

## 【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26年3月19日

【計算期間】 第13期（自 平成24年12月21日 至 平成25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】 三島 克哉

【連絡場所】 東京都港区愛宕二丁目5番1号

【電話番号】 03-5405-0228

【縦覧に供する場所】 該当ありません。

## 第一部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

イ 当ファンドは、他の投資信託への投資を通じて、実質的に日本を含む世界各国の株式および公社債に投資し、信託財産の成長を目指して運用を行います。

ロ 各ファンドにつき定めるターゲット・イヤー 到達後は、流動性を重視した安定的な運用を行います。

各ファンドのターゲット・イヤーは次の通りです。

< 2 0 1 0 > . . . 西暦2010年、 < 2 0 2 0 > . . . 西暦2020年

< 2 0 3 0 > . . . 西暦2030年、 < 2 0 4 0 > . . . 西暦2040年

ハ 委託会社は、受託会社と合意の上、各ファンドとも金3,000億円を限度として信託金を追加することができます。この限度額は、委託会社、受託会社の合意により変更できます。

ニ 当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

##### (イ) 当ファンドが該当する商品分類

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

##### (ロ) 当ファンドが該当する属性区分

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券）資産配分変更型））	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載しています。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は株式および債券であり、ファンドの収益は株式市場、債券市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「資産複合」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル（日本を含む）	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファンド・オブ・ファンズ	一般社団法人投資信託協会「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいいます。
為替ヘッジ	為替ヘッジなし	目論見書または信託約款において、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。

## 《商品分類表》

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単 位 型	国 内	株 式
		債 券
	海 外	不 動 産 投 信
<b>追 加 型</b>		そ の 他 資 産
	<b>内 外</b>	( <b>資 産 複 合</b> )

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 《属性区分表》

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株 式	<b>年 1 回</b>	<b>グ ロー パ ル</b>		
一 般		( <b>日 本 を 含 む</b> )		
大 型 株	年 2 回	日 本		
中 小 型 株	年 4 回	北 米	ファミリーファンド	あ り
債 券	年 6 回 (隔月)	欧 州		
一 般	年 12 回 (毎月)	ア ジ ア		
公 債	日 々	オ セ ア ニ ア		
社 債	そ の 他	中 南 米	<b>フ ァ ン ド ・ オ フ ・ フ ァ ン ズ</b>	<b>な し</b>
その他債券 クレジット属性 ( )	( )	ア フ リ カ		
不動産投信		中 近 東 (中 東)		
<b>その他資産</b>		エ マ ー ジ ン グ		
(投資信託証券(資産複合(株式、債券 資産配分変更型))				
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。

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

商品分類、属性区分は、一般社団法人投資信託協会「商品分類に関する指針」に基づき記載しています。商品分類、属性区分の全体的な定義等は一般社団法人投資信託協会のホームページ (<http://www.toushin.or.jp/>) をご覧ください。

## (2) 【ファンドの沿革】

平成13年3月13日

信託契約締結、設定、運用開始。

(設定時の委託会社はさくら投信投資顧問株式会社)

平成14年12月1日

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

## (3) 【ファンドの仕組み】

イ 当ファンドの関係法人とその役割

(イ) 委託会社 「三井住友アセットマネジメント株式会社」

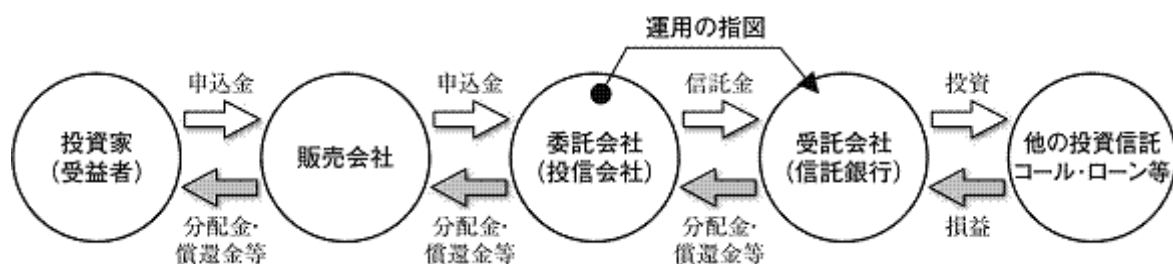
証券投資信託契約に基づき、信託財産の運用指図、投資信託説明書(目論見書)および運用報告書の作成等を行います。

(ロ) 受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

証券投資信託契約に基づき、信託財産の保管・管理・計算等を行います。なお、信託事務の一部につき、日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社に委託することがあります。また、外国における資産の保管は、その業務を行うに十分な能力を有すると認められる外国の金融機関が行う場合があります。

(ハ) 販売会社

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

運営の仕組み

## □ 委託会社の概況

### （イ）資本金の額

2,000百万円（平成26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

平成25年4月1日 トヨタアセットマネジメント株式会社と合併

### （ハ）大株主の状況

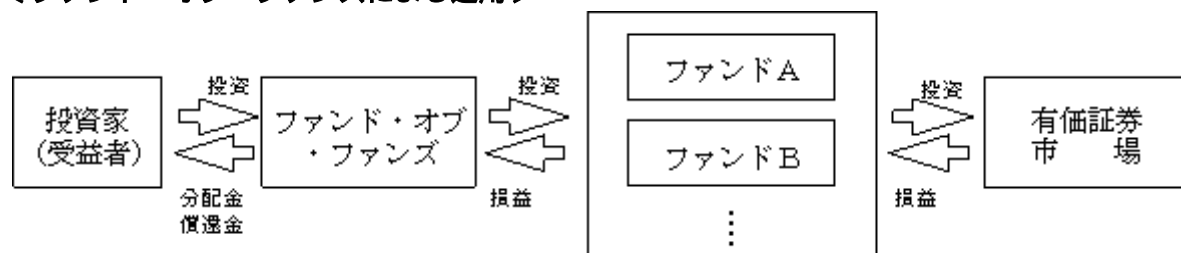
（平成26年1月31日現在）

名称	住所	所有 株式数	比率 (%)
株式会社三井住友銀行	東京都千代田区丸の内一丁目1番2号	7,056	40.0
住友生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区城見一丁目4番35号	4,851	27.5
三井住友海上火災保険株式会社	東京都千代田区神田駿河台三丁目9番地	4,851	27.5
三井生命保険株式会社	東京都千代田区大手町二丁目1番1号	882	5.0

## 八 ファンドの運用形態（ファンド・オブ・ファンズによる運用）

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

### 〔ファンド・オブ・ファンズによる運用〕



## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### イ 基本方針

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

#### ロ 投資態度

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

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

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

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

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

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

#### a . S M A M ・ 国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）

運用会社	三井住友アセットマネジメント株式会社
主要運用対象	国内株式
運用の基本方針	T O P I X（東証株価指数、配当込み）と連動する投資成果を目指して運用を行います。

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

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

#### c . S M A M ・ 外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）

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

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

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

#### e . S M A M ・ マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞

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

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

## ★ ファンドの特色

- 1 他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。

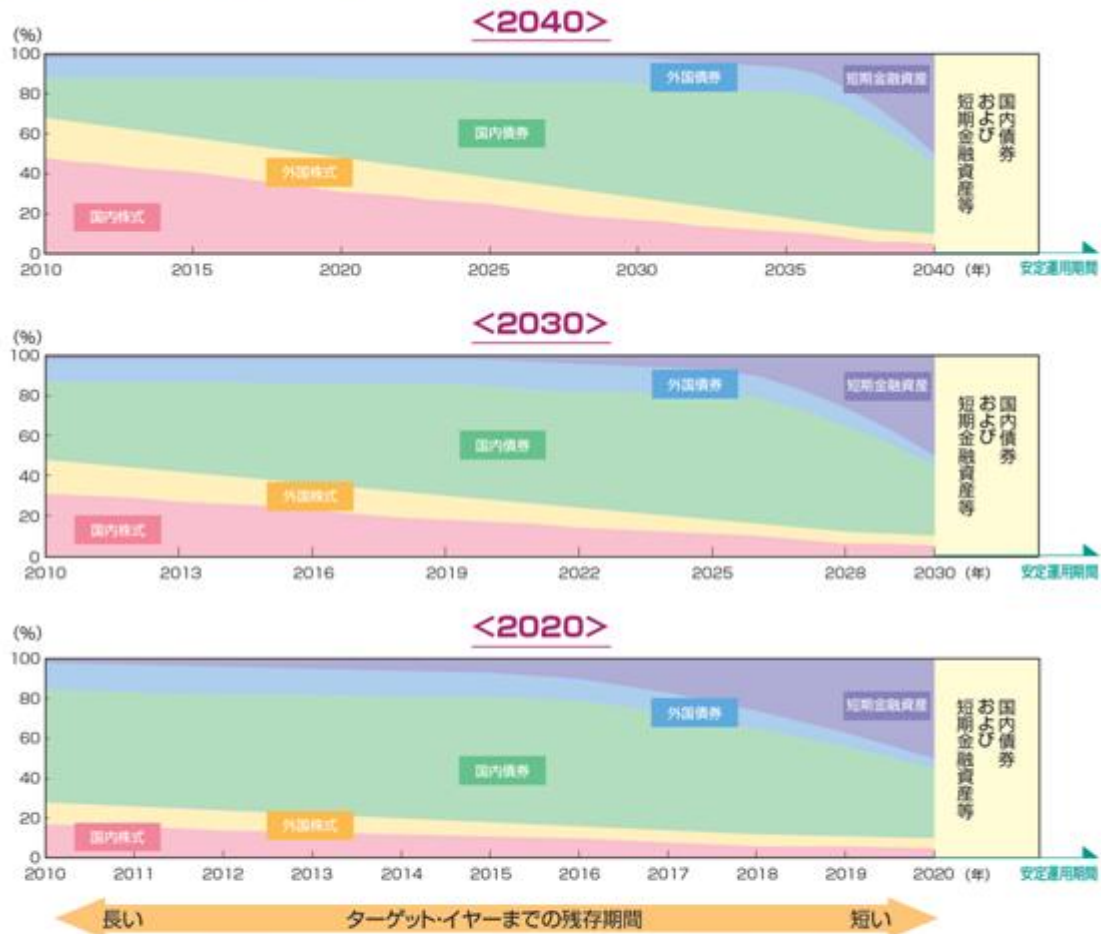
※ターゲット・イヤー到達後の安定運用期間においても国内債券および短期金融資産の他、国内外の株式および外国債券への配分が予定されています。

### 基本的な投資資産配分（基本アロケーション）

2014年1月末現在、各ファンドの基本アロケーションは以下の通りです。

	<2040>	<2030>	<2020>	<2010> 安定運用期間
国内株式	43%	27%	13%	5%
外国株式	19%	15%	9%	5%
国内債券	26%	45%	60%	35%
外国債券	10%	11%	13%	5%
短期金融資産	2%	2%	5%	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、実際上記の通りの運用を行うことを保証するものではありません。

**<2010>**

## 安定運用期間

(国内債券および短期金融資産等による運用)

※ターゲット・イヤー到達(2010年12月決算時)



### 3 ファンド・オブ・ファンズという形態で運用されます。

「ファンド・オブ・ファンズ」においては、株式や債券などの有価証券に直接投資するのではなく、複数の他の投資信託（ファンド）を組み入れることにより運用を行います（投資信託に投資する投資信託）。

種々の特徴を持った投資信託を購入することにより、効率的に資産配分を行います。

#### ファンドのしくみ



#### 投資対象とする投資信託のベンチマーク

	投資対象とする投資信託	ベンチマーク	委託会社
国内株式	SMAM・国内株式パッシブ・ファンド (適格機関投資家専用)	TOPIX (東証株価指数、配当込み)	三井住友アセットマネジメント株式会社
外国株式	SMAM・外国株式パッシブ・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。

## ★ 追加的記載事項

### 投資対象とする投資信託の運用プロセス

#### SMAM・国内株式バッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）

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

#### SMAM・年金国内債券バッシブファンド<適格機関投資家限定>

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

#### SMAM・外国株式バッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）

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

#### SMAM・年金外国債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>

- 主として日本を除く世界各国の債券に投資し、シティ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せん。）により運用することを指図することができます。

- １．預金
- ２．指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
- ３．コール・ローン
- ４．手形割引市場において売買される手形

主要投資対象となるファンドの名称、運用会社、主要運用対象、運用の基本方針に関しましては、上記「（１）投資方針」の記載をご覧ください。

## （３）【運用体制】

### イ 運用体制

当ファンドの運用は、次のプロセスに基づいて行われます。

#### （イ）計画（Plan）

国内外のエコノミスト、アナリスト、ファンドマネージャーが、マクロ経済環境、市場環境に関する分析・検討を行います。

これを元に、担当運用グループは投資政策委員会にて、運用方針を決定し月次運用計画を策定します。

#### （ロ）実行（Do）

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

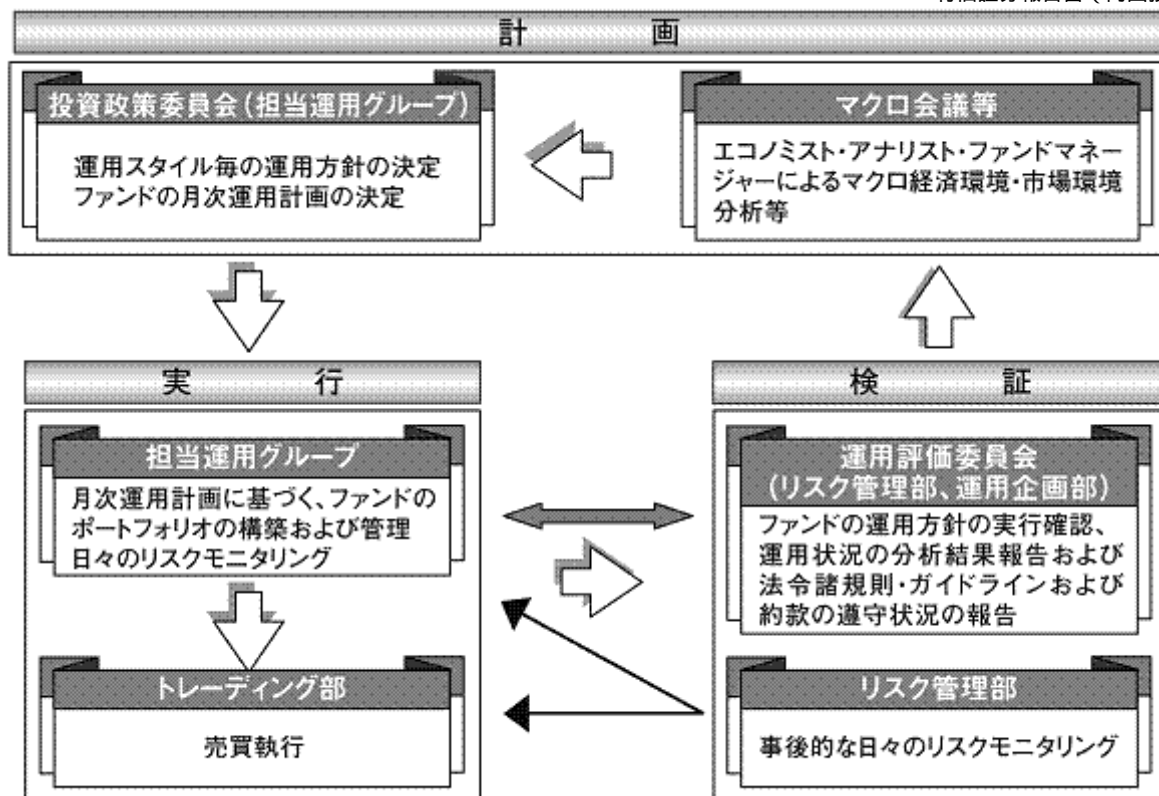
売買執行については、組織的に分離されたトレーディング部が、最良と思われる手法をもって売買を執行します。

#### （ハ）検証（Check）

運用部門から組織的に分離されたリスク管理部が、約款の遵守状況等、ファンドの運営状況を日々モニタリングし、抵触があった場合直ちに担当運用グループへ状況確認がなされます。担当運用グループは対応結果をリスク管理部へ報告します。

運用評価委員会では、ファンドの運用方針の実行状況、運用状況の分析結果を確認します。また、運用の分析、評価結果、運用リスク状況、法令諸規則、運用ガイドライン、約款の遵守状況についても報告されます。

## 〔ファンドの運用体制〕



リスク管理部は8名程度、運用企画部は8名程度で構成されています。

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

□ 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

（４）【分配方針】

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

- イ 分配対象額は、繰越分を含めた利子・配当収入と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- 分配金額は委託会社が基準価額水準、市況動向を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合等は、委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- ハ 留保益の運用については特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

（５）【投資制限】

ファンドの信託約款に基づく投資制限

- イ 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。
- 投資信託証券への投資を除いては、CP、預金、指定金銭信託、コール・ローンおよび手形割引市場において売買される手形以外には投資を行いません。
- ハ 外貨建資産への直接投資は行いません。
- ニ 資金の借入れ

（イ）委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当て

を目的として、資金の借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

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

#### 法令に基づく投資制限

- イ 同一法人の発行する株式への投資制限(投資信託及び投資法人に関する法律第9条)  
委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数(株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含みます。)が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図することが禁じられています。
- ロ デリバティブ取引にかかる投資制限(金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号)  
委託会社は、信託財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が当該信託財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引(新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含みます。)を行い、または継続することを受託会社に指図しないものとします。

## 〔参考情報：投資対象とする投資信託の概要〕

## 〔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 三井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  
 \*消費税率が8%となる平成26年4月1日以降は年0.081%となります。
- ロ 手数料 取得申込時および換金時には手数料はかかりません。
- ハ 信託財産留保額 取得申込時および解約請求時にそれぞれ受付日の翌営業日の基準価額に対して0.08%
- ニ 決算日 毎年1回（原則として11月30日）

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

## ( 1 ) 運用会社等

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

## ( 2 ) 投資方針等

## イ 基本方針

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

## ロ 投資態度

- (イ) 主としてマザーファンド受益証券およびわが国の公社債に投資を行い、 N O M U R A - B P I （総合）に連動する投資成果を目指します。  
 (ロ) マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、ファンド設定当初や解約・償還への対応などの事情により変更することもあります。  
 (ハ) 運用の効率化を図るため、有価証券先物取引等を利用することもあります。

マザーファンドにおいては、主としてわが国の公社債および短期金融資産に投資し、安定した利子等収益および売買益の確保を目指すとともに、 N O M U R A - B P I （総合）の動きに連動する投資成果を目指します。 N O M U R A - B P I （総合）は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社およびその許諾者に帰属します。なお、野村證券株式会社およびその許諾者は、 N O M U R A - B P I （総合）を用いて行われる三井住友アセットマネジメント株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。また、野村證券株式会社およびその許諾者は「 S M A M ・ 年金国内債券パッシブファンド < 適格機関投資家限定 > 」および当ファンドとは何ら関係なく、その運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

## 八 主な投資制限

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

## ( 3 ) その他

- イ 信託報酬 このファンドの信託財産の純資産総額に年0.0525%<sup>\*</sup>（税抜き0.05%）を乗じて得た額  
<sup>\*</sup>消費税率が8%となる平成26年4月1日以降は年0.054%となります。
- 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 三井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-KOKUSA Iインデックス(円ベース)と連動する投資成果を目指して運用を行います。

## ロ 投資態度

- (イ) 主としてマザーファンド受益証券への投資を通じて、世界各国の株式に投資し、MSCI-KOKUSA Iインデックス(円ベース)と連動する投資成果を目指して運用を行います。
- (ロ) 外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行わないものとします。
- (ハ) 株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。マザーファンドにおいては、主として日本を除く世界各国の株式に投資し、MSCI-KOKUSA Iインデックス(円ベース)と連動する投資成果を目指して運用を行います。MSCI-KOKUSA I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%<sup>\*</sup>(税抜き0.075%)を乗じて得た額  
<sup>\*</sup>消費税率が8%となる平成26年4月1日以降は年0.081%となります。
- ロ 手数料 取得申込時および換金時には手数料はかかりません。
- ハ 信託財産留保額 取得申込時および解約請求時にそれぞれ受付日の翌営業日の基準価額に対して0.15%
- ニ 決算日 毎年1回(原則として11月30日)



## 〔SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞〕

## (1) 運用会社等

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

## (2) 投資方針等

## イ 基本方針

SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞は、外国債券パッシブ・マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券への投資を通じて、シティ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) シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、ベンチマークと連動する投資成果を目指します。  
 (ロ) ポートフォリオ構築にあたっては、取引コストを極力抑えながら、推定トラッキングエラーを最小化します。  
 (ハ) ベンチマークの月次の変化状況とポートフォリオのリスク量の状況を勘案しながらリバランスを行います。  
 (ニ) 保有する外貨建資産については、原則として対円で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。

## 八 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%<sup>\*</sup>（税抜き0.06%）を乗じて得た額

<sup>\*</sup>消費税率が8%となる平成26年4月1日以降は年0.0648%となります。

## 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。

- 八 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%
- 二 決算日 毎年1回(原則として12月17日)

## 〔S M A M ・ マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞〕

## (1) 運用会社等

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

## (2) 投資方針等

## イ 基本方針

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

## ロ 投資態度

主として、マザーファンドへの投資を通じて、実質的に以下の運用を行います。

(イ) 主として、円貨建の短期公社債および短期金融商品に投資し、安定した収益の確保を目指します。

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

マザーファンドにおいては、円貨建の短期公社債および短期金融商品に投資し、安定した収益の確保を目指して運用を行います。

## ハ 主な投資制限

(イ) 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

(ロ) 投資信託証券（マザーファンド受益証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

(ハ) 外貨建資産への投資は行いません。

(ニ) 同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。

## (3) その他

## イ 信託報酬

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

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

(注) 上記信託報酬率は税抜き

## 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。

#### （ヘ）市場流動性リスク

ファンドの資金流出入に伴い、有価証券等を大量に売買しなければならない場合、あるいは市場を取り巻く外部環境に急激な変化があり、市場規模の縮小や市場の混乱が生じた場合等には、必要な取引ができなかったり、通常よりも不利な価格での取引を余儀なくされることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。

#### （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%<sup>\*</sup>（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%<sup>\*\*</sup>（税抜き0.4%）となります。

\* 消費税率が8%となる平成26年4月1日以降は年0.5292%となります。

\*\* 消費税率が8%となる平成26年4月1日以降は年0.432%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。

< 信託報酬の配分（税抜き）>

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

上記の配分には別途消費税等相当額がかかります。

投資対象とする投資信託（「SMAM・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）」、「SMAM・年金国内債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>」、「SMAM・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）」、「SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>」、「SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>」）の信託報酬を含めた総額は、各ファンドの基本アロケーション（平成26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0.18%（税抜き）で計算しております。

< 2010 > 年0.5439%<sup>\*</sup>（税抜き0.518%）程度

< 2020 > 年0.580965%<sup>\*</sup>（税抜き0.5533%）程度

< 2030 > 年0.58191%<sup>\*</sup>（税抜き0.5542%）程度

< 2040 > 年0.587055%<sup>\*</sup>（税抜き0.5591%）程度

\* 消費税率が8%となる平成26年4月1日以降は、< 2010 > が年0.55944%、< 2020 > が年0.597564%、< 2030 > が年0.598536%、< 2040 > が年0.603828%となります。

##### (4)【その他の手数料等】

イ 信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、原則として、計算期間を通じて毎日、純資産総額に年0.00315%<sup>\*</sup>（税抜き0.003%）以内の率を乗じて得た金額が信託財産の費用として計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。監査費用は、将来、監査法人との契約等により変更となることがあります。

\* 消費税率が8%となる平成26年4月1日以降は年0.00324%となります。

- ロ 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立て替えた立替金の利息は、信託財産中から支弁します。
- ハ 有価証券の売買時の手数料、デリバティブ取引等に要する費用、および外国における資産の保管等に要する費用等(それらにかかる消費税等相当額を含みます。)は、信託財産中から支弁するものとします。

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

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。)

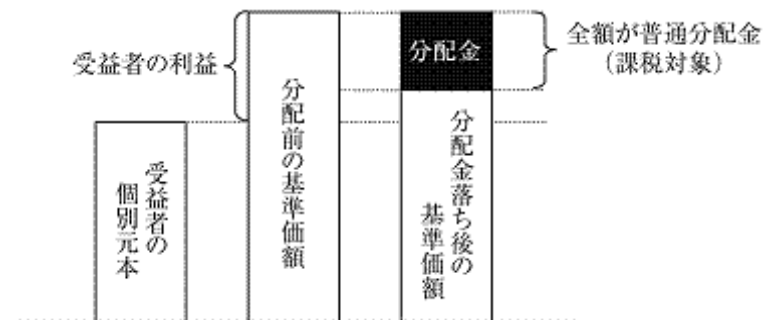
##### ロ 一部解約時および償還時の課税について

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。

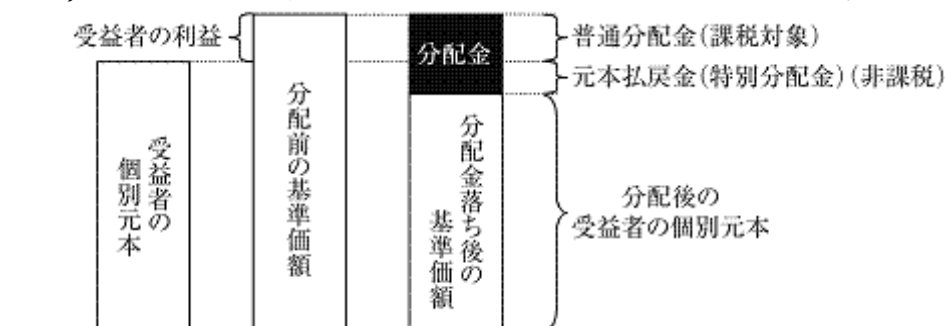
##### ハ 収益分配金の課税について

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。

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



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



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

## 二 個人、法人別の課税の取扱いについて

### (イ) 個人の受益者に対する課税

#### ・ 収益分配時

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

#### ・ 一部解約時および償還時

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

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

### (ロ) 法人の受益者に対する課税

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

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」の適用対象です。

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。



少額投資非課税制度「NISA(ニーサ)」をご利用の場合、毎年、年間100万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託等から生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設する等、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

当ファンドの外貨建資産割合および非株式割合

外貨建資産への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26年1月末現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家に確認されることをお勧めいたします。

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

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

平成26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	414,495,953	98.64
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		5,719,850	1.36
合計（純資産総額）		420,215,803	100.00

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

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

平成26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	800,484,527	99.43
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		4,602,088	0.57
合計（純資産総額）		805,086,615	100.00

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

平成26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	538,946,900	99.35
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		3,529,851	0.65
合計（純資産総額）		542,476,751	100.00

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

平成26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	438,200,651	98.88
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		4,974,539	1.12
合計（純資産総額）		443,175,190	100.00

## (2) 【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ 主要投資銘柄

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

平成26年1月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	投資信託 受益証券	SMAM・マネーインカムファン ド<適格機関投資家限定>	207,186,473	1.0083	208,906,326	1.0083	208,906,120	49.71
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>	122,468,918	1.1879	145,485,896	1.1936	146,178,900	34.79
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>	12,872,127	1.5683	20,187,883	1.5582	20,057,348	4.77
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)	11,485,303	1.7487	20,084,452	1.7170	19,720,265	4.69
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)	17,388,469	1.1642	20,244,616	1.1291	19,633,320	4.67

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

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

平成26年1月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	投資信託 受益証券	SMAM・年金国内債券パッシ ブファンド<適格機関投資家限 定>	407,572,603	1.1879	484,159,837	1.1936	486,478,658	60.43
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>	66,498,397	1.5682	104,286,204	1.5582	103,617,802	12.87
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)	88,948,856	1.1639	103,528,768	1.1291	100,432,153	12.47
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)	40,973,597	1.7483	71,636,748	1.7170	70,351,666	8.74
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>	39,278,239	1.0083	39,605,102	1.0083	39,604,248	4.92

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

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

平成26年1月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	投資信託 受益証券	SMAM・年金国内債券パッシ ブファンド<適格機関投資家限 定>	207,315,019	1.1879	246,276,145	1.1936	247,451,206	45.62
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)	125,194,681	1.1640	145,736,275	1.1291	141,357,314	26.06
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)	46,618,601	1.7482	81,501,810	1.7170	80,044,137	14.76
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>	38,262,992	1.5681	60,001,678	1.5582	59,621,394	10.99
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>	10,386,640	1.0082	10,472,837	1.0083	10,472,849	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。

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

平成26年1月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	投資比率(%)
日本	投資信託受益証券	SMAM・国内株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	164,523,732	1.1640	191,508,070	1.1291	185,763,745	41.92
日本	投資信託受益証券	SMAM・年金国内債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	96,921,603	1.1879	115,137,533	1.1936	115,685,625	26.10
日本	投資信託受益証券	SMAM・外国株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	48,819,365	1.7485	85,365,278	1.7170	83,822,849	18.91
日本	投資信託受益証券	SMAM・年金外国債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	28,528,249	1.5684	44,744,819	1.5582	44,452,717	10.03
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>	8,405,946	1.0082	8,475,714	1.0083	8,475,715	1.91

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

## □ 種類別の投資比率

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

平成26年1月31日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	98.64
合計	98.64

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

平成26年1月31日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	99.43
合計	99.43

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

平成26年1月31日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	99.35
合計	99.35

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

平成26年1月31日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	98.88
合計	98.88

**【投資不動産物件】**

- a . 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型) 2010  
該当事項はありません。
- b . 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型) 2020  
該当事項はありません。
- c . 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型) 2030  
該当事項はありません。
- d . 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型) 2040  
該当事項はありません。

**【その他投資資産の主要なもの】**

- a . 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型) 2010  
該当事項はありません。
- b . 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型) 2020  
該当事項はありません。
- c . 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型) 2030  
該当事項はありません。
- d . 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型) 2040  
該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

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

年月日	純資産総額 (円)	1万口当たりの 純資産額(円)
第4期(平成16年12月20日)	56,778,399	10,387
(分配落)		
(分配付)	56,778,399	10,387
第5期(平成17年12月20日)	118,527,624	10,782
(分配落)		
(分配付)	118,527,624	10,782
第6期(平成18年12月20日)	160,590,675	11,048
(分配落)		
(分配付)	160,590,675	11,048
第7期(平成19年12月20日)	217,158,042	11,245
(分配落)		
(分配付)	217,158,042	11,245
第8期(平成20年12月22日)	238,566,878	10,578
(分配落)		
(分配付)	238,566,878	10,578
第9期(平成21年12月21日)	301,495,735	10,921
(分配落)		
(分配付)	301,495,735	10,921
第10期(平成22年12月20日)	324,751,925	10,941
(分配落)		
(分配付)	324,751,925	10,941
第11期(平成23年12月20日)	329,392,588	10,818
(分配落)		
(分配付)	329,392,588	10,818
第12期(平成24年12月20日)	348,417,250	11,198
(分配落)		
(分配付)	348,417,250	11,198
第13期(平成25年12月20日)	406,358,497	11,884
(分配落)		
(分配付)	406,358,497	11,884
平成25年 1月末日	356,731,676	11,377
2月末日	357,804,955	11,425
3月末日	366,458,876	11,558
4月末日	369,291,539	11,675
5月末日	365,668,207	11,648
6月末日	363,144,472	11,582
7月末日	365,273,382	11,650
8月末日	378,313,048	11,637
9月末日	395,471,115	11,739
10月末日	399,812,268	11,799
11月末日	406,712,505	11,878
12月末日	408,675,435	11,913
平成26年 1月末日	420,215,803	11,868

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

年月日	純資産総額 (円)	1万口当たりの 純資産額(円)
第4期(平成16年12月20日)	50,534,185	10,223
(分配落)		
(分配付)	50,534,185	10,223
第5期(平成17年12月20日)	116,847,054	11,660
(分配落)		
(分配付)	116,847,054	11,660
第6期(平成18年12月20日)	156,345,353	12,355
(分配落)		
(分配付)	156,345,353	12,355
第7期(平成19年12月20日)	244,051,631	12,244
(分配落)		
(分配付)	244,051,631	12,244
第8期(平成20年12月22日)	258,579,003	10,124
(分配落)		
(分配付)	258,579,003	10,124
第9期(平成21年12月21日)	364,838,536	10,782
(分配落)		
(分配付)	364,838,536	10,782
第10期(平成22年12月20日)	460,154,017	10,871
(分配落)		
(分配付)	460,154,017	10,871
第11期(平成23年12月20日)	503,354,494	10,466
(分配落)		
(分配付)	503,354,494	10,466
第12期(平成24年12月20日)	605,756,824	11,419
(分配落)		
(分配付)	605,756,824	11,419
第13期(平成25年12月20日)	792,418,477	13,210
(分配落)		
(分配付)	792,418,477	13,210
平成25年 1月末日	639,770,732	11,885
2月末日	659,158,752	11,985
3月末日	687,599,687	12,305
4月末日	712,375,167	12,661
5月末日	714,282,358	12,624
6月末日	713,588,408	12,431
7月末日	731,267,398	12,602
8月末日	721,285,993	12,561
9月末日	738,258,819	12,834
10月末日	750,104,995	12,964
11月末日	776,588,518	13,183
12月末日	800,197,603	13,290
平成26年 1月末日	805,086,615	13,160

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

年月日	純資産総額 (円)	1万口当たりの 純資産額(円)
第4期(平成16年12月20日)	26,147,117	10,035
(分配落)		
(分配付)	26,147,117	10,035
第5期(平成17年12月20日)	55,989,814	12,178
(分配落)		
(分配付)	55,989,814	12,178
第6期(平成18年12月20日)	101,147,764	13,183
(分配落)		
(分配付)	101,147,764	13,183
第7期(平成19年12月20日)	149,262,430	12,809
(分配落)		
(分配付)	149,262,430	12,809
第8期(平成20年12月22日)	146,078,912	9,332
(分配落)		
(分配付)	146,078,912	9,332
第9期(平成21年12月21日)	214,049,126	10,168
(分配落)		
(分配付)	214,049,126	10,168
第10期(平成22年12月20日)	266,798,732	10,308
(分配落)		
(分配付)	266,798,732	10,308
第11期(平成23年12月20日)	273,003,638	9,525
(分配落)		
(分配付)	273,003,638	9,525
第12期(平成24年12月20日)	367,329,083	10,766
(分配落)		
(分配付)	367,329,083	10,766
第13期(平成25年12月20日)	541,345,607	13,445
(分配落)		
(分配付)	541,345,607	13,445
平成25年 1月末日	396,794,577	11,432
2月末日	407,597,724	11,554
3月末日	430,620,241	12,023
4月末日	456,053,263	12,609
5月末日	464,850,870	12,597
6月末日	460,142,288	12,323
7月末日	477,414,294	12,598
8月末日	479,820,633	12,486
9月末日	498,907,926	12,950
10月末日	519,109,047	13,072
11月末日	533,625,092	13,406
12月末日	544,662,960	13,593
平成26年 1月末日	542,476,751	13,314



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

年月日	純資産総額 (円)	1万口当たりの 純資産額(円)
第4期（平成16年12月20日）（分配落） （分配付）	30,736,176 30,736,176	9,865 9,865
第5期（平成17年12月20日）（分配落） （分配付）	64,001,577 64,001,577	12,443 12,443
第6期（平成18年12月20日）（分配落） （分配付）	113,160,193 113,160,193	13,668 13,668
第7期（平成19年12月20日）（分配落） （分配付）	143,523,897 143,523,897	13,111 13,111
第8期（平成20年12月22日）（分配落） （分配付）	134,815,396 134,815,396	8,596 8,596
第9期（平成21年12月21日）（分配落） （分配付）	188,270,881 188,270,881	9,559 9,559
第10期（平成22年12月20日）（分配落） （分配付）	231,956,041 231,956,041	9,713 9,713
第11期（平成23年12月20日）（分配落） （分配付）	230,424,744 230,424,744	8,586 8,586
第12期（平成24年12月20日）（分配落） （分配付）	287,659,579 287,659,579	10,038 10,038
第13期（平成25年12月20日）（分配落） （分配付）	445,842,340 445,842,340	13,541 13,541
平成25年 1月末日	316,602,034	10,887
2月末日	332,829,161	11,023
3月末日	351,511,574	11,627
4月末日	378,367,867	12,448
5月末日	380,640,834	12,450
6月末日	369,167,434	12,081
7月末日	386,510,297	12,456
8月末日	386,074,960	12,276
9月末日	411,452,732	12,930
10月末日	425,778,123	13,033
11月末日	439,347,583	13,486
12月末日	452,268,909	13,760
平成26年 1月末日	443,175,190	13,325

## 【分配の推移】

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

計算期間	1万口当たり分配金（円）
第4期（平成15年12月23日～平成16年12月20日）	0
第5期（平成16年12月21日～平成17年12月20日）	0
第6期（平成17年12月21日～平成18年12月20日）	0
第7期（平成18年12月21日～平成19年12月20日）	0
第8期（平成19年12月21日～平成20年12月22日）	0
第9期（平成20年12月23日～平成21年12月21日）	0
第10期（平成21年12月22日～平成22年12月20日）	0
第11期（平成22年12月21日～平成23年12月20日）	0
第12期（平成23年12月21日～平成24年12月20日）	0
第13期（平成24年12月21日～平成25年12月20日）	0

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

計算期間	1万口当たり分配金（円）
第4期（平成15年12月23日～平成16年12月20日）	0
第5期（平成16年12月21日～平成17年12月20日）	0
第6期（平成17年12月21日～平成18年12月20日）	0
第7期（平成18年12月21日～平成19年12月20日）	0
第8期（平成19年12月21日～平成20年12月22日）	0
第9期（平成20年12月23日～平成21年12月21日）	0
第10期（平成21年12月22日～平成22年12月20日）	0
第11期（平成22年12月21日～平成23年12月20日）	0
第12期（平成23年12月21日～平成24年12月20日）	0
第13期（平成24年12月21日～平成25年12月20日）	0

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

計算期間	1万口当たり分配金（円）
第4期（平成15年12月23日～平成16年12月20日）	0
第5期（平成16年12月21日～平成17年12月20日）	0
第6期（平成17年12月21日～平成18年12月20日）	0
第7期（平成18年12月21日～平成19年12月20日）	0
第8期（平成19年12月21日～平成20年12月22日）	0
第9期（平成20年12月23日～平成21年12月21日）	0
第10期（平成21年12月22日～平成22年12月20日）	0
第11期（平成22年12月21日～平成23年12月20日）	0
第12期（平成23年12月21日～平成24年12月20日）	0
第13期（平成24年12月21日～平成25年12月20日）	0

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

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

第9期(平成20年12月23日～平成21年12月21日)	0
第10期(平成21年12月22日～平成22年12月20日)	0
第11期(平成22年12月21日～平成23年12月20日)	0
第12期(平成23年12月21日～平成24年12月20日)	0
第13期(平成24年12月21日～平成25年12月20日)	0

## 【収益率の推移】

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

計算期間	収益率(%)
第4期	3.0
第5期	3.8
第6期	2.5
第7期	1.8
第8期	5.9
第9期	3.2
第10期	0.2
第11期	1.1
第12期	3.5
第13期	6.1

(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。

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

計算期間	収益率(%)
第4期	5.1
第5期	14.1
第6期	6.0
第7期	0.9
第8期	17.3
第9期	6.5
第10期	0.8
第11期	3.7
第12期	9.1
第13期	15.7

(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。

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

計算期間	収益率(%)
第4期	6.9
第5期	21.4
第6期	8.3
第7期	2.8
第8期	27.1
第9期	9.0
第10期	1.4
第11期	7.6
第12期	13.0
第13期	24.9

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

d. 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2040

計算期間	収益率(%)
第4期	7.5
第5期	26.1
第6期	9.8
第7期	4.1
第8期	34.4
第9期	11.2
第10期	1.6
第11期	11.6
第12期	16.9
第13期	34.9

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

(4) 【設定及び解約の実績】

a. 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010

計算期間	設定口数(口)	解約口数(口)
第4期	21,071,041	1,494,879
第5期	58,009,119	2,742,491
第6期	55,018,651	19,583,375
第7期	68,363,183	20,609,878
第8期	56,897,891	24,476,235
第9期	64,237,153	13,713,349
第10期	56,241,790	35,487,520
第11期	50,688,810	43,023,358
第12期	33,162,080	26,499,660
第13期	71,424,035	40,643,048

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

b. 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2020

計算期間	設定口数(口)	解約口数(口)
第4期	25,287,983	418,069
第5期	56,755,832	5,972,212
第6期	45,933,217	19,605,145
第7期	83,458,432	10,678,494
第8期	83,157,158	27,059,755
第9期	95,242,920	12,283,196
第10期	111,793,677	26,894,086
第11期	87,891,359	30,227,601
第12期	85,709,743	36,186,583
第13期	124,684,453	55,291,960

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

c. 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2030

計算期間	設定口数(口)	解約口数(口)
第4期	11,517,637	435,535

第5期	21,538,032	1,618,154
第6期	34,029,711	3,275,922
第7期	48,479,281	8,680,254
第8期	58,044,415	18,035,819
第9期	63,896,452	9,917,639
第10期	58,503,162	10,182,239
第11期	47,890,237	20,123,017
第12期	65,335,257	10,757,941
第13期	97,849,986	36,394,176

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

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

計算期間	設定口数(口)	解約口数(口)
第4期	11,907,838	767,723
第5期	38,175,773	17,899,095
第6期	51,096,621	19,739,396
第7期	50,628,800	23,956,246
第8期	65,487,055	18,108,518
第9期	57,723,829	17,613,224
第10期	52,737,375	10,883,373
第11期	49,611,557	20,043,137
第12期	48,930,836	30,725,942
第13期	84,609,174	41,944,386

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

## 〔参考情報〕

## 〔S M A M・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)〕

## 投資有価証券の主要銘柄

## 主要投資銘柄

平成26年1月30日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド(B号)	37,789,190,811	1.7637	66,652,436,327	1.7168	64,876,482,784	100.01

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

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

<国内株式インデックス・マザーファンド(B号) 平成26年1月30日現在の上位30銘柄>

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	投資比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	2,342,500	6,370.00	14,921,725,000	5,998.00	14,050,315,000	4.71
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	12,582,400	661.00	8,316,966,400	630.00	7,926,912,000	2.65
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	816,200	8,280.00	6,758,136,000	7,675.00	6,264,335,000	2.10
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,256,400	5,090.00	6,395,076,000	4,823.00	6,059,617,200	2.03
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,514,200	4,305.00	6,518,631,000	3,903.00	5,909,922,600	1.98
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	21,513,000	216.00	4,646,808,000	217.00	4,668,321,000	1.56
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	654,000	5,180.00	3,387,720,000	5,441.00	3,558,414,000	1.19
日本	株式	日立製作所	電気機器	4,041,000	758.00	3,063,078,000	794.00	3,208,554,000	1.07
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	1,045,500	3,460.00	3,617,430,000	3,026.00	3,163,683,000	1.06
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	660,100	5,030.00	3,320,303,000	4,792.00	3,163,199,200	1.06
日本	株式	ファナック	電気機器	187,800	17,170.00	3,224,526,000	16,790.00	3,153,162,000	1.06
日本	株式	K D D I	情報・通信業	515,900	6,390.00	3,296,601,000	5,914.00	3,051,032,600	1.02
日本	株式	三菱地所	不動産業	1,163,000	2,833.00	3,294,779,000	2,585.00	3,006,355,000	1.01
日本	株式	キヤノン	電気機器	975,500	3,370.00	3,287,435,000	3,015.00	2,941,132,500	0.99
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	694,900	3,765.00	2,616,298,500	4,170.00	2,897,733,000	0.97
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	406,000	6,110.00	2,480,660,000	6,423.00	2,607,738,000	0.87
日本	株式	三井不動産	不動産業	784,000	3,440.00	2,696,960,000	3,308.00	2,593,472,000	0.87
日本	株式	野村ホールディングス	証券・商品先物取引業	3,395,400	807.00	2,740,087,800	739.00	2,509,200,600	0.84
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,295,600	2,005.00	2,597,678,000	1,905.00	2,468,118,000	0.83
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	309,500	8,310.00	2,571,945,000	7,702.00	2,383,769,000	0.80
日本	株式	新日鐵住金	鉄鋼	7,450,000	331.00	2,465,950,000	315.00	2,346,750,000	0.79
日本	株式	パナソニック	電気機器	1,923,100	1,166.00	2,242,334,600	1,200.00	2,307,720,000	0.77
日本	株式	N T T ドコモ	情報・通信業	1,372,100	1,659.00	2,276,313,900	1,641.00	2,251,616,100	0.75
日本	株式	デンソー	輸送用機器	415,300	5,120.00	2,126,336,000	5,339.00	2,217,286,700	0.74
日本	株式	三井物産	卸売業	1,529,500	1,408.00	2,153,536,000	1,389.00	2,124,475,500	0.71
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	2,361,600	933.00	2,203,372,800	892.00	2,106,547,200	0.71
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	552,000	3,750.00	2,070,000,000	3,772.00	2,082,144,000	0.70
日本	株式	三菱重工業	機械	2,996,000	656.00	1,965,376,000	677.00	2,028,292,000	0.68
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,682,000	1,179.00	1,983,078,000	1,194.00	2,008,308,000	0.67
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	642,800	3,430.00	2,204,804,000	3,033.00	1,949,612,400	0.65

