037	21.50	1,613,295.50	
BARCLAYS PLC	1,552,676	1.65	2,576,665.82	
HSBC HOLDINGS PLC	2,382,689	4.78	11,395,210.14	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,555,412	0.23	1,303,577.42	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	2,450,954	0.19	475,485.07	
STANDARD CHARTERED PLC	315,798	13.51	4,268,009.97	
3I GROUP PLC	139,000	1.66	231,991.00	
ICAP PLC	71,716	3.27	235,085.04	
INVESTEC PLC	65,000	3.27	212,550.00	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	18,902	7.77	146,868.54	
MAN GROUP PLC	255,744	1.23	316,611.07	
SCHRODERS PLC	14,200	12.50	177,500.00	
ADMIRAL GROUP PLC	27,800	8.00	222,400.00	
AVIVA PLC	382,709	2.84	1,090,337.94	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	780,945	0.98	767,278.46	
OLD MUTUAL PLC	718,351	1.25	903,685.55	
PRUDENTIAL PLC	342,265	6.08	2,080,971.20	
RESOLUTION LTD	181,068	2.44	443,435.53	
RSA INSURANCE GROUP PLC	471,885	0.99	471,177.17	
STANDARD LIFE PLC	314,048	1.95	614,591.93	
SAGE GROUP PLC (THE)	181,063	2.84	515,305.29	
ARM HOLDINGS PLC	176,500	5.55	980,457.50	

BT GROUP PLC	1,032,771	1.87	1,931,281.77	
INMARSAT PLC	64,000	3.97	254,528.00	
VODAFONE GROUP PLC	6,785,697	1.74	11,841,041.26	
CENTRICA PLC	689,081	2.82	1,949,410.14	
INTERNATIONAL POWER PLC	207,253	3.21	665,282.13	
NATIONAL GRID PLC	473,867	6.07	2,878,742.02	
SEVERN TRENT PLC	30,994	14.65	454,062.10	
SSE PLC	126,408	12.45	1,573,779.60	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	89,091	5.90	525,636.90	
英ポンド 小計	57,089,631		181,012,506.89	
（邦貨換算額）			(21,913,374,084)	**（単位：円）**
スイスフラン				
TRANSOCEAN LTD	46,155	37.32	1,722,504.60	
GIVAUDAN-REG	1,132	844.50	955,974.00	
HOLCIM LTD-REG	32,775	49.38	1,618,429.50	
SIKA AG	280	1,639.00	458,920.00	
SYNGENTA AG	12,560	260.70	3,274,392.00	
ABB LTD	293,419	16.80	4,929,439.20	
GEBERIT AG-REG	5,110	175.00	894,250.00	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,540	107.70	273,558.00	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	6,270	106.60	668,382.00	
SULZER AG	3,350	92.95	311,382.50	
ADECCO SA-REG	18,334	36.46	668,457.64	
SGS SA	739	1,516.00	1,120,324.00	
KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	7,152	102.50	733,080.00	
CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-BR A	69,898	44.97	3,143,313.06	
THE SWATCH GROUP AG-B	4,196	328.60	1,378,805.60	
THE SWATCH GROUP AG-REG	5,400	58.15	314,010.00	
ARYZTA AG	11,100	44.50	493,950.00	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	230	891.00	204,930.00	

LINDT & SPRUENGLI AG	116	2,729.00	316,564.00	
LINDT & SPRUENGLI AG-REG	15	31,130.00	466,950.00	
NESTLE SA-REGISTERED	440,582	52.20	22,998,380.40	
SONOVA HOLDING AG	6,192	90.90	562,852.80	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	970	154.90	150,253.00	
SYNTHES INC	8,934	154.30	1,378,516.20	
ACTELION LTD	15,116	30.44	460,131.04	
LONZA GROUP AG-REG	6,687	53.90	360,429.30	
NOVARTIS AG-REG SHS	311,726	52.80	16,459,132.80	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	93,790	158.40	14,856,336.00	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	151,455	21.23	3,215,389.65	
GAM HOLDING LTD	28,573	9.85	281,444.05	
JULIUS BAER GROUP LTD	27,669	34.59	957,070.71	
PARGESA HOLDING SA-BR	3,100	60.10	186,310.00	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,700	159.50	271,150.00	
UBS AG-REGISTERED	487,768	10.80	5,267,894.40	
BALOISE HOLDING AG	6,250	60.45	377,812.50	
SWISS LIFE HOLDING AG	4,220	83.65	353,003.00	
SWISS RE LTD	46,797	46.63	2,182,144.11	
ZURICH FINANCIAL SERVICES AG	19,453	202.60	3,941,177.80	
SWISSCOM AG-REG	3,086	342.50	1,056,955.00	
スイスフラン 小計	2,184,839		99,263,998.86	
（邦貨換算額）			(8,267,698,465)	**（単位：円）**
スウェーデンクローナ				
LUNDIN PETROLEUM AB	29,000	158.10	4,584,900.00	
BOLIDEN AB	34,500	93.55	3,227,475.00	
HOLMEN AB-B SHARES	6,133	188.60	1,156,683.80	
SSAB AB-A SHARES	24,542	55.40	1,359,626.80	
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	77,967	98.40	7,671,952.80	
ALFA LAVAL AB	45,552	122.90	5,598,340.80	

ASSA ABLOY AB-B	41,816	160.70	6,719,831.20	
ATLAS COPCO AB-A SHS	88,809	139.30	12,371,093.70	
ATLAS COPCO AB-B SHS	53,896	123.20	6,639,987.20	
HEXAGON AB-B SHS	31,700	91.70	2,906,890.00	
SANDVIK AB	137,154	78.30	10,739,158.20	
SCANIA AB-B SHS	41,632	95.45	3,973,774.40	
SKANSKA AB-B SHS	53,490	105.50	5,643,195.00	
SKF AB-B SHARES	51,438	134.70	6,928,698.60	
VOLVO AB-B SHS	182,394	69.95	12,758,460.30	
SECURITAS AB-B SHS	45,757	58.60	2,681,360.20	
ELECTROLUX AB-SER B	30,383	104.00	3,159,832.00	
HUSQVARNA AB-B SHS	63,983	29.77	1,904,773.91	
MODERN TIMES GROUP-B SHS	6,400	300.70	1,924,480.00	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	137,044	209.90	28,765,535.60	
SWEDISH MATCH AB	27,271	235.80	6,430,501.80	
GETINGE AB-B SHS	26,138	164.70	4,304,928.60	
NORDEA BANK AB	354,947	49.88	17,704,756.36	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A	192,423	38.09	7,329,392.07	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	66,753	176.20	11,761,878.60	
SWEDBANK AB - A SHARES	107,364	85.50	9,179,622.00	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	12,800	76.95	984,960.00	
INVESTOR AB-B SHS	62,449	123.00	7,681,227.00	
KINNEVIK INVESTMENT AB-B	27,000	131.90	3,561,300.00	
RATOS AB-B SHS	24,400	76.45	1,865,380.00	
ERICSSON LM-B SHS	404,069	65.60	26,506,926.40	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	10,050	723.50	7,271,175.00	
TELE2 AB -B SHS	43,298	125.90	5,451,218.20	
TELIASONERA AB	287,171	44.70	12,836,543.70	
スウェーデンクローナ 小計	2,829,723		253,585,859.24	
（邦貨換算額）			(2,855,376,775)	**（単位：円）**

ノルウェークローネ				
AKER SOLUTIONS ASA	20,600	57.50	1,184,500.00	
SEADRILL LID	43,445	190.80	8,289,306.00	
STATOIL ASA	150,749	145.80	21,979,204.20	
SUBSEA 7 SA	37,600	104.00	3,910,400.00	
NORSK HYDRO ASA	120,597	25.91	3,124,668.27	
YARA INTERNATIONAL ASA	24,212	221.20	5,355,694.40	
ORKLA ASA	103,550	42.07	4,356,348.50	
DNB ASA	128,619	55.15	7,093,337.85	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	30,000	65.80	1,974,000.00	
TELENOR ASA	94,292	92.80	8,750,297.60	
ノルウェークローネ 小計	753,664		66,017,756.82	
（邦貨換算額）			(866,813,147)	**（単位：円）**
デンマーククローネ				
NOVOZYMES A/S-B SHARES	30,915	168.40	5,206,086.00	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	27,962	59.05	1,651,156.10	
A P MOLLER - MAERSK A/S	175	34,540.00	6,044,500.00	
A P MOLLER-MAERSK A/S-A	79	32,860.00	2,595,940.00	
DSV A/S	26,180	99.95	2,616,691.00	
CARLSBERG AS-B	13,866	388.30	5,384,167.80	
COLOPLAST-B	2,961	792.00	2,345,112.00	
WILLIAM DEMANT HOLDING	2,860	448.00	1,281,280.00	
NOVO NORDISK A/S-B	56,704	645.00	36,574,080.00	
DANSKE BANK A/S	89,438	72.05	6,444,007.90	
TRYG A/S	3,368	312.70	1,053,173.60	
TDC A/S	52,500	45.27	2,376,675.00	
デンマーククローネ 小計	307,008		73,572,869.40	
（邦貨換算額）			(1,004,269,667)	**（単位：円）**
オーストラリアドル				

CALTEX AUSTRALIA LIMITED	18,000	12.01	216,180.00	
ORIGIN ENERGY LIMITED	142,659	13.19	1,881,672.21	
SANTOS LTD	127,011	12.18	1,546,993.98	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	84,988	30.24	2,570,037.12	
WORLEY PARSONS LIMITED	26,100	25.10	655,110.00	
ALUMINA LTD	333,977	1.16	389,083.20	
AMCOR LIMITED	164,377	7.17	1,178,583.09	
BHP BILLITON LTD	428,657	34.32	14,711,508.24	
BORAL LIMITED	94,596	3.52	332,977.92	
FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	171,000	4.42	755,820.00	
ILUKA RESOURCES LIMITED	54,900	15.58	855,342.00	
INCITEC PIVOT LTD	220,000	3.04	668,800.00	
JAMES HARDIE INDUSTRIES SE	56,003	6.39	357,859.17	
LYNAS CORPORATION LIMITED	235,000	1.15	270,250.00	
NEWCREST MINING LIMITED	102,179	31.07	3,174,701.53	
ONESTEEL LIMITED	132,695	0.67	89,569.12	
ORICA LIMITED	47,923	24.68	1,182,739.64	
OZ MINERALS LIMITED	44,452	10.26	456,077.52	
RIO TINTO LIMITED	58,291	60.20	3,509,118.20	
SIMS METAL MANAGEMENT LTD	22,995	12.90	296,635.50	
LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	19,905	19.05	379,190.25	
BRAMBLES LIMITED	197,132	7.03	1,385,837.96	
CAMPBELL BROTHERS LTD	8,300	47.97	398,151.00	
ASCIANO LTD	136,666	4.48	612,263.68	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	133,138	1.47	196,378.55	
QR NATIONAL LTD	224,000	3.43	768,320.00	
TOLL HOLDINGS LIMITED	95,620	4.36	416,903.20	
CROWN LTD	62,965	8.03	505,608.95	
ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD	99,545	3.56	354,380.20	
TABCORP HOLDINGS LIMITED	77,545	2.74	212,473.30	
TATTS GROUP LTD	174,000	2.38	414,120.00	