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

## 投資有価証券の主要銘柄

## 主要投資銘柄

平成26年1月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託 受益証券	国内債券 (NOMUR A - B P I) マザー ファンド	43,798,273,018	1.2564	55,028,150,220	1.2855	56,302,679,964	100.01

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

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

## &lt; 国内債券 (NOMUR A - B P I) マザーファンド 平成26年1月30日現在の上位30銘柄 &gt;

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿 単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債 証券	第284回利付国債(1 0年)	3,920,000,000	105.18	4,123,183,000	104.55	4,098,712,800	1.700	2016/12/20	2.52
日本	国債 証券	第280回利付国債(1 0年)	3,443,000,000	105.15	3,620,448,130	104.27	3,590,257,110	1.900	2016/06/20	2.20
日本	国債 証券	第277回利付国債(1 0年)	2,834,000,000	103.96	2,946,226,400	103.20	2,924,688,000	1.600	2016/03/20	1.80
日本	国債 証券	第274回利付国債(1 0年)	2,823,000,000	103.37	2,918,135,100	102.65	2,897,837,730	1.500	2015/12/20	1.78
日本	国債 証券	第286回利付国債(1 0年)	2,715,000,000	106.16	2,882,244,000	105.62	2,867,827,350	1.800	2017/06/20	1.76
日本	国債 証券	第289回利付国債(1 0年)	2,603,000,000	105.38	2,743,041,400	105.22	2,738,954,690	1.500	2017/12/20	1.68
日本	国債 証券	第288回利付国債(1 0年)	2,538,000,000	106.01	2,690,533,800	105.64	2,681,371,620	1.700	2017/09/20	1.65
日本	国債 証券	第282回利付国債(1 0年)	2,471,000,000	104.85	2,590,879,100	104.19	2,574,584,320	1.700	2016/09/20	1.58
日本	国債 証券	第296回利付国債(1 0年)	2,376,000,000	106.14	2,522,110,700	106.08	2,520,508,320	1.500	2018/09/20	1.55
日本	国債 証券	第272回利付国債(1 0年)	2,430,000,000	102.83	2,498,769,000	102.13	2,481,929,100	1.400	2015/09/20	1.52
日本	国債 証券	第297回利付国債(1 0年)	2,214,000,000	105.76	2,341,739,600	105.84	2,343,430,440	1.400	2018/12/20	1.44
日本	国債 証券	第285回利付国債(1 0年)	2,174,000,000	105.42	2,292,036,800	104.93	2,281,221,680	1.700	2017/03/20	1.40
日本	国債 証券	第293回利付国債(1 0年)	2,026,000,000	107.34	2,174,798,300	107.07	2,169,420,540	1.800	2018/06/20	1.33
日本	国債 証券	第310回利付国債(1 0年)	2,000,000,000	102.60	2,052,000,000	104.54	2,090,960,000	1.000	2020/09/20	1.28
日本	国債 証券	第305回利付国債(1 0年)	1,940,000,000	105.08	2,038,636,000	106.23	2,060,959,000	1.300	2019/12/20	1.26
日本	国債 証券	第290回利付国債(1 0年)	1,952,000,000	105.11	2,051,747,200	105.10	2,051,552,000	1.400	2018/03/20	1.26
日本	国債 証券	第315回利付国債(1 0年)	1,890,000,000	103.85	1,962,837,300	105.76	1,999,034,100	1.200	2021/06/20	1.23
日本	国債 証券	第306回利付国債(1 0年)	1,860,000,000	105.68	1,965,648,000	106.96	1,989,586,200	1.400	2020/03/20	1.22
日本	国債 証券	第328回利付国債(1 0年)	1,920,000,000	97.87	1,879,104,000	100.39	1,927,488,000	0.600	2023/03/20	1.18
日本	国債 証券	第329回利付国債(1 0年)	1,840,000,000	100.42	1,847,805,100	102.04	1,877,646,400	0.800	2023/06/20	1.15
日本	国債 証券	第313回利付国債(1 0年)	1,710,000,000	104.59	1,788,489,000	106.49	1,820,996,100	1.300	2021/03/20	1.12
日本	国債 証券	第312回利付国債(1 0年)	1,710,000,000	103.89	1,776,519,000	105.84	1,810,017,900	1.200	2020/12/20	1.11
日本	国債 証券	第317回利付国債(1 0年)	1,670,000,000	102.99	1,719,933,000	105.02	1,753,917,500	1.100	2021/09/20	1.08

日本	国債証券	第330回利付国債(10年)	1,720,000,000	101.77	1,750,448,400	101.91	1,752,903,600	0.800	2023/09/20	1.08
日本	国債証券	第292回利付国債(10年)	1,430,000,000	106.56	1,523,880,900	106.33	1,520,519,000	1.700	2018/03/20	0.93
日本	国債証券	第324回利付国債(10年)	1,410,000,000	100.16	1,412,256,000	102.45	1,444,573,200	0.800	2022/06/20	0.89
日本	国債証券	第321回利付国債(10年)	1,280,000,000	101.92	1,304,576,000	104.14	1,333,081,600	1.000	2022/03/20	0.82
日本	国債証券	第320回利付国債(10年)	1,240,000,000	102.08	1,265,836,000	104.18	1,291,869,200	1.000	2021/12/20	0.79
日本	国債証券	第283回利付国債(10年)	1,230,000,000	105.23	1,294,415,100	104.45	1,284,784,200	1.800	2016/09/20	0.79
日本	国債証券	第327回利付国債(10年)	1,190,000,000	99.86	1,188,334,000	102.24	1,216,715,500	0.800	2022/12/20	0.75



## 〔S M A M ・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）〕

投資有価証券の主要銘柄  
主要投資銘柄

平成26年1月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託 受益証券	外国株式インデックス・ マザーファンド	19,187,104,376	2.2161	42,520,613,656	2.2087	42,378,557,435	100.01

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

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

<外国株式インデックス・マザーファンド 平成26年1月31日現在の上位30銘柄>

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ ハードウェアおよび機器	69,377	57,197.36	3,968,181,258	51,372.39	3,564,062,883	1.59
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	336,149	9,615.35	3,232,191,228	9,667.81	3,249,825,134	1.45
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・ サービス	20,917	108,989.42	2,279,731,852	116,592.83	2,438,772,404	1.09
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・ サービス	604,233	3,922.05	2,369,833,125	3,792.44	2,291,522,353	1.02
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	777,514	2,742.24	2,132,135,900	2,622.92	2,039,364,796	0.91
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	215,268	9,736.72	2,096,005,876	9,205.96	1,981,750,749	0.88
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タ バコ	246,243	7,545.47	1,858,020,646	7,516.98	1,851,003,952	0.82
アメリカ	株式	WELLS FARGO & COMPANY	銀行	385,139	4,527.89	1,743,869,799	4,736.70	1,824,289,056	0.81
アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION	エネルギー	147,516	12,594.17	1,857,842,820	11,978.04	1,766,953,581	0.79
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	287,354	5,885.64	1,691,264,840	5,760.15	1,655,205,016	0.74
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パー ソナル用品	209,065	8,662.86	1,811,102,749	7,906.84	1,653,045,218	0.74
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	505,736	3,263.74	1,650,594,757	3,170.14	1,603,256,552	0.71
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	53,644	28,802.74	1,545,094,506	28,415.21	1,524,305,739	0.68
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	1,424,123	1,155.52	1,645,603,748	1,069.32	1,522,847,990	0.68
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・ サービス	79,448	18,481.88	1,468,348,783	18,243.24	1,449,389,694	0.65
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	175,634	8,166.66	1,434,344,391	8,235.05	1,446,355,649	0.64
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	各種金融	820,023	1,627.24	1,334,378,490	1,741.41	1,428,004,288	0.64
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービ ス	3,701,651	383.47	1,419,497,280	382.88	1,417,298,943	0.63
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービ ス	405,773	3,621.70	1,469,588,317	3,430.38	1,391,955,989	0.62
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	223,566	5,125.51	1,145,890,618	5,504.03	1,230,515,893	0.55
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タ バコ	304,564	4,133.94	1,259,050,337	3,926.16	1,195,768,882	0.53
イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	1,439,129	817.85	1,177,002,590	810.90	1,166,990,742	0.52

アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	27,890	40,487.75	1,129,203,436	41,416.57	1,155,108,388	0.51
アメリカ	株式	CITIGROUP INC	各種金融	232,072	5,443.35	1,263,249,399	4,968.13	1,152,965,721	0.51
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	218,501	5,103.91	1,115,210,138	4,899.22	1,070,484,862	0.48
イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	291,761	3,475.04	1,013,883,012	3,643.87	1,063,141,488	0.47
アメリカ	株式	ORACLE CORPORATION	ソフトウェア・サービス	265,098	3,629.92	962,287,024	3,846.96	1,019,822,462	0.45
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	食品・飲料・タバコ	123,540	8,798.64	1,086,984,529	8,135.19	1,005,022,286	0.45
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	374,321	2,745.42	1,027,669,258	2,675.00	1,001,310,620	0.45
アメリカ	株式	QUALCOMM INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	130,934	7,568.43	990,965,965	7,535.52	986,656,247	0.44

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

## 投資有価証券の主要銘柄

## 主要投資銘柄

平成26年1月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託 受益証券	外国債券パッシブ・マ ザーファンド	2,704,412,748	1.5681	4,240,805,588	1.5681	4,240,789,630	100.01

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

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

## &lt; 外国債券パッシブ・マザーファンド 平成26年1月31日現在の上位30銘柄 &gt;

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B 2	17,500,000	9,643.92	1,687,687,512	9,782.95	1,712,016,304	2.000	2023/02/15	0.66
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B 0.25	14,000,000	10,284.39	1,439,814,993	10,290.82	1,440,715,018	0.250	2015/07/15	0.56
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B 0.25	14,000,000	10,275.15	1,438,521,204	10,285.19	1,439,927,504	0.250	2015/09/15	0.56
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B 0.625	14,000,000	10,278.76	1,439,027,479	10,281.17	1,439,364,981	0.625	2016/11/15	0.56
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B 0.25	13,000,000	10,293.23	1,338,120,211	10,296.44	1,338,538,080	0.250	2015/01/15	0.52
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B 0.25	13,000,000	10,289.21	1,337,597,868	10,294.83	1,338,329,145	0.250	2015/05/15	0.52
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B 0.5	13,000,000	10,289.21	1,337,597,868	10,288.41	1,337,493,408	0.500	2016/06/15	0.52
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B 1.375	12,000,000	10,266.71	1,232,005,650	10,287.60	1,234,512,862	1.375	2018/07/31	0.48
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B 0.375	12,000,000	10,277.96	1,233,355,687	10,281.17	1,233,741,412	0.375	2016/03/15	0.48
フランス	国債 証券	FRANCE O.A.T. 4.25	7,400,000	16,131.81	1,193,754,206	16,203.62	1,199,068,264	4.250	2019/04/25	0.46
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B 2.75	13,000,000	8,195.04	1,065,356,378	8,624.97	1,121,246,330	2.750	2042/11/15	0.43
フランス	国債 証券	FRANCE O.A.T. 3	7,000,000	15,034.69	1,052,428,977	15,192.40	1,063,468,442	3.000	2022/04/25	0.41
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B 1.875	10,000,000	10,598.59	1,059,859,802	10,593.77	1,059,377,645	1.875	2017/09/30	0.41
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B 2.5	10,000,000	10,605.83	1,060,583,031	10,584.13	1,058,413,333	2.500	2015/04/30	0.41
フランス	国債 証券	FRANCE O.A.T. 3	7,200,000	14,635.34	1,053,744,733	14,620.98	1,052,710,646	3.000	2015/10/25	0.41
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B 2.25	10,000,000	10,523.86	1,052,386,375	10,502.16	1,050,216,677	2.250	2015/01/31	0.41
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B 1.625	11,000,000	9,385.97	1,032,457,250	9,516.15	1,046,777,290	1.625	2022/11/15	0.40
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B 0.875	10,000,000	10,368.28	1,036,828,800	10,363.94	1,036,394,864	0.875	2016/09/15	0.40
イタリア	国債 証券	BTPS 6.5	5,960,000	16,937.49	1,009,474,876	17,343.54	1,033,675,413	6.500	2027/11/01	0.40
フランス	国債 証券	FRANCE O.A.T. 5.5	5,500,000	18,433.27	1,013,829,894	18,651.21	1,025,816,853	5.500	2029/04/25	0.40
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B 3.625	9,000,000	11,299.33	1,016,939,859	11,330.67	1,019,760,468	3.625	2020/02/15	0.39
アメリカ	国債 証券	US TREASURY N/B 2.625	9,500,000	10,560.02	1,003,202,423	10,635.56	1,010,378,516	2.625	2020/11/15	0.39
フランス	国債 証券	FRANCE O.A.T. 3.25	6,700,000	14,865.41	995,983,107	14,870.29	996,310,094	3.250	2016/04/25	0.38

ドイツ	国債証券	DEUTSCHLAND REP 4	6,000,000	15,843.17	950,590,368	15,910.38	954,622,972	4.000	2018/01/04	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.5	8,500,000	11,247.90	956,071,649	11,227.00	954,295,708	3.500	2018/02/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	9,000,000	10,588.15	952,933,612	10,564.04	950,763,909	2.500	2015/03/31	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	9,000,000	10,554.40	949,896,028	10,530.29	947,726,325	2.375	2015/02/28	0.37
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.5	6,000,000	15,660.50	939,630,384	15,750.86	945,051,811	3.500	2020/04/25	0.36
イタリア	国債証券	BTPS 6	5,600,000	16,301.93	912,908,102	16,740.19	937,450,657	6.000	2031/05/01	0.36
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 5.75	4,700,000	19,390.24	911,341,633	19,632.87	922,745,036	5.750	2032/10/25	0.36

## 〔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26年1月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託 受益証券	マネーインカム・マ ザーファンド	294,785,015	1.0104	297,850,780	1.0112	298,086,607	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」受益証券を主要投資対象としており、「マネーインカム・マザーファンド」の投資有価証券は以下の通りです。

＜マネーインカム・マザーファンド 平成26年1月30日現在＞

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿 単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債 証券	第258回利付国債(10 年)	636,000,000	100.60	639,869,900	100.15	636,960,360	1.300	2014/03/20	46.10
日本	国債 証券	第265回利付国債(10 年)	223,000,000	101.55	226,473,410	101.24	225,783,040	1.500	2014/12/20	16.34
日本	国債 証券	第263回利付国債(10 年)	223,000,000	101.59	226,555,670	100.95	225,131,880	1.600	2014/09/20	16.30
日本	国債 証券	第260回利付国債(10 年)	223,000,000	101.61	226,608,155	100.57	224,275,560	1.600	2014/06/20	16.23
日本	国債 証券	第268回利付国債(10 年)	47,000,000	101.60	47,754,890	101.59	47,748,710	1.500	2015/03/20	3.46

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

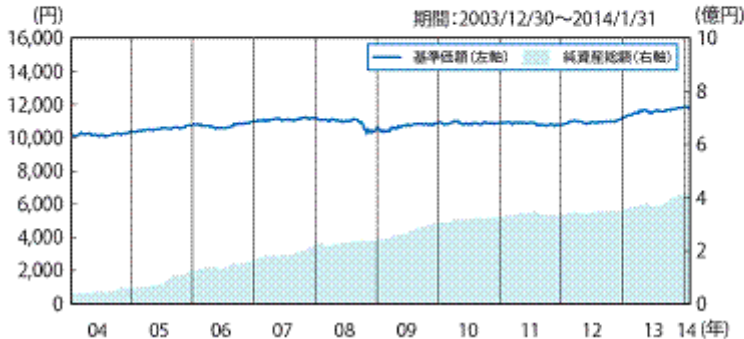
## 〔参考情報〕

基準日2014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

## &lt;2010&gt;



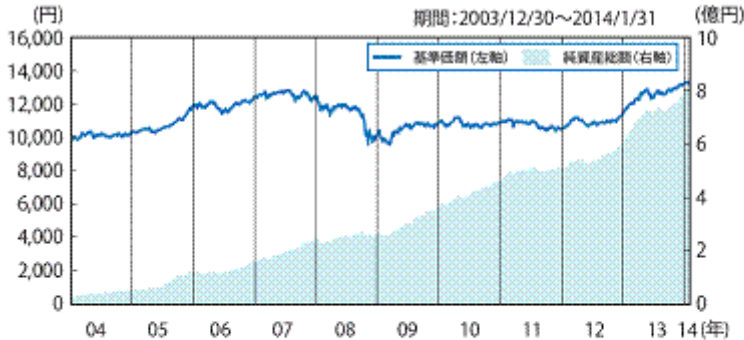
基準価額	11,868円
純資産総額	4億円

## ★ 分配の推移

決算期	分配金
2013年12月	0円
2012年12月	0円
2011年12月	0円
2010年12月	0円
2009年12月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。  
※直近5計算期間を記載しています。

## &lt;2020&gt;



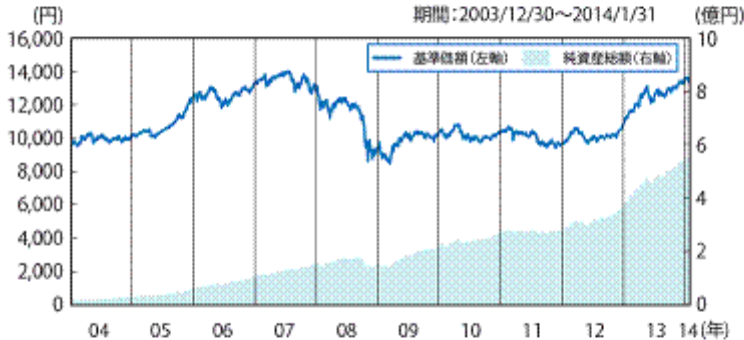
基準価額	13,160円
純資産総額	8億円

## ★ 分配の推移

決算期	分配金
2013年12月	0円
2012年12月	0円
2011年12月	0円
2010年12月	0円
2009年12月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。  
※直近5計算期間を記載しています。

## &lt;2030&gt;



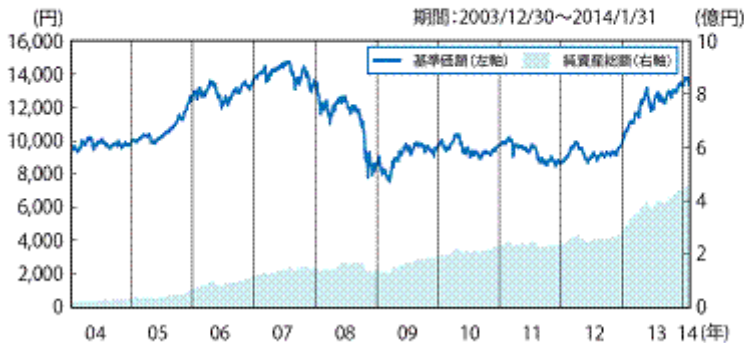
基準価額	13,314円
純資産総額	5億円

## ★ 分配の推移

決算期	分配金
2013年12月	0円
2012年12月	0円
2011年12月	0円
2010年12月	0円
2009年12月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。  
※直近5計算期間を記載しています。

## &lt;2040&gt;



基準価額	13,325円
純資産総額	4億円

## ★ 分配の推移

決算期	分配金
2013年12月	0円
2012年12月	0円
2011年12月	0円
2010年12月	0円
2009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。

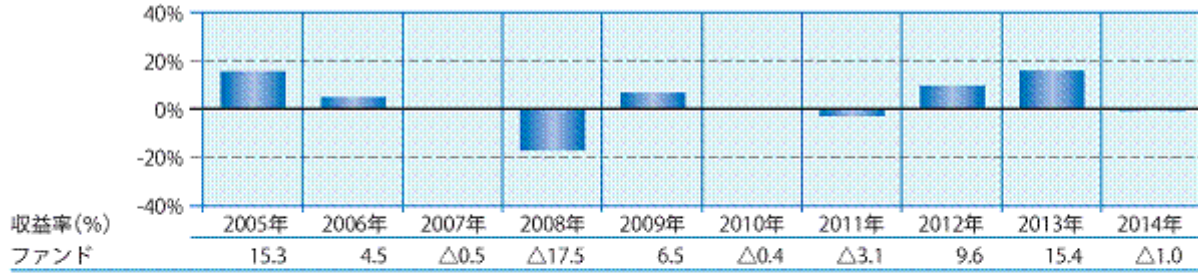
※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

## ★ 年間収益率の推移 (暦年ベース)

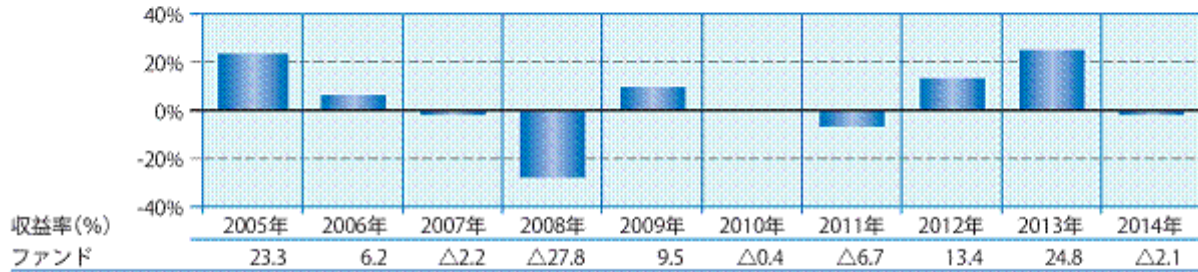
## &lt; 2010 &gt;



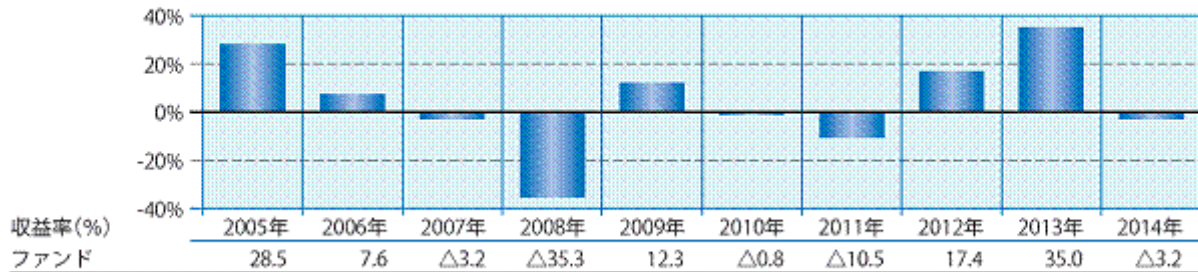
## &lt; 2020 &gt;



## &lt; 2030 &gt;



## &lt; 2040 &gt;



2014年のファンドの収益率は、年初から2014年1月31日までの騰落率を表示しています。  
 ファンドにはベンチマークはありません。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### イ 申込方法

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

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

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

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

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

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

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

#### ヘ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

#### ト 払込期日

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

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



## 2【換金（解約）手続等】

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

お買付けの販売会社にお申し出ください。

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

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

一部解約金は、解約請求受付日から起算して6営業日目からお支払いします。

一部解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

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

## 3【資産管理等の概要】

### （1）【資産の評価】

#### イ 基準価額の算出方法

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

#### ロ 基準価額の算出頻度・照会方法

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、それぞれ「TY2010」、「TY2020」、「TY2030」、「TY2040」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

### （2）【保管】

ファンドの受益権は社振法の規定の適用を受け、受益権の帰属は振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まるため、原則として受益証券は発行されません。したがって、受益証券の保管に関する該当事項はありません。

### （3）【信託期間】

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

(4)【計算期間】

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

(5)【その他】

イ 信託の終了

(イ) 信託契約の解約

- a. 委託会社は、当ファンドの信託契約を解約することが受益者にとって有利であると認めるとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、上記aの事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を当ファンドの知られたる受益者に対して交付します。ただし、当ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- c. 上記bの公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- d. 上記cの一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、信託契約の解約をしません。
- e. 委託会社は、当ファンドの信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- f. 上記c～eまでの取扱いは、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記cの一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

(ロ) 信託契約に関する監督官庁の命令

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

(ハ) 委託会社の登録取消等に伴う取扱い

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

(ニ) 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

- a. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。また、受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。
- b. 上記により受託会社が辞任し、または解任された場合は、委託会社は新受託会社を選任します。
- c. 委託会社が新受託会社を選任できないとき、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。

ロ 収益分配金、償還金の支払い

### （イ）収益分配金

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

### （ロ）償還金

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

## 八 信託約款の変更

- （イ）委託会社は、当ファンドの信託約款を変更することが受益者の利益のため必要と認めるとき、監督官庁より変更の命令を受けたとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨および内容を監督官庁に届け出ます。
- （ロ）委託会社は、上記（イ）の変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を当ファンドの知られたる受益者に交付します。ただし、当ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- （ハ）上記（ロ）の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- （ニ）上記（ハ）の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、（イ）の信託約款の変更をしません。
- （ホ）委託会社は、信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

## 二 反対者の買取請求権

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

## ホ 販売会社との契約の更改等

委託会社と販売会社との間で締結される販売契約（名称の如何を問わず、ファンドの募集・販売の取扱い、受益者からの一部解約実行請求の受付け、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を規定するもの）は、期間満了の3ヵ月前に当事者の

いずれからも、何らの意思表示もない場合は、自動的に1年間更新されます。販売契約の内容は、必要に応じて、委託会社と販売会社との合意により変更されることがあります。

へ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

ト 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

チ 運用にかかる報告書の開示方法

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

運用報告書は、原則として、あらかじめ受益者が申し出た住所に販売会社から届けられます。

#### 4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利は次の通りです。

イ 分配金請求権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に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)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)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13期(平成24年12月21日から平成25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12期 (平成24年12月20日現在)	第13期 (平成25年12月20日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	1,708,470	2,399,322
投資信託受益証券	347,763,826	405,283,667
未収利息	2	1
流動資産合計	349,472,298	407,682,990
資産合計	349,472,298	407,682,990
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金	330,000	510,000
未払受託者報酬	71,973	80,852
未払委託者報酬	647,740	727,636
その他未払費用	5,335	6,005
流動負債合計	1,055,048	1,324,493
負債合計	1,055,048	1,324,493
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	311,143,756	341,924,743
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	37,273,494	64,433,754
元本等合計	348,417,250	406,358,497
純資産合計	348,417,250	406,358,497
負債純資産合計	349,472,298	407,682,990

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第12期		第13期	
	自	平成23年12月21日 至 平成24年12月20日	自	平成24年12月21日 至 平成25年12月20日
<b>営業収益</b>				
受取利息		472		472
有価証券売買等損益		13,199,710		23,562,548
営業収益合計		13,200,182		23,563,020
<b>営業費用</b>				
受託者報酬		142,665		156,513
委託者報酬		1,283,901		1,408,539
その他費用		10,582		11,622
営業費用合計		1,437,148		1,576,674
営業利益		11,763,034		21,986,346
経常利益		11,763,034		21,986,346
当期純利益		11,763,034		21,986,346
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		485,596		1,628,326
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		24,911,252		37,273,494
剰余金増加額又は欠損金減少額		3,274,542		11,799,648
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		3,274,542		11,799,648
剰余金減少額又は欠損金増加額		2,189,738		4,997,408
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		2,189,738		4,997,408
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		37,273,494		64,433,754



( 3 ) 【注記表】  
( 重要な会計方針の注記 )

項 目	第13期 自 平成24年12月21日 至 平成25年12月20日	
	有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

( 貸借対照表に関する注記 )

項 目	第12期 (平成24年12月20日現在)	第13期 (平成25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 311,143,756口
2. 1単位当たり純資産額	1.1198円 (1万口 = 11,198円)	1.1884円 (1万口 = 11,884円)

( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項 目	第12期 自 平成23年12月21日 至 平成24年12月20日	第13期 自 平成24年12月21日 至 平成25年12月20日
	分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（471円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（4,326,169円）、収益調整金（26,916,337円）、および分配準備積立金（6,353,698円）より、分配対象収益は37,596,675円（1万口当たり1,208.33円）であります。分配を行っておりません。</p>

## （金融商品に関する注記）

## ．金融商品の状況に関する事項

項 目	第13期 自 平成24年12月21日 至 平成25年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第13期 (平成25年12月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第12期(自平成23年12月21日 至平成24年12月20日)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	11,574,249円
合計	11,574,249円

第13期(自平成24年12月21日 至平成25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	18,256,285円
合計	18,256,285円

(デリバティブ取引に関する注記)

第12期(平成24年12月20日現在)

該当事項はありません。

第13期(平成25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12期（自 平成23年12月21日 至 平成24年12月20日）

該当事項はありません。

第13期（自 平成24年12月21日 至 平成25年12月20日）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項 目	第12期 （平成24年12月20日現在）	第13期 （平成25年12月20日現在）
期首元本額	304,481,336円	311,143,756円
期中追加設定元本額	33,162,080円	71,424,035円
期中一部解約元本額	26,499,660円	40,643,048円

（4）【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘 柄	券面総額	評価額	備 考
投資信託 受益証券	S M A M ・ 国内株式パッシブ・ファ ンド（適格機関投資家専用）	17,736,444	20,646,994	
	S M A M ・ 外国株式パッシブ・ファ ンド（適格機関投資家専用）	11,772,271	20,586,170	
	S M A M ・ 年金外国債券パッシブ・ ファンド＜適格機関投資家限定＞	12,840,732	20,138,119	
	S M A M ・ 年金国内債券パッシブ ファンド＜適格機関投資家限定＞	119,198,502	141,595,900	
	S M A M ・ マネーインカムファンド ＜適格機関投資家限定＞	200,651,081	202,316,484	
	投資信託受益証券 小計	362,199,030	405,283,667	
	合 計		405,283,667	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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

## （1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第12期 （平成24年12月20日現在）	第13期 （平成25年12月20日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	5,128,349	8,470,136
投資信託受益証券	603,295,046	787,824,974
未収入金	-	230,000
未収利息	7	6
流動資産合計	608,423,402	796,525,116
資産合計	608,423,402	796,525,116
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金	1,220,000	1,960,000
未払解約金	-	227,435
未払受託者報酬	117,384	155,725
未払委託者報酬	1,320,447	1,751,861
その他未払費用	8,747	11,618
流動負債合計	2,666,578	4,106,639
負債合計	2,666,578	4,106,639
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	530,467,204	599,859,697
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	75,289,620	192,558,780
元本等合計	605,756,824	792,418,477
純資産合計	605,756,824	792,418,477
負債純資産合計	608,423,402	796,525,116

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第12期		第13期	
	自	平成23年12月21日 至 平成24年12月20日	自	平成24年12月21日 至 平成25年12月20日
<b>営業収益</b>				
受取利息		1,288		1,418
有価証券売買等損益		51,196,468		103,249,601
営業収益合計		51,197,756		103,251,019
<b>営業費用</b>				
受託者報酬		227,626		297,183
委託者報酬		2,560,601		3,343,177
その他費用		16,955		22,167
営業費用合計		2,805,182		3,662,527
営業利益		48,392,574		99,588,492
経常利益		48,392,574		99,588,492
当期純利益		48,392,574		99,588,492
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		1,366,839		5,616,493
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		22,410,450		75,289,620
剰余金増加額又は欠損金減少額		7,614,759		31,680,836
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		7,614,759		31,680,836
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,761,324		8,383,675
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,761,324		8,383,675
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		75,289,620		192,558,780

( 3 ) 【注記表】  
( 重要な会計方針の注記 )

項 目	第13期 自 平成24年12月21日 至 平成25年12月20日	
	有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

( 貸借対照表に関する注記 )

項 目	第12期 ( 平成24年12月20日現在 )	第13期 ( 平成25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 530,467,204口
2. 1 単位当たり純資産額	1.1419円 ( 1 万口 = 11,419円 )	1.3210円 ( 1 万口 = 13,210円 )

( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項 目	第12期 自 平成23年12月21日 至 平成24年12月20日	第13期 自 平成24年12月21日 至 平成25年12月20日
	分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（1,284円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（8,164,646円）、収益調整金（112,916,188円）、および分配準備積立金（12,611,244円）より、分配対象収益は133,693,362円（1万口当たり2,520.29円）ですが、分配を行っておりません。</p>

## （金融商品に関する注記）

## ・金融商品の状況に関する事項

項 目	第13期 自 平成24年12月21日 至 平成25年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>



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

・金融商品の時価等に関する事項

項 目	第13期 (平成25年12月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載してあります。 (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」に記載してあります。 (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あります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第12期(自平成23年12月21日 至平成24年12月20日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	47,935,838円
合 計	47,935,838円

第13期(自平成24年12月21日 至平成25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	86,224,208円
合 計	86,224,208円

(デリバティブ取引に関する注記)

第12期(平成24年12月20日現在)

該当事項はありません。

第13期(平成25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12期(自平成23年12月21日 至平成24年12月20日)

該当事項はありません。

第13期(自平成24年12月21日 至平成25年12月20日)

該当事項はありません。

(その他の注記)

項目	第12期 (平成24年12月20日現在)	第13期 (平成25年12月20日現在)
期首元本額	480,944,044円	530,467,204円
期中追加設定元本額	85,709,743円	124,684,453円
期中一部解約元本額	36,186,583円	55,291,960円

## (4) 【附属明細表】

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託 受益証券	S M A M ・ 国内株式パッシブ・ ファンド(適格機関投資家専用)	96,176,014	111,958,497	
	S M A M ・ 外国株式パッシブ・ ファンド(適格機関投資家専用)	45,711,597	79,935,869	
	S M A M ・ 年金外国債券パッシ ブ・ファンド<適格機関投資家限 定>	70,187,891	110,075,669	
	S M A M ・ 年金国内債券パッシブ ファンド<適格機関投資家限定>	382,919,301	454,869,837	
	S M A M ・ マネーインカムファン ド<適格機関投資家限定>	30,730,043	30,985,102	
	投資信託受益証券 小計	625,724,846	787,824,974	
合計			787,824,974	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第12期 (平成24年12月20日現在)	第13期 (平成25年12月20日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	4,953,818	3,942,574
投資信託受益証券	365,494,560	539,715,089
未収利息	6	3
流動資産合計	370,448,384	543,657,666
資産合計	370,448,384	543,657,666
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金	2,270,000	1,020,000
未払受託者報酬	68,914	104,844
未払委託者報酬	775,278	1,179,409
その他未払費用	5,109	7,806
流動負債合計	3,119,301	2,312,059
負債合計	3,119,301	2,312,059
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	341,180,499	402,636,309
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	26,148,584	138,709,298
元本等合計	367,329,083	541,345,607
純資産合計	367,329,083	541,345,607
負債純資産合計	370,448,384	543,657,666

## （ 2 ） 【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第12期		第13期	
	自	平成23年12月21日 至 平成24年12月20日	自	平成24年12月21日 至 平成25年12月20日
営業収益				
受取利息		725		1,088
有価証券売買等損益		40,793,945		100,080,562
営業収益合計		40,794,670		100,081,650
営業費用				
受託者報酬		131,406		193,887
委託者報酬		1,478,276		2,181,058
その他費用		9,727		14,429
営業費用合計		1,619,409		2,389,374
営業利益		39,175,261		97,692,276
経常利益		39,175,261		97,692,276
当期純利益		39,175,261		97,692,276
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		603,814		6,158,323
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		13,599,545		26,148,584
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,176,682		24,529,750
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		454,678		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		722,004		24,529,750
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		3,502,989
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		3,502,989
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		26,148,584		138,709,298

( 3 ) 【注記表】  
( 重要な会計方針の注記 )

項 目	第13期 自 平成24年12月21日 至 平成25年12月20日	
	有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

( 貸借対照表に関する注記 )

項 目	第12期 ( 平成24年12月20日現在 )	第13期 ( 平成25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 341,180,499口
2. 1単位当たり純資産額	1.0766円 ( 1万口 = 10,766円 )	1.3445円 ( 1万口 = 13,445円 )

( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項 目	第12期 自 平成23年12月21日 至 平成24年12月20日	第13期 自 平成24年12月21日 至 平成25年12月20日
	分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（725円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（100,534,919円）、および分配準備積立金（10,349,639円）より、分配対象収益は110,885,283円（1万口当たり3,250.04円）ですが、分配を行っておりません。</p>

## （金融商品に関する注記）

## ．金融商品の状況に関する事項

項 目	第13期 自 平成24年12月21日 至 平成25年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項 目	第13期 (平成25年12月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載してあります。 (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」に記載してあります。 (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あります。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第12期(自平成23年12月21日 至平成24年12月20日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	39,283,652円
合 計	39,283,652円

第13期(自平成24年12月21日 至平成25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	85,857,965円
合 計	85,857,965円

(デリバティブ取引に関する注記)

第12期(平成24年12月20日現在)

該当事項はありません。

第13期(平成25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12期(自平成23年12月21日 至平成24年12月20日)

該当事項はありません。

第13期(自平成24年12月21日 至平成25年12月20日)

該当事項はありません。

(その他の注記)

項目	第12期 (平成24年12月20日現在)	第13期 (平成25年12月20日現在)
期首元本額	286,603,183円	341,180,499円
期中追加設定元本額	65,335,257円	97,849,986円
期中一部解約元本額	10,757,941円	36,394,176円

## (4) 【附属明細表】

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託 受益証券	S M A M ・ 国内株式パッシブ・ファン ド(適格機関投資家専用)	135,762,547	158,041,180	
	S M A M ・ 外国株式パッシブ・ファン ド(適格機関投資家専用)	46,893,399	82,002,486	
	S M A M ・ 年金外国債券パッシブ・ ファンド<適格機関投資家限定>	38,068,787	59,703,278	
	S M A M ・ 年金国内債券パッシブ ファンド<適格機関投資家限定>	193,261,477	229,575,308	
	S M A M ・ マネーインカムファンド <適格機関投資家限定>	10,307,287	10,392,837	
	投資信託受益証券 小計	424,293,497	539,715,089	
	合計		539,715,089	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。



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

(単位:円)

	第12期 (平成24年12月20日現在)	第13期 (平成25年12月20日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	3,091,847	2,407,691
投資信託受益証券	286,976,450	445,635,441
未収入金	-	1,020,000
未収利息	4	1
流動資産合計	290,068,301	449,063,133
資産合計	290,068,301	449,063,133
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金	1,000,000	1,170,000
未払解約金	738,071	995,550
未払受託者報酬	54,429	85,631
未払委託者報酬	612,203	963,256
その他未払費用	4,019	6,356
流動負債合計	2,408,722	3,220,793
負債合計	2,408,722	3,220,793
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	286,580,741	329,245,529
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	1,078,838	116,596,811
元本等合計	287,659,579	445,842,340
純資産合計	287,659,579	445,842,340
負債純資産合計	290,068,301	449,063,133

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第12期		第13期	
	自	平成23年12月21日 至 平成24年12月20日	自	平成24年12月21日 至 平成25年12月20日
<b>営業収益</b>				
受取利息		512		777
有価証券売買等損益		41,924,506		108,595,281
営業収益合計		41,925,018		108,596,058
<b>営業費用</b>				
受託者報酬		106,882		158,151
委託者報酬		1,202,254		1,779,047
その他費用		7,890		11,736
営業費用合計		1,317,026		1,948,934
営業利益		40,607,992		106,647,124
経常利益		40,607,992		106,647,124
当期純利益		40,607,992		106,647,124
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額		1,912,845		8,368,880
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		37,951,103		1,078,838
剰余金増加額又は欠損金減少額		4,225,404		18,296,312
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		4,225,404		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		18,296,312
剰余金減少額又は欠損金増加額		3,890,610		1,056,583
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		1,056,583
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		3,890,610		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,078,838		116,596,811

## ( 3 ) 【注記表】

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	第13期 自 平成24年12月21日 至 平成25年12月20日	
	有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

## ( 貸借対照表に関する注記 )

項 目	第12期 (平成24年12月20日現在)	第13期 (平成25年12月20日現在)
	1. 受益権総数	当計算期間の末日における受益権の総数 286,580,741口
2. 1単位当たり純資産額	1.0038円 (1万口 = 10,038円)	1.3541円 (1万口 = 13,541円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項 目	第12期 自 平成23年12月21日 至 平成24年12月20日	第13期 自 平成24年12月21日 至 平成25年12月20日
	分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（508円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（86,569,289円）、および分配準備積立金（7,513,734円）より、分配対象収益は94,083,531円（1万口当たり3,282.96円）であります。が、分配を行っておりません。</p>

## （金融商品に関する注記）

## ．金融商品の状況に関する事項

項 目	第13期 自 平成24年12月21日 至 平成25年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項 目	第13期 (平成25年12月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第12期(自平成23年12月21日 至平成24年12月20日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	39,881,123円
合 計	39,881,123円

第13期(自平成24年12月21日 至平成25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	96,228,580円
合 計	96,228,580円

(デリバティブ取引に関する注記)

第12期(平成24年12月20日現在)

該当事項はありません。

第13期(平成25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12期(自平成23年12月21日 至平成24年12月20日)

該当事項はありません。

第13期(自平成24年12月21日 至平成25年12月20日)

該当事項はありません。

(その他の注記)

項目	第12期 (平成24年12月20日現在)	第13期 (平成25年12月20日現在)
期首元本額	268,375,847円	286,580,741円
期中追加設定元本額	48,930,836円	84,609,174円
期中一部解約元本額	30,725,942円	41,944,386円

## (4) 【附属明細表】

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託 受益証券	S M A M ・ 国内株式パッシブ・ファン ド(適格機関投資家専用)	173,465,683	201,931,401	
	S M A M ・ 外国株式パッシブ・ファン ド(適格機関投資家専用)	49,093,241	85,849,350	
	S M A M ・ 年金外国債券パッシブ・ ファンド<適格機関投資家限定>	28,109,972	44,084,869	
	S M A M ・ 年金国内債券パッシブ ファンド<適格機関投資家限定>	88,462,083	105,084,108	
	S M A M ・ マネーインカムファンド <適格機関投資家限定>	8,614,216	8,685,713	
	投資信託受益証券 小計	347,745,195	445,635,441	
合計			445,635,441	

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

## 参考情報

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

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

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

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

[「S M A M ・ マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>」の状況](#)

## (参考情報)

「三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010」、「三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2020」、「三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2030」および「三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2040」は、「SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)」、「SMAM・年金国内債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>」、「SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)」、「SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>」および「SMAM・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>」投資信託受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」はこれらの投資信託の受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

## 「SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)」の状況

## (1) 貸借対照表

		(単位:円)
		(平成25年12月19日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		4
親投資信託受益証券		70,468,395,347
流動資産合計		70,468,395,351
資産合計		70,468,395,351
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		1,365,191
未払委託者報酬		1,194,539
その他未払費用		28,322
流動負債合計		2,588,052
負債合計		2,588,052
純資産の部		
元本等		
元本		60,530,799,244
剰余金		
剰余金又は欠損金( )		9,935,008,055
元本等合計		70,465,807,299
純資産合計		70,465,807,299
負債純資産合計		70,468,395,351

## (2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 平成25年12月 3日 至 平成25年12月19日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(平成25年12月19日現在)
1. 受益権総数	平成25年12月19日における受益権の総数 60,530,799,244口
2. 1単位当たり純資産額	1.1641円 (1万口 = 11,641円)

## (金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成25年12月 3日 至 平成25年12月19日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>



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

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成25年12月19日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（デリバティブ取引に関する注記）

（平成25年12月19日現在）  
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

（自平成25年12月3日 至平成25年12月19日）  
該当事項はありません。

（その他の注記）

（平成25年12月19日現在）	
期首（平成25年12月 3日）における元本額	61,759,775,625円
期首より平成25年12月19日現在までの追加設定元本額	4,488,101円
期首より平成25年12月19日現在までの一部解約元本額	1,233,464,482円

（3）附属明細表  
有価証券明細表

(a) 株式  
該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託 受益証券	国内株式インデックス・マザー ファンド（B号）	39,814,902,168	70,468,395,347	
	親投資信託受益証券 小計	39,814,902,168	70,468,395,347	
合計			70,468,395,347	

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

## (参考情報)

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

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

## 「国内株式インデックス・マザーファンド(B号)」の状況

## (1) 貸借対照表

(単位:円)	
(平成25年12月19日現在)	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,799,419,380
株式	314,315,115,160
派生商品評価勘定	13,007,950
未収入金	255,800
未収配当金	23,571,280
未収利息	2,300
差入委託証拠金	14,360,000
流動資産合計	317,165,731,870
資産合計	317,165,731,870
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	36,050
前受金	13,205,000
未払解約金	46,641,439
流動負債合計	59,882,489
負債合計	59,882,489
純資産の部	
元本等	
元本	179,170,543,338
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	137,935,306,043
元本等合計	317,105,849,381
純資産合計	317,105,849,381
負債純資産合計	317,165,731,870

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項 目	自 平成25年12月 3日 至 平成25年12月19日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

項 目	(平成25年12月19日現在)				
1. 担保資産	<p>代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <table style="width: 100%; border: none;"> <tr> <td style="text-align: center;"><u>担保資産</u></td> <td style="text-align: center;"><u>金額</u></td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">株式</td> <td style="text-align: right;">11,160,000,000円</td> </tr> </table>	<u>担保資産</u>	<u>金額</u>	株式	11,160,000,000円
<u>担保資産</u>	<u>金額</u>				
株式	11,160,000,000円				
2. 受益権総数	平成25年12月19日における受益権の総数 179,170,543,338口				
3. 1単位当たり純資産額	1.7699円 (1万口 = 17,699円)				

## （金融商品に関する注記）

## ．金融商品の状況に関する事項

項 目	自 平成25年12月 3日 至 平成25年12月19日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、先物取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っております。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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理由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。
----------------------------	--

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成25年12月19日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(株式) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成25年12月19日現在)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引  
株式関連

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	東証株価指数先物	2,783,118,100		2,796,090,000	12,971,900
	小計	2,783,118,100		2,796,090,000	12,971,900
合計		2,783,118,100		2,796,090,000	12,971,900

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については以下のように評価しております。

原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。

このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引  
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

(自平成25年12月3日 至平成25年12月19日)

該当事項はありません。

(その他の注記)

(平成25年12月19日現在)

開示対象ファンドの	
期首(平成25年12月3日)における当該親投資信託の元本額	180,811,975,262円
期首より平成25年12月19日現在までの追加設定元本額	352,746,404円
期首より平成25年12月19日現在までの一部解約元本額	1,994,178,328円
平成25年12月19日現在の元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,461,560,122円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	421,560,316円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,179,371,125円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,600,804,960円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	69,081,557円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	4,546,537円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	8,224,600円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	8,180,257円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	10,043,918円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	2,777,467円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	8,741,027円
国内株式指数ファンド(TOPIX)	1,193,814,084円
三井住友・DC日本株式インデックスファンドS	138,265,920円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	39,814,902,168円
バランスファンドVA(安定運用型) <適格機関投資家限定>	431,112,485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>	34,631,342,478円
SMAM・バランスファンドVA25 <適格機関投資家専用>	12,205,335,248円
SMAM・バランスファンドVA37.5 <適格機関投資家専用>	5,332,614,676円
SMAM・バランスファンドVA50 <適格機関投資家専用>	19,643,407,115円
SMAM・バランスファンドVL30 <適格機関投資家限定>	122,754,830円
SMAM・バランスファンドVL50 <適格機関投資家限定>	430,654,491円
世界6資産バランスファンドVA <適格機関投資家限定>	57,560,620円
SMAM・バランスファンドVA75 <適格機関投資家専用>	2,098,599,887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>	107,552,550円
SMAM・インデックス・バランスVA25 <適格機関投資家専用>	709,155,790円
SMAM・インデックス・バランスVA50 <適格機関投資家専用>	2,273,832,406円
SMAM・バランスファンドVA40 <適格機関投資家専用>	3,869,670,343円
SMAM・バランスファンドVA35 <適格機関投資家専用>	7,209,722,904円
SMAM・バランスVA株40T <適格機関投資家限定>	805,876,122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)	6,239,487,076円
SMAM・グローバルバランス40VA <適格機関投資家限定>	142,231,814円
SMAM・バランスファンドVA20 <適格機関投資家専用>	1,203,825,216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)	21,451,531,218円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A <適格機関投資家専用>	207,645,648円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A <適格機関投資家専用>	106,481,847円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A <適格機関投資家専用>	43,385,880円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L <適格機関投資家専用>	493,343,254円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L <適格機関投資家専用>	880,563,654円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T <適格機関投資家専用>	360,298,261円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2 <適格機関投資家専用>	239,285,415円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2 <適格機関投資家専用>	122,393,423円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2 <適格機関投資家専用>	19,576,711円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2 <適格機関投資家専用>	216,656,393円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2 <適格機関投資家専用>	2,141,397,213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)	372,138,727円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2 <適格機関投資家専用>	74,139,225円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA <適格機関投資家限定>	1,253,973円
SMAM・FGグローバルバランス25VA <適格機関投資家限定>	3,842,387円
合計	179,170,543,338円

(3) 附属明細表  
有価証券明細表

## (a) 株式

(単位：円)

銘柄	株数	評価額 単価	評価額 金額	備考
極洋	87,000	262.00	22,794,000	
日本水産	246,600	235.00	57,951,000	
マルハニチロホールディングス	381,000	189.00	72,009,000	
サカタのタネ	26,700	1,310.00	34,977,000	
ホクト	21,200	1,920.00	40,704,000	
住石ホールディングス	69,400	133.00	9,230,200	
日鉄鉱業	49,000	485.00	23,765,000	
三井松島産業	131,000	154.00	20,174,000	
国際石油開発帝石	957,700	1,290.00	1,235,433,000	
日本海洋掘削	5,100	6,100.00	31,110,000	
関東天然瓦斯開発	21,000	727.00	15,267,000	
石油資源開発	27,600	3,845.00	106,122,000	
ショーボンドホールディングス	17,300	4,520.00	78,196,000	
ミライト・ホールディングス	56,100	889.00	49,872,900	
タマホーム	9,100	952.00	8,663,200	
安藤・間	128,800	323.00	41,602,400	
東急建設	72,400	454.00	32,869,600	
コムシスホールディングス	95,800	1,605.00	153,759,000	
ミサワホーム	21,400	1,583.00	33,876,200	
高松コンストラクショングループ	14,800	1,748.00	25,870,400	
東建コーポレーション	7,420	4,935.00	36,617,700	
ヤマウラ	12,400	285.00	3,534,000	
大成建設	997,000	446.00	444,662,000	
大林組	591,000	545.00	322,095,000	
清水建設	602,000	505.00	304,010,000	
長谷工コーポレーション	265,200	756.00	200,491,200	
松井建設	25,000	404.00	10,100,000	
銭高組	28,000	255.00	7,140,000	
鹿島建設	868,000	373.00	323,764,000	
不動テトラ	145,800	167.00	24,348,600	
鉄建建設	124,000	283.00	35,092,000	
日鉄住金テックスエンジ	34,000	419.00	14,246,000	
西松建設	261,000	302.00	78,822,000	
三井住友建設	543,200	115.00	62,468,000	
大豊建設	57,000	318.00	18,126,000	
前田建設工業	122,000	633.00	77,226,000	
佐田建設	75,000	128.00	9,600,000	
ナカノフドー建設	22,100	228.00	5,038,800	
奥村組	175,000	464.00	81,200,000	
東鉄工業	23,600	1,785.00	42,126,000	
戸田建設	233,000	342.00	79,686,000	
熊谷組	157,000	257.00	40,349,000	
青木あすなろ建設	12,900	577.00	7,443,300	
北野建設	45,000	227.00	10,215,000	
植木組	30,000	205.00	6,150,000	



三井ホーム	26,000	496.00	12,896,000
矢作建設工業	28,200	883.00	24,900,600
ピーエス三菱	18,100	441.00	7,982,100
大東建託	75,100	9,500.00	713,450,000
新日本建設	25,100	312.00	7,831,200
NIPPO	45,000	1,594.00	71,730,000
東亜道路工業	37,000	491.00	18,167,000
前田道路	62,000	1,644.00	101,928,000
日本道路	50,000	543.00	27,150,000
東亜建設工業	176,000	218.00	38,368,000
若築建設	117,000	122.00	14,274,000
東洋建設	63,900	329.00	21,023,100
五洋建設	234,500	329.00	77,150,500
大林道路	24,000	524.00	12,576,000
世紀東急工業	112,000	129.00	14,448,000
福田組	32,000	468.00	14,976,000
住友林業	136,100	1,214.00	165,225,400
日本基礎技術	24,900	341.00	8,490,900
日成ビルド工業	55,000	234.00	12,870,000
ヤマダ・エスバイエルホーム	103,000	134.00	13,802,000
巴コーポレーション	27,500	469.00	12,897,500
パナホーム	73,000	746.00	54,458,000
大和ハウス工業	542,000	1,987.00	1,076,954,000
ライト工業	41,000	710.00	29,110,000
積水ハウス	519,000	1,430.00	742,170,000
日特建設	27,700	378.00	10,470,600
北陸電気工事	13,000	401.00	5,213,000
ユアテック	31,000	332.00	10,292,000
西部電気工業	16,000	435.00	6,960,000
四電工	17,000	352.00	5,984,000
中電工	28,700	1,823.00	52,320,100
関電工	89,000	553.00	49,217,000
きんでん	132,000	1,049.00	138,468,000
東京エネシス	22,000	521.00	11,462,000
トーエネック	29,000	634.00	18,386,000
住友電設	14,100	1,539.00	21,699,900
日本電設工業	32,000	1,379.00	44,128,000
協和エクシオ	77,400	1,343.00	103,948,200
新日本空調	18,500	620.00	11,470,000
NDS	29,000	283.00	8,207,000
九電工	36,000	675.00	24,300,000
三機工業	41,000	644.00	26,404,000
日揮	198,000	3,920.00	776,160,000
中外炉工業	66,000	259.00	17,094,000
ヤマト	22,000	342.00	7,524,000
太平電業	30,000	641.00	19,230,000
高砂熱学工業	54,600	850.00	46,410,000
三晃金属工業	29,000	249.00	7,221,000
朝日工業社	26,000	370.00	9,620,000
明星工業	21,000	405.00	8,505,000
大気社	26,500	2,229.00	59,068,500
ダイダン	27,000	547.00	14,769,000
日比谷総合設備	24,100	1,199.00	28,895,900
東芝プラントシステム	33,000	1,478.00	48,774,000

東洋エンジニアリング	107,000	389.00	41,623,000
千代田化工建設	157,000	1,446.00	227,022,000
新興プランテック	41,000	751.00	30,791,000
日本製粉	117,000	506.00	59,202,000
日清製粉グループ本社	195,600	1,086.00	212,421,600
日東富士製粉	17,000	309.00	5,253,000
昭和産業	75,000	309.00	23,175,000
鳥越製粉	16,500	696.00	11,484,000
協同飼料	87,000	111.00	9,657,000
中部飼料	19,400	562.00	10,902,800
日本配合飼料	79,000	119.00	9,401,000
東洋精糖	55,000	102.00	5,610,000
日本甜菜製糖	101,000	181.00	18,281,000
三井製糖	80,000	392.00	31,360,000
森永製菓	188,000	209.00	39,292,000
中村屋	44,000	388.00	17,072,000
江崎グリコ	73,000	1,171.00	85,483,000
名糖産業	9,600	1,025.00	9,840,000
不二家	116,000	203.00	23,548,000
山崎製パン	145,000	1,077.00	156,165,000
モロゾフ	38,000	311.00	11,818,000
亀田製菓	11,500	2,745.00	31,567,500
カルビー	72,000	2,513.00	180,936,000
森永乳業	169,000	304.00	51,376,000
ヤクルト本社	115,700	5,140.00	594,698,000
明治ホールディングス	58,200	6,750.00	392,850,000
雪印メグミルク	43,000	1,284.00	55,212,000
プリマハム	106,000	194.00	20,564,000
日本ハム	138,000	1,760.00	242,880,000
伊藤ハム	104,000	458.00	47,632,000
林兼産業	92,000	82.00	7,544,000
丸大食品	81,000	301.00	24,381,000
米久	8,000	799.00	6,392,000
S Foods	13,500	993.00	13,405,500
サッポロホールディングス	326,000	457.00	148,982,000
アサヒグループホールディングス	396,900	2,967.00	1,177,602,300
キリンホールディングス	845,000	1,504.00	1,270,880,000
宝ホールディングス	156,000	978.00	152,568,000
オエノンホールディングス	58,000	250.00	14,500,000
養命酒製造	16,000	805.00	12,880,000
コカ・コーラウエスト	61,200	2,199.00	134,578,800
コカ・コーライーストジャパン	40,700	2,014.00	81,969,800
サントリー食品インターナショナル	101,900	3,440.00	350,536,000
ダイドードリンコ	8,700	4,275.00	37,192,500
伊藤園	53,900	2,173.00	117,124,700
キーコーヒー	16,300	1,564.00	25,493,200
日清オイリオグループ	81,000	327.00	26,487,000
不二製油	48,500	1,607.00	77,939,500
J-オイルミルズ	85,000	275.00	23,375,000
キッコーマン	161,000	1,992.00	320,712,000
味の素	470,000	1,506.00	707,820,000
キューピー	99,700	1,439.00	143,468,300
ハウス食品グループ本社	67,100	1,563.00	104,877,300

カゴメ	75,600	1,688.00	127,612,800
焼津水産化学工業	9,700	875.00	8,487,500
アリアケジャパン	18,000	2,531.00	45,558,000
ニチレイ	213,000	527.00	112,251,000
東洋水産	98,000	3,050.00	298,900,000
日清食品ホールディングス	76,500	4,265.00	326,272,500
永谷園	21,000	891.00	18,711,000
フジッコ	18,000	1,173.00	21,114,000
ロック・フィールド	9,600	1,851.00	17,769,600
日本たばこ産業	1,093,600	3,475.00	3,800,260,000
ケンコーマヨネーズ	7,200	875.00	6,300,000
わらべや日洋	12,000	1,835.00	22,020,000
なとり	10,000	997.00	9,970,000
ミヨシ油脂	82,000	157.00	12,874,000
片倉工業	22,100	1,144.00	25,282,400
グンゼ	140,000	254.00	35,560,000
東洋紡	787,000	190.00	149,530,000
ユニチカ	539,000	62.00	33,418,000
富士紡ホールディングス	104,000	207.00	21,528,000
日清紡ホールディングス	117,000	974.00	113,958,000
倉敷紡績	178,000	179.00	31,862,000
シキボウ	120,000	132.00	15,840,000
日本毛織	58,000	725.00	42,050,000
トーア紡コーポレーション	105,000	79.00	8,295,000
ダイドーリミテッド	23,600	641.00	15,127,600
帝国繊維	19,600	1,081.00	21,187,600
帝人	757,000	229.00	173,353,000
東レ	1,339,000	728.00	974,792,000
サカイオーベックス	63,000	173.00	10,899,000
住江織物	55,000	284.00	15,620,000
イチカワ	21,000	294.00	6,174,000
日本バイリーン	27,000	580.00	15,660,000
芦森工業	55,000	132.00	7,260,000
アツギ	162,000	118.00	19,116,000
ダイニック	42,000	178.00	7,476,000
セーレン	50,700	772.00	39,140,400
小松精練	34,000	557.00	18,938,000
ワコールホールディングス	108,000	1,051.00	113,508,000
ホギメディカル	11,700	5,240.00	61,308,000
レナウン	56,000	134.00	7,504,000
T S Iホールディングス	90,700	641.00	58,138,700
三陽商会	99,000	291.00	28,809,000
ナイガイ	82,000	103.00	8,446,000
オンワードホールディングス	124,000	780.00	96,720,000
ルック	38,000	282.00	10,716,000
ゴールドウイン	44,000	460.00	20,240,000
デサント	42,000	693.00	29,106,000
特種東海製紙	104,000	205.00	21,320,000
王子ホールディングス	813,000	502.00	408,126,000
日本製紙	94,500	1,962.00	185,409,000
三菱製紙	268,000	88.00	23,584,000
北越紀州製紙	127,000	481.00	61,087,000
中越パルプ工業	74,000	198.00	14,652,000
巴川製紙所	38,000	192.00	7,296,000

大王製紙	64,000	910.00	58,240,000
レンゴー	149,000	594.00	88,506,000
トーモク	58,000	333.00	19,314,000
ザ・パック	12,900	1,907.00	24,600,300
クラレ	292,700	1,217.00	356,215,900
旭化成	1,148,000	805.00	924,140,000
コープケミカル	31,000	140.00	4,340,000
昭和電工	1,230,000	149.00	183,270,000
住友化学	1,358,000	417.00	566,286,000
日本化成	50,000	141.00	7,050,000
住友精化	40,000	822.00	32,880,000
日産化学工業	126,300	1,633.00	206,247,900
ラサ工業	78,000	170.00	13,260,000
クレハ	129,000	495.00	63,855,000
テイカ	36,000	292.00	10,512,000
石原産業	342,000	112.00	38,304,000
片倉チッカリン	17,000	263.00	4,471,000
日本曹達	118,000	668.00	78,824,000
東ソー	494,000	463.00	228,722,000
トクヤマ	290,000	381.00	110,490,000
セントラル硝子	175,000	338.00	59,150,000
東亜合成	214,000	433.00	92,662,000
ダイソー	72,000	337.00	24,264,000
関東電化工業	52,000	245.00	12,740,000
電気化学工業	369,000	430.00	158,670,000
信越化学工業	330,600	6,040.00	1,996,824,000
日本カーバイド工業	58,000	303.00	17,574,000
堺化学工業	73,000	315.00	22,995,000
エア・ウォーター	152,000	1,384.00	210,368,000
大陽日酸	238,000	663.00	157,794,000
日本化学工業	81,000	137.00	11,097,000
日本パーカライジング	44,000	2,089.00	91,916,000
高圧ガス工業	29,000	585.00	16,965,000
チタン工業	27,000	248.00	6,696,000
四国化成工業	27,000	776.00	20,952,000
戸田工業	39,000	287.00	11,193,000
ステラ ケミファ	10,500	1,554.00	16,317,000
保土谷化学工業	60,000	207.00	12,420,000
日本触媒	156,000	1,120.00	174,720,000
大日精化工業	68,000	461.00	31,348,000
カネカ	228,000	668.00	152,304,000
三菱瓦斯化学	291,000	860.00	250,260,000
三井化学	839,000	262.00	219,818,000
J S R	169,200	1,904.00	322,156,800
東京応化工業	35,700	2,070.00	73,899,000
三菱ケミカルホールディングス	1,151,000	477.00	549,027,000
日本合成化学工業	37,000	902.00	33,374,000
ダイセル	239,000	789.00	188,571,000
住友ベークライト	144,000	364.00	52,416,000
積水化学工業	378,000	1,248.00	471,744,000
日本ゼオン	146,000	1,014.00	148,044,000
アイカ工業	51,300	1,992.00	102,189,600
宇部興産	931,000	207.00	192,717,000
積水樹脂	26,000	1,425.00	37,050,000

タキロン	46,000	413.00	18,998,000
旭有機材工業	64,000	217.00	13,888,000
日立化成	79,600	1,671.00	133,011,600
ニチバン	16,000	365.00	5,840,000
リケンテクノス	33,000	489.00	16,137,000
大倉工業	48,000	365.00	17,520,000
積水化成成品工業	54,000	272.00	14,688,000
群栄化学工業	53,000	470.00	24,910,000
タイガースポリマー	11,600	440.00	5,104,000
ミライアル	5,300	1,547.00	8,199,100
日本化薬	128,000	1,494.00	191,232,000
カーリットホールディングス	16,600	491.00	8,150,600
日本精化	14,500	637.00	9,236,500
A D E K A	79,200	1,068.00	84,585,600
日油	151,000	744.00	112,344,000
新日本理化	27,300	257.00	7,016,100
ハリマ化成グループ	16,800	453.00	7,610,400
花王	479,700	3,210.00	1,539,837,000
第一工業製薬	36,000	240.00	8,640,000
三洋化成工業	57,000	688.00	39,216,000
大日本塗料	116,000	168.00	19,488,000
日本ペイント	159,000	1,709.00	271,731,000
関西ペイント	223,000	1,520.00	338,960,000
中国塗料	54,000	524.00	28,296,000
日本特殊塗料	16,600	568.00	9,428,800
藤倉化成	25,000	537.00	13,425,000
太陽ホールディングス	14,900	3,210.00	47,829,000
D I C	657,000	303.00	199,071,000
サカタインクス	38,000	982.00	37,316,000
東洋インキS Cホールディングス	162,000	496.00	80,352,000
T & K T O K A	6,500	2,169.00	14,098,500
富士フィルムホールディングス	421,400	2,845.00	1,198,883,000
資生堂	328,700	1,632.00	536,438,400
ライオン	211,000	592.00	124,912,000
高砂香料工業	67,000	592.00	39,664,000
マンダム	18,200	3,200.00	58,240,000
ミルボン	11,640	3,810.00	44,348,400
ファンケル	41,200	1,072.00	44,166,400
コーセー	29,800	3,330.00	99,234,000
ドクターシーラボ	128	302,500.00	38,720,000
ポーラ・オルビスホールディングス	18,500	3,785.00	70,022,500
ノエビアホールディングス	11,200	1,894.00	21,212,800
エステー	10,900	987.00	10,758,300
コニシ	13,300	1,928.00	25,642,400
長谷川香料	22,400	1,447.00	32,412,800
小林製薬	30,100	5,610.00	168,861,000
荒川化学工業	16,400	915.00	15,006,000
メック	17,600	651.00	11,457,600
日本高純度化学	62	209,000.00	12,958,000
J C U	3,100	5,130.00	15,903,000
新田ゼラチン	12,900	921.00	11,880,900
アース製薬	12,400	3,795.00	47,058,000
イハラケミカル工業	28,000	752.00	21,056,000

北興化学工業	24,000	291.00	6,984,000
大成ラミック	4,800	2,510.00	12,048,000
クミアイ化学工業	39,000	708.00	27,612,000
日本農薬	43,000	1,425.00	61,275,000
アキレス	151,000	144.00	21,744,000
有沢製作所	33,300	594.00	19,780,200
日東電工	152,200	4,305.00	655,221,000
レック	5,600	1,234.00	6,910,400
きもと	14,800	905.00	13,394,000
藤森工業	15,900	2,543.00	40,433,700
前澤化成工業	11,800	1,038.00	12,248,400
J S P	12,000	1,561.00	18,732,000
エフピコ	9,100	7,270.00	66,157,000
天馬	14,500	1,402.00	20,329,000
信越ポリマー	37,400	375.00	14,025,000
東リ	51,000	207.00	10,557,000
ニフコ	41,400	2,678.00	110,869,200
日本バルカー工業	76,000	271.00	20,596,000
ユニ・チャーム	113,300	6,460.00	731,918,000
協和発酵キリン	220,000	1,154.00	253,880,000
武田薬品工業	690,800	5,070.00	3,502,356,000
アステラス製薬	424,700	6,110.00	2,594,917,000
大日本住友製薬	131,100	1,499.00	196,518,900
塩野義製薬	288,300	2,255.00	650,116,500
田辺三菱製薬	151,600	1,435.00	217,546,000
わかもと製薬	30,000	267.00	8,010,000
あすか製薬	24,000	757.00	18,168,000
日本新薬	42,000	1,956.00	82,152,000
中外製薬	183,300	2,306.00	422,689,800
科研製薬	67,000	1,520.00	101,840,000
エーザイ	227,100	3,990.00	906,129,000
ロート製薬	78,000	1,607.00	125,346,000
小野薬品工業	83,800	8,410.00	704,758,000
久光製薬	57,300	5,130.00	293,949,000
有機合成薬品工業	21,000	273.00	5,733,000
持田製薬	13,800	5,970.00	82,386,000
参天製薬	67,900	4,780.00	324,562,000
扶桑薬品工業	65,000	337.00	21,905,000
日本ケミファ	32,000	454.00	14,528,000
ツムラ	55,000	2,704.00	148,720,000
日医工	29,700	1,517.00	45,054,900
キッセイ薬品工業	34,200	2,321.00	79,378,200
生化学工業	38,900	1,244.00	48,391,600
栄研化学	14,800	1,874.00	27,735,200
鳥居薬品	12,200	2,986.00	36,429,200
東和薬品	9,500	4,230.00	40,185,000
沢井製薬	26,600	6,800.00	180,880,000
ゼリア新薬工業	29,800	2,105.00	62,729,000
第一三共	581,600	1,889.00	1,098,642,400
キョーリン製薬ホールディングス	48,800	2,172.00	105,993,600
大幸薬品	9,800	2,279.00	22,334,200
ダイト	8,000	1,406.00	11,248,000
大塚ホールディングス	366,300	2,929.00	1,072,892,700
大正製薬ホールディングス	44,200	7,090.00	313,378,000

日本コークス工業	162,900	131.00	21,339,900
昭和シェル石油	165,900	1,110.00	184,149,000
コスモ石油	516,000	197.00	101,652,000
ニチレキ	23,000	916.00	21,068,000
東燃ゼネラル石油	276,000	971.00	267,996,000
ユシロ化学工業	12,400	964.00	11,953,600
富士石油	48,800	323.00	15,762,400
MORESCO	5,300	1,718.00	9,105,400
出光興産	21,600	9,290.00	200,664,000
JXホールディングス	2,043,900	534.00	1,091,442,600
横浜ゴム	207,000	1,014.00	209,898,000
東洋ゴム工業	154,000	582.00	89,628,000
ブリヂストン	577,900	3,850.00	2,224,915,000
住友ゴム工業	144,800	1,455.00	210,684,000
オカモト	60,000	326.00	19,560,000
フコク	9,200	992.00	9,126,400
ニッタ	18,600	2,218.00	41,254,800
東海ゴム工業	34,000	994.00	33,796,000
三ツ星ベルト	48,000	583.00	27,984,000
バンドー化学	69,000	398.00	27,462,000
日東紡績	135,000	547.00	73,845,000
旭硝子	908,000	651.00	591,108,000
日本板硝子	899,000	127.00	114,173,000
石塚硝子	28,000	390.00	10,920,000
日本山村硝子	71,000	179.00	12,709,000
日本電気硝子	382,000	537.00	205,134,000
住友大阪セメント	351,000	387.00	135,837,000
太平洋セメント	1,083,000	391.00	423,453,000
デイ・シイ	21,000	618.00	12,978,000
日本ヒューム	18,000	914.00	16,452,000
日本コンクリート工業	32,000	471.00	15,072,000
三谷セキサン	10,000	1,327.00	13,270,000
ジャパンパイル	16,300	975.00	15,892,500
東海カーボン	174,000	360.00	62,640,000
日本カーボン	98,000	195.00	19,110,000
東洋炭素	10,000	2,006.00	20,060,000
ノリタケカンパニーリミテド	100,000	257.00	25,700,000
TOTO	271,000	1,601.00	433,871,000
日本碍子	233,000	1,893.00	441,069,000
日本特殊陶業	159,000	2,410.00	383,190,000
MARUWA	5,200	3,310.00	17,212,000
品川リフラクトリーズ	52,000	220.00	11,440,000
黒崎播磨	45,000	244.00	10,980,000
東京窯業	28,000	237.00	6,636,000
ニッカトー	9,300	403.00	3,747,900
フジインコーポレーテッド	16,000	1,268.00	20,288,000
エーアンドエーマテリアル	48,000	141.00	6,768,000
ニチアス	87,000	705.00	61,335,000
ニチハ	22,100	1,419.00	31,359,900
新日鐵住金	7,796,000	342.00	2,666,232,000
神戸製鋼所	2,556,000	174.00	444,744,000
合同製鐵	100,000	178.00	17,800,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	470,800	2,410.00	1,134,628,000

日新製鋼ホールディングス	78,900	1,264.00	99,729,600
東京製鐵	104,600	522.00	54,601,200
共英製鋼	17,300	1,896.00	32,800,800
大和工業	37,900	3,235.00	122,606,500
東京鐵鋼	41,000	377.00	15,457,000
大阪製鐵	9,400	1,802.00	16,938,800
淀川製鋼所	128,000	435.00	55,680,000
東洋鋼鈑	43,000	474.00	20,382,000
丸一鋼管	61,100	2,518.00	153,849,800
モリ工業	29,000	413.00	11,977,000
大同特殊鋼	308,000	529.00	162,932,000
日本高周波鋼業	88,000	102.00	8,976,000
日本冶金工業	148,000	333.00	49,284,000
山陽特殊製鋼	101,000	464.00	46,864,000
愛知製鋼	96,000	423.00	40,608,000
日立金属	165,000	1,448.00	238,920,000
日本金属	60,000	131.00	7,860,000
大平洋金属	129,000	367.00	47,343,000
日本電工	79,000	293.00	23,147,000
栗本鐵工所	95,000	239.00	22,705,000
日本鑄鉄管	20,000	226.00	4,520,000
三菱製鋼	113,000	247.00	27,911,000
日亜鋼業	26,000	399.00	10,374,000
日本精線	16,000	454.00	7,264,000
シンニッタン	20,700	403.00	8,342,100
新家工業	53,000	163.00	8,639,000
大紀アルミニウム工業所	34,000	263.00	8,942,000
日本軽金属ホールディングス	420,800	136.00	57,228,800
三井金属鉱業	474,000	309.00	146,466,000
東邦亜鉛	102,000	338.00	34,476,000
三菱マテリアル	1,151,000	369.00	424,719,000
住友金属鉱山	478,000	1,303.00	622,834,000
DOWAホールディングス	203,000	995.00	201,985,000
古河機械金属	314,000	198.00	62,172,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	20,900	1,723.00	36,010,700
東邦チタニウム	32,700	704.00	23,020,800
UACJ	232,000	354.00	82,128,000
古河電気工業	584,000	248.00	144,832,000
住友電気工業	695,400	1,728.00	1,201,651,200
フジクラ	297,000	481.00	142,857,000
昭和電線ホールディングス	246,000	99.00	24,354,000
タツタ電線	29,200	563.00	16,439,600
平河ヒューテック	5,400	787.00	4,249,800
リョービ	114,000	414.00	47,196,000
アサヒホールディングス	27,800	1,738.00	48,316,400
稲葉製作所	8,600	1,264.00	10,870,400
宮地エンジニアリンググループ	64,000	256.00	16,384,000
トーカロ	11,800	1,571.00	18,537,800
アルファC o	7,200	1,025.00	7,380,000
SUMCO	114,700	926.00	106,212,200
川田テクノロジーズ	4,000	2,604.00	10,416,000
東洋製罐グループホールディングス	130,200	2,168.00	282,273,600
ホッカンホールディングス	44,000	332.00	14,608,000



コロナ	9,700	1,124.00	10,902,800
横河ブリッジホールディングス	35,000	1,375.00	48,125,000
日本橋梁	48,600	177.00	8,602,200
駒井ハルテック	39,000	300.00	11,700,000
三和ホールディングス	157,000	668.00	104,876,000
文化シャッター	45,000	625.00	28,125,000
三協立山	24,000	2,059.00	49,416,000
LIxilグループ	256,800	2,820.00	724,176,000
日本フィルコン	17,500	442.00	7,735,000
ノーリツ	36,300	2,236.00	81,166,800
長府製作所	18,800	2,407.00	45,251,600
リンナイ	28,600	7,850.00	224,510,000
ダイニチ工業	10,600	796.00	8,437,600
日東精工	30,000	343.00	10,290,000
三洋工業	31,000	181.00	5,611,000
岡部	36,700	1,101.00	40,406,700
東プレ	36,200	1,528.00	55,313,600
高周波熱錬	26,400	833.00	21,991,200
東京製綱	136,000	160.00	21,760,000
パイオラックス	8,600	3,815.00	32,809,000
日本発條	147,000	1,140.00	167,580,000
中央発條	25,000	303.00	7,575,000
アドバネクス	54,000	123.00	6,642,000
三益半導体工業	16,900	870.00	14,703,000
アタカ大機	15,000	507.00	7,605,000
日本製鋼所	266,000	549.00	146,034,000
三浦工業	27,100	2,634.00	71,381,400
タクマ	58,000	891.00	51,678,000
ツガミ	59,000	601.00	35,459,000
オークマ	120,000	1,163.00	139,560,000
東芝機械	100,000	564.00	56,400,000
アマダ	281,000	919.00	258,239,000
アイダエンジニアリング	43,100	1,064.00	45,858,400
富士機械製造	56,400	870.00	49,068,000
牧野フライス製作所	92,000	856.00	78,752,000
オーエスジー	76,300	1,775.00	135,432,500
ダイジェット工業	32,000	150.00	4,800,000
旭ダイヤモンド工業	46,700	1,043.00	48,708,100
DMG森精機	97,500	1,790.00	174,525,000
ディスコ	20,500	6,830.00	140,015,000
日東工器	8,900	1,850.00	16,465,000
豊和工業	11,800	837.00	9,876,600
大阪機工	79,000	137.00	10,823,000
石川製作所	59,000	122.00	7,198,000
東洋機械金属	17,800	419.00	7,458,200
津田駒工業	53,000	165.00	8,745,000
エンシュウ	16,000	151.00	2,416,000
島精機製作所	24,200	1,878.00	45,447,600
日阪製作所	23,000	947.00	21,781,000
やまびこ	7,500	3,005.00	22,537,500
ベガサスミシン製造	20,600	374.00	7,704,400
ナブテスコ	84,100	2,398.00	201,671,800
三井海洋開発	15,300	2,959.00	45,272,700
レオン自動機	19,000	583.00	11,077,000

S M C	52,700	25,350.00	1,335,945,000
新川	17,200	622.00	10,698,400
ホソカワミクロン	31,000	648.00	20,088,000
ユニオンツール	8,000	2,316.00	18,528,000
オイレス工業	17,000	2,058.00	34,986,000
日精エー・エス・ビー機械	5,100	2,308.00	11,770,800
サトーホールディングス	19,100	2,394.00	45,725,400
日本エアテック	8,100	514.00	4,163,400
日精樹脂工業	15,400	601.00	9,255,400
ワイエイシイ	9,100	532.00	4,841,200
小松製作所	859,900	2,116.00	1,819,548,400
住友重機械工業	504,000	468.00	235,872,000
日立建機	93,900	2,204.00	206,955,600
日工	29,000	600.00	17,400,000
巴工業	6,500	1,610.00	10,465,000
井関農機	192,000	302.00	57,984,000
T O W A	17,800	467.00	8,312,600
丸山製作所	45,000	264.00	11,880,000
北川鉄工所	92,000	189.00	17,388,000
クボタ	963,000	1,725.00	1,661,175,000
荏原実業	5,200	1,387.00	7,212,400
三菱化工機	66,000	170.00	11,220,000
月島機械	30,000	1,058.00	31,740,000
帝国電機製作所	6,900	2,318.00	15,994,200
新東工業	43,000	761.00	32,723,000
澁谷工業	12,400	1,665.00	20,646,000
アイチ コーポレーション	28,900	460.00	13,294,000
小森コーポレーション	45,300	1,740.00	78,822,000
鶴見製作所	14,000	1,031.00	14,434,000
住友精密工業	32,000	428.00	13,696,000
酒井重工業	39,000	373.00	14,547,000
荏原製作所	408,000	651.00	265,608,000
石井鐵工所	33,000	302.00	9,966,000
西島製作所	20,300	970.00	19,691,000
ダイキン工業	240,400	6,470.00	1,555,388,000
オルガノ	27,000	457.00	12,339,000
トーヨーカネツ	101,000	288.00	29,088,000
栗田工業	110,500	2,126.00	234,923,000
椿本チエイン	92,000	779.00	71,668,000
大同工業	44,000	309.00	13,596,000
日本コンベヤ	65,000	139.00	9,035,000
木村化工機	20,200	475.00	9,595,000
アネスト岩田	33,000	664.00	21,912,000
ダイフク	74,500	1,293.00	96,328,500
加藤製作所	43,000	640.00	27,520,000
油研工業	42,000	223.00	9,366,000
タダノ	78,000	1,379.00	107,562,000
フジテック	51,000	1,287.00	65,637,000
C K D	49,300	1,059.00	52,208,700
キトー	11,300	1,863.00	21,051,900
平和	37,300	1,663.00	62,029,900
理想科学工業	13,200	2,071.00	27,337,200
S A N K Y O	53,200	4,800.00	255,360,000
日本金銭機械	16,800	1,976.00	33,196,800

マースエンジニアリング	9,700	1,921.00	18,633,700
福島工業	10,200	1,500.00	15,300,000
オーイズミ	7,300	1,115.00	8,139,500
ダイコク電機	7,800	2,036.00	15,880,800
アマノ	48,200	948.00	45,693,600
JUKI	35,000	227.00	7,945,000
サンデン	102,000	435.00	44,370,000
蛇の目ミシン工業	190,000	85.00	16,150,000
マックス	26,000	1,110.00	28,860,000
グローリー	52,200	2,657.00	138,695,400
新晃工業	11,700	750.00	8,775,000
大和冷機工業	27,000	694.00	18,738,000
セガサミーホールディングス	189,100	2,683.00	507,355,300
日本ピストンリング	77,000	190.00	14,630,000
リケン	68,000	437.00	29,716,000
T P R	19,500	1,670.00	32,565,000
ホシザキ電機	37,800	3,520.00	133,056,000
大豊工業	13,400	1,172.00	15,704,800
日本精工	391,000	1,231.00	481,321,000
NTN	409,000	461.00	188,549,000
ジェイテクト	186,800	1,781.00	332,690,800
不二越	165,000	571.00	94,215,000
日本トムソン	57,000	539.00	30,723,000
THK	110,100	2,496.00	274,809,600
ユーシン精機	8,300	2,066.00	17,147,800
前澤給装工業	5,900	1,256.00	7,410,400
イーグル工業	22,000	1,703.00	37,466,000
日本ピラー工業	20,000	694.00	13,880,000
キッツ	77,900	504.00	39,261,600
日立工機	42,900	741.00	31,788,900
マキタ	114,800	5,260.00	603,848,000
日立造船	130,400	781.00	101,842,400
三菱重工業	3,135,000	635.00	1,990,725,000
I H I	1,200,000	439.00	526,800,000
イビデン	107,700	1,926.00	207,430,200
コニカミノルタ	465,000	1,014.00	471,510,000
ブラザー工業	227,400	1,347.00	306,307,800
ミネベア	241,000	758.00	182,678,000
日立製作所	4,227,000	769.00	3,250,563,000
東芝	3,475,000	430.00	1,494,250,000
三菱電機	1,760,000	1,275.00	2,244,000,000
富士電機	488,000	474.00	231,312,000
東洋電機製造	41,000	308.00	12,628,000
安川電機	193,000	1,569.00	302,817,000
シンフォニアテクノロジー	113,000	163.00	18,419,000
明電舎	162,000	379.00	61,398,000
オリジン電気	30,000	315.00	9,450,000
山洋電気	28,000	631.00	17,668,000
デンヨー	17,200	1,369.00	23,546,800
東芝テック	110,000	672.00	73,920,000
芝浦メカトロニクス	39,000	237.00	9,243,000
マブチモーター	24,300	6,160.00	149,688,000
日本電産	95,300	9,790.00	932,987,000
東光高岳ホールディングス	9,900	1,825.00	18,067,500

ダイヘン	105,000	463.00	48,615,000
ヤーマン	3,500	1,273.00	4,455,500
JVCケンウッド	122,800	192.00	23,577,600
第一精工	8,200	1,212.00	9,938,400
日新電機	37,000	610.00	22,570,000
大崎電気工業	29,000	527.00	15,283,000
オムロン	198,600	4,500.00	893,700,000
日東工業	25,900	1,620.00	41,958,000
I D E C	22,900	851.00	19,487,900
ジーエス・ユアサ コーポレーション	341,000	594.00	202,554,000
サクサホールディングス	48,000	149.00	7,152,000
メルコホールディングス	9,100	1,300.00	11,830,000
日本電気	2,420,000	227.00	549,340,000
富士通	1,698,000	509.00	864,282,000
沖電気工業	686,000	241.00	165,326,000
岩崎通信機	97,000	96.00	9,312,000
電気興業	51,000	683.00	34,833,000
サンケン電気	95,000	700.00	66,500,000
ナカヨ通信機	17,000	333.00	5,661,000
アイホン	10,500	1,716.00	18,018,000
ルネサスエレクトロニクス	67,800	663.00	44,951,400
セイコーエプソン	120,600	2,743.00	330,805,800
ワコム	140,600	666.00	93,639,600
アルバック	30,500	1,391.00	42,425,500
アクセル	9,500	1,711.00	16,254,500
E I Z O	16,100	2,575.00	41,457,500
日本信号	43,200	800.00	34,560,000
京三製作所	42,000	331.00	13,902,000
能美防災	23,000	1,000.00	23,000,000
ホーチキ	14,000	566.00	7,924,000
日本無線	48,000	328.00	15,744,000
パナソニック	2,012,400	1,213.00	2,441,041,200
シャープ	1,218,000	331.00	403,158,000
アンリツ	102,600	1,082.00	111,013,200
富士通ゼネラル	42,000	1,093.00	45,906,000
日立国際電気	35,000	1,397.00	48,895,000
ソニー	965,500	1,820.00	1,757,210,000
T D K	106,200	4,900.00	520,380,000
帝国通信工業	46,000	169.00	7,774,000
ミツミ電機	68,000	886.00	60,248,000
タムラ製作所	74,000	282.00	20,868,000
アルプス電気	130,200	1,172.00	152,594,400
池上通信機	72,000	100.00	7,200,000
パイオニア	248,500	215.00	53,427,500
日本電波工業	17,100	870.00	14,877,000
日本トリム	3,900	7,710.00	30,069,000
ローランド ディー・ジー	7,700	3,290.00	25,333,000
フォスター電機	18,400	1,918.00	35,291,200
クラリオン	119,000	143.00	17,017,000
S M K	51,000	613.00	31,263,000
ヨコオ	17,100	517.00	8,840,700
東光	86,000	342.00	29,412,000
ティアック	122,000	79.00	9,638,000