FAIRFAX MEDIA LTD	265,729	0.72	192,653.52	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	87,850	1.78	156,812.25	
METCASH LTD	107,000	4.05	433,350.00	
WESFARMERS LIMITED	134,646	29.71	4,000,332.66	
WOOLWORTHS LIMITED	160,948	25.90	4,168,553.20	
COCA-COLA AMATIL LIMITED	76,917	11.90	915,312.30	
COCHLEAR LIMITED	7,113	55.25	392,993.25	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	18,600	18.61	346,146.00	
SONIC HEALTHCARE LTD	48,626	11.32	550,446.32	
CSL LIMITED	70,514	31.90	2,249,396.60	
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	352,501	20.65	7,279,145.65	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	47,400	8.40	398,160.00	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	207,766	48.29	10,033,020.14	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	294,923	23.15	6,827,467.45	
WESTPAC BANKING CORPORATION	402,984	20.05	8,079,829.20	
ASX LTD	23,810	30.28	720,966.80	
MACQUARIE GROUP LTD	47,132	23.50	1,107,602.00	
AMP LIMITED	366,825	4.14	1,518,655.50	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	275,006	3.08	847,018.48	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	144,181	13.14	1,894,538.34	
SUNCORP GROUP LTD	172,981	8.21	1,420,174.01	
COMPUTERSHARE LIMITED	55,229	7.80	430,786.20	
TELSTRA CORPORATION LIMITED	589,187	3.23	1,903,074.01	
AGL ENERGY LIMITED	59,969	14.40	863,553.60	
オーストラリアドル 小計	7,812,456		97,472,673.01	
（邦貨換算額）			(7,555,106,885)	**（単位：円）**
ニュージーランドドル				
FLETCHER BUILDING LTD	95,457	5.92	565,105.44	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	130,557	2.42	315,947.94	
SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP	82,890	3.39	280,997.10	

TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	249,909	2.00	499,818.00	
CONTACT ENERGY LIMITED	51,256	5.28	270,631.68	
ニュージーランドドル 小計	610,069		1,932,500.16	
（邦貨換算額）			(114,114,134)	**（単位：円）**
香港ドル				
HUTCHISON WHAMPOA LTD	284,000	64.40	18,289,600.00	
NWS HOLDINGS LTD	160,500	10.92	1,752,660.00	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	170,000	13.90	2,363,000.00	
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	144,000	13.14	1,892,160.00	
MTR CORPORATION	206,500	24.50	5,059,250.00	
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	31,000	40.00	1,240,000.00	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	96,000	23.50	2,256,000.00	
SANDS CHINA LTD	316,000	20.75	6,557,000.00	
SHANGRI-LA ASIA LTD.	196,000	13.04	2,555,840.00	
SJM HOLDINGS LIMITED	213,000	12.82	2,730,660.00	
WYNN MACAU LTD	202,000	18.22	3,680,440.00	
LI & FUNG LTD	773,200	14.26	11,025,832.00	
LIFESTYLE INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED	73,000	16.94	1,236,620.00	
BANK OF EAST ASIA	198,620	27.00	5,362,740.00	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	487,500	18.34	8,940,750.00	
HANG SENG BANK LTD	104,300	91.90	9,585,170.00	
WING HANG BANK LIMITED	22,000	60.20	1,324,400.00	
FIRST PACIFIC COMPANY	280,000	8.36	2,340,800.00	
HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	135,300	123.60	16,723,080.00	
AIA GROUP LTD	1,136,000	22.75	25,844,000.00	
CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	183,000	89.20	16,323,600.00	
HANG LUNG GROUP LTD	122,000	41.80	5,099,600.00	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	324,000	21.95	7,111,800.00	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	125,000	35.90	4,487,500.00	
HOPEWELL HOLDINGS LTD	72,000	19.86	1,429,920.00	

HYSAN DEVELOPMENT CO	92,000	25.05	2,304,600.00	
KERRY PROPERTIES LTD	91,500	25.05	2,292,075.00	
NEW WORLD DEVELOPMENT	449,000	6.20	2,783,800.00	
SINO LAND CO	398,200	10.04	3,997,928.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	189,000	93.30	17,633,700.00	
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	98,000	92.50	9,065,000.00	
WHARF HOLDINGS LTD	203,000	33.50	6,800,500.00	
WHEELOCK&COMPANY LTD	137,000	18.32	2,509,840.00	
FOXCONN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	358,000	4.84	1,732,720.00	
PCCW LIMITED	510,000	2.71	1,382,100.00	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	61,000	44.55	2,717,550.00	
CLP HOLDINGS LTD	256,600	65.30	16,755,980.00	
HONG KONG & CHINA GAS	626,741	17.66	11,068,246.06	
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	189,000	57.55	10,876,950.00	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	25,500	87.40	2,228,700.00	
香港ドル 小計	9,739,461		259,362,111.06	
（邦貨換算額）			(2,601,401,973)	**（単位：円）**
シンガポールドル				
COSCO CORP SINGAPORE LTD	150,000	0.85	127,500.00	
FRASER & NEAVE LTD	118,000	6.07	716,260.00	
KEPPEL CORP LTD	190,400	8.96	1,705,984.00	
NOBLE GROUP LTD	539,400	1.10	596,037.00	
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	123,820	3.91	484,136.20	
SEMBCORP MARINE LTD	103,400	3.69	381,546.00	
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG	212,000	2.70	572,400.00	
YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	245,000	0.89	219,275.00	
COMFORTDELGRO CORP LTD	259,000	1.38	358,715.00	
NEPTUNE ORIENT LINES LTD	98,000	1.10	108,290.00	
SINGAPORE AIRLINES LTD	74,266	10.14	753,057.24	
GENTING SINGAPORE PLC	823,000	1.50	1,234,500.00	

SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	207,250	3.62	750,245.00	
CYCLE & CARRIAGE LTD	14,000	47.53	665,420.00	
OLAM INTERNATIONAL LTD	176,000	2.13	374,880.00	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	921,600	0.70	645,120.00	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	258,000	4.91	1,266,780.00	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	232,000	11.36	2,635,520.00	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	340,000	7.86	2,672,400.00	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	167,000	15.10	2,521,700.00	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	119,000	5.93	705,670.00	
CAPITALAND LTD	328,000	2.25	738,000.00	
CAPITAMALLS ASIA LTD	190,000	1.16	221,350.00	
CITY DEVELOPMENTS LTD	73,000	8.99	656,270.00	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LIMITED	260,000	1.64	426,400.00	
KEPPEL LAND LTD	90,000	2.25	202,500.00	
UOL GROUP LIMITED	62,000	3.97	246,140.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,071,015	3.13	3,352,276.95	
STARHUB LIMITED	80,000	2.86	228,800.00	
シンガポールドル 小計	7,525,151		25,567,172.39	
（邦貨換算額）			(1,527,127,206)	**（単位：円）**
イスラエルシュケル				
DELEK GROUP LTD	530	682.50	361,725.00	
ISRAEL CHEMICALS LIMITED	60,000	36.70	2,202,000.00	
ISRAEL CORPORATION LTD/THE	335	2,300.00	770,500.00	
ELBIT SYSTEMS LTD	3,000	159.80	479,400.00	
TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	125,723	162.80	20,467,704.40	
BANK HAPOALIM BM	139,000	13.12	1,823,680.00	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	161,000	11.51	1,853,110.00	
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	113,700	5.50	625,463.70	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	16,000	29.90	478,400.00	
NICE SYSTEMS LTD	8,200	123.00	1,008,600.00	

BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	243,000	7.33	1,781,190.00	
CELLCOM ISRAEL LTD	6,700	64.02	428,934.00	
PARTNER COMMUNICATIONS COMPANY LTD	11,000	34.42	378,620.00	
イスラエルシュケル 小計	888,188		32,659,327.10	
（邦貨換算額）			(670,495,985)	**（単位：円）**
合 計	159,285,954		200,471,870,776	**単位：円**
（外貨建有価証券邦貨換算額合計）			(200,471,870,776)	**（単位：円）**

（注）

１．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。

２．米ドル表示の株式については、568銘柄、信託財産純資産総額に対する比率55.5%、
合計に対する比率57.8%です。
カナダドル表示の株式については、101銘柄、信託財産純資産総額に対する比率5.5%、
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、244銘柄、信託財産純資産総額に対する比率12.3%、
合計に対する比率12.8%です。
英ポンド表示の株式については、101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、39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1.4%、
合計に対する比率1.4%です。
ノルウェークローネ表示の株式については、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。
デンマーククローネ表示の株式については、12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、55銘柄、信託財産純資産総額に対する比率3.6%、
合計に対する比率3.8%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、40銘柄、信託財産純資産総額に対する比率1.2%、
合計に対する比率1.3%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0.7%、
合計に対する比率0.8%です。
イスラエルシュケル表示の株式については、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0.3%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			
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	129,600	2,115,072.00	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	12,817	1,628,656.19	
	BOSTON PROPERTIES INC	19,716	1,875,188.76	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	13,000	850,980.00	
	DUKE REALTY CORP	31,773	364,118.58	
	EQUITY RESIDENTIAL	40,056	2,220,704.64	
	FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	8,904	801,805.20	
	GENERAL GROWTH PROPERTIES	59,120	848,372.00	
	HCP,INC.	53,667	2,071,009.53	
	HEALTH CARE REIT INC	25,600	1,317,376.00	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	91,951	1,253,292.13	
	HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	692,000	411,740.00	
	KIMCO REALTY CORPORATION	53,932	863,451.32	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	14,665	435,550.50	
	MACERICH COMPANY/THE	17,839	862,515.65	
	PLUM CREEK TIMBER COMPANY	22,243	774,056.40	
	PROLOGIS INC	60,927	1,635,889.95	
	PUBLIC STORAGE	19,101	2,441,680.83	
	RAYONIER INC	16,200	669,870.00	
	REGENCY CENTERS CORP	11,400	410,172.00	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	39,376	4,853,485.76	
	VENTAS INC	36,620	1,910,099.20	
	VORNADO REALTY TRUST	22,093	1,614,998.30	
	米ドル 小計	1,492,600	32,230,084.94	
	（邦貨換算額）		(2,514,913,527)	（単位：円）
	カナダドル			
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	9,500	220,400.00	

	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17,400	453,966.00	
	カナダドル 小計	26,900	674,366.00	
	（邦貨換算額）		(50,712,323)	**（単位：円）**
	ユーロ			
	CORIO NV	8,248	258,904.72	
	FONCIERE DES REGIONS	4,050	181,035.00	
	GECINA SA	2,880	161,856.00	
	ICADE	2,770	146,228.30	
	KLEPIERRE	14,732	302,006.00	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	12,269	1,567,364.75	
	ユーロ 小計	44,949	2,617,394.77	
	（邦貨換算額）		(265,534,699)	**（単位：円）**
	英ポンド			
	BRITISH LAND CO PLC	115,605	520,569.31	
	CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP PLC	79,855	233,096.74	
	HAMMERSON PLC	95,997	331,381.64	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	100,927	617,673.24	
	SEGRO PLC	104,434	203,646.30	
	英ポンド 小計	496,818	1,906,367.23	
	（邦貨換算額）		(230,784,816)	**（単位：円）**
	オーストラリアドル			
	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	258,612	460,329.36	
	DEXUS PROPERTY GROUP	610,804	519,183.40	
	GOODMAN GROUP	955,000	549,125.00	
	GPT GROUP	228,494	710,616.34	
	LEND LEASE GROUP	73,372	529,012.12	
	MAP GROUP	51,000	141,270.00	
	MIRVAC GROUP	449,710	557,640.40	