ホシデン	50,000	545.00	27,250,000
ヒロセ電機	30,500	15,520.00	473,360,000
日本航空電子工業	46,000	1,297.00	59,662,000
TOA	19,700	938.00	18,478,600
古野電気	19,400	703.00	13,638,200
ユニデン	61,000	385.00	23,485,000
アルパイン	38,300	1,384.00	53,007,200
アイコム	8,900	2,417.00	21,511,300
リオン	5,800	1,522.00	8,827,600
船井電機	17,500	1,286.00	22,505,000
横河電機	191,100	1,556.00	297,351,600
新電元工業	56,000	603.00	33,768,000
アズビル	52,700	2,363.00	124,530,100
日本光電工業	37,600	3,540.00	133,104,000
チノー	35,000	214.00	7,490,000
共和電業	25,000	393.00	9,825,000
日本電子材料	10,100	360.00	3,636,000
堀場製作所	32,500	3,420.00	111,150,000
アドバンテスト	121,000	1,278.00	154,638,000
小野測器	23,000	442.00	10,166,000
エスペック	18,800	804.00	15,115,200
パナソニック デバイス S U N X	16,100	456.00	7,341,600
キーエンス	39,900	42,650.00	1,701,735,000
日置電機	8,900	1,368.00	12,175,200
シスメックス	73,600	6,150.00	452,640,000
メガチップス	16,300	1,538.00	25,069,400
O B A R A G R O U P	11,500	3,030.00	34,845,000
日本電産コパル電子	21,300	577.00	12,290,100
コーセル	25,200	1,205.00	30,366,000
日立メディコ	13,000	1,788.00	23,244,000
オブテックス	12,000	1,704.00	20,448,000
千代田インテグレ	8,300	1,833.00	15,213,900
レーザーテック	13,900	902.00	12,537,800
スタンレー電気	127,100	2,324.00	295,380,400
岩崎電気	71,000	208.00	14,768,000
ウシオ電機	107,000	1,374.00	147,018,000
ヘリオス テクノ ホールディング グ	19,300	391.00	7,546,300
日本セラミック	10,900	1,545.00	16,840,500
遠藤照明	7,600	2,007.00	15,253,200
日本デジタル研究所	13,500	1,350.00	18,225,000
古河電池	16,000	560.00	8,960,000
双信電機	10,700	367.00	3,926,900
山一電機	26,000	228.00	5,928,000
図研	13,900	772.00	10,730,800
日本電子	63,000	469.00	29,547,000
カシオ計算機	183,300	1,270.00	232,791,000
ファナック	196,400	18,680.00	3,668,752,000
日本シイエムケイ	44,500	282.00	12,549,000
エンプラス	6,700	7,250.00	48,575,000
大真空	28,000	380.00	10,640,000
ローム	93,000	4,525.00	420,825,000
浜松ホトニクス	68,500	4,075.00	279,137,500
三井ハイテック	24,800	721.00	17,880,800

新光電気工業	59,600	826.00	49,229,600	
京セラ	313,400	5,350.00	1,676,690,000	
太陽誘電	86,500	1,342.00	116,083,000	
村田製作所	184,700	9,060.00	1,673,382,000	
ユーシン	26,800	718.00	19,242,400	
双葉電子工業	32,100	1,299.00	41,697,900	
北陸電気工業	86,000	163.00	14,018,000	
ニチコン	56,100	1,013.00	56,829,300	
日本ケミコン	112,000	409.00	45,808,000	
K O A	21,400	1,061.00	22,705,400	
市光工業	51,000	163.00	8,313,000	
小糸製作所	96,000	1,920.00	184,320,000	
ミツバ	33,000	1,621.00	53,493,000	
スター精密	33,600	1,195.00	40,152,000	
大日本スクリーン製造	169,000	572.00	96,668,000	
キャノン電子	14,700	1,959.00	28,797,300	
キャノン	1,020,500	3,325.00	3,393,162,500	
リコー	530,000	1,085.00	575,050,000	
M U T O Hホールディングス	28,000	499.00	13,972,000	
東京エレクトロン	158,200	5,520.00	873,264,000	
トヨタ紡織	61,400	1,290.00	79,206,000	
鬼怒川ゴム工業	35,000	505.00	17,675,000	
ユニプレス	28,100	1,976.00	55,525,600	
豊田自動織機	158,800	4,460.00	708,248,000	
モリタホールディングス	31,000	854.00	26,474,000	
三櫻工業	22,900	710.00	16,259,000	
デンソー	434,800	5,220.00	2,269,656,000	
東海理化電機製作所	46,400	2,026.00	94,006,400	
三井造船	682,000	211.00	143,902,000	
佐世保重工業	142,000	111.00	15,762,000	
川崎重工業	1,372,000	424.00	581,728,000	
名村造船所	26,400	1,321.00	34,874,400	
日本車輛製造	65,000	487.00	31,655,000	
ニチユ三菱フォークリフト	23,000	681.00	15,663,000	
近畿車輛	34,000	283.00	9,622,000	
日産自動車	2,470,900	892.00	2,204,042,800	
いすゞ自動車	1,021,000	625.00	638,125,000	
トヨタ自動車	2,450,700	6,200.00	15,194,340,000	代用有価証券 で1,800,000 株 担保差入
日野自動車	219,000	1,561.00	341,859,000	
三菱自動車工業	407,500	1,060.00	431,950,000	
エフテック	7,400	1,567.00	11,595,800	
武蔵精密工業	19,100	2,229.00	42,573,900	
日産車体	85,000	1,466.00	124,610,000	
新明和工業	71,000	818.00	58,078,000	
極東開発工業	30,400	1,285.00	39,064,000	
日信工業	36,300	2,134.00	77,464,200	
トピー工業	145,000	192.00	27,840,000	
ティラド	72,000	270.00	19,440,000	
曙ブレーキ工業	83,900	447.00	37,503,300	
タチエス	25,700	1,424.00	36,596,800	
N O K	85,300	1,657.00	141,342,100	
フタバ産業	54,500	380.00	20,710,000	

カヤバ工業	147,000	522.00	76,734,000
シロキ工業	45,000	221.00	9,945,000
大同メタル工業	25,000	980.00	24,500,000
プレス工業	70,000	408.00	28,560,000
カルソニックカンセイ	121,000	541.00	65,461,000
太平洋工業	36,600	676.00	24,741,600
ケーヒン	40,700	1,585.00	64,509,500
河西工業	27,000	684.00	18,468,000
アイシン精機	160,600	4,150.00	666,490,000
富士機工	24,000	323.00	7,752,000
マツダ	2,626,000	491.00	1,289,366,000
ダイハツ工業	186,900	1,715.00	320,533,500
今仙電機製作所	12,900	1,398.00	18,034,200
本田技研工業	1,584,700	4,260.00	6,750,822,000
スズキ	368,200	2,766.00	1,018,441,200
富士重工業	598,400	2,896.00	1,732,966,400
ヤマハ発動機	267,600	1,558.00	416,920,800
ショーワ	41,800	1,620.00	67,716,000
T B K	21,000	551.00	11,571,000
エクセディ	21,500	3,070.00	66,005,000
豊田合成	56,400	2,404.00	135,585,600
愛三工業	22,000	969.00	21,318,000
ヨロズ	13,100	1,857.00	24,326,700
エフ・シー・シー	28,300	2,057.00	58,213,100
シマノ	76,000	8,980.00	682,480,000
タカタ	31,900	2,942.00	93,849,800
テイ・エス テック	37,000	3,460.00	128,020,000
テルモ	134,800	5,290.00	713,092,000
日機装	57,000	1,267.00	72,219,000
島津製作所	227,000	942.00	213,834,000
J M S	33,000	291.00	9,603,000
長野計器	13,500	689.00	9,301,500
ブイ・テクノロジー	43	275,000.00	11,825,000
東京計器	62,000	296.00	18,352,000
愛知時計電機	23,000	288.00	6,624,000
東京精密	31,900	2,196.00	70,052,400
マニー	5,200	3,545.00	18,434,000
ニコン	329,000	1,967.00	647,143,000
トプコン	47,500	1,539.00	73,102,500
オリンパス	262,700	3,320.00	872,164,000
理研計器	15,400	853.00	13,136,200
タムロン	13,000	2,442.00	31,746,000
H O Y A	427,800	2,878.00	1,231,208,400
ノーリツ鋼機	17,200	629.00	10,818,800
エー・アンド・デイ	18,400	627.00	11,536,800
シチズンホールディングス	218,100	861.00	187,784,100
リズム時計工業	79,000	136.00	10,744,000
大研医器	6,400	1,679.00	10,745,600
松風	7,700	859.00	6,614,300
セイコーホールディングス	115,000	511.00	58,765,000
ニプロ	95,400	915.00	87,291,000
パラマウントベッドホールディングス	16,800	3,255.00	54,684,000
前田工織	13,200	1,129.00	14,902,800

永大産業	24,000	517.00	12,408,000
ダンロップスポーツ	8,700	1,275.00	11,092,500
バンダイナムコホールディングス	194,500	2,159.00	419,925,500
共立印刷	38,900	273.00	10,619,700
フランスベッドホールディングス	112,000	197.00	22,064,000
パイロットコーポレーション	15,200	3,545.00	53,884,000
トッパン・フォームズ	30,500	911.00	27,785,500
フジシールインターナショナル	21,500	3,225.00	69,337,500
タカラトミー	58,800	466.00	27,400,800
廣済堂	19,800	529.00	10,474,200
アーク	56,000	288.00	16,128,000
プロネクサス	20,400	636.00	12,974,400
ホクシン	23,000	150.00	3,450,000
ウッドワン	35,000	303.00	10,605,000
大建工業	74,000	278.00	20,572,000
凸版印刷	493,000	815.00	401,795,000
大日本印刷	535,000	1,079.00	577,265,000
図書印刷	34,000	327.00	11,118,000
共同印刷	59,000	284.00	16,756,000
日本写真印刷	30,100	1,546.00	46,534,600
光村印刷	15,000	271.00	4,065,000
アシックス	175,500	1,682.00	295,191,000
ツツミ	8,800	2,357.00	20,741,600
ローランド	17,800	1,320.00	23,496,000
小松ウオール工業	6,700	2,023.00	13,554,100
ヤマハ	129,900	1,627.00	211,347,300
河合楽器製作所	70,000	189.00	13,230,000
クリナップ	19,100	871.00	16,636,100
ピジョン	29,100	4,830.00	140,553,000
キングジム	15,900	665.00	10,573,500
リンテック	41,800	1,855.00	77,539,000
イトーキ	38,600	599.00	23,121,400
任天堂	108,600	13,680.00	1,485,648,000
三菱鉛筆	14,600	2,342.00	34,193,200
タカラスタANDARD	70,000	766.00	53,620,000
コクヨ	86,900	777.00	67,521,300
ナカバヤシ	42,000	203.00	8,526,000
グローブライド	104,000	145.00	15,080,000
岡村製作所	69,000	875.00	60,375,000
美津濃	87,000	522.00	45,414,000
アデランス	21,000	1,142.00	23,982,000
東京電力	1,378,100	533.00	734,527,300
中部電力	583,800	1,307.00	763,026,600
関西電力	722,300	1,166.00	842,201,800
中国電力	245,400	1,601.00	392,885,400
北陸電力	175,300	1,353.00	237,180,900
東北電力	442,600	1,147.00	507,662,200
四国電力	160,700	1,520.00	244,264,000
九州電力	391,200	1,292.00	505,430,400
北海道電力	168,200	1,169.00	196,625,800
沖縄電力	12,500	3,320.00	41,500,000
電源開発	110,500	3,050.00	337,025,000
東京瓦斯	2,075,000	508.00	1,054,100,000
大阪瓦斯	1,833,000	415.00	760,695,000



東邦瓦斯	456,000	495.00	225,720,000
北海道瓦斯	52,000	270.00	14,040,000
西部瓦斯	212,000	244.00	51,728,000
静岡瓦斯	50,300	609.00	30,632,700
東武鉄道	997,000	497.00	495,509,000
相鉄ホールディングス	300,000	344.00	103,200,000
東京急行電鉄	1,034,000	663.00	685,542,000
京浜急行電鉄	453,000	840.00	380,520,000
小田急電鉄	562,000	921.00	517,602,000
京王電鉄	489,000	681.00	333,009,000
京成電鉄	263,000	954.00	250,902,000
富士急行	50,000	836.00	41,800,000
新京成電鉄	25,000	367.00	9,175,000
東日本旅客鉄道	323,800	8,330.00	2,697,254,000
西日本旅客鉄道	162,900	4,495.00	732,235,500
東海旅客鉄道	157,800	12,250.00	1,933,050,000
鴻池運輸	10,100	1,481.00	14,958,100
西日本鉄道	223,000	377.00	84,071,000
ハマキョウレックス	5,800	2,725.00	15,805,000
サカイ引越センター	3,200	3,195.00	10,224,000
近畿日本鉄道	1,773,000	360.00	638,280,000
阪急阪神ホールディングス	1,179,000	548.00	646,092,000
南海電気鉄道	363,000	362.00	131,406,000
京阪電気鉄道	369,000	387.00	142,803,000
神戸電鉄	48,000	307.00	14,736,000
名糖運輸	7,500	647.00	4,852,500
名古屋鉄道	610,000	296.00	180,560,000
山陽電気鉄道	66,000	403.00	26,598,000
日本通運	694,000	512.00	355,328,000
ヤマトホールディングス	327,300	2,153.00	704,676,900
山九	217,000	384.00	83,328,000
丸運	15,600	246.00	3,837,600
丸全昭和運輸	59,000	356.00	21,004,000
センコー	71,000	539.00	38,269,000
トナミホールディングス	41,000	220.00	9,020,000
日本梱包運輸倉庫	54,100	1,856.00	100,409,600
日本石油輸送	25,000	228.00	5,700,000
福山通運	106,000	574.00	60,844,000
セイノーホールディングス	125,000	1,089.00	136,125,000
神奈川中央交通	24,000	509.00	12,216,000
日立物流	36,700	1,622.00	59,527,400
日本郵船	1,496,000	312.00	466,752,000
商船三井	998,000	442.00	441,116,000
川崎汽船	783,000	237.00	185,571,000
N S ユナイテッド海運	86,000	284.00	24,424,000
乾汽船	30,400	362.00	11,004,800
飯野海運	77,100	620.00	47,802,000
共栄タンカー	30,000	245.00	7,350,000
日本航空	148,900	5,020.00	747,478,000
A N A ホールディングス	3,455,000	208.00	718,640,000
パスコ	17,000	480.00	8,160,000
トランコム	5,700	3,335.00	19,009,500
日新	67,000	288.00	19,296,000
三菱倉庫	116,000	1,620.00	187,920,000

三井倉庫	91,000	458.00	41,678,000
住友倉庫	118,000	572.00	67,496,000
澁澤倉庫	46,000	376.00	17,296,000
東陽倉庫	40,000	259.00	10,360,000
日本トランスシティ	46,000	335.00	15,410,000
ケイヒン	45,000	177.00	7,965,000
安田倉庫	15,700	1,088.00	17,081,600
東洋埠頭	59,000	243.00	14,337,000
宇徳	21,400	343.00	7,340,200
上組	208,000	930.00	193,440,000
サンリツ	8,800	526.00	4,628,800
郵船ロジスティクス	16,500	1,271.00	20,971,500
近鉄エクスプレス	15,600	4,115.00	64,194,000
東海運	18,800	278.00	5,226,400
NEC ネットエスアイ	19,000	2,418.00	45,942,000
システナ	19,000	708.00	13,452,000
デジタルアーツ	6,800	946.00	6,432,800
新日鉄住金ソリューションズ	14,000	2,285.00	31,990,000
コア	8,400	735.00	6,174,000
ITホールディングス	63,200	1,589.00	100,424,800
ネオス	4,400	1,427.00	6,278,800
電算システム	5,000	1,432.00	7,160,000
グリー	92,300	973.00	89,807,900
コーエーテクモホールディングス	35,200	1,208.00	42,521,600
三菱総合研究所	7,400	2,092.00	15,480,800
ポルトゥウィン・ピットクルー ホールディングス	5,800	3,275.00	18,995,000
ネクソン	145,500	956.00	139,098,000
エムアップ	4,200	865.00	3,633,000
エイチーム	2,200	5,160.00	11,352,000
ブロードリーフ	18,000	1,954.00	35,172,000
ハーツユナイテッドグループ	4,300	2,338.00	10,053,400
ドワンゴ	16,000	2,626.00	42,016,000
マクロミル	31,200	780.00	24,336,000
ティーガイア	17,600	1,121.00	19,729,600
GMOペイメントゲートウェイ	6,800	4,015.00	27,302,000
ザッパラス	12,300	763.00	9,384,900
インターネットイニシアティブ	25,600	2,882.00	73,779,200
ビットアイル	16,200	805.00	13,041,000
SRAホールディングス	9,800	1,231.00	12,063,800
朝日ネット	19,300	487.00	9,399,100
パナソニック インフォメーション システムズ	3,500	2,936.00	10,276,000
フェイス	6,400	1,122.00	7,180,800
野村総合研究所	98,600	3,270.00	322,422,000
インテージホールディングス	10,900	1,246.00	13,581,400
クレスコ	6,200	934.00	5,790,800
フジ・メディア・ホールディング ス	168,200	2,192.00	368,694,400
オービック	60,000	2,990.00	179,400,000
TDCソフトウェアエンジニアリ ング	5,600	801.00	4,485,600
ヤフー	1,260,900	584.00	736,365,600
トレンドマイクロ	77,200	3,700.00	285,640,000

日本オラクル	35,300	3,820.00	134,846,000
アルファシステムズ	7,000	1,461.00	10,227,000
フューチャーアーキテクト	25,300	553.00	13,990,900
シーエーシー	11,700	923.00	10,799,100
ソフトバンク・テクノロジー	5,100	1,602.00	8,170,200
オービックビジネスコンサルタント	9,100	3,235.00	29,438,500
伊藤忠テクノソリューションズ	20,800	4,075.00	84,760,000
アイティフォー	24,400	433.00	10,565,200
大塚商会	15,600	12,400.00	193,440,000
サイボウズ	266	41,700.00	11,092,200
電通国際情報サービス	12,100	1,100.00	13,310,000
ウェザーニューズ	6,000	2,154.00	12,924,000
C I J	20,600	409.00	8,425,400
WOWOW	5,400	3,340.00	18,036,000
日本コロムビア	11,600	586.00	6,797,600
ネットワンシステムズ	70,600	636.00	44,901,600
アルゴグラフィックス	7,800	1,703.00	13,283,400
マーベラスAQL	28,100	748.00	21,018,800
エイベックス・グループ・ホールディングス	32,500	2,191.00	71,207,500
日本ユニシス	43,500	876.00	38,106,000
兼松エレクトロニクス	10,000	1,263.00	12,630,000
東京放送ホールディングス	93,700	1,286.00	120,498,200
日本テレビホールディングス	172,500	1,855.00	319,987,500
テレビ朝日	43,800	2,317.00	101,484,600
スカパーJ S A Tホールディングス	132,600	562.00	74,521,200
テレビ東京ホールディングス	14,500	1,630.00	23,635,000
コネクシオ	16,600	795.00	13,197,000
日本電信電話	682,600	5,490.00	3,747,474,000
K D D I	539,500	6,340.00	3,420,430,000
光通信	16,100	8,020.00	129,122,000
N T T ドコモ	1,430,800	1,681.00	2,405,174,800
G M O インターネット	59,000	1,364.00	80,476,000
学研ホールディングス	63,000	293.00	18,459,000
ゼンリン	23,900	987.00	23,589,300
昭文社	4,300	625.00	2,687,500
K A D O K A W A	16,800	3,545.00	59,556,000
アイネット	11,100	767.00	8,513,700
松竹	115,000	931.00	107,065,000
東宝	123,900	2,213.00	274,190,700
東映	73,000	581.00	42,413,000
A O I P r o .	10,500	652.00	6,846,000
エヌ・ティ・ティ・データ	122,900	3,700.00	454,730,000
D T S	16,700	1,727.00	28,840,900
スクウェア・エニックス・ホールディングス	64,400	1,822.00	117,336,800
シーイーシー	12,400	641.00	7,948,400
カプコン	45,600	1,907.00	86,959,200
S C S K	41,800	2,564.00	107,175,200
アイネス	26,100	644.00	16,808,400
T K C	13,400	1,710.00	22,914,000
富士ソフト	22,400	2,205.00	49,392,000

NSD	37,000	1,223.00	45,251,000
コナミ	79,000	2,455.00	193,945,000
JBCCHホールディングス	17,200	762.00	13,106,400
ソフトバンク	853,200	8,930.00	7,619,076,000
高千穂交易	6,000	970.00	5,820,000
伊藤忠食品	4,000	3,315.00	13,260,000
エレマテック	9,800	1,589.00	15,572,200
JALUX	6,400	1,124.00	7,193,600
あらた	44,000	320.00	14,080,000
双日	1,163,700	183.00	212,957,100
アルフレッサホールディングス	51,300	5,080.00	260,604,000
横浜冷凍	41,200	777.00	32,012,400
神栄	30,000	261.00	7,830,000
アルコニックス	6,000	2,229.00	13,374,000
あいホールディングス	31,500	1,238.00	38,997,000
ダイワボウホールディングス	161,000	204.00	32,844,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	32,700	719.00	23,511,300
UKCホールディングス	10,900	1,646.00	17,941,400
TOKAIホールディングス	86,200	336.00	28,963,200
ミタチ産業	9,700	497.00	4,820,900
シップヘルスケアホールディングス	24,600	4,045.00	99,507,000
協栄産業	31,000	188.00	5,828,000
小野建	15,300	1,327.00	20,303,100
佐鳥電機	13,600	574.00	7,806,400
コンドーテック	16,100	689.00	11,092,900
ナガイレーベン	23,400	1,577.00	36,901,800
三菱食品	19,100	2,522.00	48,170,200
松田産業	13,700	1,367.00	18,727,900
メディパルホールディングス	173,800	1,345.00	233,761,000
アドヴァン	10,600	1,190.00	12,614,000
SPK	4,400	1,773.00	7,801,200
アズワン	11,600	2,302.00	26,703,200
尾家産業	6,600	818.00	5,398,800
シモジマ	12,500	961.00	12,012,500
ドウシシャ	18,300	1,428.00	26,132,400
高速	13,000	871.00	11,323,000
黒田電気	25,200	1,530.00	38,556,000
丸文	16,400	537.00	8,806,800
ハピネット	13,200	839.00	11,074,800
トーメンエレクトロニクス	9,900	1,134.00	11,226,600
エクセル	8,400	1,152.00	9,676,800
マルカキカイ	7,000	1,328.00	9,296,000
ガリバーインターナショナル	58,100	554.00	32,187,400
日本エム・ディ・エム	21,500	313.00	6,729,500
進和	12,800	1,142.00	14,617,600
ダイトエレクトロン	10,500	387.00	4,063,500
シークス	12,200	1,239.00	15,115,800
田中商事	8,300	582.00	4,830,600
オーハシテクニカ	11,800	958.00	11,304,400
マクニカ	8,800	2,748.00	24,182,400
白銅	7,400	840.00	6,216,000
伊藤忠商事	1,385,500	1,250.00	1,731,875,000

丸紅	1,520,000	719.00	1,092,880,000
高島	40,000	243.00	9,720,000
長瀬産業	98,000	1,217.00	119,266,000
蝶理	12,800	1,139.00	14,579,200
豊田通商	193,100	2,576.00	497,425,600
三共生興	33,200	349.00	11,586,800
兼松	369,000	155.00	57,195,000
ツカモトコーポレーション	42,000	159.00	6,678,000
三井物産	1,599,100	1,400.00	2,238,740,000
日本紙パルプ商事	90,000	324.00	29,160,000
日立ハイテクノロジーズ	53,200	2,538.00	135,021,600
カメイ	24,200	782.00	18,924,400
東都水産	40,000	207.00	8,280,000
スターゼン	68,000	267.00	18,156,000
山善	66,800	637.00	42,551,600
椿本興業	26,000	279.00	7,254,000
住友商事	1,024,900	1,256.00	1,287,274,400
内田洋行	47,000	275.00	12,925,000
三菱商事	1,355,000	1,954.00	2,647,670,000
第一実業	44,000	447.00	19,668,000
キャノンマーケティングジャパン	49,900	1,452.00	72,454,800
西華産業	67,000	241.00	16,147,000
佐藤商事	16,600	645.00	10,707,000
菱洋エレクトロ	17,000	1,045.00	17,765,000
東京産業	19,300	366.00	7,063,800
ユアサ商事	181,000	202.00	36,562,000
神鋼商事	48,000	231.00	11,088,000
阪和興業	174,000	551.00	95,874,000
カナデン	19,000	705.00	13,395,000
菱電商事	25,000	705.00	17,625,000
フルサト工業	10,800	1,250.00	13,500,000
岩谷産業	195,000	522.00	101,790,000
すてきなイスグループ	76,000	240.00	18,240,000
昭光通商	66,000	167.00	11,022,000
極東貿易	30,000	217.00	6,510,000
イワキ	34,000	210.00	7,140,000
三愛石油	42,000	465.00	19,530,000
稲畑産業	42,100	1,110.00	46,731,000
G S Iクレオス	61,000	161.00	9,821,000
明和産業	21,600	372.00	8,035,200
ワキタ	25,000	1,171.00	29,275,000
東邦ホールディングス	55,200	1,674.00	92,404,800
サンゲツ	30,400	2,529.00	76,881,600
ミツウロコグループホールディングス	30,100	538.00	16,193,800
シナネン	35,000	400.00	14,000,000
伊藤忠エネクス	36,700	543.00	19,928,100
サンリオ	44,100	4,285.00	188,968,500
サンワテクノス	10,500	855.00	8,977,500
リョーサン	25,900	2,128.00	55,115,200
新光商事	19,500	844.00	16,458,000
トーホー	38,000	373.00	14,174,000
三信電気	22,500	719.00	16,177,500
東陽テクニカ	24,500	1,056.00	25,872,000

モスフードサービス	20,600	1,946.00	40,087,600
加賀電子	17,000	1,162.00	19,754,000
ソーダニッカ	16,000	426.00	6,816,000
立花エレテック	11,700	1,248.00	14,601,600
P a l t a c	24,300	1,306.00	31,735,800
太平洋興発	83,000	109.00	9,047,000
ヤマタネ	99,000	175.00	17,325,000
日鉄住金物産	114,000	362.00	41,268,000
トラスコ中山	19,200	2,300.00	44,160,000
オートバックスセブン	61,100	1,574.00	96,171,400
加藤産業	24,700	1,864.00	46,040,800
イノテック	18,100	460.00	8,326,000
イエローハット	15,000	1,898.00	28,470,000
富士エレクトロニクス	10,000	1,317.00	13,170,000
J Kホールディングス	18,100	555.00	10,045,500
日伝	7,800	2,199.00	17,152,200
北沢産業	24,500	186.00	4,557,000
杉本商事	9,100	944.00	8,590,400
因幡電機産業	23,600	3,060.00	72,216,000
ミスミグループ本社	70,000	3,210.00	224,700,000
江守商事	6,600	2,020.00	13,332,000
タキヒヨー	31,000	402.00	12,462,000
スズケン	71,800	3,290.00	236,222,000
ジェコス	14,500	759.00	11,005,500
ローソン	71,400	7,740.00	552,636,000
サンエー	13,200	2,787.00	36,788,400
キリン堂	9,300	676.00	6,286,800
カワチ薬品	11,900	1,887.00	22,455,300
エービーシー・マート	25,000	4,620.00	115,500,000
ハードオフコーポレーション	10,900	803.00	8,752,700
アスクル	14,800	3,275.00	48,470,000
ゲオホールディングス	30,500	916.00	27,938,000
アダストリアホールディングス	13,600	3,820.00	51,952,000
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	27,000	245.00	6,615,000
くらコーポレーション	11,400	1,519.00	17,316,600
キャンドゥ	10,100	1,443.00	14,574,300
パル	9,900	2,493.00	24,680,700
エディオン	81,000	608.00	49,248,000
サーラコーポレーション	18,300	494.00	9,040,200
あみやき亭	3,600	3,715.00	13,374,000
ひらまつ	20,000	605.00	12,100,000
ゲンキー	2,100	2,124.00	4,460,400
大黒天物産	4,200	2,783.00	11,688,600
ハニーズ	15,190	1,000.00	15,190,000
アルペン	13,100	1,855.00	24,300,500
クオール	16,100	585.00	9,418,500
ジェイアイエヌ	9,100	4,485.00	40,813,500
ビックカメラ	643	52,300.00	33,628,900
D C Mホールディングス	86,900	680.00	59,092,000
M o n o t a R O	27,100	1,974.00	53,495,400
J . フロント リテイリング	411,000	768.00	315,648,000
ドトール・日レスホールディングス	30,900	1,665.00	51,448,500
マツモトキヨシホールディングス	36,300	3,265.00	118,519,500

スタートトゥデイ	54,400	2,518.00	136,979,200
物語コーポレーション	2,700	3,145.00	8,491,500
ココカラファイン	18,000	2,682.00	48,276,000
三越伊勢丹ホールディングス	345,400	1,469.00	507,392,600
ウエルシアホールディングス	6,300	5,570.00	35,091,000
クリエイトSDホールディングス	7,200	3,635.00	26,172,000
エー・ピーカンパニー	2,700	2,042.00	5,513,400
あさひ	11,600	1,509.00	17,504,400
日本調剤	3,050	2,757.00	8,408,850
コスモス薬品	8,700	10,960.00	95,352,000
セブン&アイ・ホールディングス	726,900	4,040.00	2,936,676,000
ツルハホールディングス	17,100	9,450.00	161,595,000
サンマルクホールディングス	5,700	4,960.00	28,272,000
フェリシモ	5,200	995.00	5,174,000
トリドール	17,500	924.00	16,170,000
クスリのアオキ	2,600	6,000.00	15,600,000
メディカルシステムネットワーク	18,700	463.00	8,658,100
総合メディカル	5,000	3,840.00	19,200,000
はるやま商事	8,800	719.00	6,327,200
カップパ・クリエイトホールディングス	11,900	1,915.00	22,788,500
ライトオン	15,800	713.00	11,265,400
良品計画	18,500	10,960.00	202,760,000
三城ホールディングス	24,600	452.00	11,119,200
コナカ	23,000	886.00	20,378,000
コジマ	30,600	275.00	8,415,000
ヒマラヤ	5,400	1,265.00	6,831,000
コーナン商事	22,900	1,028.00	23,541,200
ワタミ	20,800	1,369.00	28,475,200
ドンキホーテホールディングス	51,300	6,180.00	317,034,000
西松屋チェーン	34,500	786.00	27,117,000
ゼンショーホールディングス	66,100	1,071.00	70,793,100
幸楽苑	14,100	1,257.00	17,723,700
サイゼリヤ	25,100	1,259.00	31,600,900
ユニテッドアローズ	22,800	3,775.00	86,070,000
ハイデイ日高	9,000	2,061.00	18,549,000
京都きもの友禅	13,700	1,048.00	14,357,600
コロワイド	58,000	1,000.00	58,000,000
壺番屋	7,100	3,700.00	26,270,000
スギホールディングス	31,400	4,095.00	128,583,000
スクロール	25,900	304.00	7,873,600
ヨンドシーホールディングス	13,500	1,485.00	20,047,500
ファミリーマート	59,000	4,735.00	279,365,000
木曽路	20,100	1,818.00	36,541,800
千趣会	31,300	885.00	27,700,500
タカキュー	19,500	303.00	5,908,500
ケーヨー	30,900	459.00	14,183,100
上新電機	38,000	780.00	29,640,000
日本瓦斯	25,800	1,038.00	26,780,400
ベスト電器	69,200	150.00	10,380,000
マルエツ	38,000	338.00	12,844,000
ロイヤルホールディングス	28,600	1,571.00	44,930,600
東天紅	24,000	194.00	4,656,000
いなげや	16,800	978.00	16,430,400

島忠	39,400	2,380.00	93,772,000
チヨダ	20,900	1,943.00	40,608,700
ライフコーポレーション	12,900	1,561.00	20,136,900
カスミ	33,300	629.00	20,945,700
リンガーハット	16,800	1,466.00	24,628,800
テナアライド	18,900	301.00	5,688,900
A O K Iホールディングス	15,000	3,360.00	50,400,000
オークワ	26,000	886.00	23,036,000
コメリ	27,300	2,623.00	71,607,900
青山商事	48,100	2,773.00	133,381,300
しまむら	20,200	10,240.00	206,848,000
C F Sコーポレーション	15,200	390.00	5,928,000
高島屋	235,000	1,003.00	235,705,000
松屋	34,100	1,041.00	35,498,100
エイチ・ツー・オー リテイリング	103,000	811.00	83,533,000
近鉄百貨店	69,000	338.00	23,322,000
ニッセンホールディングス	38,400	400.00	15,360,000
パルコ	18,000	923.00	16,614,000
丸井グループ	227,000	1,050.00	238,350,000
アクシアル リテイリング	10,800	1,505.00	16,254,000
井筒屋	114,000	87.00	9,918,000
ダイエー	109,450	335.00	36,665,750
イズミヤ	61,000	456.00	27,816,000
イオン	682,700	1,380.00	942,126,000
ユニーグループ・ホールディングス	167,400	646.00	108,140,400
イズミ	39,200	3,135.00	122,892,000
東武ストア	23,000	259.00	5,957,000
平和堂	34,900	1,503.00	52,454,700
フジ	18,600	1,763.00	32,791,800
ヤオコー	8,700	4,100.00	35,670,000
ゼビオ	21,200	1,970.00	41,764,000
ケーズホールディングス	37,200	2,980.00	110,856,000
O l y m p i cグループ	12,600	720.00	9,072,000
日産東京販売ホールディングス	27,000	447.00	12,069,000
アインファーマシーズ	10,700	5,000.00	53,500,000
元気寿司	8,700	1,327.00	11,544,900
ヤマダ電機	691,000	340.00	234,940,000
アークランドサカモト	12,700	1,681.00	21,348,700
ニトリホールディングス	34,650	9,640.00	334,026,000
グルメ杵屋	15,000	686.00	10,290,000
愛眼	16,500	271.00	4,471,500
吉野家ホールディングス	47,200	1,211.00	57,159,200
松屋フーズ	8,400	1,680.00	14,112,000
サガミチェーン	23,000	892.00	20,516,000
王将フードサービス	8,800	3,000.00	26,400,000
プレナス	19,400	2,331.00	45,221,400
ミニストップ	11,800	1,626.00	19,186,800
アークス	29,400	1,936.00	56,918,400
パロー	38,000	1,358.00	51,604,000
ベルク	9,000	1,793.00	16,137,000
大庄	8,800	1,284.00	11,299,200
ファーストリテイリング	40,600	40,750.00	1,654,450,000



サンドラッグ	36,600	4,650.00	170,190,000
東京デリカ	9,500	1,399.00	13,290,500
ヤマザワ	4,100	1,548.00	6,346,800
やまや	4,400	1,736.00	7,638,400
ペルーナ	43,400	497.00	21,569,800
島根銀行	3,900	1,290.00	5,031,000
じもとホールディングス	128,400	208.00	26,707,200
新生銀行	1,509,000	251.00	378,759,000
あおぞら銀行	901,000	291.00	262,191,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	13,161,500	660.00	8,686,590,000
りそなホールディングス	1,652,500	516.00	852,690,000
三井住友トラスト・ホールディングス	3,415,000	540.00	1,844,100,000
三井住友フィナンシャルグループ	1,314,200	5,290.00	6,952,118,000
第四銀行	223,000	348.00	77,604,000
北越銀行	194,000	208.00	40,352,000
西日本シティ銀行	612,000	271.00	165,852,000
千葉銀行	669,000	701.00	468,969,000
横浜銀行	1,146,000	556.00	637,176,000
常陽銀行	642,000	514.00	329,988,000
群馬銀行	388,000	567.00	219,996,000
武蔵野銀行	28,000	3,390.00	94,920,000
千葉興業銀行	37,100	741.00	27,491,100
筑波銀行	74,600	361.00	26,930,600
東京都民銀行	32,200	1,044.00	33,616,800
七十七銀行	276,000	500.00	138,000,000
青森銀行	133,000	267.00	35,511,000
秋田銀行	118,000	276.00	32,568,000
山形銀行	108,000	420.00	45,360,000
岩手銀行	11,500	5,090.00	58,535,000
東邦銀行	159,000	315.00	50,085,000
東北銀行	97,000	146.00	14,162,000
みちのく銀行	97,000	206.00	19,982,000
ふくおかフィナンシャルグループ	703,000	450.00	316,350,000
静岡銀行	506,000	1,108.00	560,648,000
十六銀行	214,000	368.00	78,752,000
スルガ銀行	170,000	1,707.00	290,190,000
八十二銀行	315,000	596.00	187,740,000
山梨中央銀行	108,000	450.00	48,600,000
大垣共立銀行	212,000	279.00	59,148,000
福井銀行	152,000	240.00	36,480,000
北國銀行	192,000	357.00	68,544,000
清水銀行	6,000	2,778.00	16,668,000
滋賀銀行	162,000	528.00	85,536,000
南都銀行	170,000	385.00	65,450,000
百五銀行	153,000	405.00	61,965,000
京都銀行	329,000	837.00	275,373,000
紀陽銀行	68,600	1,391.00	95,422,600
三重銀行	70,000	214.00	14,980,000
ほくほくフィナンシャルグループ	1,177,000	202.00	237,754,000
広島銀行	510,000	411.00	209,610,000
山陰合同銀行	104,000	729.00	75,816,000
中国銀行	127,800	1,303.00	166,523,400

鳥取銀行	58,000	190.00	11,020,000
伊予銀行	184,900	1,016.00	187,858,400
百十四銀行	195,000	355.00	69,225,000
四国銀行	132,000	231.00	30,492,000
阿波銀行	139,000	514.00	71,446,000
鹿児島銀行	115,000	643.00	73,945,000
大分銀行	111,000	386.00	42,846,000
宮崎銀行	117,000	290.00	33,930,000
肥後銀行	140,000	554.00	77,560,000
佐賀銀行	110,000	220.00	24,200,000
十八銀行	109,000	234.00	25,506,000
沖縄銀行	13,100	3,845.00	50,369,500
琉球銀行	35,000	1,195.00	41,825,000
八千代銀行	8,700	2,646.00	23,020,200
セブン銀行	658,100	388.00	255,342,800
みずほフィナンシャルグループ	22,493,100	214.00	4,813,523,400
山口フィナンシャルグループ	174,000	948.00	164,952,000
長野銀行	61,000	182.00	11,102,000
名古屋銀行	160,000	347.00	55,520,000
北洋銀行	265,100	416.00	110,281,600
愛知銀行	6,200	4,965.00	30,783,000
第三銀行	101,000	174.00	17,574,000
中京銀行	77,000	179.00	13,783,000
東日本銀行	79,000	236.00	18,644,000
大光銀行	67,000	225.00	15,075,000
愛媛銀行	105,000	221.00	23,205,000
トマト銀行	62,000	176.00	10,912,000
みなと銀行	162,000	173.00	28,026,000
京葉銀行	143,000	499.00	71,357,000
関西アーバン銀行	238,000	119.00	28,322,000
栃木銀行	91,000	395.00	35,945,000
北日本銀行	5,500	2,594.00	14,267,000
東和銀行	198,000	91.00	18,018,000
福島銀行	205,000	86.00	17,630,000
大東銀行	107,000	113.00	12,091,000
トモニホールディングス	134,800	402.00	54,189,600
フィデアホールディングス	105,300	196.00	20,638,800
池田泉州ホールディングス	133,000	473.00	62,909,000
F P G	12,500	1,007.00	12,587,500
S B Iホールディングス	210,500	1,420.00	298,910,000
ジャフコ	24,100	5,540.00	133,514,000
大和証券グループ本社	1,723,000	988.00	1,702,324,000
野村ホールディングス	3,553,800	780.00	2,771,964,000
岡三証券グループ	139,000	927.00	128,853,000
丸三証券	53,600	865.00	46,364,000
東洋証券	74,000	353.00	26,122,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	185,500	905.00	167,877,500
光世証券	47,000	274.00	12,878,000
水戸証券	54,000	486.00	26,244,000
いちよし証券	35,200	1,584.00	55,756,800
松井証券	89,000	1,291.00	114,899,000
マネックスグループ	190,800	420.00	80,136,000
カブドットコム証券	70,900	567.00	40,200,300

極東証券	21,600	1,907.00	41,191,200
岩井コスモホールディングス	17,600	1,397.00	24,587,200
NKSJホールディングス	385,800	2,853.00	1,100,687,400
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	519,300	2,721.00	1,413,015,300
ソニーフィナンシャルホールディングス	167,300	1,855.00	310,341,500
第一生命保険	875,800	1,685.00	1,475,723,000
東京海上ホールディングス	672,300	3,420.00	2,299,266,000
T&Dホールディングス	596,600	1,395.00	832,257,000
全国保証	21,400	4,555.00	97,477,000
クレディセゾン	143,100	2,802.00	400,966,200
芙蓉総合リース	19,000	3,825.00	72,675,000
興銀リース	31,700	2,880.00	91,296,000
東京センチュリーリース	41,700	3,325.00	138,652,500
日本証券金融	82,300	760.00	62,548,000
アイフル	180,100	414.00	74,561,400
ポケットカード	20,300	817.00	16,585,100
リコーリース	12,900	3,010.00	38,829,000
イオンフィナンシャルサービス	101,800	2,660.00	270,788,000
アコム	356,600	335.00	119,461,000
ジャックス	111,000	486.00	53,946,000
オリエン트コーポレーション	398,700	235.00	93,694,500
日立キャピタル	35,300	2,870.00	101,311,000
アプラスフィナンシャル	74,500	145.00	10,802,500
オリックス	1,058,500	1,769.00	1,872,486,500
三菱UFJリース	447,400	595.00	266,203,000
日本取引所グループ	256,300	2,926.00	749,933,800
イー・ギャランティ	6,200	2,282.00	14,148,400
アサックス	5,100	1,346.00	6,864,600
NECキャピタルソリューション	7,100	2,946.00	20,916,600
日本駐車場開発	2,348	7,530.00	17,680,440
ヒューリック	292,900	1,492.00	437,006,800
野村不動産ホールディングス	115,000	2,275.00	261,625,000
常和ホールディングス	7,200	2,818.00	20,289,600
フージャースホールディングス	27,100	706.00	19,132,600
オープンハウス	7,200	2,378.00	17,121,600
東急不動産ホールディングス	421,700	947.00	399,349,900
飯田グループホールディングス	75,800	2,140.00	162,212,000
パーク24	90,900	1,966.00	178,709,400
三井不動産	819,000	3,585.00	2,936,115,000
三菱地所	1,216,000	2,991.00	3,637,056,000
平和不動産	35,200	1,779.00	62,620,800
東京建物	356,000	1,130.00	402,280,000
ダイビル	52,000	1,197.00	62,244,000
京阪神ビルディング	34,600	527.00	18,234,200
住友不動産	417,000	4,945.00	2,062,065,000
大京	293,000	269.00	78,817,000
テーオーシー	60,700	814.00	49,409,800
東京楽天地	33,000	470.00	15,510,000
レオパレス21	169,000	525.00	88,725,000
フジ住宅	24,100	660.00	15,906,000
空港施設	22,100	816.00	18,033,600
住友不動産販売	12,500	3,055.00	38,187,500

ゴールドクレスト	14,000	2,641.00	36,974,000
日本エスリード	7,900	1,070.00	8,453,000
日神不動産	25,600	382.00	9,779,200
タカラレーベン	58,300	325.00	18,947,500
サンヨーハウジング名古屋	10,700	1,162.00	12,433,400
イオンモール	112,400	2,800.00	314,720,000
トーセイ	24,700	776.00	19,167,200
エヌ・ティ・ティ都市開発	109,500	1,145.00	125,377,500
サンフロンティア不動産	17,400	1,512.00	26,308,800
ランドビジネス	15,300	451.00	6,900,300
日本空港ビルデング	60,800	2,238.00	136,070,400
日本工営	63,000	397.00	25,011,000
ネクスト	5,500	3,045.00	16,747,500
日本M&Aセンター	9,700	6,390.00	61,983,000
アコーディア・ゴルフ	75,500	1,226.00	92,563,000
タケエイ	13,400	1,237.00	16,575,800
パソナグループ	20,800	727.00	15,121,600
リンクアンドモチベーション	248	17,090.00	4,238,320
G C Aサヴィアン	13,100	988.00	12,942,800
エス・エム・エス	11,100	2,007.00	22,277,700
テンプホールディングス	40,300	2,689.00	108,366,700
リニカル	4,300	1,123.00	4,828,900
クックパッド	11,300	3,115.00	35,199,500
エスクリ	8,400	888.00	7,459,200
学情	8,100	974.00	7,889,400
スタジオアリス	9,700	1,421.00	13,783,700
シミックホールディングス	8,800	1,186.00	10,436,800
NECフィールディング	14,800	1,153.00	17,064,400
総合警備保障	66,700	2,009.00	134,000,300
カカコム	112,400	1,807.00	203,106,800
ルネサンス	11,100	747.00	8,291,700
新日本科学	1,700	1,310.00	2,227,000
ツクイ	20,900	936.00	19,562,400
エムスリー	615	250,500.00	154,057,500
ベストブライダル	13,700	657.00	9,000,900
アウトソーシング	7,200	1,065.00	7,668,000
ディー・エヌ・エー	99,800	2,090.00	208,582,000
博報堂DYホールディングス	253,300	809.00	204,919,700
ぐるなび	13,500	3,055.00	41,242,500
一休	141	148,200.00	20,896,200
ジャパンベストレスキューシステム	132	56,600.00	7,471,200
ジェイコムホールディングス	6,300	754.00	4,750,200
PGMホールディングス	24,200	1,005.00	24,321,000
バリューコマース	12,200	1,255.00	15,311,000
J Pホールディングス	34,100	390.00	13,299,000
イーピーエス	212	119,700.00	25,376,400
アミューズ	6,200	1,990.00	12,338,000
ドリームインキュベータ	56	159,000.00	8,904,000
ケネディクス	219,700	489.00	107,433,300
電通	173,300	4,300.00	745,190,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	8,500	2,174.00	18,479,000
ぴあ	6,600	1,718.00	11,338,800
イオンファンタジー	7,000	1,538.00	10,766,000

みらかホールディングス	48,200	4,950.00	238,590,000
アルプス技研	8,900	1,049.00	9,336,100
サニックス	27,700	874.00	24,209,800
オリエンタルランド	49,700	14,470.00	719,159,000
ダスキン	48,100	1,924.00	92,544,400
明光ネットワークジャパン	19,200	1,057.00	20,294,400
ファルコS Dホールディングス	11,000	1,207.00	13,277,000
ラウンドワン	53,300	788.00	42,000,400
リゾートトラスト	31,200	3,725.00	116,220,000
ビー・エム・エル	12,200	3,415.00	41,663,000
ワタベウェディング	5,900	645.00	3,805,500
もしもしホットライン	34,900	1,081.00	37,726,900
リソー教育	23,800	453.00	10,781,400
ユー・エス・エス	223,200	1,382.00	308,462,400
セントラルスポーツ	6,400	1,462.00	9,356,800
フルキャストホールディングス	23,600	262.00	6,183,200
リゾートソリューション	26,000	237.00	6,162,000
リブセンス	4,900	4,550.00	22,295,000
リロ・ホールディング	6,800	4,835.00	32,878,000
エイチ・アイ・エス	15,000	5,380.00	80,700,000
共立メンテナンス	9,000	3,745.00	33,705,000
イチネンホールディングス	21,900	750.00	16,425,000
建設技術研究所	12,300	936.00	11,512,800
燦ホールディングス	3,700	1,368.00	5,061,600
東京テアトル	86,000	153.00	13,158,000
よみうりランド	39,000	698.00	27,222,000
東京都競馬	145,000	389.00	56,405,000
常磐興産	72,000	159.00	11,448,000
カナモト	23,000	2,604.00	59,892,000
東京ドーム	138,000	689.00	95,082,000
西尾レントオール	10,200	2,643.00	26,958,600
アゴラ・ホスピタリティー・グループ	53,000	54.00	2,862,000
トランス・コスモス	24,000	1,897.00	45,528,000
乃村工藝社	37,700	816.00	30,763,200
藤田観光	51,000	385.00	19,635,000
日本管財	8,500	1,884.00	16,014,000
トーカイ	8,000	2,838.00	22,704,000
白洋舎	32,000	241.00	7,712,000
セコム	191,100	6,190.00	1,182,909,000
セントラル警備保障	6,400	932.00	5,964,800
丹青社	20,000	716.00	14,320,000
メイテック	25,700	2,641.00	67,873,700
アサツー ディ・ケイ	32,700	2,592.00	84,758,400
応用地質	18,000	1,618.00	29,124,000
船井総合研究所	20,400	847.00	17,278,800
進学会	11,400	405.00	4,617,000
ベネッセホールディングス	61,800	3,985.00	246,273,000
イオンディライト	17,600	1,973.00	34,724,800
ナック	10,000	1,607.00	16,070,000
ニチイ学館	40,000	821.00	32,840,000
ダイセキ	28,000	1,930.00	54,040,000
合計	281,515,694		314,315,115,160

## (b) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

## 「SMAM・年金国内債券パッシブファンド&lt;適格機関投資家限定&gt;」の状況

## (1) 貸借対照表

		(単位:円)
		(平成25年12月19日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		1,241
親投資信託受益証券		55,971,992,217
未収入金		1,999,999
流動資産合計		55,973,993,457
資産合計		55,973,993,457
負債の部		
流動負債		
未払解約金		1,999,999
未払受託者報酬		7,381,227
未払委託者報酬		7,381,169
その他未払費用		472,500
流動負債合計		17,234,895
負債合計		17,234,895
純資産の部		
元本等		
元本		47,105,275,939
剰余金		
剰余金又は欠損金( )		8,851,482,623
元本等合計		55,956,758,562
純資産合計		55,956,758,562
負債純資産合計		55,973,993,457

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	自 平成25年 6月21日 至 平成25年12月19日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

## ( 貸借対照表に関する注記 )

項 目	( 平成25年12月19日現在 )
1. 受益権総数	平成25年12月19日における受益権の総数 47,105,275,939口
2. 1単位当たり純資産額	1.1879円 ( 1万口 = 11,879円 )

## ( 金融商品に関する注記 )

## . 金融商品の状況に関する事項

項 目	自 平成25年 6月21日 至 平成25年12月19日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>



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

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成25年12月19日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（デリバティブ取引に関する注記）

（平成25年12月19日現在）  
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

（自平成25年6月21日 至 平成25年12月19日）  
該当事項はありません。

（その他の注記）

（平成25年12月19日現在）	
期首（平成25年 6月21日）における元本額	47,706,164,734円
期首より平成25年12月19日現在までの追加設定元本額	469,390,247円
期首より平成25年12月19日現在までの一部解約元本額	1,070,279,042円

（3）附属明細表  
有価証券明細表

(a) 株式  
該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託 受益証券	国内債券（NOMURA - B P I）マザーファンド	43,752,045,820	55,971,992,217	
	親投資信託受益証券 小計	43,752,045,820	55,971,992,217	
合計			55,971,992,217	

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

## （参考情報）

S M A M ・ 年 金 国 内 債 券 パ ッ シ ュ フ ァ ン ド < 適 格 機 関 投 資 家 限 定 > は、「 国 内 債 券 ( N O M U R A - B P I ) マ ザ ー フ ァ ン ド 」 受 益 証 券 を 主 要 投 資 対 象 と し て お り、 貸 借 対 照 表 の 資 産 の 部 に 計 上 さ れ た 「 親 投 資 信 託 受 益 証 券 」 は、 す べ て 同 マ ザ ー フ ァ ン ド の 受 益 証 券 で す。

な お、 以 下 に 記 載 し た 状 況 は、 監 査 の 対 象 外 で す。

## 「国内債券（NOMURA - B P I）マザーファンド」の状況

## （１）貸借対照表

（単位：円）	
（平成25年12月19日現在）	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,077,338,550
国債証券	125,991,048,410
地方債証券	10,135,528,095
特殊債券	15,269,112,744
社債券	11,745,784,000
未収入金	242,746,300
未収利息	805,261,950
前払費用	32,646,364
流動資産合計	165,299,466,413
資産合計	165,299,466,413
負債の部	
流動負債	
未払解約金	606,882,222
流動負債合計	606,882,222
負債合計	606,882,222
純資産の部	
元本等	
元本	128,732,516,853
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	35,960,067,338
元本等合計	164,692,584,191
純資産合計	164,692,584,191
負債純資産合計	165,299,466,413

( 2 ) 注記表  
( 重要な会計方針の注記 )

項 目	自 平成25年 6月21日 至 平成25年12月19日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

( 貸借対照表に関する注記 )

項 目	( 平成25年12月19日現在 )
1. 受益権総数	平成25年12月19日における受益権の総数 128,732,516,853口
2. 1単位当たり純資産額	1.2793円 ( 1万口 = 12,793円 )

( 金融商品に関する注記 )

・金融商品の状況に関する事項

項 目	自 平成25年 6月21日 至 平成25年12月19日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成25年12月19日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成25年12月19日現在)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

(自平成25年6月21日 至 平成25年12月19日)

該当事項はありません。

(その他の注記)

(平成25年12月19日現在)	
開示対象ファンドの	
期首(平成25年6月21日)における当該親投資信託の元本額	135,230,028,200円
期首より平成25年12月19日現在までの追加設定元本額	3,508,623,826円
期首より平成25年12月19日現在までの一部解約元本額	10,006,135,173円
平成25年12月19日現在の元本の内訳	
三井住友・DC年金日本債券インデックス・ファンド	21,685,568,426円
SMA・国内債券インデックス・ファンド	62,628,054,921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>	666,847,686円
SMA・年金国内債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>	43,752,045,820円
合計	128,732,516,853円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第1回利付国債(40年)	110,000,000	129,464,500	
	第2回利付国債(40年)	242,000,000	272,567,020	
	第3回利付国債(40年)	245,000,000	275,870,000	
	第4回利付国債(40年)	345,000,000	388,314,750	
	第5回利付国債(40年)	345,000,000	368,980,950	
	第6回利付国債(40年)	255,000,000	265,439,700	
	第270回利付国債(10年)	1,833,000,000	1,866,085,650	
	第272回利付国債(10年)	2,430,000,000	2,485,282,500	
	第274回利付国債(10年)	2,993,000,000	3,076,774,070	
	第277回利付国債(10年)	3,034,000,000	3,135,851,380	
	第279回利付国債(10年)	450,000,000	469,120,500	
	第280回利付国債(10年)	3,443,000,000	3,596,764,380	
	第282回利付国債(10年)	2,471,000,000	2,578,661,470	
	第283回利付国債(10年)	1,230,000,000	1,286,949,000	
	第284回利付国債(10年)	3,820,000,000	3,999,731,000	
	第285回利付国債(10年)	2,624,000,000	2,757,168,000	
	第286回利付国債(10年)	2,715,000,000	2,871,899,850	
	第288回利付国債(10年)	2,588,000,000	2,737,664,040	
	第289回利付国債(10年)	2,703,000,000	2,846,556,330	
	第290回利付国債(10年)	1,952,000,000	2,052,528,000	

第292回利付国債(10年)	1,430,000,000	1,521,677,300
第293回利付国債(10年)	2,026,000,000	2,171,608,620
第296回利付国債(10年)	2,266,000,000	2,405,426,980
第297回利付国債(10年)	1,814,000,000	1,920,572,500
第299回利付国債(10年)	150,000,000	158,343,000
第300回利付国債(10年)	1,190,000,000	1,268,504,300
第301回利付国債(10年)	383,000,000	409,135,920
第303回利付国債(10年)	500,000,000	532,385,000
第305回利付国債(10年)	1,940,000,000	2,055,934,400
第306回利付国債(10年)	1,940,000,000	2,068,719,000
第308回利付国債(10年)	830,000,000	880,298,000
第309回利付国債(10年)	700,000,000	733,530,000
第310回利付国債(10年)	2,000,000,000	2,082,160,000
第312回利付国債(10年)	1,760,000,000	1,855,092,800
第313回利付国債(10年)	1,900,000,000	2,014,570,000
第315回利付国債(10年)	1,890,000,000	1,990,510,200
第317回利付国債(10年)	1,700,000,000	1,777,316,000
第319回利付国債(10年)	610,000,000	637,626,900
第320回利付国債(10年)	1,240,000,000	1,286,636,400
第321回利付国債(10年)	1,320,000,000	1,368,945,600
第322回利付国債(10年)	770,000,000	792,168,300
第323回利付国債(10年)	430,000,000	442,022,800
第324回利付国債(10年)	1,520,000,000	1,550,172,000
第325回利付国債(10年)	1,070,000,000	1,089,570,300
第326回利付国債(10年)	850,000,000	857,242,000
第327回利付国債(10年)	1,340,000,000	1,362,847,000
第328回利付国債(10年)	1,920,000,000	1,916,640,000
第329回利付国債(10年)	1,730,000,000	1,755,534,800
第330回利付国債(10年)	1,720,000,000	1,742,824,400
第2回利付国債(30年)	150,000,000	176,391,000
第4回利付国債(30年)	160,000,000	199,350,400
第5回利付国債(30年)	110,000,000	124,935,800
第7回利付国債(30年)	180,000,000	205,660,800
第10回利付国債(30年)	230,000,000	215,139,700
第11回利付国債(30年)	150,000,000	154,873,500
第12回利付国債(30年)	240,000,000	263,332,800
第14回利付国債(30年)	250,000,000	286,482,500
第15回利付国債(30年)	250,000,000	290,772,500
第16回利付国債(30年)	300,000,000	349,110,000
第18回利付国債(30年)	240,000,000	270,921,600
第19回利付国債(30年)	290,000,000	327,433,200
第21回利付国債(30年)	212,000,000	239,447,640
第22回利付国債(30年)	169,000,000	197,179,060
第23回利付国債(30年)	251,000,000	292,959,670
第24回利付国債(30年)	180,000,000	210,164,400
第25回利付国債(30年)	255,000,000	288,147,450
第26回利付国債(30年)	349,000,000	401,388,390
第27回利付国債(30年)	356,000,000	416,858,200
第28回利付国債(30年)	391,000,000	458,861,960
第29回利付国債(30年)	400,000,000	462,036,000
第30回利付国債(30年)	450,000,000	511,222,500
第31回利付国債(30年)	550,000,000	613,514,000
第32回利付国債(30年)	590,000,000	671,278,400
第33回利付国債(30年)	620,000,000	665,818,000
第34回利付国債(30年)	605,000,000	675,778,950
第35回利付国債(30年)	620,000,000	665,725,000

第36回利付国債(30年)	555,000,000	595,859,100
第37回利付国債(30年)	580,000,000	609,452,400
第38回利付国債(30年)	420,000,000	431,571,000
第39回利付国債(30年)	320,000,000	335,868,800
第40回利付国債(30年)	330,000,000	338,523,900
第28回利付国債(20年)	350,000,000	371,255,500
第30回利付国債(20年)	450,000,000	478,260,000
第32回利付国債(20年)	150,000,000	162,096,000
第33回利付国債(20年)	230,000,000	253,216,200
第35回利付国債(20年)	315,000,000	347,170,950
第37回利付国債(20年)	230,000,000	255,231,000
第39回利付国債(20年)	223,000,000	245,734,850
第40回利付国債(20年)	492,000,000	540,762,120
第42回利付国債(20年)	400,000,000	449,272,000
第43回利付国債(20年)	710,000,000	816,464,500
第46回利付国債(20年)	289,000,000	323,249,390
第48回利付国債(20年)	368,000,000	420,848,480
第50回利付国債(20年)	223,000,000	246,105,030
第52回利付国債(20年)	210,000,000	235,307,100
第54回利付国債(20年)	275,000,000	311,272,500
第56回利付国債(20年)	320,000,000	358,060,800
第58回利付国債(20年)	300,000,000	333,771,000
第59回利付国債(20年)	280,000,000	306,922,000
第61回利付国債(20年)	140,000,000	144,772,600
第63回利付国債(20年)	156,000,000	172,571,880
第64回利付国債(20年)	210,000,000	234,473,400
第65回利付国債(20年)	370,000,000	413,574,900
第69回利付国債(20年)	200,000,000	227,940,000
第70回利付国債(20年)	560,000,000	656,538,400
第72回利付国債(20年)	410,000,000	468,974,400
第74回利付国債(20年)	408,000,000	467,478,240
第75回利付国債(20年)	410,000,000	470,278,200
第78回利付国債(20年)	410,000,000	461,819,900
第82回利付国債(20年)	413,000,000	474,433,750
第84回利付国債(20年)	584,000,000	664,662,080
第85回利付国債(20年)	587,000,000	675,050,000
第88回利付国債(20年)	609,000,000	715,556,730
第90回利付国債(20年)	578,000,000	672,329,600
第92回利付国債(20年)	560,000,000	644,520,800
第93回利付国債(20年)	527,000,000	599,457,230
第95回利付国債(20年)	566,000,000	664,902,840
第97回利付国債(20年)	510,000,000	592,150,800
第99回利付国債(20年)	594,000,000	681,288,300
第100回利付国債(20年)	523,000,000	606,115,160
第102回利付国債(20年)	670,000,000	793,715,500
第105回利付国債(20年)	647,000,000	739,372,190
第107回利付国債(20年)	723,000,000	825,051,450
第109回利付国債(20年)	700,000,000	778,148,000
第111回利付国債(20年)	723,000,000	832,650,180
第113回利付国債(20年)	650,000,000	738,198,500
第114回利付国債(20年)	743,000,000	842,309,380
第116回利付国債(20年)	850,000,000	974,100,000
第118回利付国債(20年)	390,000,000	434,436,600
第119回利付国債(20年)	405,000,000	439,048,350
第121回利付国債(20年)	370,000,000	405,534,800
第122回利付国債(20年)	400,000,000	432,548,000



	第123回利付国債(20年)	80,000,000	89,906,400
	第124回利付国債(20年)	745,000,000	826,190,100
	第125回利付国債(20年)	280,000,000	318,396,400
	第126回利付国債(20年)	250,000,000	276,587,500
	第127回利付国債(20年)	290,000,000	316,503,100
	第128回利付国債(20年)	370,000,000	402,489,700
	第129回利付国債(20年)	430,000,000	461,291,100
	第130回利付国債(20年)	390,000,000	417,206,400
	第131回利付国債(20年)	410,000,000	432,082,600
	第132回利付国債(20年)	260,000,000	273,169,000
	第133回利付国債(20年)	620,000,000	661,335,400
	第134回利付国債(20年)	335,000,000	356,275,850
	第135回利付国債(20年)	150,000,000	157,107,000
	第136回利付国債(20年)	350,000,000	360,955,000
	第137回利付国債(20年)	385,000,000	402,255,700
	第138回利付国債(20年)	190,000,000	192,224,900
	第139回利付国債(20年)	250,000,000	257,152,500
	第140回利付国債(20年)	865,000,000	900,845,600
	第141回利付国債(20年)	450,000,000	467,095,500
	第142回利付国債(20年)	400,000,000	421,784,000
	第143回利付国債(20年)	645,000,000	657,080,850
	第144回利付国債(20年)	300,000,000	300,672,000
	第145回利付国債(20年)	710,000,000	733,067,900
	第146回利付国債(20年)	830,000,000	854,626,100
	国債証券 小計	117,916,000,000	125,991,048,410
地方債証券	第1回東京都公募公債(20年)	200,000,000	215,256,000
	第7回東京都公募公債(20年)	100,000,000	114,701,000
	第8回東京都公募公債(30年)	100,000,000	108,361,000
	第13回東京都公募公債(30年)	200,000,000	203,926,000
	第28回東京都公募公債(5年)	100,000,000	100,715,000
	第629回東京都公募公債	100,000,000	102,598,000
	第656回東京都公募公債	300,000,000	316,293,000
	第660回東京都公募公債	200,000,000	212,030,000
	第668回東京都公募公債	200,000,000	213,204,000
	第681回東京都公募公債	200,000,000	212,704,000
	平成16年度第11回北海道公募公債	100,000,000	101,313,000
	平成19年度第9回北海道公募公債	200,000,000	211,254,000
	第7回神奈川県公募公債(20年)	200,000,000	230,818,000
	第47回神奈川県公募公債(5年)	100,000,000	100,704,000
	第48回神奈川県公募公債(5年)	100,000,000	100,574,000
	第147回神奈川県公募公債	200,000,000	212,490,000
	第192回神奈川県公募公債	100,000,000	101,322,000
	第77回大阪府公募公債(5年)	100,000,000	100,581,000
	第273回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,236,000
	第297回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,743,000
	第311回大阪府公募公債(10年)	250,000,000	264,632,500
	第361回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,095,000
	第5回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	102,343,000
	第9回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	113,724,000
	平成16年度第13回兵庫県公募公債	100,000,000	101,334,000
	平成16年度第5回兵庫県公募公債	100,000,000	100,747,000
	平成17年度第4回兵庫県公募公債	200,000,000	203,424,000
	平成19年度第18回兵庫県公募公債	100,000,000	105,526,000
	第7回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	102,745,000
	平成19年度第7回静岡県公募公債	100,000,000	106,277,000

	平成20年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	114,854,000	
	平成21年度第7回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	213,864,000	
	平成16年度第2回広島県公募公債	100,000,000	101,707,000	
	平成17年度第4回埼玉県公募公債	200,000,000	204,220,000	
	平成19年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	106,108,000	
	平成21年度第2回埼玉県公募公債	146,000,000	156,041,880	
	平成17年度第5回福岡県公募公債	100,000,000	102,835,000	
	平成21年度第13回福岡県公募公債	200,000,000	200,892,000	
	平成17年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	101,655,000	
	平成18年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	104,650,000	
	平成18年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	104,951,000	
	第14回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,594,000	
	第17回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,276,000	
	第20回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,538,000	
	第23回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,379,000	
	第30回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,028,000	
	第31回共同発行市場公募地方債	100,500,000	102,995,415	
	第36回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,540,000	
	第38回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,478,000	
	第40回共同発行市場公募地方債	200,000,000	210,076,000	
	第47回共同発行市場公募地方債	300,000,000	315,432,000	
	第51回共同発行市場公募地方債	200,000,000	211,960,000	
	第66回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,195,000	
	第75回共同発行市場公募地方債	300,000,000	321,981,000	
	第115回共同発行市場公募地方債	300,000,000	303,759,000	
	平成17年度第10回大阪市公募公債	192,500,000	197,805,300	
	平成19年度第7回大阪市公募公債	100,000,000	105,897,000	
	平成21年度第4回大阪市公募公債	200,000,000	214,238,000	
	第464回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	106,460,000	
	平成21年度第1回京都市公募公債	100,000,000	106,868,000	
	第16回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	116,463,000	
	平成17年度第4回横浜市公募公債	300,000,000	308,247,000	
	平成16年度第2回札幌市公募公債	100,000,000	100,638,000	
	平成16年度第6回福岡市公募公債	100,000,000	101,357,000	
	平成18年度第4回福岡市公募公債	100,000,000	104,615,000	
	平成16年度第1回広島市公募公債	100,000,000	101,260,000	
	地方債証券 小計	9,689,000,000	10,135,528,095	
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	528,745,000	
	第7回政府保証日本政策投資銀行債券	3,000,000	3,006,810	
	第15回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	111,041,000	
	第16回日本政策投資銀行債券	100,000,000	100,997,000	
	第22回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	113,670,000	
	第39回日本政策投資銀行債券	100,000,000	105,597,000	
	第4回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,918,000	
	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	103,208,000	
	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	219,974,000	
	第10回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	314,253,000	
	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	198,399,900	
	第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	218,484,000	

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	210,458,000	
第27回道路債券	100,000,000	115,236,000	
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	315,033,000	
第32回道路債券	100,000,000	116,016,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	116,069,000	
第38回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,950,000	
第42回道路債券	100,000,000	113,949,000	
第48回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	320,952,000	
第52回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,807,000	
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	319,611,000	
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	113,062,000	
第91回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,861,000	
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	112,666,000	
第99回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	113,890,000	
第101回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,218,000	
第327回政府保証道路債券	50,000,000	50,248,500	
第328回政府保証道路債券	100,000,000	100,624,000	
第331回政府保証道路債券	200,000,000	202,334,000	
第337回政府保証道路債券	100,000,000	101,409,000	
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券	700,000,000	747,565,000	
第4回公営企業債券(20年)	200,000,000	224,580,000	
第7回地方公営企業等金融機構債券(5年)	100,000,000	100,540,000	
第18回公営企業債券(20年)	100,000,000	118,944,000	
第19回公営企業債券	100,000,000	104,153,000	
第22回公営企業債券(20年)	200,000,000	231,524,000	
第28回公営企業債券	100,000,000	106,334,000	
第840回政府保証公営企業債券	200,000,000	201,508,000	
第851回政府保証公営企業債券	400,000,000	406,736,000	
第858回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,765,000	
第860回政府保証公営企業債券	300,000,000	309,540,000	
第861回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,284,000	
第863回政府保証公営企業債券	400,000,000	418,156,000	
第875回政府保証公営企業債券	300,000,000	315,669,000	
第876回政府保証公営企業債券	101,000,000	107,081,210	
第882回政府保証公営企業債券	100,000,000	105,797,000	
第193回政府保証首都高速道路債券	200,000,000	202,114,000	
第195回政府保証首都高速道路債券	200,000,000	202,810,000	
第12回中小企業債券	100,000,000	103,272,000	
第33回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	100,028,000	
第34回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	100,043,000	
第184回政府保証中小企業債券	100,000,000	101,296,000	
第29回国際協力銀行債券	100,000,000	105,709,000	
第341回東京交通債券	100,000,000	100,425,000	
第13回関西国際空港株式会社社債	100,000,000	106,227,000	
第6回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	112,872,000	
第1回貸付債権担保住宅金融公庫債券	35,492,000	37,120,372	

第1回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	26,607,000	27,813,893
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	31,988,000	34,214,044
第2回貸付債権担保住宅金融公庫債券	17,057,000	17,813,819
第2回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	27,738,000	29,131,557
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	27,243,000	28,867,500
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	27,984,000	29,548,025
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	29,148,000	31,451,857
第7回貸付債権担保住宅金融公庫債券	19,665,000	20,543,238
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	29,474,000	31,793,898
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	30,557,000	32,841,441
第9回貸付債権担保住宅金融公庫債券	20,845,000	21,624,394
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	30,278,000	32,574,283
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券	22,455,000	23,235,760
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	31,082,000	33,384,554
第12回貸付債権担保住宅金融公庫債券	25,936,000	27,076,146
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	48,679,000	51,137,776
第18回貸付債権担保住宅金融公庫債券	29,502,000	31,090,977
第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	65,255,000	69,276,665
第30回貸付債権担保住宅金融公庫債券	40,766,000	42,754,973
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	47,579,000	49,929,878
第32回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	68,070,000	71,779,815
第35回貸付債権担保住宅金融公庫債券	47,819,000	50,423,700
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券	44,411,000	47,042,351
第37回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,621,000	81,348,360
第40回貸付債権担保住宅金融公庫債券	43,999,000	46,722,538
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	41,669,000	45,142,944
第43回貸付債権担保住宅金融公庫債券	41,357,000	44,705,262
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,194,000	90,005,498
第44回貸付債権担保住宅金融公庫債券	39,339,000	42,582,107
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,644,000	90,536,841
第48回貸付債権担保住宅金融公庫債券	41,563,000	45,001,091
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,124,000	91,832,180
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,443,000	92,526,413
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,287,000	94,092,249
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,513,000	94,508,220
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,413,000	95,406,257
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,738,000	96,146,801
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,515,000	98,339,133
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,940,000	98,650,991
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,647,000	99,643,881
第130回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	101,921,000
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,411,000	46,576,096
第3回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	33,531,000	35,912,036
第12回政府保証国民生活債券	37,000,000	37,119,510
第5回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	101,469,000
い第723号商工債	100,000,000	100,556,000
い第733号商工債	200,000,000	201,826,000
い第712号農林債	100,000,000	100,576,000
い第720号農林債	200,000,000	201,360,000
い第728号農林債	100,000,000	100,765,000
い第735号農林債	100,000,000	100,669,000
い第749号農林債	100,000,000	100,152,000
い第752号農林債	200,000,000	200,104,000

	第243回信金中金債(5年)	100,000,000	100,647,000	
	第236回信金中金債(5年)	200,000,000	200,948,000	
	第237回信金中金債(5年)	100,000,000	100,601,000	
	第281回信金中金債(5年)	100,000,000	99,913,000	
	第149号商工債(3年)	100,000,000	100,121,000	
	第156号商工債(3年)	400,000,000	400,208,000	
	第16回政府保証東日本高速道路債券	200,000,000	210,806,000	
	第1回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,684,000	
	第46回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,226,000	
	第5回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	203,632,000	
	特殊債券 小計	14,578,578,000	15,269,112,744	
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	101,802,000	
	第23回ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポレーション	100,000,000	100,190,000	
	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	102,873,000	
	第11回ジェー・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニー	100,000,000	100,652,000	
	第16回シティグループ・インク円貨債券	100,000,000	102,127,000	
	第5回オーストラリア・コモンウェルス銀行円貨社債(2011)	100,000,000	101,503,000	
	第7回オーストラリア・コモンウェルス銀行円貨社債(2013)	100,000,000	100,004,000	
	第8回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	100,000,000	101,830,000	
	第21回コーペラティブ・セントラル・ライフアイゼン・ボエレン	100,000,000	100,854,000	
	第10回コーペラティブ・セントラル・ライフアイゼン・ボエレン	200,000,000	202,392,000	
	第18回コーペラティブ・セントラル・ライフアイゼン・ボエレン	200,000,000	202,418,000	
	第4回ウォルマート・ストアーズ・インク円貨社債(2010)	100,000,000	101,148,000	
	H S B C 銀行 P L C 第1回円貨社債	100,000,000	100,956,000	
	第3回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,155,000	
	第9回キリンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	104,370,000	
	第7回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	100,120,000	
	第8回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	100,193,000	
	第48回住友化学株式会社無担保社債	100,000,000	100,895,000	
	第38回三菱化学株式会社無担保社債	100,000,000	108,787,000	
	第8回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	102,549,000	
	第4回花王株式会社無担保社債	100,000,000	101,037,000	
	第14回武田薬品工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,861,000	
	第6回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,076,000	
	第30回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	110,573,000	
	第63回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	108,057,000	
	第46回株式会社神戸製鋼所無担保社債	100,000,000	105,251,000	
	第12回株式会社クボタ無担保社債	100,000,000	99,942,000	
	第13回株式会社クボタ無担保社債	100,000,000	100,335,000	
	第55回株式会社東芝無担保社債	100,000,000	101,222,000	
	第22回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	106,482,000	
	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	102,183,000	

第1回明治安田生命2013基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,765,000	
第1回トヨタ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	111,266,000	
第49回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	108,557,000	
第66回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,182,000	
第70回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,659,000	
第95回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	100,612,000	
第64回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	104,828,000	
第69回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	107,193,000	
第3回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	107,757,000	
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	200,448,000	
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	104,563,000	
第57回株式会社東京三菱銀行無担保社債	100,000,000	113,058,000	
第104回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	300,000,000	301,212,000	
第6回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	101,550,000	
第4回株式会社りそな銀行無担保社債	100,000,000	111,943,000	
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	100,727,000	
第9回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	106,882,000	
第4回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	101,774,000	
第6回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	100,559,000	
第8回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	101,453,000	
第20回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	109,474,000	
第47回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	100,465,000	
第8回株式会社みずほ銀行無担保社債	200,000,000	210,896,000	
第16回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	100,000,000	101,044,000	
第22回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	100,000,000	99,986,000	
第19回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,347,000	
第27回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	105,098,000	
第55回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,073,000	
第46回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,388,000	
第47回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	99,884,000	
第113回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	106,032,000	
第23回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,480,000	
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	105,682,000	
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	100,872,000	
第22回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,980,000	
第38回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,600,000	
第27回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	104,944,000	
第65回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	105,095,000	
第88回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,123,000	
第101回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	100,021,000	
第29回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	106,557,000	

第22回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	109,966,000	
第7回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	111,210,000	
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	113,607,000	
第24回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	108,601,000	
第32回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	113,987,000	
第69回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	104,837,000	
第10回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	111,835,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	112,470,000	
第13回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	111,473,000	
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	105,622,000	
第45回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,452,000	
第48回日本電信電話株式会社電信電話債券	200,000,000	202,112,000	
第53回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	105,050,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	200,000,000	199,312,000	
第19回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	103,970,000	
第457回東京電力株式会社社債	100,000,000	92,635,000	
第528回東京電力株式会社社債	200,000,000	181,872,000	
第536回東京電力株式会社社債	100,000,000	92,800,000	
第547回東京電力株式会社社債	100,000,000	88,924,000	
第442回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,428,000	
第444回関西電力株式会社社債	100,000,000	102,245,000	
第448回関西電力株式会社社債	100,000,000	106,302,000	
第491回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,035,000	
第376回中国電力株式会社社債	100,000,000	100,742,000	
第303回北陸電力株式会社社債	100,000,000	101,180,000	
第383回東北電力株式会社社債	200,000,000	218,726,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	100,167,000	
第343回九州電力株式会社社債	100,000,000	109,769,000	
第292回北海道電力株式会社社債	100,000,000	105,429,000	
第20回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	104,868,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	99,710,000	
第19回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	108,582,000	
社債券 小計	11,400,000,000	11,745,784,000	
合計		163,141,473,249	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 「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

(単位：円)

(平成25年12月20日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	14
親投資信託受益証券	46,141,051,588
未収入金	197,349,996
流動資産合計	46,338,401,598
資産合計	46,338,401,598
負債の部	
流動負債	
未払解約金	197,349,996
未払受託者報酬	1,301,991
未払委託者報酬	473,443
その他未払費用	31,500
流動負債合計	199,156,930
負債合計	199,156,930
純資産の部	
元本等	
元本	26,385,636,483
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	19,753,608,185
元本等合計	46,139,244,668
純資産合計	46,139,244,668
負債純資産合計	46,338,401,598



## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	自 平成25年12月 3日 至 平成25年12月20日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

## ( 貸借対照表に関する注記 )

項 目	( 平成25年12月20日現在 )
1. 受益権総数	平成25年12月20日における受益権の総数 26,385,636,483口
2. 1単位当たり純資産額	1.7487円 ( 1万口 = 17,487円 )

## ( 金融商品に関する注記 )

## . 金融商品の状況に関する事項

項 目	自 平成25年12月 3日 至 平成25年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成25年12月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（デリバティブ取引に関する注記）

（平成25年12月20日現在）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

（自平成25年12月3日 至平成25年12月20日）

該当事項はありません。

（その他の注記）

（平成25年12月20日現在）	
期首（平成25年12月 3日）における元本額	27,309,808,470円
期首より平成25年12月20日現在までの追加設定元本額	5,413,703円
期首より平成25年12月20日現在までの一部解約元本額	929,585,690円

（3）附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託 受益証券	外国株式インデックス・マザー ファンド	20,514,428,058	46,141,051,588	
	親投資信託受益証券 小計	20,514,428,058	46,141,051,588	
合計			46,141,051,588	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## （参考情報）

S M A M ・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）は、「外国株式インデックス・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

## 「外国株式インデックス・マザーファンド」の状況

## （１）貸借対照表

（単位：円）	
（平成25年12月20日現在）	
資産の部	
流動資産	
預金	1,025,669,061
コール・ローン	100,613,458
株式	229,249,988,416
投資証券	4,575,310,843
派生商品評価勘定	64,015,994
未収入金	3,083,203,036
未収配当金	332,585,450
未収利息	82
差入委託証拠金	1,294,486,362
流動資産合計	239,725,872,702
資産合計	239,725,872,702
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	9,341,780
未払金	20,043,100
未払解約金	504,134,799
流動負債合計	533,519,679
負債合計	533,519,679
純資産の部	
元本等	
元本	106,343,414,005
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	132,848,939,018
元本等合計	239,192,353,023
純資産合計	239,192,353,023
負債純資産合計	239,725,872,702

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	自 平成25年12月 3日 至 平成25年12月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## ( 貸借対照表に関する注記 )

項 目	( 平成25年12月20日現在 )
1. 受益権総数	平成25年12月20日における受益権の総数 106,343,414,005口
2. 1単位当たり純資産額	2.2492円 ( 1万口 = 22,492円 )

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

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

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成25年12月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(株式、投資証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## (デリバティブ取引に関する注記)

(平成25年12月20日現在)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引  
株式関連

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	SP500 1403	3,309,452,595		3,339,471,509	30,018,914
	FTSE 1403	749,954,753		757,286,338	7,331,585
	DJ EUR 1403	1,074,258,529		1,092,815,035	18,556,506
	小計	5,133,665,877		5,189,572,882	55,907,005
合 計		5,133,665,877		5,189,572,882	55,907,005

## (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。



## 通貨関連

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建				
	米ドル	1,457,540,000		1,461,460,000	3,920,000
	カナダドル	11,468,818		11,536,060	67,242
	オーストラリアドル	184,420,000		185,000,000	580,000
	英ポンド	170,550,000		170,770,000	220,000
	ユーロ	435,859,458		435,584,082	275,376
	小計	2,259,838,276		2,264,350,142	4,511,866
	売建				
	米ドル	1,841,408,721		1,846,361,121	4,952,400
	カナダドル	141,601,914		142,432,125	830,211
	オーストラリアドル	104,286,405		104,614,385	327,980
	英ポンド	296,410,486		296,792,839	382,353
	スイスフラン	121,771,940		121,447,744	324,196
	シンガポールドル	20,425,779		20,373,805	51,974
	スウェーデンクローナ	44,524,499		44,423,473	101,026
	ノルウェークローネ	7,801,836		7,799,994	1,842
	デンマーククローネ	14,616,824		14,604,577	12,247
	ユーロ	406,776,150		406,519,148	257,002
	小計	2,999,624,554		3,005,369,211	5,744,657
合計	5,259,462,830		5,269,719,353	1,232,791	

## (注) 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法について

1. 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しています。  
計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しています。  
計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっています。
  - ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いています。
  - ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いています。
2. 計算期間末日において対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しています。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引  
該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

(自平成25年12月3日 至 平成25年12月20日)

該当事項はありません。

(その他の注記)

(平成25年12月20日現在)

開示対象ファンドの	
期首(平成25年12月3日)における当該親投資信託の元本額	108,558,675,380円
期首より平成25年12月20日現在までの追加設定元本額	25,439,293円
期首より平成25年12月20日現在までの一部解約元本額	2,240,700,668円
平成25年12月20日現在の元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	5,699,620,168円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	169,659,151円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	752,457,023円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	510,733,703円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	35,356,952円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	1,670,921円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	3,288,144円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	4,139,379円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	5,861,244円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	1,652,961円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	5,500,719円
外国株式指数ファンド	239,911,808円
三井住友・DC全海外株式インデックスファンド	16,542,875円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	20,514,428,058円
バランスファンドVA(安定運用型) <適格機関投資家限定>	171,441,473円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型 <適格機関投資家限定>	13,753,697,375円
SMAM・バランスファンドVA25 <適格機関投資家専用>	6,625,636,229円
SMAM・バランスファンドVA37.5 <適格機関投資家専用>	3,754,991,867円
SMAM・バランスファンドVA50 <適格機関投資家専用>	15,670,968,529円
SMAM・バランスファンドVL30 <適格機関投資家限定>	48,918,084円
SMAM・バランスファンドVL50 <適格機関投資家限定>	231,742,484円
世界6資産バランスファンドVA <適格機関投資家限定>	34,431,987円
SMAM・バランスファンドVA75 <適格機関投資家専用>	1,911,605,182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>	129,048,689円
SMAM・インデックス・バランスVA25 <適格機関投資家専用>	384,874,235円
SMAM・インデックス・バランスVA50 <適格機関投資家専用>	1,838,904,052円
SMAM・バランスファンドVA40 <適格機関投資家専用>	3,147,974,182円
SMAM・バランスファンドVA35 <適格機関投資家専用>	4,318,955,513円
SMAM・バランスVA株40T <適格機関投資家限定>	640,191,363円
三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,728,222,007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)	4,948,984,305円
SMAM・グローバルバランス40VA <適格機関投資家限定>	340,831,147円
SMAM・バランスファンドVA20 <適格機関投資家専用>	946,312,508円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	16,926,898,274円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A <適格機関投資家専用>	56,107,607円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A <適格機関投資家専用>	34,442,671円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A <適格機関投資家専用>	14,687,605円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L <適格機関投資家専用>	131,740,373円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L <適格機関投資家専用>	300,269,330円

S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T < 適格機関投資家専用 >	283,651,907円
S M A M ・ F G 新興国重視型バランス20V A < 適格機関投資家限定 >	946,138円
S M A M ・ F G グローバルバランス25V A < 適格機関投資家限定 >	6,115,783円
合 計	106,343,414,005円

( 3 ) 附属明細表  
有価証券明細表

(a) 株式

銘柄	株数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル				
REGENERON PHARMACEUTICALS	6,240	270.55	1,688,232.00	
ANADARKO PETROLEUM CORP	39,535	79.02	3,124,055.70	
APACHE CORPORATION	30,938	86.59	2,678,921.42	
BAKER HUGHES INC	35,432	53.19	1,884,628.08	
CABOT OIL & GAS CORPORATION	32,795	38.31	1,256,376.45	
CAMERON INTERNATIONAL CORP	19,410	58.09	1,127,526.90	
CHENIERE ENERGY INC	17,000	41.45	704,650.00	
CHESAPEAKE ENERGY CORPORATION	42,756	27.21	1,163,390.76	
CHEVRON CORPORATION	152,336	123.22	18,770,841.92	
CIMAREX ENERGY CO	6,980	102.60	716,148.00	
COBALT INTERNATIONAL ENERGY	20,857	14.84	309,517.88	
CONCHO RESOURCES INC	8,662	104.96	909,163.52	
CONOCOPHILLIPS	91,569	69.08	6,325,586.52	
CONSOL ENERGY INC	16,785	38.40	644,544.00	
CONTINENTAL RESOURCES, INC.	3,265	110.53	360,880.45	
CORE LABORATORIES N.V.	3,346	192.36	643,636.56	
DENBURY RESOURCES INC	33,033	16.42	542,401.86	
DEVON ENERGY CORPORATION	29,816	60.75	1,811,322.00	
DIAMOND OFFSHORE DRILLING, INC.	6,436	55.62	357,970.32	
ENSCO PLC-CL A	18,695	55.51	1,037,759.45	
EOG RESOURCES INC	21,429	165.33	3,542,856.57	
EXXON MOBIL CORPORATION	347,099	99.43	34,512,053.57	
FMC TECHNOLOGIES INC	19,693	51.92	1,022,460.56	
HALLIBURTON CO	66,509	49.42	3,286,874.78	
HELMERICH & PAYNE INC	8,500	81.67	694,195.00	
HESS CORPORATION	23,906	80.54	1,925,389.24	
HOLLYFRONTIER CORP	14,797	47.31	700,046.07	
KINDER MORGAN INC	53,794	34.76	1,869,879.44	
KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	8,289	72.43	600,372.27	
MARATHON OIL CORP	55,524	34.91	1,938,342.84	
MARATHON PETROLEUM CORPORATION	24,608	85.71	2,109,151.68	
MURPHY OIL CORPORATION	13,707	64.41	882,867.87	
NABORS INDUSTRIES LTD	20,776	16.15	335,532.40	
NATIONAL-OILWELL VARCO INC.	33,960	77.78	2,641,408.80	
NOBLE CORPORATION PLC	20,718	36.50	756,207.00	
NOBLE ENERGY INC	27,823	67.87	1,888,347.01	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	63,500	92.93	5,901,055.00	
OCEANEERING INTL INC	9,102	76.95	700,398.90	
PEABODY ENERGY CORP	23,953	19.13	458,220.89	
PHILLIPS 66	45,659	72.92	3,329,454.28	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	11,076	187.55	2,077,303.80	
RANGE RESOURCES CORPORATION	12,964	81.78	1,060,195.92	
ROWAN COMPANIES PLC	8,545	32.94	281,472.30	
SCHLUMBERGER LTD	104,305	86.47	9,019,253.35	
SOUTHWESTERN ENERGY COMPANY	27,642	39.50	1,091,859.00	
SPECTRA ENERGY CORPORATION	52,662	33.89	1,784,715.18	

SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	11,900	25.16	299,404.00
TESORO CORPORATION	9,883	56.39	557,302.37
VALERO ENERGY CORP	42,524	46.66	1,984,169.84
WEATHERFORD INTL LTD	62,411	14.91	930,548.01
WHITING PETROLEUM CORP	9,800	61.46	602,308.00
WILLIAMS COS INC	54,585	36.89	2,013,640.65
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	16,293	110.92	1,807,219.56
AIRGAS INC	5,440	109.95	598,128.00
ALBEMARLE CORPORATION	6,700	63.13	422,971.00
ALCOA INC	85,476	9.97	852,195.72
ASHLAND INC	6,169	94.29	581,675.01
BALL CORPORATION	10,848	50.75	550,536.00
CELANESE CORPORATION	13,670	54.34	742,827.80
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	4,397	228.02	1,002,603.94
CROWN HOLDINGS INC	12,051	43.67	526,267.17
DOW CHEMICAL	95,233	43.90	4,180,728.70
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	72,683	62.71	4,557,950.93
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	12,234	75.01	917,672.34
ECOLAB INC	21,414	102.95	2,204,571.30
FMC CORPORATION	11,200	73.02	817,824.00
FREEMPORT-MCMORAN COPPER-B	81,599	35.19	2,871,468.81
INTERNATIONAL PAPER CO	33,712	48.85	1,646,831.20
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	7,042	85.10	599,274.20
LYONDELLBASELL INDU-CL A	33,431	77.96	2,606,280.76
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,293	95.98	316,062.14
MEADWESTVACO CORP	14,015	36.16	506,782.40
MONSANTO CO	42,005	113.81	4,780,589.05
MOSAIC CO/THE	24,260	44.68	1,083,936.80
NEWMONT MINING CORP	39,416	22.76	897,108.16
NUCOR CORP	25,243	52.39	1,322,480.77
OWENS-ILLINOIS INC	12,465	34.59	431,164.35
PPG INDUSTRIES INC	11,219	185.30	2,078,880.70
PRAXAIR INC	23,183	127.15	2,947,718.45
ROCK-TENN COMPANY CL A	5,132	102.03	523,617.96
SEALED AIR CORP	16,038	32.55	522,036.90
SIGMA-ALDRICH	8,703	89.88	782,225.64
VULCAN MATERIALS CO	8,903	57.16	508,895.48
WEYERHAEUSER CO	44,881	31.27	1,403,428.87
3M COMPANY	51,173	136.41	6,980,508.93
AGCO CORP	7,454	57.16	426,070.64
AMETEK INC	19,199	51.37	986,252.63
BE AEROSPACE INC	8,962	85.14	763,024.68
BOEING CO	56,493	135.17	7,636,158.81
CATERPILLAR INC	50,974	87.54	4,462,263.96
CHICAGO BRIDGE & IRON COMPANY NV	7,171	80.98	580,707.58
CUMMINS INC	13,972	137.20	1,916,958.40
DANAHER CORP	46,511	76.58	3,561,812.38
DEERE & CO	28,955	89.41	2,588,866.55
DOVER CORP	13,071	93.17	1,217,825.07
EATON CORP PLC	37,254	74.48	2,774,677.92
EMERSON ELECTRIC CO	56,221	68.66	3,860,133.86
FASTENAL COMPANY	23,414	48.01	1,124,106.14
FLOWSERVE CORPORATION	10,634	75.22	799,889.48
FLUOR CORP	12,524	78.83	987,266.92

GENERAL DYNAMICS CORP	23,829	92.66	2,207,995.14	
GENERAL ELECTRIC CO	803,330	27.32	21,946,975.60	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	58,753	88.64	5,207,865.92	
ILLINOIS TOOL WORKS	33,446	81.82	2,736,551.72	
INGERSOLL-RAND PLC	23,171	59.15	1,370,564.65	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	11,390	60.57	689,892.30	
JOY GLOBAL INC	9,260	54.08	500,780.80	
KBR, INC.	10,985	29.80	327,353.00	
L-3 COMMUNICATIONS HLDGS INC	7,770	104.57	812,508.90	
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	21,451	142.99	3,067,278.49	
MASCO CORP	30,586	21.67	662,798.62	
NORTHROP GRUMMAN CORP	17,473	110.55	1,931,640.15	
PACCAR INC	27,591	57.29	1,580,688.39	
PALL CORPORATION	8,746	84.52	739,211.92	
PARKER HANNIFIN CORPORATION	11,519	123.87	1,426,858.53	
PENTAIR LTD-REGISTERED	15,067	74.89	1,128,367.63	
PRECISION CASTPARTS CORP	11,444	263.89	3,019,957.16	
QUANTA SERVICES INC	17,759	30.28	537,742.52	
RAYTHEON COMPANY	25,056	88.49	2,217,205.44	
ROCKWELL AUTOMATION INC	11,360	114.03	1,295,380.80	
ROCKWELL COLLINS INC.	9,671	71.90	695,344.90	
ROPER INDUSTRIES INC	7,990	133.94	1,070,180.60	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	10,000	37.88	378,800.00	
SPX CORP	3,480	96.21	334,810.80	
TEXTRON INC	21,069	32.57	686,217.33	
THE ADT CORPORATION	16,959	39.95	677,512.05	
TRANSDIGM GROUP INC	3,993	156.64	625,463.52	
TYCO INTERNATIONAL LTD	35,987	38.91	1,400,254.17	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	68,702	109.50	7,522,869.00	
WW GRAINGER INC	4,811	253.39	1,219,059.29	
XYLEM INC	14,066	34.16	480,494.56	
AVERY DENNISON CORP	7,162	49.33	353,301.46	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,358	514.58	1,213,379.64	
CINTAS CORP	8,248	56.48	465,847.04	
DUN & BRADSTREET CORP	2,874	117.97	339,045.78	
EQUIFAX INC	10,702	67.07	717,783.14	
IHS INC-CLASS A	4,319	116.44	502,904.36	
IRON MOUNTAIN INC	10,136	29.23	296,275.28	
MANPOWERGROUP	6,492	83.50	542,082.00	
NETFLIX INC	4,027	376.74	1,517,131.98	
NIELSEN HOLDINGS NV	20,403	45.13	920,787.39	
REPUBLIC SERVICES INC	24,904	33.00	821,832.00	
ROBERT HALF INTL INC	9,817	39.74	390,127.58	
STERICYCLE, INC.	6,534	114.53	748,339.02	
TOWERS WATSON & CO-CL A	4,910	123.63	607,023.30	
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	12,400	65.85	816,540.00	
WASTE MANAGEMENT INC	34,584	43.89	1,517,891.76	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	9,951	71.95	715,974.45	
C.H.ROBINSON WORLDWIDE, INC.	11,996	56.48	677,534.08	
CSX CORPORATION	81,086	27.88	2,260,677.68	
DELTA AIR LINES INC	16,020	27.51	440,710.20	
EXPEDITORS INTL WASH INC	15,502	42.96	665,965.92	
FEDEX CORP	23,621	139.69	3,299,617.49	
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	31,575	25.41	802,320.75	

J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	6,780	76.02	515,415.60
KANSAS CITY SOUTHERN	8,919	120.60	1,075,631.40
NORFOLK SOUTHERN CORP	25,021	90.51	2,264,650.71
SOUTHWEST AIRLINES	11,631	18.62	216,569.22
UNION PACIFIC CORP	36,555	164.19	6,001,965.45
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	8,200	37.27	305,614.00
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	56,863	103.18	5,867,124.34
AUTOLIV INC	7,900	89.27	705,233.00
BORGWARNER INC	9,172	54.59	500,699.48
BORGWARNER INC NEW	9,172	54.59	500,699.48
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	23,379	58.97	1,378,659.63
FORD MOTOR COMPANY	289,353	15.30	4,427,100.90
GENERAL MOTORS CO	77,155	40.30	3,109,346.50
HARLEY-DAVIDSON INC	17,925	68.20	1,222,485.00
JOHNSON CONTROLS INC	54,464	50.16	2,731,914.24
TESLA MOTORS INC	6,373	140.72	896,808.56
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	9,309	73.07	680,208.63
BEAM INC	11,023	66.94	737,879.62
COACH INC	22,230	55.43	1,232,208.90
D.R.HORTON INC	25,053	20.16	505,068.48
FOSSIL GROUP INC	4,050	118.81	481,180.50
GARMIN LTD	9,416	45.70	430,311.20
HASBRO INC	10,014	52.27	523,431.78
LEGGETT & PLATT INC	12,915	30.26	390,807.90
LULULEMON ATHLETICA INC	7,335	58.77	431,077.95
MATTEL INC	26,011	45.07	1,172,315.77
MICHAEL KORS HOLDINGS LIMITED	14,798	83.92	1,241,848.16
MOHAWK INDUSTRIES INC	5,003	143.50	717,930.50
NEWELL RUBBERMAID INC	24,022	32.10	771,106.20
NIKE INC -CL B	55,863	78.26	4,371,838.38
POLARIS INDUSTRIES INC	5,360	139.59	748,202.40
PULTE GROUP INC	26,400	18.25	481,800.00
PVH CORP	6,401	130.98	838,402.98
RALPH LAUREN CORPORATION	4,851	175.14	849,604.14
STANLEY BLACK & DECKER INC	11,693	80.73	943,975.89
TOLL BROTHERS INC	12,242	34.22	418,921.24
UNDER ARMOUR INC	7,125	86.05	613,106.25
VF CORP	6,709	238.48	1,599,962.32
WHIRLPOOL CORP	6,184	153.52	949,367.68
CARNIVAL CORP	32,089	38.05	1,220,986.45
DARDEN RESTAURANTS INC	11,240	51.02	573,464.80
H&R BLOCK INC	22,392	28.48	637,724.16
INTL GAME TECHNOLOGY	17,886	17.25	308,533.50
LAS VEGAS SANDS CORP	32,177	77.09	2,480,524.93
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	20,599	47.72	982,984.28
MCDONALD'S CORPORATION	78,791	95.14	7,496,175.74
MGM MIRAGE	32,000	22.61	723,520.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	11,271	45.91	517,451.61
STARBUCKS CORP	58,939	77.15	4,547,143.85
STARWOOD HOTELS & RESORTS	15,290	77.76	1,188,950.40
WYNN RESORTS LTD	6,110	185.11	1,131,022.10
YUM! BRANDS INC	35,523	72.75	2,584,298.25
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	15,920	17.16	273,187.20
CBS CORP-CL B	45,013	60.72	2,733,189.36

CHARTER COMMUNICATTION-A	4,800	129.12	619,776.00
COMCAST CORP-CL A	168,068	50.78	8,534,493.04
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	38,450	48.72	1,873,284.00
DIRECTV	41,518	65.93	2,737,281.74
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-A	11,470	86.32	990,090.40
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-C	6,869	79.71	547,527.99
DISH NETWORK CORP.	16,614	55.83	927,559.62
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	34,770	16.78	583,440.60
LIBERTY GLOBAL PLC-A	16,453	85.64	1,409,034.92
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	13,686	80.91	1,107,334.26
LIBERTY MEDIA CORP	7,584	143.27	1,086,559.68
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	21,280	73.82	1,570,889.60
NEWS CORP-CLASS A	27,668	17.36	480,316.48
OMNICOM GROUP	20,251	72.60	1,470,222.60
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	6,059	83.36	505,078.24
SIRIUS XM HOLDINGS INC	237,000	3.43	812,910.00
THE WALT DISNEY CO.	133,733	72.97	9,758,497.01
TIME WARNER CABLE, INC.	22,762	133.74	3,044,189.88
TIME WARNER INC	72,428	67.90	4,917,861.20
TWENTY-FIRST CE CL-A	118,815	33.97	4,036,145.55
TWENTY-FIRST CE CL-B	33,405	33.22	1,109,714.10
VIACOM INC-CLASS B	33,894	84.12	2,851,163.28
ADVANCE AUTO PARTS	6,138	108.40	665,359.20
AMAZON.COM INC	28,803	395.19	11,382,657.57
AUTOZONE INC	2,785	470.84	1,311,289.40
BED BATH & BEYOND INC	17,273	77.52	1,339,002.96
BEST BUY COMPANY INC	22,538	41.35	931,946.30
CARMAX INC	17,033	53.05	903,600.65
DICK'S SPORTING GOODS INC	7,600	56.06	426,056.00
DOLLAR GENERAL CORP	23,844	59.56	1,420,148.64
DOLLAR TREE INC	18,178	55.30	1,005,243.40
EXPEDIA INC	9,491	66.79	633,951.34
FAMILY DOLLAR STORES	7,804	63.58	496,178.32
GAMESTOP CORP-CL A	9,747	49.87	486,082.89
GAP INC/THE	23,645	38.29	905,367.05
GENUINE PARTS CO	11,919	81.60	972,590.40
HOME DEPOT INC	112,893	79.95	9,025,795.35
KOHL'S CORP	17,074	54.62	932,581.88
L BRANDS INC	19,280	60.92	1,174,537.60
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION-A	38,772	28.22	1,094,145.84
LKQ CORPORATION	24,945	32.51	810,961.95
LOWE'S COMPANIES INC	82,430	48.39	3,988,787.70
MACY'S INC	30,074	52.23	1,570,765.02
NORDSTROM INC	13,168	60.24	793,240.32
O'REILLY AUTOMOTIVE INC NEW	8,562	129.14	1,105,696.68
PETSMART INC	8,619	72.19	622,205.61
PRICELINE.COM INC	4,045	1,191.57	4,819,900.65
ROSS STORES INC	17,080	73.32	1,252,305.60
SEARS HOLDINGS CORP	2,090	45.49	95,074.10
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,917	180.15	1,246,097.55
STAPLES INC	54,035	15.58	841,865.30
TARGET CORP	47,749	62.15	2,967,600.35
TIFFANY & CO	10,018	90.43	905,927.74
TJX COMPANIES INC	56,009	62.55	3,503,362.95



TRACTOR SUPPLY COMPANY	10,068	74.07	745,736.76	
TRIPADVISOR INC-W/I	9,218	82.02	756,060.36	
ULTA SALON COSMETICS & FRAGRANCE INC	4,920	93.44	459,724.80	
URBAN OUTFITTERS, INC.	8,165	35.72	291,653.80	
COSTCO WHOLESALE CORP	34,364	117.99	4,054,608.36	
CVS CAREMARK CORPORATION	96,724	70.14	6,784,221.36	
KROGER CO	38,352	39.67	1,521,423.84	
SAFEWAY INC	19,049	32.82	625,188.18	
SYSCO CORP	45,670	36.26	1,655,994.20	
WALGREEN CO	70,489	56.94	4,013,643.66	
WAL-MART STORES INC	129,152	77.24	9,975,700.48	
WHOLE FOODS MARKET INC	29,101	58.75	1,709,683.75	
ALTRIA GROUP INC	157,928	38.22	6,036,008.16	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	52,753	43.79	2,310,053.87	
BROWN-FORMAN CORPORATION	8,992	74.43	669,274.56	
BUNGE LIMITED	11,530	81.26	936,927.80	
CAMPBELL SOUP CO	16,974	43.20	733,276.80	
COCA-COLA CO/THE	314,550	39.86	12,537,963.00	
COCA-COLA ENTERPRISES INC	20,031	42.39	849,114.09	
CONAGRA FOODS INC	32,989	33.47	1,104,141.83	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	13,123	69.48	911,786.04	
DR.PEPPER SNAPPLE GROUP, INC	16,170	47.80	772,926.00	
GENERAL MILLS INC	50,257	49.36	2,480,685.52	
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTERS, INC.	9,584	76.25	730,780.00	
HORMEL FOODS CORPORATION	12,461	44.98	560,495.78	
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	8,425	101.95	858,928.75	
KELLOGG CO	20,657	60.60	1,251,814.20	
KRAFT FOODS GROUP INC	46,632	53.18	2,479,889.76	
LORILLARD INC	30,479	49.78	1,517,244.62	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	8,922	68.40	610,264.80	
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	15,551	83.35	1,296,175.85	
MOLSON COORS BREWING COMPANY	11,734	54.97	645,017.98	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	133,168	34.43	4,584,974.24	
MONSTER BEVERAGE CORPORATION	11,045	66.24	731,620.80	
PEPSICO INC	121,574	81.66	9,927,732.84	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	127,596	85.48	10,906,906.08	
REYNOLDS AMERICAN INC	26,976	48.82	1,316,968.32	
THE HERSHEY COMPANY	11,634	96.26	1,119,888.84	
TYSON FOODS INC-CL A	22,881	33.84	774,293.04	
AVON PRODUCTS INC	34,724	17.16	595,863.84	
CHURCH & DWIGHT CO INC	11,787	65.75	774,995.25	
CLOROX COMPANY	10,154	92.54	939,651.16	
COLGATE-PALMOLIVE COMPANY	73,043	64.24	4,692,282.32	
ENERGIZER HOLDINGS INC	4,697	106.57	500,559.29	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	18,973	73.91	1,402,294.43	
HERBALIFE LTD	6,836	79.58	544,008.88	
KIMBERLY-CLARK CORP	30,484	104.38	3,181,919.92	
PROCTER & GAMBLE CO	215,909	81.90	17,682,947.10	
AETNA INC	29,745	66.63	1,981,909.35	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	15,131	130.75	1,978,378.25	
AMERISOURCEBERGEN CORP	18,662	69.63	1,299,435.06	
BARD(C.R.) INC	5,480	131.96	723,140.80	
BAXTER INTERNATIONAL INC	43,061	67.06	2,887,670.66	
BECTON DICKINSON & CO	14,964	108.02	1,616,411.28	

BOSTON SCIENTIFIC CORP	103,103	11.62	1,198,056.86	
CARDINAL HEALTH INC	27,085	66.77	1,808,465.45	
CAREFUSION CORPORATION	15,998	39.54	632,560.92	
CERNER CORP	24,515	54.69	1,340,725.35	
CIGNA CORP	22,309	85.32	1,903,403.88	
COVIDIEN PLC	36,049	67.42	2,430,423.58	
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	13,956	61.69	860,945.64	
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	10,509	48.33	507,899.97	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	8,248	63.97	527,624.56	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	64,061	67.88	4,348,780.98	
HCA HOLDINGS, INC.	24,123	45.66	1,101,456.18	
HENRY SCHEIN INC	7,500	112.05	840,375.00	
HOLOGIC INC	22,380	22.44	502,207.20	
HOSPIRA INC	13,589	41.05	557,828.45	
HUMANA INC.	12,773	101.69	1,298,886.37	
INTUITIVE SURGICAL INC	2,990	359.10	1,073,709.00	
LABORATORY CRP OF AMR HLDGS	6,792	89.61	608,631.12	
MCKESSON CORP	18,220	160.59	2,925,949.80	
MEDTRONIC INC	79,296	57.17	4,533,352.32	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	2,655	240.72	639,111.60	
OMNICARE INC	8,895	59.64	530,497.80	
PATTERSON COS INC	6,332	40.52	256,572.64	
QUEST DIAGNOSTICS	11,900	52.79	628,201.00	
RESMED INC	12,100	45.65	552,365.00	
ST JUDE MEDICAL INC	22,288	60.82	1,355,556.16	
STRYKER CORP	23,308	73.85	1,721,295.80	
UNITEDHEALTH GROUP INC	80,128	72.39	5,800,465.92	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	6,576	79.02	519,635.52	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	9,467	76.77	726,781.59	
WELLPOINT INC	24,129	88.75	2,141,448.75	
ZIMMER HOLDINGS INC	13,564	92.61	1,256,162.04	
ABBOTT LABORATORIES	122,280	38.03	4,650,308.40	
ABBVIE INC	124,872	52.63	6,572,013.36	
ACTAVIS PLC	13,564	165.29	2,241,993.56	
ALLERGAN INC	23,496	103.76	2,437,944.96	
AMGEN INC	59,359	112.60	6,683,823.40	
BIOGEN IDEC INC	18,713	277.21	5,187,430.73	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	12,000	68.36	820,320.00	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	129,684	53.84	6,982,186.56	
CELGENE CORP	32,394	164.02	5,313,263.88	
ELI LILLY & CO	79,765	50.14	3,999,417.10	
FOREST LABORATORIES, INC.	19,632	56.93	1,117,649.76	
GILEAD SCIENCES INC	120,689	73.43	8,862,193.27	
ILLUMINA INC	9,872	103.51	1,021,850.72	
JOHNSON & JOHNSON	222,232	91.98	20,440,899.36	
LIFE TECHNOLOGIES CORPORATION	13,716	75.64	1,037,478.24	
MERCK & CO. INC.	230,754	48.79	11,258,487.66	
MYLAN INC	29,347	42.53	1,248,127.91	
PERRIGO CO PLC	7,063	151.14	1,067,501.82	
PERRIGO CO PLC NEW	3,219	151.14	486,519.66	
PFIZER INC	522,060	30.71	16,032,462.60	
PHARMACYCLICS INC	4,497	101.41	456,040.77	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	28,596	108.16	3,092,943.36	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	18,414	69.95	1,288,059.30	

WATERS CORP	6,721	99.02	665,513.42	
ZOETIS INC	37,880	32.31	1,223,902.80	
BB & T CORPORATION	55,567	36.59	2,033,196.53	
COMERICA INC	16,046	46.54	746,780.84	
FIFTH THIRD BANCORP	65,251	20.67	1,348,738.17	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	7,100	51.52	365,792.00	
HUDSON CITY BANCORP INC	34,269	9.14	313,218.66	
KEYCORP	70,409	13.27	934,327.43	
M & T BANK CORP	9,259	113.73	1,053,026.07	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	33,868	16.34	553,403.12	
OCWEN FINANCIAL CORP	10,375	54.94	570,002.50	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	28,000	14.55	407,400.00	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	42,296	76.00	3,214,496.00	
REGIONS FINANCIAL CORPORATION	112,022	9.59	1,074,290.98	
SUNTRUST BANKS INC	42,382	36.11	1,530,414.02	
US BANCORP	144,800	40.04	5,797,792.00	
WELLS FARGO & COMPANY	397,691	45.02	17,904,048.82	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	4,180	208.17	870,150.60	
AMERICAN EXPRESS COMPANY	76,459	86.41	6,606,822.19	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	15,428	110.84	1,710,039.52	
BANK OF AMERICA CORP	846,687	15.75	13,335,320.25	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP(THE)	91,531	33.87	3,100,154.97	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	87,058	116.36	10,130,068.88	
BLACKROCK INC	10,518	308.39	3,243,646.02	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	46,584	73.64	3,430,445.76	
CIT GROUP INC	14,368	50.43	724,578.24	
CITIGROUP INC	239,710	51.88	12,436,154.80	
CME GROUP INC.	25,388	83.68	2,124,467.84	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	38,652	53.90	2,083,342.80	
EATON VANCE CORP	10,700	42.23	451,861.00	
FRANKLIN RESOURCES INC	32,449	55.67	1,806,435.83	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	33,590	174.77	5,870,524.30	
INTERCONTINENTALEXCHANGE GROUP	8,872	222.63	1,975,173.36	
INVESCO LIMITED	35,853	35.25	1,263,818.25	
JPMORGAN CHASE & CO	296,748	57.23	16,982,888.04	
LEGG MASON INC	7,803	43.37	338,416.11	
LEUCADIA NATIONAL CORPORATION	22,652	27.41	620,891.32	
MOODY'S CORP	15,988	74.20	1,186,309.60	
MORGAN STANLEY	115,445	30.86	3,562,632.70	
NASDAQ STOCK MARKET INC	8,849	39.46	349,181.54	
NORTHERN TRUST CORP	17,548	59.28	1,040,245.44	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	11,000	50.61	556,710.00	
SCHWAB (CHARLES) CORP	91,519	25.58	2,341,056.02	
SEI INVESTMENTS COMPANY	11,024	34.04	375,256.96	
SLM CORPORATION	35,970	25.94	933,061.80	
STATE STREET CORP	34,838	71.03	2,474,543.14	
T ROWE PRICE GROUP INC	20,160	82.13	1,655,740.80	
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	18,694	30.41	568,484.54	
ACE LIMITED	26,588	100.36	2,668,371.68	
AFLAC INC	36,327	66.00	2,397,582.00	
ALLEGHANY CORPORATION	1,217	395.46	481,274.82	
ALLSTATE CORP	37,406	53.25	1,991,869.50	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	110,444	50.36	5,561,959.84	
AON PLC	22,970	83.09	1,908,577.30	

ARCH CAPITAL GROUP LTD.	10,038	57.83	580,497.54	
ASSURANT INC	5,174	65.17	337,189.58	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	9,103	46.64	424,563.92	
CHUBB CORP	20,392	93.63	1,909,302.96	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	13,350	51.40	686,190.00	
EVEREST RE GROUP LTD	3,809	150.24	572,264.16	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL INC-CL A	19,214	31.38	602,935.32	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	33,364	35.52	1,185,089.28	
LINCOLN NATIONAL CORP	20,736	51.31	1,063,964.16	
LOEWS CORPORATION	24,942	47.27	1,179,008.34	
MARSH & MCLENNAN COS	43,424	48.07	2,087,391.68	
METLIFE INC	73,211	52.27	3,826,738.97	
PARTNERRE LTD	4,297	100.03	429,828.91	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	22,144	48.20	1,067,340.80	
PROGRESSIVE CORP	43,145	26.70	1,151,971.50	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	36,845	90.17	3,322,313.65	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,963	91.86	364,041.18	
TORCHMARK CORPORATION	6,679	77.00	514,283.00	
TRAVELERS COS INC(THE)	29,694	88.79	2,636,530.26	
UNUM GROUP	20,699	34.29	709,768.71	
W.R.BERKLEY CORPORATION	8,584	42.41	364,047.44	
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	12,334	44.63	550,466.42	
XL GROUP PLC	22,449	30.74	690,082.26	
CBRE GROUP INC-A	23,131	25.56	591,228.36	
LENNAR CORP-CL A	12,312	37.04	456,036.48	
REALOGY HOLDINGS CORP	10,601	47.37	502,169.37	
ACCENTURE PLC-CL A	50,646	79.51	4,026,863.46	
ACTIVISION BLIZZARD INC	37,020	17.66	653,773.20	
ADOBE SYSTEMS INC	37,670	58.13	2,189,757.10	
AKAMAI TECHNOLOGIES	13,948	46.60	649,976.80	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,918	251.00	983,418.00	
ANSYS INC	6,700	85.84	575,128.00	
AUTODESK INC	16,190	48.04	777,848.55	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	38,491	79.42	3,057,147.67	
CA INC	25,374	32.90	834,804.60	
CITRIX SYSTEMS INC	13,961	59.12	825,374.32	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATION	23,340	97.02	2,264,446.80	
COMPUTER SCIENCES CORP	12,684	54.35	689,375.40	
EBAY INC	91,706	53.40	4,897,100.40	
ELECTRONIC ARTS INC	25,530	23.42	597,912.60	
EQUINIX INC	3,661	169.06	618,928.66	
F5 NETWORKS INC	6,711	84.98	570,300.78	
FACEBOOK INC-A	136,001	55.05	7,486,855.05	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	23,066	52.19	1,203,814.54	
FISERV INC	10,761	57.27	616,282.47	
FISERV INC-NEW	10,761	57.27	616,282.47	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	6,100	117.06	714,066.00	
GOOGLE INC-CL A	21,600	1,086.22	23,462,352.00	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	82,021	180.22	14,781,824.62	
INTUIT INC	22,456	75.69	1,699,694.64	
LEIDOS HOLDINGS INC	6,500	44.28	287,820.00	
LINKEDIN CORP-A	7,706	219.07	1,688,153.42	
MASTERCARD INC-CL A	8,223	805.38	6,622,639.74	
MICROSOFT CORP	623,885	36.26	22,622,070.10	

NETSUITE INC	3,000	94.69	284,070.00
NUANCE COMMUNICATIONS INC	19,200	14.96	287,232.00
ORACLE CORPORATION	273,643	36.60	10,015,333.80
PAYCHEX INC	25,949	44.90	1,165,110.10
RACKSPACE HOSTING INC	9,400	35.94	337,836.00
RED HAT INC	15,711	49.00	769,839.00
SALESFORCE.COM, INC.	44,979	53.07	2,387,035.53
SERVICENOW INC	8,910	50.84	452,984.40
SYMANTEC CORPORATION	53,662	22.99	1,233,689.38
SYNOPSYS INC	12,055	39.14	471,832.70
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	12,619	32.74	413,146.06
VANTIV INC-CL A	10,000	30.17	301,700.00
VERISIGN INC	11,646	58.13	676,981.98
VISA INC	40,537	216.08	8,759,234.96
VMWARE INC	6,900	87.35	602,715.00
WESTERN UNION COMPANY	41,384	16.88	698,561.92
WORKDAY INC-CLASS A	4,585	80.13	367,396.05
YAHOO! INC	77,150	40.20	3,101,430.00
AGILENT TECHNOLOGIES INC	26,276	57.38	1,507,716.88
AMPHENOL CORPORATION -CL A	12,978	87.03	1,129,475.34
APPLE INC	71,646	544.46	39,008,381.16
ARROW ELECTRONICS INC	8,507	51.83	440,917.81
AVAGO TECHNOLOGIES LTD.	19,363	51.44	996,032.72
AVNET INC	10,200	42.36	432,072.00
CISCO SYSTEMS INC	421,016	21.07	8,870,807.12
CORNING INC	114,909	17.42	2,001,714.78
EMC CORP/MASS	163,710	24.02	3,932,314.20
FLEXTRONICS INTL LTD	44,748	7.38	330,240.24
FLIR SYSTEMS INC	12,640	28.67	362,388.80
HARRIS CORP	8,650	67.96	587,854.00
HEWLETT-PACKARD CO	151,755	28.04	4,255,210.20
JUNIPER NETWORKS INC	39,623	21.20	840,007.60
MOTOROLA SOLUTIONS INC	18,917	65.85	1,245,684.45
NETAPP INC	26,794	40.64	1,088,908.16
QUALCOMM INC	135,187	72.43	9,791,594.41
SANDISK CORP	18,714	68.66	1,284,903.24
SEAGATE TECHNOLOGY	24,659	52.49	1,294,350.91
TE CONNECTIVITY LTD	32,941	53.01	1,746,202.41
TERADATA CORP	12,269	42.18	517,506.42
TRIMBLE NAVIGATION LTD	22,400	32.71	732,704.00
WESTERN DIGITAL CORP	16,539	82.10	1,357,851.90
XEROX CORP	90,848	11.78	1,070,189.44
AT&T INC	418,580	34.45	14,420,081.00
CENTURYLINK INC	47,794	31.36	1,498,819.84
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	26,065	73.00	1,902,745.00
FRONTIER COMMUNICATIONS CORPORATION	85,959	4.73	406,586.07
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	11,667	31.99	373,227.33
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	9,746	87.21	849,948.66
SPRINT CORP	72,631	9.24	671,110.44
T-MOBILE US INC	18,949	29.61	561,079.89
VERIZON COMMUNICATIONS INC	225,522	48.43	10,922,030.46
WINDSTREAM HOLDINGS INC	51,749	8.15	421,754.35
AES CORPORATION	54,480	14.12	769,257.60
ALLIANT ENERGY CORP	9,548	51.26	489,430.48

AMEREN CORPORATION	18,724	35.79	670,131.96	
AMERICAN ELECTRIC POWER	38,242	46.38	1,773,663.96	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	15,687	41.84	656,344.08	
CALPINE CORP	31,000	19.31	598,610.00	
CENTERPOINT ENERGY INC	31,009	22.76	705,764.84	
CMS ENERGY CORPORATION	21,600	26.67	576,072.00	
CONSOLIDATED EDISON INC	23,159	54.85	1,270,271.15	
DOMINION RESOURCES INC/VA	45,527	64.50	2,936,491.50	
DTE ENERGY COMPANY	13,504	65.60	885,862.40	
DUKE ENERGY CORP	55,544	69.19	3,843,089.36	
EDISON INTERNATIONAL	23,741	46.12	1,094,934.92	
ENERGEN CORPORATION	5,900	68.26	402,734.00	
ENTERGY CORP	14,463	61.56	890,342.28	
EQT CORPORATION	11,480	87.27	1,001,859.60	
EXELON CORP	67,667	27.22	1,841,895.74	
FIRSTENERGY CORP	34,392	31.60	1,086,787.20	
INTEGRYS ENERGY GROUP, INC.	6,500	54.01	351,065.00	
MDU RESOURCES GROUP INC	15,000	29.49	442,350.00	
NEXTERA ENERGY INC	33,385	83.73	2,795,326.05	
NISOURCE INC	23,806	31.50	749,889.00	
NORTHEAST UTILITIES	23,786	41.88	996,157.68	
NRG ENERGY INC	23,225	28.42	660,054.50	
OGE ENERGY CORP	16,212	33.37	540,994.44	
ONEOK INC	15,984	59.10	944,654.40	
P G & E CORPORATION	34,303	40.22	1,379,666.66	
PEPCO HOLDINGS INC	21,434	18.62	399,101.08	
PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	8,744	53.10	464,306.40	
PPL CORPORATION	49,003	29.33	1,437,257.99	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	38,964	31.65	1,233,210.60	
QEP RESOURCES INC	14,066	30.46	428,450.36	
SCANA CORP	9,864	47.02	463,805.28	
SEMPRA ENERGY	18,205	88.31	1,607,683.55	
SOUTHERN CO	68,703	40.79	2,802,395.37	
WISCONSIN ENERGY CORP	17,532	41.23	722,844.36	
XCEL ENERGY INC	40,665	28.15	1,144,719.75	
ALTERA CORPORATION	25,331	31.26	791,847.06	
ANALOG DEVICES INC	24,702	49.66	1,226,701.32	
APPLIED MATERIALS INC	94,548	16.88	1,595,970.24	
BROADCOM CORP-CL A	41,688	28.74	1,198,113.12	
CREE INC	9,558	57.98	554,172.84	
INTEL CORP	392,526	25.14	9,868,103.64	
KLA-TENCOR CORPORATION	12,832	62.70	804,566.40	
LAM RESEARCH CORP	12,446	53.02	659,886.92	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	19,862	44.54	884,653.48	
LSI CORPORATION	47,857	10.93	523,077.01	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	27,720	13.45	372,834.00	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	23,000	27.93	642,390.00	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	13,842	42.69	590,914.98	
MICRON TECHNOLOGY INC	80,050	21.62	1,730,681.00	
NVIDIA CORP	47,502	15.38	730,580.76	
TEXAS INSTRUMENTS INC	86,472	42.46	3,671,601.12	
XILINX INC	22,223	44.31	984,701.13	
米ドル小計	23,794,937		1,312,357,383.12	
(邦貨換算額：円)			(137,010,110,797)	

カナダドル				
ALTAGAS LTD	10,000	40.37	403,700.00	
ARC RESOURCES LTD	26,250	29.32	769,650.00	
ATHABASCA OIL CORP	29,700	6.19	183,843.00	
BAYTEX ENERGY CORPORATION	10,407	41.61	433,035.27	
CAMECO CORP	33,443	22.26	744,441.18	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	85,490	35.02	2,993,859.80	
CANADIAN OIL SANDS LTD	40,316	19.90	802,288.40	
CENOVUS ENERGY INC	60,172	30.00	1,805,160.00	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	31,284	41.11	1,286,085.24	
ENBRIDGE INC	62,260	45.33	2,822,245.80	
ENCANA CORP	58,095	19.27	1,119,490.65	
ENERPLUS CORP	13,590	19.52	265,276.80	
HUSKY ENERGY INC	27,593	32.77	904,222.61	
IMPERIAL OIL LTD	22,609	46.89	1,060,136.01	
KEYERA CORP	5,200	63.60	330,720.00	
MEG ENERGY CORPORATION	12,587	30.15	379,498.05	
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORPORATION	22,264	18.53	412,551.92	
PEMBINA PIPELINE CORP	23,245	36.60	850,767.00	
PENGROWTH ENERGY CORPORATION	38,700	6.69	258,903.00	
PENN WEST PETROLEUM LTD	30,053	9.07	272,580.71	
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	12,000	32.43	389,160.00	
SUNCOR ENERGY INC	118,122	36.48	4,309,090.56	
TALISMAN ENERGY INC	82,174	12.42	1,020,601.08	
TOURMALINE OIL CORP	12,700	45.05	572,135.00	
TRANSCANADA CORP	55,559	47.94	2,663,498.46	
VERMILION ENERGY INC	6,799	61.06	415,146.94	
AGNICO EAGLE MINES LIMITED	11,631	26.75	311,129.25	
AGRIUM INC	11,977	96.65	1,157,577.05	
BARRICK GOLD CORP	90,856	17.68	1,606,334.08	
ELDORADO GOLD CORPORATION	49,231	5.79	285,047.49	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	45,032	17.93	807,423.76	
FRANCO-NEVADA CORPORATION	10,368	42.30	438,566.40	
GOLDCORP INC	63,657	22.24	1,415,731.68	
KINROSS GOLD CORP	99,958	4.69	468,803.02	
METHANEX CORPORATION	6,955	60.14	418,273.70	
NEW GOLD INC	44,500	5.21	231,845.00	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	68,946	33.47	2,307,622.62	
SILVER WHEATON CORPORATION	30,361	21.07	639,706.27	
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	44,611	25.66	1,144,718.26	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	58,320	3.40	198,288.00	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD-RTS	23,320	0.86	20,055.20	
YAMANA GOLD INC	64,554	9.01	581,631.54	
BOMBARDIER INC 'B'	106,479	4.63	492,997.77	
CAE INC	16,932	13.45	227,735.40	
FINNING INTERNATIONAL INC	14,195	26.07	370,063.65	
SNC-LAVALIN GROUP INC	12,769	47.36	604,739.84	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	66,210	60.16	3,983,193.60	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	13,938	163.60	2,280,256.80	
MAGNA INTERNATIONAL INC	18,147	84.13	1,526,707.11	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	9,700	55.63	539,611.00	
TIM HORTONS INC	12,281	62.46	767,071.26	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	28,945	25.33	733,176.85	

THOMSON REUTERS CORP	29,990	39.81	1,193,901.90	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,719	97.12	555,429.28	
DOLLARAMA INC	5,200	87.51	455,052.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B	11,244	78.56	883,328.64	
EMPIRE CO LTD A	3,728	72.20	269,161.60	
LOBLAW COMPANIES LTD	9,840	42.17	414,952.80	
METRO INC	7,850	65.25	512,212.50	
SHOPPERS DRUG MART CORP	15,805	58.07	917,796.35	
WESTON (GEORGE) LTD	4,094	77.04	315,401.76	
SAPUTO INC	9,305	48.26	449,059.30	
CATAMARAN CORPORATION	15,766	49.72	783,885.52	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	24,994	119.36	2,983,283.84	
BANK OF MONTREAL	50,808	69.83	3,547,922.64	
BANK OF NOVA SCOTIA	94,826	64.19	6,086,880.94	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	31,708	90.36	2,865,134.88	
NATIONAL BANK OF CANADA	13,237	88.42	1,170,415.54	
ROYAL BANK OF CANADA	113,516	70.58	8,011,959.28	
TORONTO-DOMINION BANK	72,643	97.95	7,115,381.85	
CI FINANCIAL CORP	12,000	35.12	421,440.00	
FIRST CAPITAL REALTY INC	9,000	17.62	158,580.00	
IGM FINANCIAL INC	7,098	55.70	395,358.60	
ONEX CORPORATION	7,432	56.10	416,935.20	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	784	423.00	331,632.00	
GREAT-WEST LIFECO INC	24,823	32.06	795,825.38	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANC	6,770	46.68	316,023.60	
INTACT FINANCIAL CORPORATION	11,210	69.01	773,602.10	
MANULIFE FINANCIAL CORP	146,402	20.75	3,037,841.50	
POWER CORP OF CANADA	26,899	32.10	863,457.90	
POWER FINANCIAL CORP	18,030	36.40	656,292.00	
SUN LIFE FINANCIAL INC	48,342	36.97	1,787,203.74	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	43,158	40.45	1,745,741.10	
BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES	22,463	20.64	463,636.32	
CGI GROUP INC - CL A	16,687	37.99	633,939.13	
OPEN TEXT CORPORATION	5,129	96.55	495,204.95	
BLACKBERRY LIMITED	33,224	6.67	221,604.08	
BCE INC	20,499	45.51	932,909.49	
BELL ALIANT INC.	6,133	26.28	161,175.24	
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	27,759	46.36	1,286,907.24	
TELUS CORPORATION	17,114	36.24	620,211.36	
ATCO LTD-CLASS I	6,051	46.68	282,460.68	
CANADIAN UTILITIES LIMITED	9,552	35.67	340,719.84	
FORTIS INC	15,791	30.11	475,467.01	
TRANSALTA CORP	23,868	13.34	318,399.12	
カナダドル小計	3,040,976		107,490,122.28	
(邦貨換算額：円)			(10,513,608,860)	
オーストラリアドル				
CALTEX AUSTRALIA LIMITED	9,059	19.12	173,208.08	
ORIGIN ENERGY LIMITED	87,287	13.67	1,193,213.29	
SANTOS LTD	81,346	14.12	1,148,605.52	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	51,486	37.95	1,953,893.70	
WORLEY PARSONS LIMITED	16,351	15.80	258,345.80	
ALUMINA LTD	226,977	1.03	234,921.19	
AMCOR LIMITED	95,273	10.45	995,602.85	



BHP BILLITON LTD	253,158	36.80	9,316,214.40	
BORAL LIMITED	63,542	4.71	299,282.82	
FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	129,216	5.75	742,992.00	
ILUKA RESOURCES LIMITED	37,840	8.47	320,504.80	
INCITEC PIVOT LTD	126,486	2.56	323,804.16	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	35,734	12.47	445,602.98	
NEWCREST MINING LIMITED	54,790	7.32	401,062.80	
ORICA LIMITED	27,473	22.98	631,329.54	
ORORA LTD NEW	95,273	1.22	116,233.06	
RIO TINTO LIMITED	34,169	66.53	2,273,263.57	
LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	12,264	15.39	188,742.96	
ALS LTD	31,500	8.55	269,325.00	
BRAMBLES LIMITED	127,316	8.84	1,125,473.44	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	4,778	44.84	214,245.52	
RECALL HOLDINGS LTD	25,463	4.18	106,435.34	
SEEK LIMITED	22,857	12.78	292,112.46	
ASCIANO LTD	83,609	5.64	471,554.76	
AURIZON HOLDINGS LTD	152,265	4.78	727,826.70	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	97,138	1.05	101,994.90	
TOLL HOLDINGS LIMITED	56,701	5.52	313,273.02	
CROWN RESORTS LTD	30,485	16.20	493,857.00	
ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD	63,132	2.29	144,572.28	
TABCORP HOLDINGS LIMITED	61,345	3.50	214,707.50	
TATTS GROUP LTD	111,012	3.04	337,476.48	
REA GROUP LTD	3,058	36.32	111,066.56	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	43,710	2.99	130,692.90	
METCASH LTD	74,654	3.28	244,865.12	
WESFARMERS LIMITED	78,647	42.88	3,372,383.36	
WOOLWORTHS LIMITED	98,461	33.21	3,269,889.81	
COCA-COLA AMATIL LIMITED	43,541	11.77	512,477.57	
TREASURY WINE ESTATES LTD	45,000	4.61	207,450.00	
COCHLEAR LIMITED	4,763	56.71	270,109.73	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	9,779	41.73	408,077.67	
SONIC HEALTHCARE LTD	30,655	16.08	492,932.40	
CSL LIMITED	38,270	66.69	2,552,226.30	
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	216,062	31.13	6,726,010.06	
BANK OF QUEENSLAND LIMITED	21,298	11.75	250,251.50	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	31,400	11.29	354,506.00	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	126,997	74.85	9,505,725.45	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	184,960	34.03	6,294,188.80	
WESTPAC BANKING CORPORATION	244,468	31.37	7,668,961.16	
ASX LTD	15,631	35.98	562,403.38	
MACQUARIE GROUP LTD-NEW	22,849	54.15	1,237,273.35	
AMP LIMITED	236,426	4.26	1,007,174.76	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	167,851	5.55	931,573.05	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	95,045	10.90	1,035,990.50	
SUNCORP GROUP LTD	101,957	12.85	1,310,147.45	
COMPUTERSHARE LIMITED	35,478	11.05	392,031.90	
TELSTRA CORPORATION LIMITED	346,416	5.11	1,770,185.76	
AGL ENERGY LIMITED	44,239	14.65	648,101.35	
オーストラリアドル小計	4,666,940		77,096,373.81	
(邦貨換算額:円)			(7,133,727,468)	
英ポンド				