	SP AUSNET	155,000	141,825.00	
	STOCKLAND	321,614	1,077,406.90	
	TRANSURBAN GROUP	182,032	1,023,019.84	
	WESTFIELD GROUP	297,027	2,331,661.95	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	398,993	977,532.85	
	オーストラリアドル 小計	3,981,658	9,018,623.16	
	（邦貨換算額）		(699,033,481)	**（単位：円）**
	香港ドル			
	LINK REIT	294,500	8,393,250.00	
	香港ドル 小計	294,500	8,393,250.00	
	（邦貨換算額）		(84,184,297)	**（単位：円）**
	シンガポールドル			
	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	223,000	412,550.00	
	CAPITAMALL TRUST	280,000	469,000.00	
	シンガポールドル 小計	503,000	881,550.00	
	（邦貨換算額）		(52,654,981)	**（単位：円）**
合 計			3,897,818,124	**単位：円**
（外貨建有価証券邦貨換算額合計）			(3,897,818,124)	**（単位：円）**

（注）

1．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。

2．米ドル表示の投資証券については、23銘柄、信託財産純資産総額に対する比率1.2%、
合計に対する比率64.5%です。
カナダ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1.3%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6.8%です。
英ポンド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5.9%です。
オーストラリアドル表示の投資証券については、12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17.9%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2.2%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1.4%です。

②デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
※「（デリバティブ取引に関する注記）」に同様の内容が記載されているため、省略しております。

「ＳＭＡＭ・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22年12月20日現在）	（平成23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	12	57
親投資信託受益証券	5,982,307,328	5,945,902,725
流動資産合計	5,982,307,340	5,945,902,782
資産合計	5,982,307,340	5,945,902,782
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	20,672	6,806
未払委託者報酬	10,335	3,402
流動負債合計	31,007	10,208
負債合計	31,007	10,208
純資産の部		
元本等		
元本		
元本	5,449,580,077	5,453,470,323
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	532,696,256	492,422,251
元本等合計	5,982,276,333	5,945,892,574
純資産合計	5,982,276,333	5,945,892,574
負債純資産合計	5,982,307,340	5,945,902,782

（注）「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、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22年12月20日ならびに平成23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22年12月18日 至 平成22年12月20日	自 平成23年12月20日 至 平成23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22年12月20日現在）	（平成23年12月20日現在）
１．受益権総数	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	平成23年12月20日現在における受益権の総数 5,453,470,323口
２．１単位当たり純資産額	1.0977円 （１万口＝10,977円）	1.0903円 （１万口＝10,903円）

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．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	自 平成23年12月20日 至 平成23年12月20日
	（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。	――――――
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。	同 左
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。	（1）金融商品の内容 1）有価証券 同 左

	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。	2）デリバティブ取引 同 左 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 同 左
３．金融商品に係るリスク管理体制	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。 また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限値、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。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、測定項目が上下限値（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。	同 左

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。	同 左

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項 目	（平成22年12月20日現在）	（平成23年12月20日現在）
１．貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同 左
２．時価の算定方法	（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。 （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。	（1）有価証券（親投資信託受益証券） 同 左 （2）派生商品評価勘定（デリバティブ取引） 同 左 （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 同 左

（デリバティブ取引に関する注記）

（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。

（平成23年12月20日現在）

平成23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。

（自 平成23年12月20日 至 平成23年12月20日）

該当事項はありません。

（その他の注記）

（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

（平成23年12月20日現在）	
期　首	平成23年12月20日
期首元本額	5,453,470,323円
期首より平成23年12月20日現在までの追加設定元本額	－円
期首より平成23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	5,426,083,889円	1.0958円	5,945,902,725円

（参考情報）

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」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22年12月20日現在）	（平成23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	546,267,383	2,601,329,010
コール・ローン	1,587,684,297	2,776,108,359
国債証券	246,685,097,822	238,498,899,015
派生商品評価勘定	1,189,038	－
未収入金	2,135,730,000	4,000
未収利息	2,990,787,054	2,754,413,456
前払費用	143,784,393	79,077,245
流動資産合計	254,090,539,987	246,709,831,085
資産合計	254,090,539,987	246,709,831,085
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	1,992,045	121,637,549
流動負債合計	2,651,267,659	121,637,549
負債合計	2,651,267,659	121,637,549
純資産の部		

元本等		
元本		
元本	228,049,629,058	225,020,984,718
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	23,389,643,270	21,567,208,818
元本等合計	251,439,272,328	246,588,193,536
純資産合計	251,439,272,328	246,588,193,536
負債純資産合計	254,090,539,987	246,709,831,085

（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22年12月20日ならびに平成23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22年12月18日 至 平成22年12月20日	自 平成23年12月20日 至 平成23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22年12月20日現在）	（平成23年12月20日現在）
１．受益権総数	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	平成23年12月20日現在における受益権の総数 225,020,984,718口
２．１単位当たり純資産額	1.1026円 （１万口＝11,026円）	1.0958円 （１万口＝10,958円）

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．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	自 平成23年12月20日 至 平成23年12月20日
	（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。	―――――

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。	同 左
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、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。 3）コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 （2）金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。	（1）金融商品の内容 1）有価証券 同 左 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 同 左

３．金融商品に係るリスク管理体制	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。 また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限値、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。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、測定項目が上下限値（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。	同 左
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。	同 左

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項 目	（平成22年12月20日現在）	（平成23年12月20日現在）
１．貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同 左

２．時価の算定方法	**（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。** **（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。**	**（1）有価証券（国債証券）** **同 左** **（2）派生商品評価勘定（デリバティブ取引）** **同 左** **（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** **同 左**

（デリバティブ取引に関する注記）

（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

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。

①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。

②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。

（平成23年12月20日現在）
平成23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。

（自　平成23年12月20日　至　平成23年12月20日）
該当事項はありません。

（その他の注記）

(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

(平成23年12月20日現在)	
期　首	平成23年12月20日
期首元本額	224,957,760,630円
期首より平成23年12月20日現在までの追加設定元本額	146,255,943円
期首より平成23年12月20日現在までの一部解約元本額	83,031,855円
平成23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	2,742,528,711円
三井住友・ＤＣ年金バランス30（債券重点型）	207,458,410円
三井住友・ＤＣ年金バランス50（標準型）	581,155,614円
三井住友・ＤＣ年金バランス70（株式重点型）	265,666,326円
スミセイ・ＤＣバランスファンド（機動的資産配分型）	22,160,121円
スミセイ・ＤＣターゲットイヤーファンド2020	4,445,662円
スミセイ・ＤＣターゲットイヤーファンド2025	4,181,791円
スミセイ・ＤＣターゲットイヤーファンド2030	3,468,402円
スミセイ・ＤＣターゲットイヤーファンド2035	3,573,444円
スミセイ・ＤＣターゲットイヤーファンド2040	868,560円
スミセイ・ＤＣターゲットイヤーファンド2045	2,072,294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＞	5,426,083,889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＞	12,348,074,686円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	37,960,089,736円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３７．５＜適格機関投資家専用＞	11,781,075,282円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	24,507,299,633円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ３０＜適格機関投資家限定＞	88,003,152円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＬ５０＜適格機関投資家限定＞	181,603,177円
世界６資産バランスファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	46,963,700円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ７５＜適格機関投資家専用＞	1,279,736,340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＞	176,215,623円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ２５＜適格機関投資家専用＞	2,324,275,098円
ＳＭＡＭ・インデックス・バランスＶＡ５０＜適格機関投資家専用＞	3,077,924,594円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ４０＜適格機関投資家専用＞	6,969,932,181円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ３５＜適格機関投資家専用＞	15,668,683,215円
ＳＭＡＭ・バランスＶＡ株４０Ｔ＜適格機関投資家限定＞	1,247,741,729円
ＳＭＡＭ・外国債券パッシブファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	22,310,394,821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）	2,171,389,005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）	10,442,358,160円
ＳＭＡＭ・グローバルバランス４０ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	430,059,123円
ＳＭＡＭ・バランスファンドＶＡ２０＜適格機関投資家専用＞	11,142,317,659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）	44,841,795,595円

ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ＜適格機関投資家専用＞	307,445,418円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ＜適格機関投資家専用＞	91,963,553円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ＜適格機関投資家専用＞	22,650,071円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｌ＜適格機関投資家専用＞	412,170,575円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ＜適格機関投資家専用＞	1,432,723,169円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｔ＜適格機関投資家専用＞	409,123,925円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	351,079,423円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ３５Ａ２＜適格機関投資家専用＞	85,812,994円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ５０Ａ２＜適格機関投資家専用＞	13,193,042円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２５Ｌ２＜適格機関投資家専用＞	3,381,804,150円
ＳＭＡＭ・アセットバランスファンドＶＡ２０Ｔ２＜適格機関投資家専用＞	96,783,980円
ＳＭＡＭ・ＦＧ新興国重視型バランス20ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	110,454,488円
ＳＭＡＭ・ＦＧグローバルバランス25ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	46,184,197円
合　計	225,020,984,718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 0.125% 13/08/31	5,000,000.00	4,990,625.00	
	US T 0.125% 130930	8,500,000.00	8,482,734.37	
	US T 0.25% 13/10/31	9,000,000.00	9,001,406.25	
	US T 0.375% 13/07/31	5,000,000.00	5,011,718.75	
	US T 0.375% 130630	8,000,000.00	8,018,125.04	
	US T 0.375% 14/11/15	9,000,000.00	9,004,218.75	
	US T 0.5% 12/11/30	8,000,000.00	8,023,750.00	
	US T 0.5% 13/10/15	5,000,000.00	5,022,656.25	
	US T 0.5% 13/11/15	7,000,000.00	7,032,265.66	
	US T 0.5% 14/08/15	8,000,000.00	8,037,500.00	
	US T 0.5% 14/10/15	10,000,000.00	10,041,406.30	
	US T 0.625% 12/12/31	7,500,000.00	7,532,812.50	
	US T 0.625% 13/01/31	4,000,000.00	4,018,750.00	
	US T 0.625% 13/02/28	5,000,000.00	5,025,000.00	
	US T 0.625% 140715	7,000,000.00	7,054,140.66	
	US T 0.75% 13/08/15	8,000,000.00	8,068,125.04	
	US T 0.75% 13/09/15	6,000,000.00	6,052,968.78	
	US T 0.75% 13/12/15	7,000,000.00	7,068,359.41	
	US T 0.75% 140615	9,000,000.00	9,098,437.50	
	US T 1 14/01/15	3,000,000.00	3,045,000.00	
	US T 1% 13/07/15	8,000,000.00	8,096,250.00	
	US T 1% 14/05/15	3,000,000.00	3,050,156.25	
	US T 1% 16/09/30	5,000,000.00	5,054,296.90	

	US T 1% 16/10/31	4,000,000.00	4,040,312.52	
	US T 1.125% 12/12/15	9,000,000.00	9,082,265.67	
	US T 1.125% 2013/06/15	6,000,000.00	6,080,156.28	
	US T 1.25% 14/02/15	4,000,000.00	4,083,125.00	
	US T 1.25% 14/03/15	6,000,000.00	6,129,375.00	
	US T 1.25% 14/04/15	5,000,000.00	5,109,765.65	
	US T 1.25% 15/08/31	8,000,000.00	8,226,875.04	
	US T 1.25% 15/09/30	7,000,000.00	7,193,046.91	
	US T 1.25% 15/10/31	5,000,000.00	5,135,156.25	
	US T 1.375% 12/11/15	10,000,000.00	10,107,812.50	
	US T 1.375% 13/02/15	10,000,000.00	10,134,375.00	
	US T 1.375% 13/03/15	8,000,000.00	8,118,125.04	
	US T 1.375% 13/05/15	8,000,000.00	8,129,375.04	
	US T 1.375% 15/11/30	5,000,000.00	5,159,375.00	
	US T 1.375% 18/09/30	7,500,000.00	7,553,906.25	
	US T 1.375% 2013/01/15	10,000,000.00	10,125,781.30	
	US T 1.5% 13/12/31	7,000,000.00	7,176,640.66	
	US T 1.5% 16/07/31	8,000,000.00	8,278,125.04	
	US T 1.5% 160630	7,000,000.00	7,246,640.66	
	US T 1.5% 18/08/31	2,000,000.00	2,034,375.00	
	US T 1.75% 13/04/15	10,000,000.00	10,202,343.80	
	US T 1.75% 14/01/31	6,500,000.00	6,701,601.59	
	US T 1.75% 14/03/31	8,000,000.00	8,266,875.04	
	US T 1.75% 15/7/31	5,000,000.00	5,226,953.15	
	US T 1.75% 160531	3,000,000.00	3,140,859.39	
	US T 1.75% 18/10/31	6,000,000.00	6,188,437.50	
	US T 1.875% 14/02/28	6,000,000.00	6,208,125.00	
	US T 1.875% 14/04/30	8,000,000.00	8,295,625.04	
	US T 1.875% 17/08/31	3,000,000.00	3,146,250.00	
	US T 1.875% 17/09/30	6,000,000.00	6,290,625.00	
	US T 1.875% 17/10/31	6,000,000.00	6,289,687.50	

	US T 1.875% 2015/06/30	7,000,000.00	7,345,078.16	
	US T 11.25% 15/02/15	2,000,000.00	2,679,062.50	
	US T 2% 13/11/30	7,000,000.00	7,235,703.16	
	US T 2% 16/01/31	7,000,000.00	7,400,859.41	
	US T 2.125 15/12/31	3,000,000.00	3,187,265.64	
	US T 2.125% 14/11/30	10,500,000.00	11,038,945.36	
	US T 2.125% 16/02/29	5,000,000.00	5,314,843.75	
	US T 2.125% 2015/05/31	8,000,000.00	8,459,375.04	
	US T 2.125% 21/08/15	11,000,000.00	11,336,875.00	
	US T 2.25% 14/05/31	7,000,000.00	7,333,046.91	
	US T 2.25% 15/01/31	10,000,000.00	10,575,781.30	
	US T 2.25% 17/11/30	7,000,000.00	7,487,812.50	
	US T 2.25% 18/07/31	6,000,000.00	6,398,437.50	
	US T 2.375% 14/08/31	8,000,000.00	8,436,875.04	
	US T 2.375% 14/09/30	10,000,000.00	10,561,718.80	
	US T 2.375% 14/10/31	8,000,000.00	8,460,625.04	
	US T 2.375% 15/02/28	9,000,000.00	9,562,500.00	
	US T 2.375% 16/03/31	5,500,000.00	5,901,328.12	
	US T 2.375% 17/7/31	5,000,000.00	5,388,281.25	
	US T 2.375% 180630	2,000,000.00	2,150,312.50	
	US T 2.5% 13/03/31	4,500,000.00	4,631,835.96	
	US T 2.5% 15/03/31	9,000,000.00	9,616,640.67	
	US T 2.5% 15/04/30	10,000,000.00	10,691,406.30	
	US T 2.50% 2017/06/30	5,000,000.00	5,420,312.50	
	US T 2.625% 14/06/30	9,000,000.00	9,524,531.25	
	US T 2.625% 14/07/31	6,000,000.00	6,359,531.28	
	US T 2.625% 16/02/29	5,000,000.00	5,414,843.75	
	US T 2.625% 16/04/30	5,000,000.00	5,421,093.75	
	US T 2.625% 18/01/31	4,000,000.00	4,368,750.00	
	US T 2.625% 20/11/15	18,000,000.00	19,499,062.50	
	US T 2.625% 20/8/15	15,000,000.00	16,258,593.75	

	US T 2.625% 2014/12/31	8,000,000.00	8,541,250.00	
	US T 2.75 17/12/31	4,000,000.00	4,398,125.00	
	US T 2.75% 13/02/28	3,700,000.00	3,811,867.20	
	US T 2.75% 13/10/31	5,500,000.00	5,756,523.46	
	US T 2.75% 16/11/30	7,000,000.00	7,655,156.25	
	US T 2.75% 19/02/15	9,000,000.00	9,891,562.50	
	US T 2.75% 2017/05/31	7,000,000.00	7,677,031.25	
	US T 2.875% 13/01/31	4,000,000.00	4,119,375.00	
	US T 2.875% 18/03/31	4,000,000.00	4,433,125.00	
	US T 3% 16/08/31	7,000,000.00	7,730,625.00	
	US T 3% 16/09/30	7,000,000.00	7,730,625.00	
	US T 3% 17/02/28	7,000,000.00	7,755,781.25	
	US T 3.125% 13/04/30	4,500,000.00	4,677,890.62	
	US T 3.125% 13/08/31	5,500,000.00	5,768,984.37	
	US T 3.125% 13/09/30	6,500,000.00	6,833,125.00	
	US T 3.125% 16/10/31	6,000,000.00	6,668,437.50	
	US T 3.125% 17/01/31	7,000,000.00	7,795,156.25	
	US T 3.125% 17/04/30	7,000,000.00	7,810,468.75	
	US T 3.125% 19/05/15	12,000,000.00	13,503,750.00	
	US T 3.125% 21/05/15	11,000,000.00	12,338,906.25	
	US T 3.25% 16/05/31	4,000,000.00	4,452,500.00	
	US T 3.25% 16/06/30	6,000,000.00	6,685,312.50	
	US T 3.25% 16/07/31	5,000,000.00	5,575,781.25	
	US T 3.25% 17/03/31	4,000,000.00	4,486,875.00	
	US T 3.25% 2016/12/31	6,000,000.00	6,711,562.50	
	US T 3.375% 12/11/30	3,000,000.00	3,091,171.89	
	US T 3.375% 13/06/30	5,000,000.00	5,241,406.25	
	US T 3.375% 13/07/31	5,500,000.00	5,778,437.50	
	US T 3.375% 19/11/15	11,000,000.00	12,610,468.75	
	US T 3.5% 13/05/31	5,000,000.00	5,238,281.25	
	US T 3.5% 18/02/15	8,500,000.00	9,724,531.25	

	US T 3.5% 20/05/15	15,000,000.00	17,360,156.25	
	US T 3.5% 39/02/15	6,000,000.00	6,866,250.00	
	US T 3.625 12/12/31	3,500,000.00	3,623,867.20	
	US T 3.625% 13/05/15	3,650,000.00	3,825,085.93	
	US T 3.625% 19/08/15	9,000,000.00	10,476,562.50	
	US T 3.625% 20/02/15	15,000,000.00	17,500,781.25	
	US T 3.625% 21/02/15	13,000,000.00	15,171,406.25	
	US T 3.75% 18/11/15	7,000,000.00	8,169,218.75	
	US T 3.75% 41/08/15	5,000,000.00	5,974,218.75	
	US T 3.875% 12/10/31	3,000,000.00	3,095,625.00	
	US T 3.875% 13/02/15	3,800,000.00	3,960,312.50	
	US T 3.875% 18/05/15	6,000,000.00	7,022,812.50	
	US T 3.875% 40/8/15	11,000,000.00	13,392,500.00	
	US T 4% 12/11/15	5,000,000.00	5,173,437.50	
	US T 4% 14/02/15	6,500,000.00	7,018,984.37	
	US T 4% 18/08/15	6,000,000.00	7,093,125.00	
	US T 4% 2015/02/15	7,700,000.00	8,567,453.12	
	US T 4.125 15/05/15	4,200,000.00	4,721,718.75	
	US T 4.25% 13/08/15	7,000,000.00	7,467,031.25	
	US T 4.25% 13/11/15	6,900,000.00	7,422,890.62	
	US T 4.25% 14/08/15	5,400,000.00	5,961,937.50	
	US T 4.25% 14/11/15	6,100,000.00	6,783,390.62	
	US T 4.25% 15/08/15	7,600,000.00	8,634,312.50	
	US T 4.25% 17/11/15	5,000,000.00	5,932,812.50	
	US T 4.25% 39/05/15	7,000,000.00	9,055,156.25	
	US T 4.25% 40/11/15	11,000,000.00	14,263,906.25	
	US T 4.375% 38/02/15	4,200,000.00	5,517,093.75	
	US T 4.375% 39/11/15	9,000,000.00	11,881,406.25	
	US T 4.375% 40/05/15	11,000,000.00	14,530,312.50	
	US T 4.375% 41/05/15	6,000,000.00	7,949,062.50	
	US T 4.5 15/11/15	5,800,000.00	6,684,500.00	

	US T 4.5% 160215	5,400,000.00	6,261,468.75	
	US T 4.5% 17/05/15	3,000,000.00	3,566,250.00	
	US T 4.5% 36/02/15	5,500,000.00	7,302,968.75	
	US T 4.5% 38/05/15	4,500,000.00	6,027,890.62	
	US T 4.5% 39/08/15	7,000,000.00	9,412,812.50	
	US T 4.625% 16/11/15	5,200,000.00	6,158,750.00	
	US T 4.625% 17/02/15	3,000,000.00	3,570,000.00	
	US T 4.625% 40/02/15	10,000,000.00	13,715,625.00	
	US T 4.75% 14/05/15	6,400,000.00	7,082,000.00	
	US T 4.75% 17/08/15	5,000,000.00	6,050,781.25	
	US T 4.75% 37/02/15	4,000,000.00	5,510,625.00	
	US T 4.75% 41/02/15	11,000,000.00	15,413,750.00	
	US T 4.875% 16/08/15	4,900,000.00	5,834,062.50	
	US T 5% 37/05/15	2,000,000.00	2,856,562.50	
	US T 5.125% 16/05/15	5,700,000.00	6,800,812.50	
	US T 5.25% 28/11/15	2,000,000.00	2,788,750.00	
	US T 5.25% 29/02/15	2,000,000.00	2,794,062.50	
	US T 5.375% 31/02/15	3,020,000.00	4,355,406.25	
	US T 5.5% 28/08/15	2,000,000.00	2,853,750.00	
	US T 6% 26/02/15	1,000,000.00	1,454,375.00	
	US T 6.125% 27/11/15	4,000,000.00	6,005,625.00	
	US T 6.125% 29/08/15	1,100,000.00	1,684,203.12	
	US T 6.25% 23/08/15	4,500,000.00	6,484,921.87	
	US T 6.25% 30/05/15	3,000,000.00	4,689,843.75	
	US T 6.5% 26/11/15	2,000,000.00	3,064,375.00	
	US T 6.625% 27/02/15	2,000,000.00	3,108,750.00	
	US T 6.75% 26/08/15	1,000,000.00	1,559,218.75	
	US T 6.875% 25/08/15	2,000,000.00	3,106,875.00	
	US T 7.125% 23/02/15	2,400,000.00	3,652,875.00	
	US T 7.25% 16/05/15	4,000,000.00	5,148,750.00	
	US T 7.25% 22/08/15	2,500,000.00	3,807,812.50	