AMEC PLC	25,649	10.40	266,749.60
BG GROUP PLC	268,294	12.57	3,373,797.05
BP PLC	1,486,033	4.72	7,022,248.94
PETROFAC LIMITED	18,800	11.40	214,320.00
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	301,269	21.09	6,353,763.21
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	198,021	22.11	4,378,244.31
TULLOW OIL PLC	72,830	8.39	611,407.85
ANGLO AMERICAN PLC	110,372	12.83	1,416,072.76
ANTOFAGASTA PLC	34,056	7.99	272,277.72
BHP BILLITON PLC	166,421	18.01	2,998,074.31
CRODA INTERNATIONAL PLC	10,404	23.87	248,343.48
FRESNILLO PLC	17,200	6.98	120,056.00
GLENORE XSTRATA PLC	835,058	3.07	2,570,726.05
JOHNSON MATTHEY PLC	15,472	32.06	496,032.32
MELROSE INDUSTRIES PLC	105,000	2.86	300,825.00
RANDGOLD RESOURCES LTD	7,262	38.11	276,754.82
REXAM PLC	59,884	5.02	300,917.10
RIO TINTO PLC	100,321	32.87	3,297,551.27
BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	30,300	12.99	393,597.00
BAE SYSTEMS PLC	253,576	4.42	1,120,805.92
BUNZL PLC	25,919	14.04	363,902.76
COBHAM PLC	79,074	2.67	211,839.24
IMI PLC	25,600	14.70	376,320.00
INVENSYS PLC	50,091	5.06	253,710.91
MEGGITT PLC	64,354	5.16	332,066.64
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	147,851	12.41	1,834,830.91
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-C ENTITLEMENT	13,725,686	0.00	13,725.68
SMITHS GROUP PLC	31,880	14.30	455,884.00
TRAVIS PERKINS PLC	17,647	17.72	312,704.84
WEIR GROUP PLC/THE	17,900	20.95	375,005.00
WOLSELEY PLC	21,260	33.25	706,895.00
AGGREKO PLC	19,228	16.37	314,762.36
CAPITA PLC	49,973	10.05	502,228.65
EXPERIAN PLC	77,830	10.84	843,677.20
G4S PLC	133,966	2.48	333,441.37
INTERTEK GROUP PLC	12,483	29.60	369,496.80
SERCO GROUP PLC	39,128	4.76	186,484.04
EASYJET PLC	14,184	15.20	215,596.80
GKN PLC	141,000	3.66	516,060.00
BURBERRY GROUP PLC	34,589	14.50	501,540.50
PERSIMMON PLC	26,000	11.82	307,320.00
CARNIVAL PLC	14,248	23.12	329,413.76
COMPASS GROUP PLC	142,450	9.31	1,326,209.50
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	20,499	19.41	397,885.59
TUI TRAVEL PLC	32,000	4.00	128,160.00
WHITBREAD PLC	14,210	36.13	513,407.30
WILLIAM HILL PLC	59,475	3.91	232,666.20
BRITISH SKY BROADCASTING PLC	84,971	7.93	673,820.03
ITV PLC	298,592	1.85	552,693.79
PEARSON PLC	65,016	13.00	845,208.00
REED ELSEVIER PLC	91,492	8.65	791,863.26
WPP PLC	104,016	13.46	1,400,055.36
KINGFISHER PLC	187,634	3.77	707,755.44
MARKS & SPENCER GROUP PLC	121,575	4.44	540,036.15

NEXT PLC	12,418	54.10	671,813.80	
SAINSBURY (J) PLC	93,296	3.66	341,463.36	
TESCO PLC	634,735	3.23	2,055,589.29	
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	170,311	2.59	441,786.73	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	29,143	24.00	699,432.00	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	149,884	31.94	4,787,294.96	
COCA-COLA HBC AG-CDI	16,449	16.79	276,178.71	
DIAGEO PLC	197,723	19.57	3,870,427.72	
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	77,221	23.07	1,781,488.47	
SABMILLER PLC	75,582	30.38	2,296,559.07	
TATE & LYLE PLC	37,927	7.89	299,244.03	
UNILEVER PLC	100,862	23.98	2,418,670.76	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	50,817	46.65	2,370,613.05	
SMITH & NEPHEW PLC	70,511	8.50	599,696.05	
ASTRAZENECA PLC	98,707	35.99	3,552,464.93	
GLAXOSMITHKLINE PLC	386,181	15.73	6,074,627.13	
SHIRE PLC	43,452	27.95	1,214,483.40	
BARCLAYS PLC	1,204,143	2.57	3,100,066.15	
HSBC HOLDINGS PLC	1,470,921	6.47	9,527,155.31	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,936,424	0.77	3,050,728.60	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	169,500	3.26	552,739.50	
STANDARD CHARTERED PLC	190,725	13.25	2,527,106.25	
3I GROUP PLC	80,523	3.79	305,584.78	
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	71,027	4.59	326,653.17	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	18,000	13.16	236,880.00	
ICAP PLC	45,404	4.40	200,050.02	
INVESTEC PLC	53,289	4.23	225,519.04	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	13,411	16.52	221,549.72	
SCHRODERS PLC	7,800	24.62	192,036.00	
ADMIRAL GROUP PLC	13,350	12.67	169,144.50	
AVIVA PLC	228,435	4.35	995,748.16	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	74,144	2.39	177,204.16	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	461,650	2.14	988,854.30	
OLD MUTUAL PLC	387,878	1.86	723,392.47	
PRUDENTIAL PLC	201,420	13.06	2,630,545.20	
RESOLUTION LTD	113,468	3.35	380,344.73	
RSA INSURANCE GROUP PLC	323,816	0.90	293,539.20	
STANDARD LIFE PLC	186,385	3.52	657,379.89	
SAGE GROUP PLC/THE	81,570	3.92	319,835.97	
ARM HOLDINGS PLC	111,136	10.56	1,173,596.16	
BT GROUP PLC	625,169	3.75	2,345,008.91	
INMARSAT PLC	34,000	7.60	258,400.00	
VODAFONE GROUP PLC	3,821,049	2.33	8,927,880.98	
CENTRICA PLC	405,433	3.37	1,366,714.64	
NATIONAL GRID PLC	293,464	7.87	2,311,029.00	
SEVERN TRENT PLC	18,429	16.91	311,634.39	
SSE PLC	76,896	13.72	1,055,013.12	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	54,958	6.55	359,974.90	
英ポンド小計	37,127,079		133,462,374.47	
(邦貨換算額：円)			(22,792,704,311)	
スイスフラン				
TRANSOCEAN LTD	28,627	42.28	1,210,349.56	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	700	306.00	214,200.00	

GIVAUDAN-REG	652	1,253.00	816,956.00	
HOLCIM LTD-REG	17,774	64.75	1,150,866.50	
SIKA AG	158	3,051.00	482,058.00	
SYNGENTA AG	7,418	348.90	2,588,140.20	
ABB LTD	173,073	22.88	3,959,910.24	
GEBERIT AG-REG	3,159	262.10	827,973.90	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,881	128.50	241,708.50	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,353	126.30	423,483.90	
SULZER AG	1,850	139.00	257,150.00	
ADECCO SA-REG	9,670	67.80	655,626.00	
SGS SA	453	2,003.00	907,359.00	
KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	3,985	115.50	460,267.50	
CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-REGD A	41,077	86.60	3,557,268.20	
THE SWATCH GROUP AG-B	2,396	575.00	1,377,700.00	
THE SWATCH GROUP AG-REG	3,703	98.00	362,894.00	
ARYZTA AG	7,216	66.75	481,668.00	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	127	1,098.00	139,446.00	
LINDT & SPRUENGLI AG	69	3,937.00	271,653.00	
LINDT & SPRUENGLI AG-REG	9	47,025.00	423,225.00	
NESTLE SA-REGISTERED	254,255	63.95	16,259,607.25	
SONOVA HOLDING AG	3,863	117.80	455,061.40	
ACTELION LTD	8,547	74.45	636,324.15	
LONZA GROUP AG-REG	3,986	82.65	329,442.90	
NOVARTIS AG-REG SHS	181,407	70.40	12,771,052.80	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	55,426	241.80	13,402,006.80	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	118,676	26.62	3,159,155.12	
JULIUS BAER GROUP LTD	18,033	41.81	753,959.73	
PARGESA HOLDING SA-BR	2,300	71.45	164,335.00	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,350	225.50	304,425.00	
UBS AG-REGISTERED	286,925	16.59	4,760,085.75	
BALOISE HOLDING AG	3,805	109.90	418,169.50	
SWISS LIFE HOLDING AG	2,609	180.90	471,968.10	
SWISS RE AG	27,513	80.25	2,207,918.25	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	11,864	253.00	3,001,592.00	
SWISS PRIME SITE-REG	4,100	68.05	279,005.00	
SWISSCOM AG-REG	1,818	467.70	850,278.60	
スイスフラン小計	1,293,827		81,034,290.85	
(邦貨換算額：円)			(9,410,512,196)	
香港ドル				
HUTCHISON WHAMPOA LTD	169,000	101.40	17,136,600.00	
NWS HOLDINGS LTD	93,500	11.18	1,045,330.00	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	169,000	67.75	11,449,750.00	
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	109,000	15.74	1,715,660.00	
KERRY LOGISTICS NETWORK LTD	25,250	10.22	258,055.00	
MTR CORPORATION	118,000	28.75	3,392,500.00	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	37,000	24.50	906,500.00	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	82,000	31.00	2,542,000.00	
SANDS CHINA LTD	186,400	61.50	11,463,600.00	
SHANGRI-LA ASIA LTD.	126,000	15.04	1,895,040.00	
SJM HOLDINGS LIMITED	154,000	24.80	3,819,200.00	
WYNN MACAU LTD	129,600	34.80	4,510,080.00	
LI & FUNG LTD	477,200	9.72	4,638,384.00	
BANK OF EAST ASIA	95,220	32.35	3,080,367.00	

BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	275,000	24.55	6,751,250.00	
HANG SENG BANK LTD	57,000	123.20	7,022,400.00	
FIRST PACIFIC COMPANY	220,000	8.76	1,927,200.00	
HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	86,700	129.30	11,210,310.00	
AIA GROUP LTD	945,800	38.10	36,034,980.00	
CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	111,000	119.20	13,231,200.00	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	167,000	24.00	4,008,000.00	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	83,200	43.60	3,627,520.00	
HOPEWELL HOLDINGS LTD	46,500	25.75	1,197,375.00	
HYSAN DEVELOPMENT CO	62,000	32.60	2,021,200.00	
KERRY PROPERTIES LTD	50,500	26.70	1,348,350.00	
NEW WORLD DEVELOPMENT	309,000	9.77	3,018,930.00	
SINO LAND CO	232,200	10.48	2,433,456.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	126,000	96.80	12,196,800.00	
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	51,500	89.55	4,611,825.00	
SWIRE PROPERTIES LIMITED	110,000	19.36	2,129,600.00	
WHARF HOLDINGS LTD	120,000	59.70	7,164,000.00	
WHEELOCK&COMPANY LTD	76,000	35.15	2,671,400.00	
PCCW LIMITED	370,000	3.17	1,172,900.00	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	50,000	47.90	2,395,000.00	
CLP HOLDINGS LTD	140,100	60.35	8,455,035.00	
HONG KONG & CHINA GAS	446,756	17.52	7,827,165.12	
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	110,000	59.95	6,594,500.00	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	20,000	63.55	1,271,000.00	
香港ドル小計	6,237,426		218,174,462.12	
(邦貨換算額：円)			(2,936,628,260)	
シンガポールドドル				
KEPPEL CORP LTD	113,400	10.73	1,216,782.00	
NOBLE GROUP LTD	290,400	1.02	297,660.00	
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	80,820	5.39	435,619.80	
SEMBCORP MARINE LTD	74,400	4.30	319,920.00	
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG	126,000	3.76	473,760.00	
YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	160,000	1.18	188,800.00	
COMFORTDELGRO CORP LTD	145,000	1.97	286,375.00	
SINGAPORE AIRLINES LTD	40,266	10.03	403,867.98	
GENTING SINGAPORE PLC	499,000	1.45	723,550.00	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	126,250	3.99	503,737.50	
CYCLE & CARRIAGE LTD	8,000	34.00	272,000.00	
OLAM INTERNATIONAL LTD	125,000	1.46	183,125.00	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	583,600	0.53	309,308.00	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	149,000	3.35	499,150.00	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	136,000	16.59	2,256,240.00	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	198,000	9.87	1,954,260.00	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	103,000	20.35	2,096,050.00	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	65,000	7.09	460,850.00	
CAPITALAND LTD	214,000	2.96	633,440.00	
CAPITAMALLS ASIA LTD	98,000	1.90	186,200.00	
CITY DEVELOPMENTS LTD	33,000	9.50	313,500.00	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LIMITED	251,000	2.87	720,370.00	
KEPPEL LAND LTD	63,000	3.29	207,270.00	
UOL GROUP LIMITED	41,000	6.00	246,000.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	642,015	3.52	2,259,892.80	
STARHUB LIMITED	37,000	4.17	154,290.00	

シンガポールドル小計	4,402,151		17,602,018.08
(邦貨換算額:円)			(1,449,174,148)
ニュージーランドドル			
FLETCHER BUILDING LTD	52,544	8.53	448,200.32
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	76,557	3.60	275,605.20
RYMAN HEALTHCARE LIMITED	33,000	7.74	255,420.00
TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	137,942	2.35	324,163.70
CONTACT ENERGY LIMITED	36,256	4.94	179,104.64
ニュージーランドドル小計	336,299		1,482,493.86
(邦貨換算額:円)			(126,797,699)
スウェーデンクローナ			
LUNDIN PETROLEUM AB	18,711	131.40	2,458,625.40
BOLIDEN AB	20,580	93.55	1,925,259.00
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	46,310	193.40	8,956,354.00
ALFA LAVAL AB	26,140	157.60	4,119,664.00
ASSA ABLOY AB-B	26,531	330.70	8,773,801.70
ATLAS COPCO AB-A SHS	53,063	176.00	9,339,088.00
ATLAS COPCO AB-B SHS	30,602	161.50	4,942,223.00
HEXAGON AB-B SHS	18,280	199.10	3,639,548.00
SANDVIK AB	82,277	88.75	7,302,083.75
SCANIA AB-B SHS	23,151	125.10	2,896,190.10
SKANSKA AB-B SHS	29,839	126.20	3,765,681.80
SKF AB-B SHARES	33,199	178.30	5,919,381.70
VOLVO AB-B SHS	120,599	81.90	9,877,058.10
SECURITAS AB-B SHS	23,173	66.20	1,534,052.60
ELECTROLUX AB-SER B	20,236	165.40	3,347,034.40
HUSQVARNA AB-B SHS	31,853	37.27	1,187,161.31
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	74,674	290.90	21,722,666.60
SWEDISH MATCH AB	16,311	201.90	3,293,190.90
ELEKTA AB-B SHS	28,843	96.50	2,783,349.50
GETINGE AB-B SHS	15,180	212.20	3,221,196.00
NORDEA BANK AB	238,816	83.35	19,905,313.60
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A	115,596	81.15	9,380,615.40
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	40,561	303.50	12,310,263.50
SWEDBANK AB - A SHARES	71,877	173.40	12,463,471.80
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	9,075	118.00	1,070,850.00
INVESTOR AB-B SHS	35,265	213.00	7,511,445.00
KINNEVIK INVESTMENT AB-B	18,000	297.50	5,355,000.00
ERICSSON LM-B SHS	240,775	76.90	18,515,597.50
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	4,868	648.00	3,154,464.00
TELE2 AB-B SHS	24,838	73.15	1,816,899.70
TELIASONERA AB	190,961	52.55	10,035,000.55
スウェーデンクローナ小計	1,730,184		212,522,530.91
(邦貨換算額:円)			(3,366,356,889)
ノルウェークローネ			
AKER SOLUTIONS ASA	11,600	100.50	1,165,800.00
SEADRILL LID	30,198	236.40	7,138,807.20
STATOIL ASA	87,609	143.60	12,580,652.40
SUBSEA 7 SA	20,749	108.40	2,249,191.60
NORSK HYDRO ASA	102,500	25.88	2,652,700.00
YARA INTERNATIONAL ASA	14,304	255.00	3,647,520.00
ORKLA ASA	61,935	46.00	2,849,010.00

DNB ASA	77,838	106.20	8,266,395.60	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	15,788	109.70	1,731,943.60	
TELENOR ASA	54,189	144.40	7,824,891.60	
ノルウェークローネ小計	476,710		50,106,912.00	
(邦貨換算額:円)			(849,312,158)	
デンマーククローネ				
NOVOZYMES A/S-B SHARES	18,714	219.90	4,115,208.60	
A P MOLLER - MAERSK A/S	104	56,050.00	5,829,200.00	
A P MOLLER-MAERSK A/S-A	45	53,350.00	2,400,750.00	
DSV A/S	14,389	171.20	2,463,396.80	
CARLSBERG AS-B	8,339	584.00	4,869,976.00	
COLOPLAST-B	9,075	350.20	3,178,065.00	
WILLIAM DEMANT HOLDING	1,692	512.00	866,304.00	
NOVO NORDISK A/S-B	31,385	978.00	30,694,530.00	
DANSKE BANK A/S	52,292	121.00	6,327,332.00	
TRYG A/S	1,782	504.00	898,128.00	
TDC A/S	63,019	51.65	3,254,931.35	
デンマーククローネ小計	200,836		64,897,821.75	
(邦貨換算額:円)			(1,238,250,438)	
イスラエルシェケル				
DELEK GROUP LTD	330	1,294.00	427,020.00	
ISRAEL CHEMICALS LIMITED	44,600	28.25	1,259,950.00	
ISRAEL CORPORATION LTD/THE	115	1,805.00	207,575.00	
TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	65,620	139.50	9,153,990.00	
BANK HAPOLIM BM	79,000	19.28	1,523,120.00	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	109,000	13.81	1,505,290.00	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,000	43.86	438,600.00	
NICE SYSTEMS LTD	4,800	141.00	676,800.00	
BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	143,000	5.95	850,850.00	
イスラエルシェケル小計	456,465		16,043,195.00	
(邦貨換算額:円)			(476,803,755)	
ユーロ				
CGG	12,763	11.68	149,135.65	
ENI SPA	200,439	16.88	3,383,410.32	
FUGRO NV-CVA	5,081	40.71	206,872.91	
GALP ENERGIA SGPS S.A	27,055	11.78	318,843.17	
NESTE OIL OYJ	10,060	13.90	139,834.00	
OMV AG	11,774	33.42	393,487.08	
REPSOL SA	66,296	18.49	1,225,813.04	
SAIPEM	22,507	15.00	337,605.00	
TECHNIP S.A.	7,821	65.14	509,459.94	
TENARIS S.A.	36,660	16.06	588,759.60	
TOTAL SA	168,625	43.17	7,280,384.37	
AIR LIQUIDE	24,522	99.98	2,451,709.56	
AKZO NOBEL	19,028	53.39	1,015,904.92	
ARCELOR MITTAL	77,664	12.18	945,947.52	
ARKEMA	4,592	79.91	366,946.72	
BASF SE	72,435	75.25	5,450,733.75	
CRH PLC	60,280	17.88	1,078,107.80	
FUCHS PETROLUB SE-PREF	2,400	70.42	169,008.00	
HEIDELBERGCEMENT AG	11,460	54.02	619,069.20	

IMERYS SA	2,813	62.10	174,687.30	
K+S AG	14,644	20.58	301,373.52	
KONINKLIJKE DSM NV	11,760	55.68	654,796.80	
LAFARGE SA	14,756	52.61	776,313.16	
LANXESS	6,238	45.38	283,080.44	
LINDE AG	14,719	149.45	2,199,754.55	
SOLVAY SA	4,569	109.35	499,620.15	
STORA ENSO OYJ-R SHS	42,409	7.09	300,679.81	
THYSSENKRUPP AG	34,851	17.09	595,603.59	
UMICORE	8,846	32.41	286,743.09	
UPM-KYMMENE OYJ	42,918	11.99	514,586.82	
VOESTALPINE AG	9,309	33.95	316,087.09	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	12,280	23.83	292,693.80	
ALSTOM RGPT	16,546	25.81	427,052.26	
ANDRITZ AG	5,650	43.72	247,018.00	
BOSKALIS WESTMINSTER NV	6,659	36.99	246,316.41	
BOUYGUES SA	15,431	26.64	411,081.84	
BRENNTAG AG	3,933	130.95	515,026.35	
CNH INDUSTRIAL NV	75,010	7.68	576,076.80	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	33,212	38.71	1,285,802.58	
EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	46,452	55.84	2,593,879.68	
FINMECCANICA SPA	33,589	5.28	177,517.86	
GEA GROUP AG	15,002	33.64	504,667.28	
HOCHTIEF AG	1,887	60.33	113,842.71	
KONE OYJ-B	25,902	32.30	836,634.60	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	77,708	26.24	2,039,446.46	
LEGRAND SA	20,655	39.23	810,295.65	
MAN SE	2,969	89.22	264,894.18	
METSO OYJ	9,881	29.03	286,845.43	
OCI NV	6,475	29.20	189,070.00	
OSRAM LICHT AG	7,286	40.11	292,241.46	
PRYSMIAN SPA	17,000	18.48	314,160.00	
REXEL SA	18,735	18.57	347,908.95	
SAFRAN SA	21,136	49.26	1,041,159.36	
SCHNEIDER ELECTRIC SA	41,877	61.50	2,575,435.50	
SIEMENS AG-REG	62,500	97.40	6,087,500.00	
THALES SA	7,275	44.74	325,519.87	
VALLOUREC	7,978	38.37	306,155.75	
VINCI S.A.	37,651	46.07	1,734,769.82	
WARTSILA OYJ-B SHARES	13,433	34.42	462,363.86	
WENDEL	2,500	104.25	260,625.00	
ZARDOYA OTIS SA	13,585	12.71	172,665.35	
ZODIAC AEROSPACE	2,812	126.80	356,561.60	
BIC	1,913	85.08	162,758.04	
BUREAU VERITAS SA	17,800	19.99	355,822.00	
EDENRED	17,485	24.60	430,218.42	
RANDSTAD HOLDING NV	9,699	45.34	439,752.66	
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	30,108	15.61	469,985.88	
AEROPORTS DE PARIS (ADP)	2,760	81.00	223,560.00	
ATLANTIA SPA	27,751	15.99	443,738.49	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	17,758	15.38	273,206.83	
DEUTSCHE POST AG-REG	72,201	26.00	1,877,226.00	
FERROVIAL SA	33,672	13.67	460,296.24	
FRAPORT AG	2,468	54.55	134,629.40	
GROUPE EUROTUNNEL SA	38,581	7.38	284,959.26	



INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP	68,500	4.67	320,100.50	
RYANAIR HOLDINGS PLC	1,656	6.16	10,209.24	
TNT EXPRESS NV	27,425	6.60	181,032.42	
VOPAK	5,791	41.00	237,459.95	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	26,033	83.39	2,170,891.87	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE(BMW)AG-PFD	4,668	62.13	290,022.84	
CONTINENTAL AG	8,576	158.25	1,357,152.00	
DAIMLER AG	75,859	60.86	4,616,778.74	
FIAT SPA	68,495	5.51	377,749.92	
MICHELIN (CGDE)-B	14,718	74.50	1,096,491.00	
NOKIAN RENKAAT OYJ	8,450	34.80	294,060.00	
PIRELLI & C.	18,802	12.04	226,376.08	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PREF	12,298	74.55	916,815.90	
RENAULT SA	15,344	57.42	881,052.48	
VALEO	5,466	78.44	428,753.04	
VOLKSWAGEN AG	2,452	190.00	465,880.00	
VOLKSWAGEN AG PFD	11,372	198.00	2,251,656.00	
ADIDAS AG	16,336	88.89	1,452,107.04	
CHRISTIAN DIOR SA	4,452	132.05	587,886.60	
HUGO BOSS AG	2,890	101.65	293,768.50	
LUXOTTICA GROUP SPA	13,187	38.05	501,765.35	
LVMH MOET HENNESSY LOUI V SA	19,912	130.05	2,589,555.60	
ACCOR SA	12,716	33.01	419,755.16	
SODEXO	7,286	72.39	527,433.54	
AXEL SPRINGER SE	2,891	45.79	132,378.89	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	12,100	21.25	257,185.50	
JC DECAUX S.A.	5,938	29.14	173,063.01	
KABEL DEUTSCHLAND HOLDINGS AG	1,917	94.59	181,329.03	
LAGARDERE S.C.A.	9,103	25.94	236,131.82	
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-REG	14,351	34.84	500,060.59	
PUBLICIS GROUPE	14,188	65.88	934,705.44	
REED ELSEVIER NV	54,069	14.90	805,628.10	
RTL GROUP	2,900	90.95	263,755.00	
SES	22,627	22.85	517,140.08	
SKY DEUTSCHLAND AG	30,117	7.93	238,948.27	
WOLTERS KLUWER-CVA	25,187	20.18	508,273.66	
INDITEX	17,149	115.85	1,986,711.65	
KERING	6,002	149.60	897,899.20	
CARREFOUR SA	48,287	27.81	1,343,102.90	
CASINO GUICHARD PERRACHON	4,641	81.58	378,612.78	
COLRUYT NV	5,670	39.87	226,091.25	
DELHAIZE GROUP	8,555	41.07	351,353.85	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	45,671	6.36	290,787.25	
JERONIMO MARTINS SGPS S.A.	20,249	14.05	284,599.69	
KONINKLIJKE AHOLD NV	80,100	12.75	1,021,275.00	
METRO AG	9,828	35.00	343,980.00	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	63,277	75.66	4,787,537.82	
DANONE	44,666	51.32	2,292,259.12	
HEINEKEN HOLDING NV	7,230	44.35	320,686.65	
HEINEKEN NV	18,271	47.30	864,218.30	
KERRY GROUP PLC-A	12,998	49.29	640,671.42	
PERNOD-RICARD SA	16,696	80.51	1,344,194.96	
REMY COINTREAU	1,873	59.95	112,286.35	
SUEDZUCKER AG	5,953	18.55	110,428.15	

UNILEVER NV-CVA	128,588	28.31	3,640,326.28
BEIERSDORF AG	7,887	73.50	579,694.50
HENKEL AG & CO KGAA	10,181	73.81	751,459.61
HENKEL AG & CO KGAA	14,185	82.31	1,167,567.35
L'OREAL	19,020	125.05	2,378,451.00
CELESIO AG	6,194	23.06	142,864.61
ESSILOR INTERNATIONAL	16,325	74.30	1,212,947.50
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	16,795	51.47	864,438.65
FRESENIUS SE & CO KGAA	9,885	111.30	1,100,200.50
BAYER AG	65,186	99.40	6,479,488.40
GRIFOLS S.A.	11,580	34.16	395,630.70
MERCK KGAA	5,125	128.00	656,000.00
ORION OYJ	8,601	19.33	166,257.33
QIAGEN N.V.	18,923	16.95	320,839.46
SANOFI	94,073	75.21	7,075,230.33
UCB SA	8,593	52.93	454,827.49
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	633,414	0.16	102,296.36
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	467,683	8.71	4,073,986.61
BANCO DE SABADELL SA	296,818	1.82	541,396.03
BANCO ESPIRITO SANTO,S.A(BES)	134,219	0.99	133,547.90
BANCO POPULAR ESPANOL	112,009	4.36	489,143.30
BANCO SANTANDER SA	912,113	6.31	5,762,729.93
BANK OF IRELAND	1,613,237	0.26	421,054.85
BNP PARIBAS	78,458	54.34	4,263,407.72
COMMERZBANK AG	78,788	11.32	892,274.10
CREDIT AGRICOLE SA	77,928	9.09	708,677.23
ERSTE GROUP BANK AG	20,594	24.84	511,554.96
INTESA SANPAOLO	925,565	1.74	1,614,185.36
KBC GROUPE SA	19,103	40.09	765,839.27
NATIXIS	64,551	4.23	273,373.48
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	3,319	25.21	83,671.99
SOCIETE GENERALE	56,529	40.83	2,308,361.71
UNICREDIT SPA	341,212	5.29	1,806,717.54
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	69,319	4.85	336,751.70
AGEAS	18,994	30.27	574,948.38
CAIXABANK	148,471	3.74	555,875.42
DEUTSCHE BANK AG -REG	80,214	33.52	2,688,773.28
DEUTSCHE BOERSE AG	14,844	57.08	847,295.52
EURAZEO	2,465	56.86	140,159.90
EXOR SPA	6,651	28.00	186,228.00
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	6,052	64.70	391,564.40
ING GROEP NV-CVA	302,016	9.56	2,889,689.08
MEDIOBANCA SPA	43,058	6.23	268,251.34
POHJOLA BANK PLC	10,677	14.10	150,545.70
AEGON NV	142,120	6.58	935,575.96
ALLIANZ SE-REG	35,985	127.15	4,575,492.75
ASSICURAZIONI GENERALI	90,420	16.77	1,516,343.40
AXA SA	141,158	19.43	2,743,405.73
CNP ASSURANCES	15,184	13.86	210,526.16
DELTA LLOYD NV	15,163	17.54	266,034.83
HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	4,566	61.64	281,448.24
MAPFRE SA	93,649	2.97	278,980.37
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	14,201	159.50	2,265,059.50
SAMPO OYJ-A SHS	33,159	34.60	1,147,301.40
SCOR SE	11,558	25.76	297,791.87

VIENNA INSURANCE GROUP AG WIENER VERSICH	3,019	35.36	106,751.84	
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	23,519	14.19	333,734.61	
IMMOFINANZ AG	77,867	3.27	255,014.42	
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	29,791	29.51	879,281.36	
ATOS	5,309	63.16	335,316.44	
CAP GEMINI SA	11,855	47.10	558,370.50	
DASSAULT SYSTEMES SA	4,989	88.00	439,032.00	
SAP AG	72,537	61.02	4,426,207.74	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	23,871	6.00	143,249.87	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	7,858	30.48	239,551.13	
ALCATEL-LUCENT	219,192	3.32	728,375.01	
GEMALTO	5,934	79.12	469,498.08	
NOKIA OYJ	293,390	5.65	1,657,653.50	
BELGACOM SA	12,168	21.07	256,379.76	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	228,615	12.37	2,827,967.55	
ELISA OYJ	10,666	18.93	201,907.38	
ILIAD SA	1,899	166.90	316,943.10	
KONINKLIJKE KPN NV	271,258	2.31	628,233.52	
ORANGE S.A.	149,812	9.03	1,353,101.98	
PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	57,052	3.25	185,533.10	
TELECOM ITALIA SPA	832,383	0.70	583,084.29	
TELECOM ITALIA-RNC	427,976	0.54	235,172.81	
TELEFONICA S.A.	323,316	11.60	3,752,082.18	
TELEKOM AUSTRIA AG	17,354	5.50	95,533.77	
TELENET GROUP HOLDINGS NV	4,404	40.92	180,211.68	
VIVENDI SA	94,759	18.95	1,796,156.84	
ZIGGO NV	10,891	33.00	359,403.00	
E.ON SE	141,543	13.19	1,867,659.88	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	154,341	2.63	405,916.83	
ELECTRICITE DE FRANCE(EDF)	19,918	25.11	500,240.57	
ENAGAS	13,302	18.59	247,284.18	
ENEL GREEN POWER SPA	137,336	1.80	248,166.15	
ENEL SPA	515,624	3.12	1,609,778.12	
FORTUM OYJ	34,063	16.34	556,589.42	
GAS NATURAL SDG SA	28,059	18.47	518,249.73	
GDF SUEZ	104,270	16.86	1,757,992.20	
IBERDROLA SA	366,790	4.56	1,674,396.35	
RED ELECTRICA CORPORATION S.A.	9,146	46.63	426,477.98	
RWE AG	38,227	26.23	1,002,885.34	
SNAM SPA	163,408	3.90	637,291.20	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	23,600	12.51	295,354.00	
TERNA SPA	122,846	3.56	438,068.83	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	26,735	11.21	299,833.02	
ASML HOLDING NV	28,092	66.31	1,862,780.52	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	91,602	7.57	694,251.55	
STMICROELECTRONICS NV	53,301	5.40	287,932.00	
ユーロ小計	15,920,179		224,387,170.31	
(邦貨換算額：円)			(31,946,001,437)	
合計	99,684,009		229,249,988,416	
(外貨建有価証券邦貨換算額合計：円)			(229,249,988,416)	

(注)金額欄の( )内は、外貨建有価証券にかかるもので、内書きであります。

通貨	銘柄数	組入株式時価比率	合計金額に対する比率
----	-----	----------	------------

米ドル	株式	584銘柄	57.3%	59.8%
カナダドル	株式	95銘柄	4.4%	4.6%
オーストラリアドル	株式	57銘柄	3.0%	3.1%
英ポンド	株式	102銘柄	9.5%	9.9%
スイスフラン	株式	38銘柄	3.9%	4.1%
香港ドル	株式	38銘柄	1.2%	1.3%
シンガポールドル	株式	26銘柄	0.6%	0.6%
ニュージーランドドル	株式	5銘柄	0.1%	0.1%
スウェーデンクローナ	株式	31銘柄	1.4%	1.5%
ノルウェークローネ	株式	10銘柄	0.4%	0.4%
デンマーククローネ	株式	11銘柄	0.5%	0.5%
イスラエルシェケル	株式	9銘柄	0.2%	0.2%
ユーロ	株式	229銘柄	13.4%	13.9%

## (b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	33,581	653,822.07	
		AMERICAN TOWER CORP	30,844	2,409,224.84	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	77,817	768,053.79	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	9,826	1,159,566.26	
		BOSTON PROPERTIES INC	11,709	1,196,074.35	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	6,260	355,505.40	
		COLE REAL ESTATE INVESTMENTS INC	33,949	467,138.24	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	11,200	518,448.00	
		DUKE REALTY CORP	24,773	363,667.64	
		EQUITY RESIDENTIAL	27,820	1,447,752.80	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	4,800	484,032.00	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	36,528	736,769.76	
		HCP, INC.	35,089	1,256,186.20	
		HEALTH CARE REIT INC	22,672	1,192,093.76	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	61,863	1,167,354.81	
		HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	423,000	266,490.00	
		KIMCO REALTY CORPORATION	31,655	640,064.10	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	12,565	427,210.00	
		MACERICH COMPANY/THE	11,861	695,529.04	
		PLUM CREEK TIMBER COMPANY	13,548	624,020.88	
		PROLOGIS INC	38,695	1,421,267.35	
		PUBLIC STORAGE	11,880	1,795,780.80	
		RAYONIER INC	9,900	419,067.00	
		REALTY INCOME CORPORATION	15,800	601,032.00	
		REGENCY CENTERS CORP	6,500	300,365.00	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	24,407	3,758,678.00	
		SL GREEN REALTY CORP	7,800	721,890.00	
		UDR INC	19,300	445,830.00	
		VENTAS INC	22,633	1,282,159.45	
	VORNADO REALTY TRUST	13,637	1,208,238.20		
	米ドル小計 (邦貨換算額：円)		1,091,912	28,783,311.74 (3,004,977,745)	
	カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,500	182,580.00	
		RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	12,819	320,475.00	
カナダドル小計 (邦貨換算額：円)		21,319	503,055.00 (49,203,809)		

オーストラリアドル	APA GROUP	63,089	392,413.58	
	CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP	183,612	356,207.28	
	DEXUS PROPERTY GROUP	373,588	379,191.82	
	FEDERATION CENTRES	90,000	205,200.00	
	GOODMAN GROUP	138,000	663,780.00	
	GPT GROUP	127,841	447,443.50	
	LEND LEASE GROUP	45,172	486,954.16	
	MIRVAC GROUP	286,710	478,805.70	
	SP AUSNET	133,413	158,761.47	
	STOCKLAND	189,614	697,779.52	
	SYDNEY AIRPORT	57,800	225,420.00	
	SYDNEY AIRPORT-NEW	24,210	94,419.00	
	TRANSURBAN GROUP	109,347	765,429.00	
	WESTFIELD GROUP	164,076	1,657,167.60	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	233,348	683,709.64	
	オーストラリアドル小計 (邦貨換算額：円)	2,219,820	7,692,682.27 (711,803,890)	
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	76,828	471,723.92	
	HAMMERSON PLC	62,152	311,692.28	
	INTU PROPERTIES PLC	54,855	169,117.96	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	66,127	628,867.77	
	SEGRO PLC	46,280	152,816.56	
	英ポンド小計 (邦貨換算額：円)	306,242	1,734,218.49 (296,169,833)	
香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	139,000	936,860.00	
	LINK REIT	187,000	7,068,600.00	
	香港ドル小計 (邦貨換算額：円)	326,000	8,005,460.00 (107,753,491)	
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	148,000	315,240.00	
	CAPITACOMMERCIAL TRUST	159,000	221,010.00	
	CAPITAMALL TRUST	166,000	302,120.00	
	シンガポールドル小計 (邦貨換算額：円)	473,000	838,370.00 (69,023,002)	
ユーロ	CORIO NV	5,769	179,213.98	
	FONCIERE DES REGIONS	2,450	148,960.00	
	GECINA SA	1,793	170,083.98	
	ICADE	3,050	199,927.50	
	KLEPIERRE	8,620	285,451.30	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	7,776	1,379,073.60	
	ユーロ小計 (邦貨換算額：円)	29,458	2,362,710.36 (336,379,073)	
	投資証券合計		4,575,310,843 (4,575,310,843)	
	合計		4,575,310,843	
	(外貨建有価証券邦貨換算額合計：円)		(4,575,310,843)	

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

通貨	銘柄数		組入投資証券 時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	投資証券	30銘柄	1.3%	65.7%
カナダドル	投資証券	2銘柄	0.0%	1.1%
オーストラリアドル	投資証券	15銘柄	0.3%	15.6%

英ポンド	投資証券	5銘柄	0.1%	6.5%
香港ドル	投資証券	2銘柄	0.0%	2.4%
シンガポールドル	投資証券	3銘柄	0.0%	1.5%
ユーロ	投資証券	6銘柄	0.1%	7.4%

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

(単位：円)

(平成25年12月20日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	65
親投資信託受益証券	4,322,902,803
未収入金	959,998
流動資産合計	4,323,862,866
資産合計	4,323,862,866
負債の部	
流動負債	
未払解約金	959,998
未払受託者報酬	14,854
未払委託者報酬	7,425
その他未払費用	1,854
流動負債合計	984,131
負債合計	984,131
純資産の部	
元本等	
元本	2,756,364,692
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,566,514,043
元本等合計	4,322,878,735
純資産合計	4,322,878,735
負債純資産合計	4,323,862,866

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項目	自 平成25年12月18日 至 平成25年12月20日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(平成25年12月20日現在)
1. 受益権総数	平成25年12月20日における受益権の総数 2,756,364,692口
2. 1単位当たり純資産額	1.5683円 (1万口 = 15,683円)

## (金融商品に関する注記)

## ・金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成25年12月18日 至 平成25年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>



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

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成25年12月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（デリバティブ取引に関する注記）

（平成25年12月20日現在）  
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

（自平成25年12月18日 至平成25年12月20日）  
該当事項はありません。

（その他の注記）

（平成25年12月20日現在）	
期首（平成25年12月18日）における元本額	2,757,123,727円
期首より平成25年12月20日現在までの追加設定元本額	円
期首より平成25年12月20日現在までの一部解約元本額	759,035円

（3）附属明細表  
有価証券明細表

(a) 株式  
該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託 受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	2,739,134,966	4,322,902,803	
	親投資信託受益証券 小計	2,739,134,966	4,322,902,803	
合計			4,322,902,803	

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

## (参考情報)

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

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

## 「外国債券パッシブ・マザーファンド」の状況

## (1) 貸借対照表

(単位：円)	
(平成25年12月20日現在)	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,541,731,613
国債証券	259,388,359,504
未収入金	3,729,684,634
未収利息	2,746,425,692
前払費用	69,111,934
流動資産合計	269,475,313,377
資産合計	269,475,313,377
負債の部	
流動負債	
未払金	1,836,070,006
未払解約金	1,127,450,146
流動負債合計	2,963,520,152
負債合計	2,963,520,152
純資産の部	
元本等	
元本	168,867,973,833
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	97,643,819,392
元本等合計	266,511,793,225
純資産合計	266,511,793,225
負債純資産合計	269,475,313,377

## (2) 注記表

## (重要な会計方針の注記)

項 目	自 平成25年12月18日 至 平成25年12月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

項 目	(平成25年12月20日現在)
1. 受益権総数	<p>平成25年12月20日における受益権の総数</p> <p style="text-align: right;">168,867,973,833口</p>
2. 1単位当たり純資産額	<p style="text-align: right;">1.5782円</p> <p style="text-align: right;">(1万口 = 15,782円)</p>

## （金融商品に関する注記）

## ．金融商品の状況に関する事項

項 目	自 平成25年12月18日 至 平成25年12月20日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っております。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成25年12月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(国債証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成25年12月20日現在)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

(自平成25年12月18日 至 平成25年12月20日)

該当事項はありません。

(その他の注記)

(平成25年12月20日現在)

開示対象ファンドの	
期首(平成25年12月18日)における当該親投資信託の元本額	170,049,110,793円
期首より平成25年12月20日現在までの追加設定元本額	931,555円
期首より平成25年12月20日現在までの一部解約元本額	1,182,068,515円
平成25年12月20日現在の元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	4,039,183,496円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	238,419,804円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	694,024,273円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	362,834,550円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	30,528,194円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	4,605,095円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	8,901,448円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	6,935,847円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	7,596,272円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	1,998,812円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	5,742,299円
SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	2,739,134,966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>	9,621,594,374円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	32,150,993,914円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	9,829,101,529円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	22,143,586,792円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	69,327,860円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	160,997,541円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	32,035,727円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	1,336,175,161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>	182,364,742円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,917,564,089円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,592,653,310円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	6,496,007,155円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	12,207,828,739円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	889,560,582円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	18,372,787,853円
三井住友・外国債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,705,209,184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)	6,915,935,789円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	313,491,697円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	5,346,105,812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)	23,692,929,757円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	238,771,107円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	73,826,314円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	20,724,711円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	276,708,641円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	990,037,268円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	299,755,363円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	275,250,718円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	82,841,102円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	9,383,177円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	2,374,760,671円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	63,057,691円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定>	8,078,015円
SMAM・FGグローバルバランス25VA<適格機関投資家限定>	34,877,333円
SMAM・グローバル・マルチアセット・グロース・ファンド(安定成長型)<適格機関投資家限定>	1,374,755円
SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定>	1,176,399円
SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション・ファンド<適格機関投資家限定>	1,193,905円
合計	168,867,973,833円

(3) 附属明細表  
有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B 0.25	7,000,000	7,006,015.66	
		US TREASURY N/B 0.25	7,000,000	7,006,015.66	
		US TREASURY N/B 0.25	13,000,000	13,009,140.69	
		US TREASURY N/B 0.25	7,000,000	7,004,375.00	
		US TREASURY N/B 0.25	13,000,000	13,003,046.94	
		US TREASURY N/B 0.25	14,000,000	13,994,531.32	
		US TREASURY N/B 0.25	8,000,000	7,996,250.00	
		US TREASURY N/B 0.25	14,000,000	13,987,968.82	
		US TREASURY N/B 0.25	8,000,000	7,983,125.04	
		US TREASURY N/B 0.25	8,000,000	7,961,875.04	
		US TREASURY N/B 0.375	4,000,000	4,008,125.00	
		US TREASURY N/B 0.375	8,000,000	8,015,625.04	
		US TREASURY N/B 0.375	8,000,000	8,015,625.04	
		US TREASURY N/B 0.375	4,000,000	4,002,812.52	
		US TREASURY N/B 0.375	12,000,000	11,987,812.56	
		US TREASURY N/B 0.5	13,000,000	12,998,984.44	
		US TREASURY N/B 0.5	4,000,000	3,924,687.52	
		US TREASURY N/B 0.625	8,000,000	8,011,875.04	
		US TREASURY N/B 0.625	5,000,000	4,998,046.90	
		US TREASURY N/B 0.625	14,000,000	13,980,312.50	
		US TREASURY N/B 0.625	5,000,000	4,945,703.15	
		US TREASURY N/B 0.625	8,000,000	7,871,250.00	
		US TREASURY N/B 0.625	5,000,000	4,891,406.25	
		US TREASURY N/B 0.75	5,000,000	4,956,640.65	
		US TREASURY N/B 0.75	7,000,000	6,840,312.50	
		US TREASURY N/B 0.75	3,000,000	2,925,234.39	
		US TREASURY N/B 0.875	13,000,000	13,097,500.00	
		US TREASURY N/B 0.875	6,000,000	6,030,000.00	
		US TREASURY N/B 0.875	6,000,000	6,024,843.78	
		US TREASURY N/B 0.875	7,000,000	7,022,421.91	
		US TREASURY N/B 0.875	3,000,000	3,005,859.39	
		US TREASURY N/B 1	2,000,000	2,021,718.76	
		US TREASURY N/B 1	5,000,000	5,051,757.80	
		US TREASURY N/B 1	4,000,000	4,037,812.52	
		US TREASURY N/B 1	7,000,000	7,032,812.50	
		US TREASURY N/B 1	5,000,000	4,774,609.40	
US TREASURY N/B 1	6,000,000	5,699,531.28			
US TREASURY N/B 1	2,000,000	1,896,406.26			
US TREASURY N/B 1	6,000,000	5,659,687.50			
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000	2,890,781.25			