	US T 7.5% 16/11/15	2,400,000.00	3,177,375.00	
	US T 7.5% 24/11/15	1,000,000.00	1,608,750.00	
	US T 7.625% 25/02/15	2,000,000.00	3,260,000.00	
	US T 7.875% 21/02/15	2,000,000.00	3,069,375.00	
	US T 8% 21/11/15	2,800,000.00	4,402,562.50	
	US T 8.125% 21/05/15	1,000,000.00	1,565,312.50	
	US T 8.75% 17/05/15	3,000,000.00	4,250,625.00	
	US T 8.75% 20/08/15	1,000,000.00	1,587,656.25	
	US T 8.875% 17/08/15	2,000,000.00	2,879,687.50	
	US T 8.875% 190215	2,100,000.00	3,200,203.12	
	米ドル 小計	1,145,970,000.00	1,275,110,946.80	
	（邦貨換算額）		(99,496,907,178)	**（単位：円）**
	カナダドル			
	CAN 1.5% 12/12/01	3,000,000.00	3,017,370.00	
	CAN 1.75% 2013/03/01	4,000,000.00	4,041,840.00	
	CAN 2% 12/09/01	3,000,000.00	3,022,770.00	
	CAN 2% 14/03/01	3,000,000.00	3,074,400.00	
	CAN 2% 14/12/01	4,000,000.00	4,120,880.00	
	CAN 2% 16/06/01	2,000,000.00	2,074,120.00	
	CAN 2.5% 13/09/01	2,000,000.00	2,055,640.00	
	CAN 2.5% 2015/06/01	2,000,000.00	2,101,000.00	
	CAN 2.75% 16/09/01	2,000,000.00	2,143,000.00	
	CAN 3% 14/06/01	4,500,000.00	4,730,400.00	
	CAN 3% 15/12/01	3,000,000.00	3,222,930.00	
	CAN 3.25% 21/06/01	2,000,000.00	2,240,000.00	
	CAN 3.5% 13/06/01	4,500,000.00	4,670,730.00	
	CAN 3.5% 20/06/01	3,000,000.00	3,409,230.00	
	CAN 3.75% 19/06/01	5,000,000.00	5,753,500.00	
	CAN 4% 16/06/01	3,000,000.00	3,370,920.00	
	CAN 4% 17/06/01	3,000,000.00	3,427,140.00	

	CAN 4% 41/06/01	4,000,000.00	5,316,000.00	
	CAN 4.25% 18/06/01	2,500,000.00	2,934,000.00	
	CAN 4.5% 15/06/01	3,000,000.00	3,354,540.00	
	CAN 5% 14/06/01	2,500,000.00	2,748,825.00	
	CAN 5% 37/06/01	4,000,000.00	5,904,880.00	
	CAN 5.25% 12/06/01	1,620,000.00	1,651,282.20	
	CAN 5.25% 13/06/01	2,000,000.00	2,126,040.00	
	CAN 5.75% 29/06/01	2,800,000.00	4,165,448.00	
	CAN 5.75% 33/06/01	3,000,000.00	4,654,050.00	
	CAN 8% 23/06/01	1,400,000.00	2,257,514.00	
	CAN 8% 27/06/01	1,000,000.00	1,756,590.00	
	CAN 9% 25/06/01	1,480,000.00	2,669,712.80	
	カナダドル 小計	82,300,000.00	96,014,752.00	
	（邦貨換算額）		(7,220,309,350)	**（単位：円）**
	メキシコペソ			
	MEX BONOS 8% 200611	50,000,000.00	55,313,750.00	
	MEX BONOS 8.5% 290531	50,000,000.00	55,251,750.00	
	MEX BONOS 8.5% 381118	65,000,000.00	69,791,800.00	
	MEX BONOS 9% 121220	90,000,000.00	93,869,730.00	
	MEX BONOS 9.5% 141218	80,000,000.00	89,756,320.00	
	メキシコペソ 小計	335,000,000.00	363,983,350.00	
	（邦貨換算額）		(2,038,306,760)	**（単位：円）**
	ユーロ			
	BGB 2.75% 16/03/28	2,000,000.00	1,952,700.00	
	BGB 3.25% 16/09/28	3,500,000.00	3,467,800.00	
	BGB 3.5% 15/03/28	1,500,000.00	1,512,495.00	
	BGB 3.5% 17/06/28	2,000,000.00	1,967,300.00	
	BGB 3.75% 15/09/28	3,300,000.00	3,366,000.00	
	BGB 3.75% 20/09/28	4,000,000.00	3,873,800.00	

	BGB 4% 13/03/28	2,800,000.00	2,869,580.00	
	BGB 4% 14/03/28	3,200,000.00	3,276,576.00	
	BGB 4% 17/03/28	2,500,000.00	2,528,000.00	
	BGB 4% 18/03/28	2,500,000.00	2,521,450.00	
	BGB 4% 19/03/28	3,000,000.00	3,003,060.00	
	BGB 4% 2022/03/28	3,000,000.00	2,931,000.00	
	BGB 4.25% 13/09/28	3,000,000.00	3,084,990.00	
	BGB 4.25% 14/09/28	2,500,000.00	2,579,375.00	
	BGB 4.25% 2041/03/28	2,000,000.00	1,914,700.00	
	BGB 4.25% 21/09/28	3,000,000.00	2,977,350.00	
	BGB 4.5% 26/03/28	1,000,000.00	1,006,950.00	
	BGB 5% 35/03/28	3,000,000.00	3,211,440.00	
	BGB 5.5% 17/09/28	1,740,000.00	1,885,638.00	
	BGB 5.5% 28/03/28	4,000,000.00	4,446,320.00	
	BGB 8% 12/12/24	1,600,000.00	1,707,600.00	
	BGB 8% 15/03/28	2,000,000.00	2,287,400.00	
	BKO 1% 12/12/14	5,000,000.00	5,047,750.00	
	BKO 1.5% 13/03/15	5,000,000.00	5,087,000.00	
	BTNS 2% 13/09/25	2,500,000.00	2,547,450.00	
	BTNS 2% 15/07/12	5,000,000.00	5,060,900.00	
	BTNS 2.25% 16/02/25	4,000,000.00	4,058,920.00	
	BTNS 2.5% 14/01/12	6,500,000.00	6,695,000.00	
	BTNS 2.5% 15/01/15	4,500,000.00	4,631,400.00	
	BTNS 2.5% 16/07/25	3,600,000.00	3,676,788.00	
	BTNS 3% 14/07/12	5,500,000.00	5,734,740.00	
	BTNS 3.75% 13/01/12	7,000,000.00	7,247,450.00	
	BTNS 4.5% 13/07/12	5,500,000.00	5,824,500.00	
	BTPS 2% 12/12/15	5,000,000.00	4,901,750.00	
	BTPS 2% 13/06/01	4,000,000.00	3,847,800.00	
	BTPS 2.25% 13/11/01	3,000,000.00	2,856,390.00	
	BTPS 3 14/04/01	4,000,000.00	3,819,400.00	

	BTPS 3% 15/04/15	5,000,000.00	4,619,150.00	
	BTPS 3% 15/06/15	4,000,000.00	3,682,120.00	
	BTPS 3% 15/11/01	4,000,000.00	3,631,680.00	
	BTPS 3.5% 14/06/01	5,000,000.00	4,805,500.00	
	BTPS 3.75% 13/12/15	5,000,000.00	4,883,500.00	
	BTPS 3.75% 15/08/01	6,200,000.00	5,818,700.00	
	BTPS 3.75% 16/04/15	3,000,000.00	2,771,790.00	
	BTPS 3.75% 16/08/01	6,000,000.00	5,478,000.00	
	BTPS 3.75% 21/03/01	6,000,000.00	5,003,280.00	
	BTPS 3.75% 21/08/01	6,300,000.00	5,170,410.00	
	BTPS 4% 17/02/01	6,000,000.00	5,464,200.00	
	BTPS 4% 20/09/01	5,500,000.00	4,659,490.00	
	BTPS 4% 37/02/01	6,500,000.00	4,532,125.00	
	BTPS 4.25 12/10/15	2,000,000.00	2,001,700.00	
	BTPS 4.25 13/08/01	5,810,000.00	5,763,520.00	
	BTPS 4.25 19/02/01	5,400,000.00	4,790,880.00	
	BTPS 4.25% 13/04/15	4,500,000.00	4,466,925.00	
	BTPS 4.25% 14/08/01	6,900,000.00	6,742,887.00	
	BTPS 4.25% 15/02/01	5,000,000.00	4,838,000.00	
	BTPS 4.25% 19/09/01	5,000,000.00	4,368,650.00	
	BTPS 4.25% 20/03/01	5,000,000.00	4,369,900.00	
	BTPS 4.5% 18/02/01	6,000,000.00	5,469,900.00	
	BTPS 4.5% 18/08/01	5,000,000.00	4,521,500.00	
	BTPS 4.5% 19/03/01	6,000,000.00	5,365,080.00	
	BTPS 4.5% 20/02/01	5,500,000.00	4,866,675.00	
	BTPS 4.5% 26/03/01	3,000,000.00	2,400,600.00	
	BTPS 4.75% 13/02/01	5,300,000.00	5,303,975.00	
	BTPS 4.75% 16/09/15	2,500,000.00	2,372,825.00	
	BTPS 4.75% 21/09/01	6,000,000.00	5,333,100.00	
	BTPS 4.75% 23/08/01	5,500,000.00	4,626,875.00	
	BTPS 5% 25/03/01	5,000,000.00	4,210,150.00	

	BTPS 5% 34/08/01	4,970,000.00	3,919,988.10	
	BTPS 5% 39/08/01	4,000,000.00	3,132,720.00	
	BTPS 5% 40/09/01	5,000,000.00	3,912,900.00	
	BTPS 5.25 17/08/01	5,000,000.00	4,773,650.00	
	BTPS 5.25% 29/11/01	7,200,000.00	5,938,920.00	
	BTPS 5.75% 33/02/01	3,700,000.00	3,152,215.00	
	BTPS 6% 31/05/01	6,900,000.00	6,080,970.00	
	BTPS 6.5% 27/11/01	5,960,000.00	5,600,910.00	
	BTPS 7.25% 26/11/01	2,000,000.00	2,061,860.00	
	BTPS 9.00% 23/11/01	3,000,000.00	3,347,340.00	
	BUNDESOBLIGA 2% 16/02/26	3,000,000.00	3,167,400.00	
	BUNDESSCHA 1.75% 130614	3,000,000.00	3,072,240.00	
	DBR 2.25% 20/09/04	4,000,000.00	4,179,000.00	
	DBR 2.25% 21/09/04	3,000,000.00	3,111,240.00	
	DBR 2.5% 21/01/04	4,000,000.00	4,259,080.00	
	DBR 3% 20/07/04	5,000,000.00	5,530,250.00	
	DBR 3.25% 15/07/04	5,500,000.00	6,027,725.00	
	DBR 3.25% 20/01/04	5,500,000.00	6,188,765.00	
	DBR 3.25% 21/07/04	5,000,000.00	5,634,500.00	
	DBR 3.25% 42/07/04	2,000,000.00	2,370,300.00	
	DBR 3.5% 160104	5,200,000.00	5,798,156.00	
	DBR 3.5% 19/07/04	5,000,000.00	5,708,150.00	
	DBR 3.75% 13/07/04	5,800,000.00	6,121,900.00	
	DBR 3.75% 15/01/04	6,000,000.00	6,602,580.00	
	DBR 3.75% 17/01/04	5,000,000.00	5,707,250.00	
	DBR 3.75% 19/01/04	6,000,000.00	6,940,980.00	
	DBR 4% 18/01/04	5,000,000.00	5,834,500.00	
	DBR 4% 37/01/04	6,200,000.00	7,940,774.00	
	DBR 4.00% 16/07/04	5,900,000.00	6,759,512.00	
	DBR 4.25% 14/01/04	5,700,000.00	6,171,561.00	
	DBR 4.25% 14/07/04	6,500,000.00	7,151,950.00	

	DBR 4.25% 17/07/04	4,000,000.00	4,695,520.00	
	DBR 4.25% 18/07/04	5,200,000.00	6,172,296.00	
	DBR 4.25% 39/07/04	3,500,000.00	4,765,530.00	
	DBR 4.5% 13/01/04	6,700,000.00	7,010,545.00	
	DBR 4.75% 28/07/04	3,000,000.00	3,921,750.00	
	DBR 4.75% 34/07/04	4,600,000.00	6,370,540.00	
	DBR 4.75% 40/07/04	4,000,000.00	5,899,400.00	
	DBR 5.5% 31/01/04	4,300,000.00	6,224,809.00	
	DBR 5.625% 28/01/04	2,980,000.00	4,235,712.40	
	DBR 6% 16/06/20	890,000.00	1,094,077.00	
	DBR 6.25% 24/01/04	2,700,000.00	3,877,065.00	
	DBR 6.25% 300104	2,200,000.00	3,385,844.00	
	DBR 6.5% 27/07/04	3,000,000.00	4,592,040.00	
	FINNISH GO 1.75% 160415	2,000,000.00	2,047,700.00	
	FINNISH GO 3.875% 170915	2,000,000.00	2,227,260.00	
	FRANCE 3.75% 17/04/25	6,000,000.00	6,437,100.00	
	FRANCE 3.75% 19/10/25	5,000,000.00	5,321,400.00	
	FRANCE O.A.T.3.5% 150425	5,600,000.00	5,949,160.00	
	FRANCE O.A.T.3.5% 200425	7,000,000.00	7,287,350.00	
	FRANCE O.A.T.4% 600425	2,000,000.00	2,155,660.00	
	FRANCE OAT4% 141025	5,000,000.00	5,363,500.00	
	FRTR 2.5% 20/10/25	7,000,000.00	6,733,160.00	
	FRTR 3.0% 15/10/25	8,000,000.00	8,358,800.00	
	FRTR 3.25% 16/04/25	6,700,000.00	7,059,321.00	
	FRTR 3.25% 21/10/25	4,000,000.00	4,054,720.00	
	FRTR 3.5% 26/04/25	6,000,000.00	6,041,580.00	
	FRTR 3.75% 21/04/25	7,700,000.00	8,126,195.00	
	FRTR 4% 13/04/25	5,700,000.00	5,965,050.00	
	FRTR 4% 13/10/25	5,060,000.00	5,343,866.00	
	FRTR 4% 14/04/25	5,300,000.00	5,645,454.00	
	FRTR 4% 18/04/25	6,000,000.00	6,505,380.00	

	FRTR 4% 38/10/25	5,500,000.00	5,896,440.00	
	FRTR 4% 55/04/25	3,170,000.00	3,397,289.00	
	FRTR 4.25% 17/10/25	4,500,000.00	4,947,210.00	
	FRTR 4.25% 18/10/25	5,000,000.00	5,487,400.00	
	FRTR 4.25% 19/04/25	6,900,000.00	7,573,440.00	
	FRTR 4.25% 23/10/25	7,000,000.00	7,657,160.00	
	FRTR 4.5% 41/04/25	4,000,000.00	4,658,920.00	
	FRTR 4.75% 12/10/25	1,800,000.00	1,867,716.00	
	FRTR 4.75% 35/04/25	4,600,000.00	5,447,688.00	
	FRTR 5% 16/10/25	7,600,000.00	8,607,000.00	
	FRTR 5.5% 29/04/25	6,000,000.00	7,495,200.00	
	FRTR 5.75% 32/10/25	4,700,000.00	6,167,575.00	
	FRTR 6.00% 25/10/25	3,500,000.00	4,496,100.00	
	FRTR 8.5% 12/12/26	1,000,000.00	1,081,680.00	
	FRTR 8.5% 19/10/25	2,550,000.00	3,566,506.50	
	FRTR 8.5% 23/04/25	3,200,000.00	4,758,880.00	
	IRISH 4% 14/01/15	2,500,000.00	2,335,200.00	
	IRISH 4.4% 19/06/18	1,500,000.00	1,193,175.00	
	IRISH 4.5% 18/10/18	2,000,000.00	1,616,960.00	
	IRISH 4.5% 20/04/18	2,490,000.00	1,934,730.00	
	IRISH 4.6% 16/04/18	2,800,000.00	2,491,944.00	
	IRISH 5% 13/04/18	2,000,000.00	1,935,000.00	
	IRISH 5% 2020/10/18	2,000,000.00	1,586,700.00	
	IRISH 5.4% 25/03/13	2,000,000.00	1,563,660.00	
	IRISH 5.9% 19/10/18	2,000,000.00	1,724,700.00	
	ITALY 5.75% 16/07/25	1,000,000.00	967,050.00	
	NETHER 1% 14/01/15	2,000,000.00	2,021,000.00	
	NETHERLANDS 2.5% 170115	2,000,000.00	2,104,600.00	
	NETHERLANDS 2.75 150115	3,500,000.00	3,702,405.00	
	NETHERLANDS 3.25% 150715	3,100,000.00	3,348,713.00	
	NETHERLANDS 3.25% 210715	4,200,000.00	4,576,446.00	

	NETHERLANDS 3.5% 200715	4,000,000.00	4,442,520.00	
	NETHERLANDS 3.75% 140715	3,400,000.00	3,670,062.00	
	NETHERLANDS 3.75% 230115	2,000,000.00	2,270,260.00	
	NETHERLANDS 3.75% 420115	3,000,000.00	3,795,840.00	
	NETHERLANDS 4% 16/07/15	3,300,000.00	3,706,065.00	
	NETHERLANDS 4% 18/07/15	3,500,000.00	3,978,030.00	
	NETHERLANDS 4% 19/07/15	3,500,000.00	4,002,705.00	
	NETHERLANDS 4.25% 130715	3,400,000.00	3,611,718.00	
	NETHERLANDS 4.5% 170715	3,600,000.00	4,156,488.00	
	NETHERLANDS 5.5% 280115	3,000,000.00	4,144,800.00	
	NETHERLANDS 7.5% 230115	1,000,000.00	1,500,430.00	
	NETHERLANDS G1.75%130115	3,000,000.00	3,049,590.00	
	NETHERLANDS GOVT4%370115	3,000,000.00	3,804,900.00	
	OBL 1.75% 15/10/09	4,000,000.00	4,178,920.00	
	OBL 2.25% 14/04/11	4,000,000.00	4,194,320.00	
	OBL 2.25% 15/04/10	4,000,000.00	4,232,120.00	
	OBL 2.5% 14/10/10	4,000,000.00	4,240,800.00	
	OBL 2.5% 15/02/27	4,500,000.00	4,789,710.00	
	OBL 3.5% 13/04/12	4,500,000.00	4,699,350.00	
	OBL 4% 13/10/11	4,000,000.00	4,275,600.00	
	OBL-160 2.75% 16/04/08	4,000,000.00	4,349,000.00	
	PGB 3.35% 15/10/15	3,000,000.00	2,148,240.00	
	PGB 3.6% 14/10/15	2,000,000.00	1,473,600.00	
	PGB 3.85% 21/04/15	2,000,000.00	1,075,700.00	
	PGB 4.10% 37/04/15	2,000,000.00	1,003,700.00	
	PGB 4.2% 16/10/15	1,000,000.00	648,800.00	
	PGB 4.35% 17/10/16	1,400,000.00	828,688.00	
	PGB 4.375% 14/06/16	2,000,000.00	1,554,300.00	
	PGB 4.45% 18/06/15	2,000,000.00	1,147,160.00	
	PGB 4.75% 19/06/14	2,000,000.00	1,124,900.00	
	PGB 4.8% 20/06/15	2,000,000.00	1,093,100.00	

	PGB 4.95% 23/10/25	2,000,000.00	1,042,360.00	
	PGB 5.45% 13/09/23	2,000,000.00	1,743,940.00	
	RAGB 3.2% 17/02/20	2,700,000.00	2,823,066.00	
	RAGB 3.4% 14/10/20	2,000,000.00	2,120,360.00	
	RAGB 3.5% 15/07/15	3,200,000.00	3,410,656.00	
	RAGB 3.5% 21/09/15	3,000,000.00	3,143,700.00	
	RAGB 3.65% 22/04/20	2,000,000.00	2,103,160.00	
	RAGB 3.8% 13/10/20	3,000,000.00	3,159,150.00	
	RAGB 3.9% 20/07/15	3,500,000.00	3,741,255.00	
	RAGB 4% 16/09/15	2,000,000.00	2,179,160.00	
	RAGB 4.15% 37/03/15	2,000,000.00	2,259,500.00	
	RAGB 4.3% 14/07/15	2,400,000.00	2,589,672.00	
	RAGB 4.3% 17/09/15	1,500,000.00	1,646,295.00	
	RAGB 4.35% 19/03/15	2,200,000.00	2,417,514.00	
	RAGB 4.65% 18/01/15	3,000,000.00	3,352,140.00	
	RAGB 4.85% 26/03/15	1,000,000.00	1,176,050.00	
	RAGB 6.25% 27/07/15	2,000,000.00	2,699,560.00	
	RFGB 3.125% 14/09/15	1,500,000.00	1,599,420.00	
	RFGB 3.375% 20/04/15	2,000,000.00	2,161,200.00	
	RFGB 3.5% 21/04/15	1,000,000.00	1,093,220.00	
	RFGB 4% 25/07/04	1,000,000.00	1,147,400.00	
	RFGB 4.25% 15/07/04	1,300,000.00	1,445,509.00	
	RFGB 4.375% 19/07/04	1,000,000.00	1,149,750.00	
	RFGB 5.375% 13/07/04	1,500,000.00	1,615,275.00	
	SPGB 2.3% 2013/04/30	4,500,000.00	4,457,385.00	
	SPGB 2.5% 13/10/31	4,000,000.00	3,945,920.00	
	SPGB 3% 15/04/30	3,000,000.00	2,937,840.00	
	SPGB 3.15% 16/01/31	3,800,000.00	3,686,190.00	
	SPGB 3.25% 16/04/30	3,000,000.00	2,893,950.00	
	SPGB 3.3% 14/10/31	4,000,000.00	3,972,600.00	
	SPGB 3.4% 14/04/30	1,000,000.00	998,880.00	

	SPGB 3.8% 17/01/31	3,000,000.00	2,917,740.00	
	SPGB 3.9% 12/10/31	2,000,000.00	2,013,800.00	
	SPGB 4% 20/04/30	4,000,000.00	3,776,120.00	
	SPGB 4.1% 18/07/30	4,000,000.00	3,896,200.00	
	SPGB 4.2% 13/07/30	3,500,000.00	3,558,100.00	
	SPGB 4.2% 37/01/31	3,250,000.00	2,515,272.50	
	SPGB 4.25% 14/01/31	3,500,000.00	3,561,425.00	
	SPGB 4.25% 16/10/31	2,000,000.00	1,990,360.00	
	SPGB 4.3% 19/10/31	3,000,000.00	2,916,240.00	
	SPGB 4.4% 15/01/31	3,800,000.00	3,884,550.00	
	SPGB 4.6% 19/07/30	3,500,000.00	3,476,550.00	
	SPGB 4.65% 25/07/30	3,500,000.00	3,170,300.00	
	SPGB 4.7% 41/07/30	2,000,000.00	1,648,900.00	
	SPGB 4.75% 14/07/30	3,500,000.00	3,608,850.00	
	SPGB 4.8% 24/01/31	3,300,000.00	3,078,669.00	
	SPGB 4.85% 20/10/31	4,000,000.00	3,971,400.00	
	SPGB 4.9% 40/07/30	4,000,000.00	3,376,920.00	
	SPGB 5.5% 17/07/30	4,280,000.00	4,484,156.00	
	SPGB 5.5% 21/04/30	4,000,000.00	4,105,920.00	
	SPGB 5.75% 32/07/30	3,700,000.00	3,604,466.00	
	SPGB 5.9% 26/07/30	1,000,000.00	1,011,070.00	
	SPGB 6% 29/01/31	4,900,000.00	4,921,217.00	
	SPGB 6.15% 13/01/31	3,600,000.00	3,720,060.00	
	ユーロ 小計	925,950,000.00	950,129,185.50	
	（邦貨換算額）		(96,390,605,868)	**（単位：円）**
	英ポンド			
	UKT 1.75% 17/01/22	3,000,000.00	3,101,280.00	
	UKT 2% 16/01/22	8,000,000.00	8,386,800.00	
	UKT 2.25% 14/03/07	6,000,000.00	6,253,380.00	
	UKT 2.75% 15/01/22	6,500,000.00	6,937,450.00	

	UKT 3.75% 19/09/07	6,000,000.00	6,890,520.00	
	UKT 3.75% 20/09/07	5,000,000.00	5,745,500.00	
	UKT 3.75% 21/09/07	5,000,000.00	5,734,850.00	
	UKT 3.75% 520722	1,300,000.00	1,486,485.00	
	UKT 4% 16/09/07	4,800,000.00	5,479,056.00	
	UKT 4% 22/03/07	3,000,000.00	3,516,240.00	
	UKT 4% 60/01/22	2,000,000.00	2,461,200.00	
	UKT 4.25% 27/12/07	3,800,000.00	4,595,340.00	
	UKT 4.25% 32/06/07	3,800,000.00	4,602,180.00	
	UKT 4.25% 36/03/07	4,800,000.00	5,848,032.00	
	UKT 4.25% 39/09/07	3,500,000.00	4,273,395.00	
	UKT 4.25% 40/12/07	5,500,000.00	6,713,685.00	
	UKT 4.25% 46/12/07	3,900,000.00	4,861,662.00	
	UKT 4.25% 49/12/07	3,500,000.00	4,390,330.00	
	UKT 4.25% 55/12/07	5,000,000.00	6,385,200.00	
	UKT 4.5% 13/03/07	6,700,000.00	7,038,350.00	
	UKT 4.5% 19/03/07	4,200,000.00	5,041,680.00	
	UKT 4.5% 34/09/07	4,000,000.00	5,007,880.00	
	UKT 4.5% 42/12/07	4,000,000.00	5,134,520.00	
	UKT 4.75% 15/09/07	4,400,000.00	5,069,680.00	
	UKT 4.75% 20/03/07	5,200,000.00	6,384,352.00	
	UKT 4.75% 30/12/07	3,800,000.00	4,887,218.00	
	UKT 4.75% 38/12/07	4,500,000.00	5,934,015.00	
	UKT 5% 14/09/07	5,500,000.00	6,173,200.00	
	UKT 5% 18/03/07	3,500,000.00	4,265,901.50	
	UKT 5% 25/03/07	3,900,000.00	5,036,850.00	
	UKT 6.0% 281207	3,000,000.00	4,375,830.00	
	UKT 8% 13/09/27	1,500,000.00	1,702,215.00	
	UKT 8% 15/12/07	1,900,000.00	2,443,951.00	
	UKT 8% 21/06/07	2,620,000.00	3,986,854.00	
	UKT 8.75% 17/08/25	1,300,000.00	1,843,400.00	

	英ポンド 小計	144,420,000.00	171,988,481.50	
	（邦貨換算額）		(20,820,925,570)	**（単位：円）**
	スイスフラン			
	SWITZERLAND 2.5% 160312	2,000,000.00	2,204,800.00	
	SWITZERLAND 3% 180108	1,000,000.00	1,156,400.00	
	SWITZERLAND 3% 19/05/12	1,500,000.00	1,764,300.00	
	SWITZERLAND 4% 13/02/11	1,000,000.00	1,047,000.00	
	SWITZERLAND 4% 280408	900,000.00	1,296,990.00	
	SWITZERLAND 4%230211	2,000,000.00	2,668,000.00	
	SWITZERLAND 4.25% 140106	800,000.00	871,440.00	
	SWITZERLAND 4.25% 170605	2,000,000.00	2,432,400.00	
	スイスフラン 小計	11,200,000.00	13,441,330.00	
	（邦貨換算額）		(1,119,528,375)	**（単位：円）**
	スウェーデンクローナ			
	SGB 3% 16/07/12	17,000,000.00	18,501,100.00	
	SGB 3.5% 39/03/30	10,000,000.00	13,042,400.00	
	SGB 3.75% 17/08/12	13,200,000.00	15,013,680.00	
	SGB 4.25% 19/03/12	20,000,000.00	23,902,200.00	
	SGB 4.5% 15/08/12	13,000,000.00	14,678,300.00	
	SGB 5% 20/12/01	20,000,000.00	25,788,000.00	
	SGB 6.75% 14/05/05	19,100,000.00	21,758,720.00	
	スウェーデンクローナ 小計	112,300,000.00	132,684,400.00	
	（邦貨換算額）		(1,494,026,344)	**（単位：円）**
	ノルウェークローネ			
	NORWAY GOV 3.75% 210525	7,000,000.00	7,931,000.00	
	NORWAY GOV 4.25% 170519	10,000,000.00	11,341,000.00	
	NORWAY GOV 4.5% 19/05/22	6,000,000.00	7,062,600.00	
	NORWAY GOV 5% 150515	10,000,000.00	11,260,000.00	

	NORWAY GOV 6.5% 130515	16,000,000.00	17,216,000.00	
	ノルウェークローネ 小計	49,000,000.00	54,810,600.00	
	（邦貨換算額）		(719,663,178)	**（単位：円）**
	デンマーククローネ			
	DGB 2% 14/11/15	13,000,000.00	13,672,750.00	
	DGB 3% 21/11/15	6,000,000.00	6,651,000.00	
	DGB 4% 15/11/15	16,000,000.00	18,158,400.00	
	DGB 4% 17/11/15	15,000,000.00	17,550,000.00	
	DGB 4% 19/11/15	21,000,000.00	24,927,000.00	
	DGB 4.5% 39/11/15	27,000,000.00	40,192,200.00	
	DGB 5% 13/11/15	20,820,000.00	22,735,648.20	
	DGB 7% 24/11/10	5,080,000.00	7,957,312.00	
	デンマーククローネ 小計	123,900,000.00	151,844,310.20	
	（邦貨換算額）		(2,072,674,834)	**（単位：円）**
	ポーランドズロチ			
	POLGB 0% 12/10/25	6,000,000.00	5,771,400.00	
	POLGB 5% 16/04/25	4,000,000.00	3,970,000.00	
	POLGB 5.00% 13/10/24	6,500,000.00	6,506,500.00	
	POLGB 5.25% 13/04/25	5,000,000.00	5,025,500.00	
	POLGB 5.25% 17/10/25	8,000,000.00	7,920,000.00	
	POLGB 5.25% 2020/10/25	5,000,000.00	4,780,500.00	
	POLGB 5.5% 19/10/25	6,000,000.00	5,919,000.00	
	POLGB 5.5% 2015/04/25	5,000,000.00	5,067,500.00	
	POLGB 5.75% 14/04/25	8,000,000.00	8,140,000.00	
	POLGB 5.75% 22/09/23	10,200,000.00	9,975,600.00	
	POLGB 6.25% 15/10/24	7,500,000.00	7,822,500.00	
	ポーランドズロチ 小計	71,200,000.00	70,898,500.00	
	（邦貨換算額）		(1,602,306,100)	**（単位：円）**

	オーストラリアドル			
	ACGB 4.5% 14/10/21	2,000,000.00	2,074,000.00	
	ACGB 4.5% 20/04/15	4,000,000.00	4,247,108.00	
	ACGB 4.75% 12/11/15	1,000,000.00	1,012,459.00	
	ACGB 4.75% 15/10/21	1,000,000.00	1,054,800.00	
	ACGB 4.75% 16/06/15	4,000,000.00	4,266,364.00	
	ACGB 5.25% 19/03/15	3,000,000.00	3,331,482.00	
	ACGB 5.5% 13/12/15	2,000,000.00	2,098,100.00	
	ACGB 5.5% 18/01/21	2,000,000.00	2,224,600.00	
	ACGB 5.5% 23/04/21	1,000,000.00	1,139,500.00	
	ACGB 5.75% 21/05/15	5,000,000.00	5,777,500.00	
	ACGB 5.75% 22/07/15	2,000,000.00	2,318,000.00	
	ACGB 6% 17/02/15	3,300,000.00	3,732,587.10	
	ACGB 6.25% 14/06/15	3,000,000.00	3,232,917.00	
	ACGB 6.25% 15/04/15	3,000,000.00	3,305,226.00	
	ACGB 6.5% 13/05/15	3,540,000.00	3,702,769.20	
	オーストラリアドル 小計	39,840,000.00	43,517,412.30	
	（邦貨換算額）		(3,373,034,627)	**（単位：円）**
	シンガポールドル			
	SIGB 1.625% 130401	3,000,000.00	3,049,917.00	
	SIGB 2.25% 13/07/01	1,000,000.00	1,029,613.00	
	SIGB 3.125% 22/09/01	1,000,000.00	1,126,207.00	
	SIGB 3.25% 20/09/01	2,000,000.00	2,269,546.00	
	SIGB 3.5% 12/07/01	1,000,000.00	1,016,760.00	
	SIGB 3.5% 27/03/01	2,000,000.00	2,299,360.00	
	SIGB 3.625 140701	2,500,000.00	2,699,345.00	
	SIGB 3.75% 160901	1,000,000.00	1,138,482.00	
	SIGB 4% 18/09/01	1,200,000.00	1,416,866.40	
	シンガポールドル 小計	14,700,000.00	16,046,096.40	
	（邦貨換算額）		(958,433,337)	**（単位：円）**

	マレーシアリンギット			
	MALAYSIAN 3.502 27/05/31	9,000,000.00	8,528,904.00	
	MALAYSIAN 3.702 13/02/25	8,000,000.00	8,073,584.00	
	MALAYSIAN 3.741 15/02/27	10,000,000.00	10,186,540.00	
	MALAYSIAN 3.814%17/02/15	2,000,000.00	2,040,700.00	
	MALAYSIAN 4.24 18/02/07	5,000,000.00	5,212,945.00	
	MALAYSIAN 4.262 16/09/15	3,000,000.00	3,122,151.00	
	MALAYSIAN 4.378 19/11/29	5,000,000.00	5,272,695.00	
	MALAYSIAN 5.094 14/04/30	6,000,000.00	6,282,444.00	
	マレーシアリンギット 小計	48,000,000.00	48,719,963.00	
	（邦貨換算額）		(1,192,177,494)	**（単位：円）**
合 計			238,498,899,015	**単位：円**
（外貨建有価証券邦貨換算額合計）			(238,498,899,015)	**（単位：円）**

（注）

1．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。

2．米ドル表示の債券については、188銘柄、信託財産純資産総額に対する比率40.3%、
合計に対する比率41.7%です。
カナダドル表示の債券については、29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3.0%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0.8%、
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、246銘柄、信託財産純資産総額に対する比率39.1%、
合計に対する比率40.4%です。
英ポンド表示の債券については、35銘柄、信託財産純資産総額に対する比率8.4%、
合計に対する比率8.7%です。
スイスフラン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0.5%、
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、7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0.6%です。
ノルウェークローネ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0.3%、
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0.9%です。
ポーランドズロチ表示の債券については、11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。
オーストラリアドル表示の債券については、15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0.4%、合計に対する比率0.4%です。
マレーシアリンギット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0.5%、合計に対する比率0.5%です。

「ＳＭＡＭ・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22年12月17日現在）	（平成23年12月19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	182,288,608	228,498,437
流動資産合計	182,288,609	228,498,438
資産合計	182,288,609	228,498,438
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	1,241	1,376
未払委託者報酬	11,118	12,538
流動負債合計	12,359	13,914
負債合計	12,359	13,914
純資産の部		
元本等		
元本		
元本	181,181,446	226,892,340
剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	1,094,804	1,592,184
元本等合計	182,276,250	228,484,524
純資産合計	182,276,250	228,484,524
負債純資産合計	182,288,609	228,498,438

（注）「ＳＭＡＭ・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22年12月17日ならびに平成23年12月19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22年４月14日 至 平成22年12月17日	自 平成23年４月14日 至 平成23年12月19日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券（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22年12月17日現在）	（平成23年12月19日現在）
１．受益権総数	平成22年12月17日現在における受益権の総数 181,181,446口	平成23年12月19日現在における受益権の総数 226,892,340口
２．１単位当たり純資産額	1.0060円 （１万口＝10,060円）	1.0070円 （１万口＝10,070円）

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．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	自 平成23年４月14日 至 平成23年12月19日
	（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。	―――――――――
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。	同 左
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。	（1）金融商品の内容 1）有価証券 同 左

	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。	2）デリバティブ取引 同 左 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 同 左
３．金融商品に係るリスク管理体制	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。 また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限値、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。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、測定項目が上下限値（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。	同 左

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。	同 左

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項 目	（平成22年12月17日現在）	（平成23年12月19日現在）
１．貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同 左
２．時価の算定方法	（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。 （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。	（1）有価証券（親投資信託受益証券） 同 左 （2）派生商品評価勘定（デリバティブ取引） 同 左 （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 同 左

（デリバティブ取引に関する注記）

（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。

（平成23年12月19日現在）
平成23年12月19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。

（自 平成23年４月14日 至 平成23年12月19日）
該当事項はありません。

（その他の注記）

（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

（平成23年12月19日現在）	
期　　首	平成23年４月14日
期首元本額	229,216,917円
期首より平成23年12月19日現在までの追加設定元本額	13,098,006円
期首より平成23年12月19日現在までの一部解約元本額	15,422,583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	226,415,416円	1.0092円	228,498,437円

（参考情報）

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22年12月17日現在）	（平成23年12月19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	5,643,274	18,414,901
国債証券	239,514,820	1,893,772,740
未収入金	48,000	15,051,750
未収利息	519,219	4,536,262
前払費用	602,799	3,752,174
流動資産合計	246,328,112	1,935,527,827
資産合計	246,328,112	1,935,527,827
負債の部		
流動負債		
未払金	－	5,017,400
未払解約金	－	15,000,000
流動負債合計	－	20,017,400
負債合計	－	20,017,400
純資産の部		
元本等		
元本		
元本	244,394,027	1,898,050,924

剰余金		
剰余金又は欠損金（△）	1,934,085	17,459,503
元本等合計	246,328,112	1,915,510,427
純資産合計	246,328,112	1,915,510,427
負債純資産合計	246,328,112	1,935,527,827

（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22年12月17日ならびに平成23年12月19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22年４月14日 至 平成22年12月17日	自 平成23年４月14日 至 平成23年12月19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22年12月17日現在）	（平成23年12月19日現在）
１．受益権総数	平成22年12月17日現在における受益権の総数 244,394,027口	平成23年12月19日現在における受益権の総数 1,898,050,924口
２．１単位当たり純資産額	1.0079円 （１万口＝10,079円）	1.0092円 （１万口＝10,092円）

（金融商品に関する注記）

Ⅰ．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	自 平成23年４月14日 至 平成23年12月19日
	（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。	―――――――――
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。	同 左
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。	（1）金融商品の内容 1）有価証券 同 左

	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）デリバティブ取引 同 左 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。	（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 同 左
３．金融商品に係るリスク管理体制	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。 また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限値、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。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、測定項目が上下限値（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。	同 左

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。	同 左

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

項 目	（平成22年12月17日現在）	（平成23年12月19日現在）
１．貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同 左
２．時価の算定方法	（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。 （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。	（1）有価証券（国債証券） 同 左 （2）派生商品評価勘定（デリバティブ取引） 同 左 （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 同 左

（デリバティブ取引に関する注記）

（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。

（平成23年12月19日現在）

平成23年12月19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。

（自 平成23年４月14日 至 平成23年12月19日）

該当事項はありません。

（その他の注記）

（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
ＳＭＡＭ円高期待ファンド（豪ドル安型）	8,340,735円
ＳＭＡＭ円高期待ファンド（米ドル安型）	8,343,887円
ＳＭＡＭ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
ＳＭＡＭ・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞	180,859,816円
ＳＭＡＭ・バランス先物ファンドＶＡ２０＜適格機関投資家限定＞	4,960,810円
合 計	244,394,027円

（平成23年12月19日現在）	
期　首	平成23年４月14日
期首元本額	597,626,140円
期首より平成23年12月19日現在までの追加設定元本額	1,685,420,511円
期首より平成23年12月19日現在までの一部解約元本額	384,995,727円
平成23年12月19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）	11,338,161円
スミセイ・ＤＣターゲットイヤーファンド2020	2,141,573円
スミセイ・ＤＣターゲットイヤーファンド2025	442,429円
スミセイ・ＤＣターゲットイヤーファンド2030	363,170円
スミセイ・ＤＣターゲットイヤーファンド2035	377,922円
スミセイ・ＤＣターゲットイヤーファンド2040	88,427円
スミセイ・ＤＣターゲットイヤーファンド2045	237,548円
三井住友・ロシア株式オープン	999,001円
ＳＭＡＭ円高期待ファンド（豪ドル安型）	11,809,173円
ＳＭＡＭ円高期待ファンド（米ドル安型）	9,531,561円
ＳＭＡＭ円高期待ファンド（ユーロ安型）	8,039,947円
アジア高成長国ＣＢファンド	29,767,812円
日興ニューバーガー米国小型ハイクオリティファンド（毎月決算型）	99,128円
日興ニューバーガー米国小型ハイクオリティファンド（資産成長型）	297,384円
ＳＭＡＭ・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞	226,415,416円
ＳＭＡＭ・バランス先物ファンドＶＡ２０＜適格機関投資家限定＞	778,413,876円
ＳＭＡＭ・ＦＧマネーファンドＶＡ＜適格機関投資家限定＞	817,688,396円
合 計	1,898,050,924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２３７回利付国債（１０年）	935,000,000	938,160,300	
	第２３９回利付国債（１０年）	316,000,000	318,019,240	
	第２４１回利付国債（１０年）	316,000,000	318,809,240	
	第２４４回利付国債（１０年）	316,000,000	318,783,960	
	国債証券 小計	1,883,000,000	1,893,772,740	
合 計			1,893,772,740	

独立監査人の監査報告書

平成２４年２月１４日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　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２２年１２月２１日から平成２３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・ＤＣ年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）２０１０の平成２３年１２月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ＸＢＲＬデータ自体は含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成２４年２月１４日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　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２２年１２月２１日から平成２３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・ＤＣ年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）２０２０の平成２３年１２月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ＸＢＲＬデータ自体は含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成２４年２月１４日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　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２２年１２月２１日から平成２３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・ＤＣ年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）２０３０の平成２３年１２月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ＸＢＲＬデータ自体は含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成２４年２月１４日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員　　公認会計士　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２２年１２月２１日から平成２３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・ＤＣ年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）２０４０の平成２３年１２月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ＸＢＲＬデータ自体は含まれていません。

委託会社の監査報告書（当期）へ

独立監査人の監査報告書

平成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・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ＸＢＲＬデータ自体は含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成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）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・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ＸＢＲＬデータ自体は含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成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・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ＸＢＲＬデータ自体は含まれていません。

独立監査人の監査報告書

平成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）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・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ＸＢＲＬデータ自体は含まれていません。

委託会社の監査報告書（前期）へ

独立監査人の監査報告書

平成23年６月17日

三井住友アセットマネジメント株式会社
　取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	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23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 業務執行社員	公認会計士	鈴木 敏夫 印
指定社員 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。

独立監査人の中間監査報告書

平成23年12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
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23年４月１日から平成24年３月31日までの第27期事業年度の中間会計期間（平成23年４月１日から平成23年９月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友アセットマネジメント株式会社の平成23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23年４月１日から平成23年９月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

※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。