US TREASURY N/B 1.125	3,800,000	3,576,156.25	
US TREASURY N/B 1.125	6,000,000	5,631,093.78	
US TREASURY N/B 1.25	8,000,000	8,131,250.00	
US TREASURY N/B 1.25	7,000,000	7,116,484.41	
US TREASURY N/B 1.25	5,000,000	5,085,546.90	
US TREASURY N/B 1.25	7,000,000	6,892,812.50	
US TREASURY N/B 1.25	5,000,000	4,866,015.65	
US TREASURY N/B 1.25	5,000,000	4,755,078.15	
US TREASURY N/B 1.375	5,000,000	5,099,609.40	
US TREASURY N/B 1.375	12,000,000	11,941,875.00	
US TREASURY N/B 1.375	6,500,000	6,446,679.72	
US TREASURY N/B 1.375	5,000,000	4,945,703.15	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000	2,963,906.25	
US TREASURY N/B 1.375	7,000,000	6,886,250.00	
US TREASURY N/B 1.375	5,000,000	4,760,546.90	
US TREASURY N/B 1.5	5,500,000	5,635,781.25	
US TREASURY N/B 1.5	8,000,000	8,195,625.04	
US TREASURY N/B 1.5	5,000,000	4,995,703.15	
US TREASURY N/B 1.625	8,000,000	7,315,625.04	
US TREASURY N/B 1.625	13,000,000	11,805,625.00	
US TREASURY N/B 1.75	5,000,000	5,118,750.00	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000	3,091,406.25	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000	3,026,250.00	
US TREASURY N/B 1.75	6,300,000	6,075,070.34	
US TREASURY N/B 1.75	6,000,000	5,582,343.78	
US TREASURY N/B 1.875	7,000,000	7,173,359.41	
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000	3,086,015.64	
US TREASURY N/B 1.875	10,000,000	10,284,375.00	
US TREASURY N/B 1.875	6,000,000	6,170,156.28	
US TREASURY N/B 11.25	2,000,000	2,254,843.76	
US TREASURY N/B 2	7,000,000	7,237,343.75	
US TREASURY N/B 2	3,000,000	2,961,796.89	
US TREASURY N/B 2	4,300,000	4,224,414.08	
US TREASURY N/B 2	3,000,000	2,879,062.50	
US TREASURY N/B 2	6,600,000	6,298,875.00	
US TREASURY N/B 2	17,500,000	16,335,156.25	
US TREASURY N/B 2.125	8,000,000	8,216,875.04	
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000	3,106,406.25	
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000	3,113,437.50	
US TREASURY N/B 2.125	5,500,000	5,456,171.87	
US TREASURY N/B 2.125	9,000,000	8,770,078.17	
US TREASURY N/B 2.25	10,000,000	10,229,687.50	
US TREASURY N/B 2.25	4,000,000	4,166,250.00	
US TREASURY N/B 2.25	2,000,000	2,070,468.76	
US TREASURY N/B 2.375	9,000,000	9,232,734.42	
US TREASURY N/B 2.375	5,500,000	5,744,062.50	
US TREASURY N/B 2.375	5,000,000	5,241,015.65	
US TREASURY N/B 2.375	2,000,000	2,082,656.26	
US TREASURY N/B 2.5	9,000,000	9,262,265.67	
US TREASURY N/B 2.5	10,000,000	10,309,375.00	

US TREASURY N/B 2.5	5,000,000	5,264,062.50	
US TREASURY N/B 2.625	8,000,000	8,201,250.00	
US TREASURY N/B 2.625	5,000,000	5,242,968.75	
US TREASURY N/B 2.625	5,000,000	5,253,125.00	
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000	4,220,625.00	
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000	4,216,562.52	
US TREASURY N/B 2.625	8,000,000	8,208,750.00	
US TREASURY N/B 2.625	9,500,000	9,708,554.73	
US TREASURY N/B 2.75	6,000,000	6,358,125.00	
US TREASURY N/B 2.75	5,000,000	5,306,640.65	
US TREASURY N/B 2.75	4,000,000	4,242,500.00	
US TREASURY N/B 2.75	6,000,000	6,318,750.00	
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000	1,596,250.00	
US TREASURY N/B 2.75	13,000,000	10,351,250.00	
US TREASURY N/B 2.875	4,000,000	4,258,437.52	
US TREASURY N/B 3	4,000,000	4,257,187.52	
US TREASURY N/B 3	5,000,000	5,324,609.40	
US TREASURY N/B 3	7,000,000	7,480,156.25	
US TREASURY N/B 3	7,000,000	5,913,359.41	
US TREASURY N/B 3.125	6,000,000	6,417,656.28	
US TREASURY N/B 3.125	3,200,000	3,430,000.00	
US TREASURY N/B 3.125	4,000,000	4,292,500.00	
US TREASURY N/B 3.125	2,000,000	2,141,250.00	
US TREASURY N/B 3.125	6,000,000	6,292,500.00	
US TREASURY N/B 3.125	2,000,000	1,739,843.76	
US TREASURY N/B 3.125	3,000,000	2,604,375.00	
US TREASURY N/B 3.25	4,000,000	4,267,812.52	
US TREASURY N/B 3.25	4,000,000	4,275,625.00	
US TREASURY N/B 3.25	5,000,000	5,350,390.65	
US TREASURY N/B 3.25	4,000,000	4,302,500.00	
US TREASURY N/B 3.25	4,000,000	4,307,187.52	
US TREASURY N/B 3.375	5,000,000	5,402,734.40	
US TREASURY N/B 3.5	8,500,000	9,268,320.35	
US TREASURY N/B 3.5	7,500,000	8,135,156.25	
US TREASURY N/B 3.5	3,000,000	2,846,953.14	
US TREASURY N/B 3.625	7,000,000	7,662,812.50	
US TREASURY N/B 3.625	9,000,000	9,846,562.50	
US TREASURY N/B 3.625	7,000,000	7,600,468.75	
US TREASURY N/B 3.75	7,000,000	7,720,781.25	
US TREASURY N/B 3.75	5,000,000	4,909,765.65	
US TREASURY N/B 3.875	6,000,000	6,642,187.50	
US TREASURY N/B 3.875	5,000,000	5,036,328.15	
US TREASURY N/B 4	7,700,000	8,037,476.60	
US TREASURY N/B 4	3,500,000	3,899,765.62	
US TREASURY N/B 4.125	4,200,000	4,429,031.25	
US TREASURY N/B 4.25	5,000,000	5,591,796.90	
US TREASURY N/B 4.25	3,000,000	3,224,296.89	
US TREASURY N/B 4.25	5,000,000	5,357,812.50	
US TREASURY N/B 4.375	2,200,000	2,411,406.25	
US TREASURY N/B 4.375	4,500,000	4,926,445.33	

US TREASURY N/B 4.375	4,000,000	4,379,375.00	
US TREASURY N/B 4.375	4,000,000	4,372,187.52	
US TREASURY N/B 4.5	5,800,000	6,258,109.40	
US TREASURY N/B 4.5	2,400,000	2,611,687.51	
US TREASURY N/B 4.5	3,000,000	3,358,828.14	
US TREASURY N/B 4.5	2,500,000	2,799,804.70	
US TREASURY N/B 4.5	2,000,000	2,234,218.76	
US TREASURY N/B 4.5	3,000,000	3,351,328.14	
US TREASURY N/B 4.625	5,200,000	5,789,062.50	
US TREASURY N/B 4.625	3,000,000	3,357,187.50	
US TREASURY N/B 4.625	4,000,000	4,553,125.00	
US TREASURY N/B 4.75	3,000,000	3,400,546.89	
US TREASURY N/B 4.75	1,000,000	1,157,343.75	
US TREASURY N/B 4.75	5,000,000	5,796,093.75	
US TREASURY N/B 4.875	3,400,000	3,785,687.50	
US TREASURY N/B 5	2,000,000	2,396,093.76	
US TREASURY N/B 5.125	3,700,000	4,109,601.58	
US TREASURY N/B 5.25	1,000,000	1,212,968.75	
US TREASURY N/B 5.25	1,500,000	1,818,632.82	
US TREASURY N/B 5.375	2,320,000	2,865,743.76	
US TREASURY N/B 5.5	2,000,000	2,483,906.26	
US TREASURY N/B 6	1,000,000	1,285,312.50	
US TREASURY N/B 6.125	1,000,000	1,310,312.50	
US TREASURY N/B 6.125	1,100,000	1,455,867.19	
US TREASURY N/B 6.25	2,500,000	3,233,593.75	
US TREASURY N/B 6.25	1,000,000	1,345,859.38	
US TREASURY N/B 6.5	1,000,000	1,344,843.75	
US TREASURY N/B 6.75	1,000,000	1,370,625.00	
US TREASURY N/B 7.125	1,400,000	1,901,484.38	
US TREASURY N/B 7.25	4,000,000	4,645,937.52	
US TREASURY N/B 7.25	2,500,000	3,400,781.25	
US TREASURY N/B 7.5	1,000,000	1,422,421.88	
US TREASURY N/B 8	2,800,000	3,916,718.76	
US TREASURY N/B 8.125	1,000,000	1,393,906.25	
US TREASURY N/B 8.75	1,000,000	1,263,203.13	
US TREASURY N/B 8.75	1,000,000	1,412,421.88	
US TREASURY N/B 8.875	2,100,000	2,855,179.69	
米ドル小計 (邦貨換算額：円)	947,520,000	971,165,519.64 (101,389,680,250)	
カナダドル			
CANADA-GOV'T 1	1,500,000	1,499,655.00	
CANADA-GOV'T 1.5	1,000,000	1,006,900.00	
CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000	2,008,080.00	
CANADA-GOV'T 1.5	1,000,000	997,590.00	
CANADA-GOV'T 1.5	1,000,000	900,300.00	
CANADA-GOV'T 2	4,000,000	4,037,200.00	
CANADA-GOV'T 2	2,000,000	2,040,840.00	
CANADA-GOV'T 2.5	2,000,000	2,041,420.00	
CANADA-GOV'T 2.75	2,000,000	2,079,540.00	
CANADA-GOV'T 2.75	2,000,000	2,026,800.00	
CANADA-GOV'T 3	4,500,000	4,539,915.00	

	CANADA-GOV'T 3	3,000,000	3,107,730.00	
	CANADA-GOV'T 3.25	2,000,000	2,122,280.00	
	CANADA-GOV'T 3.5	2,000,000	2,161,680.00	
	CANADA-GOV'T 3.75	4,500,000	4,908,780.00	
	CANADA-GOV'T 4	3,000,000	3,205,410.00	
	CANADA-GOV'T 4	2,000,000	2,171,600.00	
	CANADA-GOV'T 4	4,000,000	4,568,000.00	
	CANADA-GOV'T 4.25	2,500,000	2,766,500.00	
	CANADA-GOV'T 4.5	2,000,000	2,098,420.00	
	CANADA-GOV'T 5	1,500,000	1,526,430.00	
	CANADA-GOV'T 5	4,000,000	5,191,720.00	
	CANADA-GOV'T 5.75	1,300,000	1,735,461.00	
	CANADA-GOV'T 5.75	3,000,000	4,134,840.00	
	CANADA-GOV'T 8	400,000	578,920.00	
	CANADA-GOV'T 8	1,000,000	1,562,840.00	
	CANADA-GOV'T 9	980,000	1,575,065.80	
	カナダドル小計 (邦貨換算額：円)	60,180,000	66,593,916.80 (6,513,551,002)	
オーストラリアドル	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,000,000	873,995.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	2,000,000	1,796,200.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	1,500,000	1,265,100.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25	1,000,000	1,039,800.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	2,000,000	2,033,100.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	4,000,000	4,177,000.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	1,500,000	1,440,300.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.75	1,000,000	1,036,910.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.75	4,000,000	4,188,200.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.75	1,200,000	1,227,960.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.25	3,000,000	3,254,550.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	2,000,000	2,173,400.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	3,500,000	3,860,150.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	4,000,000	4,470,000.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	2,000,000	2,239,000.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 6	3,300,000	3,598,650.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 6.25	3,000,000	3,143,040.00	
	オーストラリアドル小計 (邦貨換算額：円)	40,000,000	41,817,355.00 (3,869,359,858)	
英ポンド	TREASURY 1	4,800,000	4,735,392.00	
	TREASURY 1.25	1,500,000	1,471,515.00	
	TREASURY 1.75	3,000,000	3,060,810.00	
	TREASURY 1.75	3,500,000	3,228,400.00	
	TREASURY 2	3,000,000	3,081,510.00	
	TREASURY 2.25	4,700,000	4,428,810.00	
	TREASURY 2.75	2,000,000	2,049,420.00	
	TREASURY 3.75	3,000,000	3,267,330.00	
	TREASURY 3.75	4,300,000	4,691,730.00	
	TREASURY 3.75	4,400,000	4,778,400.00	
	TREASURY 3.75	2,300,000	2,370,932.00	
		TREASURY 4	4,800,000	5,204,640.00

TREASURY 4	2,000,000	2,200,640.00	
TREASURY 4	2,000,000	2,205,380.00	
TREASURY 4.25	2,300,000	2,539,269.00	
TREASURY 4.25	3,000,000	3,310,650.00	
TREASURY 4.25	3,400,000	3,760,060.00	
TREASURY 4.25	2,500,000	2,773,000.00	
TREASURY 4.25	3,000,000	3,336,540.00	
TREASURY 4.25	3,900,000	4,395,300.00	
TREASURY 4.25	2,700,000	3,061,233.00	
TREASURY 4.25	3,900,000	4,495,725.00	
TREASURY 4.5	4,200,000	4,734,996.00	
TREASURY 4.5	3,500,000	3,994,410.00	
TREASURY 4.5	3,500,000	4,075,715.00	
TREASURY 4.75	4,400,000	4,716,360.00	
TREASURY 4.75	3,700,000	4,251,670.00	
TREASURY 4.75	2,800,000	3,275,636.00	
TREASURY 4.75	3,000,000	3,563,400.00	
TREASURY 5	3,500,000	3,993,920.00	
TREASURY 5	2,500,000	2,947,250.00	
TREASURY 6	2,000,000	2,624,300.00	
TREASURY 8	1,900,000	2,176,450.00	
TREASURY 8	2,620,000	3,608,395.00	
TREASURY 8.75	1,300,000	1,647,750.00	
英ポンド小計 (邦貨換算額：円)	108,920,000	120,056,938.00 (20,503,323,871)	
スイスフラン	SWISS (GOVT) 2.25	900,000	991,980.00
	SWISS (GOVT) 2.5	2,000,000	2,115,000.00
	SWISS (GOVT) 3	500,000	556,500.00
	SWISS (GOVT) 3	1,500,000	1,708,350.00
	SWISS (GOVT) 4	1,000,000	1,256,500.00
	SWISS (GOVT) 4	700,000	921,900.00
	SWISS (GOVT) 4.25	1,000,000	1,143,200.00
スイスフラン小計 (邦貨換算額：円)	7,600,000	8,693,430.00 (1,009,568,025)	
シンガポールドル	SINGAPORE GOV'T 2.25	500,000	501,350.00
	SINGAPORE GOV'T 2.75	400,000	380,240.00
	SINGAPORE GOV'T 2.875	1,400,000	1,384,320.00
	SINGAPORE GOV'T 3.125	1,000,000	1,053,000.00
	SINGAPORE GOV'T 3.25	1,000,000	1,075,400.00
	SINGAPORE GOV'T 3.5	1,500,000	1,598,775.00
	SINGAPORE GOV'T 3.625	2,500,000	2,544,000.00
	SINGAPORE GOV'T 3.75	1,000,000	1,091,750.00
	SINGAPORE GOV'T 4	2,100,000	2,376,780.00
シンガポールドル小計 (邦貨換算額：円)	11,400,000	12,005,615.00 (988,422,282)	
マレーシア リンギット	MALAYSIAN GOV'T 3.418	8,000,000	7,592,320.00
	MALAYSIAN GOV'T 3.502	9,000,000	8,192,700.00
	MALAYSIAN GOV'T 3.741	10,000,000	10,068,000.00

	MALAYSIAN GOV'T 3.814	2,000,000	2,018,500.00	
	MALAYSIAN GOV'T 4.24	5,000,000	5,096,545.00	
	MALAYSIAN GOV'T 4.262	3,000,000	3,069,600.00	
	MALAYSIAN GOV'T 4.378	5,000,000	5,099,355.00	
	MALAYSIAN GOV'T 5.094	2,000,000	2,014,704.00	
	マレーシアリングット小計 (邦貨換算額:円)	44,000,000	43,151,724.00 (1,372,224,823)	
スウェーデン クローナ	SWEDISH GOVRNMNT 1.5	8,000,000	7,343,520.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3	11,000,000	11,535,700.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	11,000,000	12,039,500.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	12,000,000	12,626,640.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 3.75	13,200,000	14,310,120.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 4.25	12,000,000	13,509,000.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 4.5	13,000,000	13,772,200.00	
	SWEDISH GOVRNMNT 5	5,000,000	5,946,500.00	
	スウェーデンクローナ小計 (邦貨換算額:円)	85,200,000	91,083,180.00 (1,442,757,571)	
ノルウェー クローネ	NORWEGIAN GOV'T 3.75	16,000,000	17,121,600.00	
	NORWEGIAN GOV'T 4.25	10,000,000	10,798,000.00	
	NORWEGIAN GOV'T 4.5	6,000,000	6,666,000.00	
	NORWEGIAN GOV'T 5	12,000,000	12,584,400.00	
	ノルウェークローネ小計 (邦貨換算額:円)	44,000,000	47,170,000.00 (799,531,500)	
デンマーク クローネ	DENMARK - BULLET 3	10,000,000	11,085,500.00	
	DENMARK - BULLET 4	16,000,000	17,145,600.00	
	DENMARK - BULLET 4	15,000,000	16,996,500.00	
	DENMARK - BULLET 4	21,000,000	24,474,870.00	
	DENMARK - BULLET 4.5	24,000,000	32,268,000.00	
	DENMARK - BULLET 7	5,080,000	7,626,604.00	
	デンマーククローネ小計 (邦貨換算額:円)	91,080,000	109,597,074.00 (2,091,112,171)	
メキシコペ ソ	MEXICAN BONOS 7.25	70,000,000	75,687,500.00	
	MEXICAN BONOS 7.75	20,000,000	22,202,000.00	
	MEXICAN BONOS 8	50,000,000	56,595,100.00	
	MEXICAN BONOS 8.5	50,000,000	57,027,650.00	
	MEXICAN BONOS 8.5	55,000,000	60,786,000.00	
	MEXICAN BONOS 9.5	50,000,000	52,874,550.00	
	メキシコペソ小計 (邦貨換算額:円)	295,000,000	325,172,800.00 (2,614,389,312)	
ポーランド ズロチ	POLAND GOVT BOND 5	11,000,000	11,497,200.00	
	POLAND GOVT BOND 5.25	8,000,000	8,536,800.00	
	POLAND GOVT BOND 5.25	5,000,000	5,365,000.00	
	POLAND GOVT BOND 5.5	5,000,000	5,180,000.00	
	POLAND GOVT BOND 5.5	6,000,000	6,540,000.00	
	POLAND GOVT BOND 5.75	4,000,000	4,414,000.00	
	POLAND GOVT BOND 5.75	10,200,000	11,260,800.00	
	POLAND GOVT BOND 5.75	4,000,000	4,470,000.00	

	POLAND GOVT BOND 6.25	7,500,000	7,965,000.00	
	ポーランドズロチ小計 (邦貨換算額:円)	60,700,000	65,228,800.00 (2,232,781,824)	
南アフリカ ランド	REP SOUTH AFRICA 6.5	35,000,000	25,777,500.00	
	REP SOUTH AFRICA 6.75	40,000,000	38,276,000.00	
	REP SOUTH AFRICA 7	30,000,000	25,236,000.00	
	REP SOUTH AFRICA 8	25,000,000	25,911,250.00	
	REP SOUTH AFRICA 8.25	8,000,000	8,367,200.00	
	REP SOUTH AFRICA 8.75	8,000,000	8,295,760.00	
	南アフリカランド小計 (邦貨換算額:円)	146,000,000	131,863,710.00 (1,319,955,737)	
ユーロ	BELGIAN 0326 4	1,000,000	1,114,430.00	
	BELGIAN 0282 8	2,000,000	2,195,100.00	
	BELGIAN 0291 5.5	3,000,000	3,895,290.00	
	BELGIAN 0300 5.5	1,740,000	2,039,680.20	
	BELGIAN 0304 5	3,500,000	4,439,820.00	
	BELGIAN 0306 3.75	2,300,000	2,440,944.00	
	BELGIAN 0307 3.25	2,000,000	2,149,800.00	
	BELGIAN 0308 4	3,500,000	3,991,050.00	
	BELGIAN 0309 4	1,500,000	1,660,275.00	
	BELGIAN 0312 4	2,000,000	2,250,500.00	
	BELGIAN 0315 4	2,500,000	2,842,575.00	
	BELGIAN 0316 3.5	1,500,000	1,561,695.00	
	BELGIAN 0318 3.75	3,000,000	3,389,100.00	
	BELGIAN 0319 2.75	2,000,000	2,105,360.00	
	BELGIAN 0320 4.25	2,000,000	2,320,400.00	
	BELGIAN 0321 4.25	1,700,000	1,975,111.00	
	BELGIAN 0323 3.5	2,000,000	2,188,760.00	
	BELGIAN 0324 4.5	2,000,000	2,353,400.00	
	BELGIAN 0325 4.25	2,000,000	2,313,700.00	
	BELGIAN 0327 3	2,000,000	2,166,440.00	
	BELGIAN 0328 2.25	3,000,000	2,951,340.00	
	BTAN 1	3,500,000	3,532,900.00	
	BTAN 1.75	3,500,000	3,626,630.00	
	BTAN 2	5,000,000	5,134,500.00	
	BTAN 2.25	4,000,000	4,163,400.00	
	BTAN 2.5	3,000,000	3,072,750.00	
	BTAN 2.5	3,600,000	3,790,188.00	
	BTPS 2.5	3,000,000	3,055,650.00	
	BTPS 3	2,500,000	2,566,375.00	
	BTPS 3	6,400,000	6,579,840.00	
	BTPS 3	4,000,000	4,133,720.00	
	BTPS 3.5	3,400,000	3,544,772.00	
BTPS 3.75	6,200,000	6,456,370.00		
BTPS 3.75	3,000,000	3,156,690.00		
BTPS 3.75	4,700,000	4,957,231.00		
BTPS 3.75	5,000,000	5,136,150.00		
BTPS 3.75	5,300,000	5,431,069.00		
BTPS 4	2,500,000	2,658,125.00		

BTPS 4	4,500,000	4,733,685.00	
BTPS 4	3,500,000	3,238,655.00	
BTPS 4.25	3,000,000	3,111,390.00	
BTPS 4.25	5,400,000	5,793,552.00	
BTPS 4.25	4,500,000	4,819,500.00	
BTPS 4.25	4,300,000	4,578,640.00	
BTPS 4.5	6,000,000	6,495,480.00	
BTPS 4.5	5,000,000	5,431,000.00	
BTPS 4.5	3,700,000	4,009,616.00	
BTPS 4.5	3,700,000	3,989,081.00	
BTPS 4.5	4,800,000	5,026,896.00	
BTPS 4.5	3,000,000	3,108,450.00	
BTPS 4.75	3,500,000	3,786,405.00	
BTPS 4.75	4,000,000	4,343,800.00	
BTPS 4.75	2,000,000	2,172,000.00	
BTPS 4.75	4,600,000	4,991,920.00	
BTPS 4.75	5,500,000	5,892,975.00	
BTPS 5	2,000,000	2,188,460.00	
BTPS 5	4,000,000	4,301,920.00	
BTPS 5	3,970,000	4,157,106.10	
BTPS 5	4,000,000	4,166,000.00	
BTPS 5	4,000,000	4,139,520.00	
BTPS 5.25	5,000,000	5,526,650.00	
BTPS 5.25	4,700,000	5,101,991.00	
BTPS 5.5	5,000,000	5,628,150.00	
BTPS 5.5	3,000,000	3,378,390.00	
BTPS 5.75	2,700,000	3,089,151.00	
BTPS 6	5,600,000	6,550,320.00	
BTPS 6.5	5,960,000	7,248,552.00	
BTPS 7.25	2,000,000	2,577,460.00	
BTPS 9	2,000,000	2,823,900.00	
BUNDESOBL-156 2.5	4,500,000	4,623,525.00	
BUNDESOBL-157 2.25	5,500,000	5,648,225.00	
BUNDESOBL-158 1.75	4,000,000	4,111,520.00	
BUNDESOBL-159 2	3,000,000	3,115,800.00	
BUNDESOBL-160 2.75	4,000,000	4,229,400.00	
BUNDESOBL-161 1.25	2,000,000	2,052,400.00	
BUNDESOBL-162 0.75	2,500,000	2,526,925.00	
BUNDESOBL-163 0.5	2,000,000	2,003,500.00	
BUNDESOBL-164 0.5	3,000,000	2,992,740.00	
BUNDESOBL-165 0.5	2,000,000	1,986,300.00	
BUNDESOBL-167 1	2,000,000	2,013,100.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	4,500,000	4,432,050.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	3,500,000	3,415,930.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,000,000	1,941,800.00	
DEUTSCHLAND REP 1.75	3,500,000	3,528,630.00	
DEUTSCHLAND REP 2	2,000,000	2,069,500.00	
DEUTSCHLAND REP 2	2,500,000	2,528,200.00	
DEUTSCHLAND REP 2.25	3,500,000	3,727,150.00	
DEUTSCHLAND REP 2.25	3,000,000	3,173,760.00	



DEUTSCHLAND REP 2.5	4,000,000	4,313,800.00	
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,700,000	2,587,896.00	
DEUTSCHLAND REP 3	3,000,000	3,338,190.00	
DEUTSCHLAND REP 3.25	3,000,000	3,140,010.00	
DEUTSCHLAND REP 3.25	4,000,000	4,500,800.00	
DEUTSCHLAND REP 3.25	3,000,000	3,390,600.00	
DEUTSCHLAND REP 3.25	3,000,000	3,324,660.00	
DEUTSCHLAND REP 3.5	5,200,000	5,546,996.00	
DEUTSCHLAND REP 3.5	4,000,000	4,540,400.00	
DEUTSCHLAND REP 3.75	6,000,000	6,222,480.00	
DEUTSCHLAND REP 3.75	4,000,000	4,409,200.00	
DEUTSCHLAND REP 3.75	4,500,000	5,137,425.00	
DEUTSCHLAND REP 4	3,900,000	4,265,742.00	
DEUTSCHLAND REP 4	6,000,000	6,810,900.00	
DEUTSCHLAND REP 4	3,200,000	3,906,240.00	
DEUTSCHLAND REP 4.25	3,000,000	3,395,340.00	
DEUTSCHLAND REP 4.25	4,200,000	4,856,754.00	
DEUTSCHLAND REP 4.25	2,500,000	3,207,125.00	
DEUTSCHLAND REP 4.75	2,300,000	2,958,605.00	
DEUTSCHLAND REP 4.75	3,100,000	4,121,853.00	
DEUTSCHLAND REP 4.75	2,400,000	3,323,160.00	
DEUTSCHLAND REP 5.5	2,800,000	3,929,884.00	
DEUTSCHLAND REP 5.625	2,980,000	4,139,816.00	
DEUTSCHLAND REP 6	890,000	1,016,335.50	
DEUTSCHLAND REP 6.25	1,200,000	1,679,436.00	
DEUTSCHLAND REP 6.25	1,700,000	2,539,851.00	
DEUTSCHLAND REP 6.5	2,000,000	2,979,800.00	
FINNISH GOV'T 1.625	2,000,000	1,946,900.00	
FINNISH GOV'T 1.75	1,200,000	1,240,080.00	
FINNISH GOV'T 2.75	1,100,000	1,119,305.00	
FINNISH GOV'T 3.375	1,200,000	1,342,140.00	
FINNISH GOV'T 3.5	1,000,000	1,125,930.00	
FINNISH GOV'T 3.875	2,000,000	2,231,900.00	
FINNISH GOV'T 4	1,000,000	1,165,750.00	
FINNISH GOV'T 4.25	1,300,000	1,380,600.00	
FINNISH GOV'T 4.375	1,000,000	1,169,470.00	
FRANCE O.A.T. 1	4,000,000	4,003,520.00	
FRANCE O.A.T. 1	1,000,000	993,430.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	3,000,000	2,868,000.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	2,300,000	2,319,504.00	
FRANCE O.A.T. 2.5	5,500,000	5,814,215.00	
FRANCE O.A.T. 2.75	1,000,000	988,430.00	
FRANCE O.A.T. 3	7,200,000	7,560,000.00	
FRANCE O.A.T. 3	7,000,000	7,532,140.00	
FRANCE O.A.T. 3.25	6,700,000	7,145,751.00	
FRANCE O.A.T. 3.25	7,000,000	7,697,060.00	
FRANCE O.A.T. 3.5	5,600,000	5,843,600.00	
FRANCE O.A.T. 3.5	6,000,000	6,729,480.00	
FRANCE O.A.T. 3.5	6,000,000	6,501,180.00	
FRANCE O.A.T. 3.75	5,000,000	5,512,250.00	

FRANCE O.A.T. 3.75	5,000,000	5,669,150.00	
FRANCE O.A.T. 3.75	5,700,000	6,480,900.00	
FRANCE O.A.T. 4	4,000,000	4,520,000.00	
FRANCE O.A.T. 4	3,700,000	4,180,260.00	
FRANCE O.A.T. 4	2,870,000	3,254,723.50	
FRANCE O.A.T. 4	2,000,000	2,277,200.00	
FRANCE O.A.T. 4.25	4,500,000	5,088,150.00	
FRANCE O.A.T. 4.25	5,000,000	5,746,000.00	
FRANCE O.A.T. 4.25	7,400,000	8,550,182.00	
FRANCE O.A.T. 4.25	5,500,000	6,413,550.00	
FRANCE O.A.T. 4.5	3,700,000	4,516,516.00	
FRANCE O.A.T. 4.75	3,600,000	4,492,260.00	
FRANCE O.A.T. 5	5,600,000	6,312,712.00	
FRANCE O.A.T. 5.5	5,500,000	7,253,840.00	
FRANCE O.A.T. 5.75	4,700,000	6,518,336.00	
FRANCE O.A.T. 6	3,500,000	4,704,805.00	
FRANCE O.A.T. 8.5	2,550,000	3,574,845.00	
FRANCE O.A.T. 8.5	2,200,000	3,369,696.00	
IRISH GOVT 4.4	1,500,000	1,650,150.00	
IRISH GOVT 4.5	2,000,000	2,219,460.00	
IRISH GOVT 4.5	2,490,000	2,724,010.20	
IRISH GOVT 4.6	1,800,000	1,953,684.00	
IRISH GOVT 5	1,000,000	1,124,130.00	
IRISH GOVT 5.4	2,000,000	2,276,700.00	
IRISH GOVT 5.5	1,500,000	1,707,525.00	
IRISH GOVT 5.9	1,300,000	1,528,020.00	
ITALY GOV'T INT 5.75	1,000,000	1,097,750.00	
NETHERLANDS GOVT 0.75	2,000,000	2,013,800.00	
NETHERLANDS GOVT 1.25	1,500,000	1,524,075.00	
NETHERLANDS GOVT 1.25	1,000,000	1,005,700.00	
NETHERLANDS GOVT 1.75	3,000,000	2,893,200.00	
NETHERLANDS GOVT 2.25	2,000,000	2,045,800.00	
NETHERLANDS GOVT 2.5	3,000,000	3,175,500.00	
NETHERLANDS GOVT 2.5	1,600,000	1,532,560.00	
NETHERLANDS GOVT 2.75	3,500,000	3,594,325.00	
NETHERLANDS GOVT 3.25	1,600,000	1,674,528.00	
NETHERLANDS GOVT 3.25	2,500,000	2,766,750.00	
NETHERLANDS GOVT 3.5	3,000,000	3,376,440.00	
NETHERLANDS GOVT 3.75	2,000,000	2,282,600.00	
NETHERLANDS GOVT 3.75	2,500,000	2,941,375.00	
NETHERLANDS GOVT 4	3,300,000	3,598,584.00	
NETHERLANDS GOVT 4	3,500,000	3,968,405.00	
NETHERLANDS GOVT 4	1,500,000	1,722,045.00	
NETHERLANDS GOVT 4	2,700,000	3,240,405.00	
NETHERLANDS GOVT 4.5	3,000,000	3,398,400.00	
NETHERLANDS GOVT 5.5	1,500,000	2,017,650.00	
NETHERLANDS GOVT 7.5	1,000,000	1,452,180.00	
REP OF AUSTRIA 3.15	1,000,000	1,043,580.00	
REP OF AUSTRIA 3.2	2,700,000	2,925,450.00	
REP OF AUSTRIA 3.4	1,000,000	1,111,130.00	

REP OF AUSTRIA 3.5	3,200,000	3,362,656.00	
REP OF AUSTRIA 3.5	3,000,000	3,370,650.00	
REP OF AUSTRIA 3.65	2,000,000	2,265,300.00	
REP OF AUSTRIA 3.8	1,000,000	1,216,430.00	
REP OF AUSTRIA 3.9	2,000,000	2,297,900.00	
REP OF AUSTRIA 4	1,000,000	1,096,850.00	
REP OF AUSTRIA 4.15	1,800,000	2,180,340.00	
REP OF AUSTRIA 4.3	1,500,000	1,696,770.00	
REP OF AUSTRIA 4.35	2,200,000	2,555,300.00	
REP OF AUSTRIA 4.65	2,000,000	2,304,800.00	
REP OF AUSTRIA 4.85	1,000,000	1,250,350.00	
REP OF AUSTRIA 6.25	1,500,000	2,130,675.00	
SPANISH GOV'T 3	6,000,000	6,148,500.00	
SPANISH GOV'T 3.15	3,800,000	3,924,450.00	
SPANISH GOV'T 3.25	5,000,000	5,175,400.00	
SPANISH GOV'T 3.3	2,000,000	2,071,660.00	
SPANISH GOV'T 3.75	2,000,000	2,085,960.00	
SPANISH GOV'T 3.75	1,000,000	1,046,020.00	
SPANISH GOV'T 3.8	4,500,000	4,736,790.00	
SPANISH GOV'T 4	2,500,000	2,607,375.00	
SPANISH GOV'T 4	4,000,000	4,160,400.00	
SPANISH GOV'T 4.1	3,000,000	3,197,340.00	
SPANISH GOV'T 4.2	3,250,000	2,956,297.50	
SPANISH GOV'T 4.25	4,000,000	4,254,600.00	
SPANISH GOV'T 4.3	4,000,000	4,261,120.00	
SPANISH GOV'T 4.4	3,800,000	3,941,170.00	
SPANISH GOV'T 4.5	2,500,000	2,694,325.00	
SPANISH GOV'T 4.6	3,500,000	3,790,605.00	
SPANISH GOV'T 4.65	2,500,000	2,574,950.00	
SPANISH GOV'T 4.7	2,000,000	1,933,940.00	
SPANISH GOV'T 4.8	4,300,000	4,527,384.00	
SPANISH GOV'T 4.85	4,000,000	4,340,120.00	
SPANISH GOV'T 4.9	3,000,000	2,995,740.00	
SPANISH GOV'T 5.15	1,500,000	1,586,820.00	
SPANISH GOV'T 5.4	3,000,000	3,305,100.00	
SPANISH GOV'T 5.5	3,380,000	3,757,647.40	
SPANISH GOV'T 5.5	4,000,000	4,476,400.00	
SPANISH GOV'T 5.75	2,700,000	3,054,780.00	
SPANISH GOV'T 5.85	3,500,000	3,982,300.00	
SPANISH GOV'T 5.9	1,000,000	1,144,380.00	
SPANISH GOV'T 6	2,400,000	2,759,472.00	
ユーロ小計 (邦貨換算額：円)	722,780,000	795,404,237.40 (113,241,701,278)	
国債証券合計		259,388,359,504 (259,388,359,504)	
合計		259,388,359,504	
(外貨建有価証券邦貨換算額合計：円)		(259,388,359,504)	

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

通貨	銘柄数	組入債券時価比率	合計金額に対する比率
----	-----	----------	------------

米ドル	国債証券	177銘柄	38.0%	39.1%
カナダドル	国債証券	27銘柄	2.4%	2.5%
オーストラリアドル	国債証券	17銘柄	1.5%	1.5%
英ポンド	国債証券	35銘柄	7.7%	7.9%
スイスフラン	国債証券	7銘柄	0.4%	0.4%
シンガポールドル	国債証券	9銘柄	0.4%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券	8銘柄	0.5%	0.5%
スウェーデンクローナ	国債証券	8銘柄	0.5%	0.6%
ノルウェークローネ	国債証券	4銘柄	0.3%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券	6銘柄	0.8%	0.8%
メキシコペソ	国債証券	6銘柄	1.0%	1.0%
ポーランドズロチ	国債証券	9銘柄	0.8%	0.9%
南アフリカランド	国債証券	6銘柄	0.5%	0.5%
ユーロ	国債証券	229銘柄	42.5%	43.7%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

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

## (1) 貸借対照表

		(単位:円)
		(平成25年12月19日現在)
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券		296,227,480
流動資産合計		296,227,480
資産合計		296,227,480
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		1,561
未払委託者報酬		13,949
流動負債合計		15,510
負債合計		15,510
純資産の部		
元本等		
元本		293,785,017
剰余金		
剰余金又は欠損金( )		2,426,953
元本等合計		296,211,970
純資産合計		296,211,970
負債純資産合計		296,227,480

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	自 平成25年 4月16日 至 平成25年12月19日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

## ( 貸借対照表に関する注記 )

項 目	( 平成25年12月19日現在 )
1. 受益権総数	平成25年12月19日における受益権の総数 293,785,017口
2. 1単位当たり純資産額	1.0083円 ( 1万口 = 10,083円 )

## ( 金融商品に関する注記 )

## . 金融商品の状況に関する事項

項 目	自 平成25年 4月16日 至 平成25年12月19日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成25年12月19日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（デリバティブ取引に関する注記）

（平成25年12月19日現在）  
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

（自平成25年4月16日 至平成25年12月19日）  
該当事項はありません。

（その他の注記）

（平成25年12月19日現在）	
期首（平成25年 4月16日）における元本額	267,383,768円
期首より平成25年12月19日現在までの追加設定元本額	37,364,801円
期首より平成25年12月19日現在までの一部解約元本額	10,963,552円

（3）附属明細表  
有価証券明細表

(a) 株式  
該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託 受益証券	マネーインカム・マザーファンド	292,975,453	296,227,480	
	親投資信託受益証券 小計	292,975,453	296,227,480	
合計			296,227,480	

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



## （参考情報）

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

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

## 「マネーインカム・マザーファンド」の状況

## （１）貸借対照表

		（単位：円）
		（平成25年12月19日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		13,613,718
国債証券		1,315,144,500
未収利息		4,147,280
前払費用		2,220,638
流動資産合計		1,335,126,136
資産合計		1,335,126,136
負債の部		
流動負債		
流動負債合計		
負債合計		
純資産の部		
元本等		
元本		1,320,481,280
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		14,644,856
元本等合計		1,335,126,136
純資産合計		1,335,126,136
負債純資産合計		1,335,126,136

## ( 2 ) 注記表

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	自 平成25年 4月16日 至 平成25年12月19日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

## ( 貸借対照表に関する注記 )

項 目	( 平成25年12月19日現在 )
1. 受益権総数	平成25年12月19日における受益権の総数 1,320,481,280口
2. 1単位当たり純資産額	1.0111円 ( 1万口 = 10,111円 )

## ( 金融商品に関する注記 )

## . 金融商品の状況に関する事項

項 目	自 平成25年 4月16日 至 平成25年12月19日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成25年12月19日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(国債証券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成25年12月19日現在)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

(自平成25年4月16日 至 平成25年12月19日)

該当事項はありません。

(その他の注記)

(平成25年12月19日現在)

開示対象ファンドの	
期首(平成25年4月16日)における当該親投資信託の元本額	1,616,825,023円
期首より平成25年12月19日現在までの追加設定元本額	335,345,343円
期首より平成25年12月19日現在までの一部解約元本額	631,689,086円
平成25年12月19日現在の元本の内訳	
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	67,732円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	6,672,099円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	1,355,943円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	1,008,442円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	1,138,980円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	302,260円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	910,379円
三井住友・ロシア株式オープン	999,001円
S M A M円高期待ファンド(豪ドル安型)	18,939,095円
S M A M円高期待ファンド(米ドル安型)	4,681,033円
S M A M円高期待ファンド(ユーロ安型)	19,521,387円
アジア高成長国C Bファンド	29,767,812円
日興ニューバーガー米国小型ハイクオリティファンド(毎月決算型)	99,128円
日興ニューバーガー米国小型ハイクオリティファンド(資産成長型)	297,384円
S M A M・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	292,975,453円
S M A M・バランス先物ファンドV A 2 0 <適格機関投資家限定>	665,494,695円
S M A M・F GマネーファンドV A <適格機関投資家限定>	276,250,457円
合 計	1,320,481,280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258回利付国債(10年)	637,000,000	638,834,560	
	第260回利付国債(10年)	223,000,000	224,656,890	
	第263回利付国債(10年)	223,000,000	225,513,210	
	第265回利付国債(10年)	223,000,000	226,139,840	
	国債証券 小計	1,306,000,000	1,315,144,500	
合計			1,315,144,500	

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

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

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

平成26年1月31日現在

資産総額	421,462,590 円
負債総額	1,246,787 円
純資産総額( - )	420,215,803 円
発行済口数	354,079,957 口
1口当たり純資産額( / )	1.1868 円
( 1万口当たり純資産額	11,868 円)

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

平成26年1月31日現在

資産総額	807,341,245 円
負債総額	2,254,630 円
純資産総額( - )	805,086,615 円
発行済口数	611,770,169 口
1口当たり純資産額( / )	1.3160 円
( 1万口当たり純資産額	13,160 円)

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

平成26年1月31日現在

資産総額	544,087,600 円
負債総額	1,610,849 円
純資産総額( - )	542,476,751 円
発行済口数	407,433,903 口
1口当たり純資産額( / )	1.3314 円
( 1万口当たり純資産額	13,314 円)

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

平成26年1月31日現在

資産総額	445,907,608 円
負債総額	2,732,418 円
純資産総額( - )	443,175,190 円
発行済口数	332,591,201 口
1口当たり純資産額( / )	1.3325 円
( 1万口当たり純資産額	13,325 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します。
- c. 上記 a の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

#### (ロ) 受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件

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

### ホ 受益権の再分割

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

### 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26年1月31日現在
資本金の額	2,000百万円
会社が発行する株式の総数	60,000 株
発行済株式総数	17,640 株

ロ 最近5年間における資本金の額の増減  
該当ありません。

##### ハ 会社の機構

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

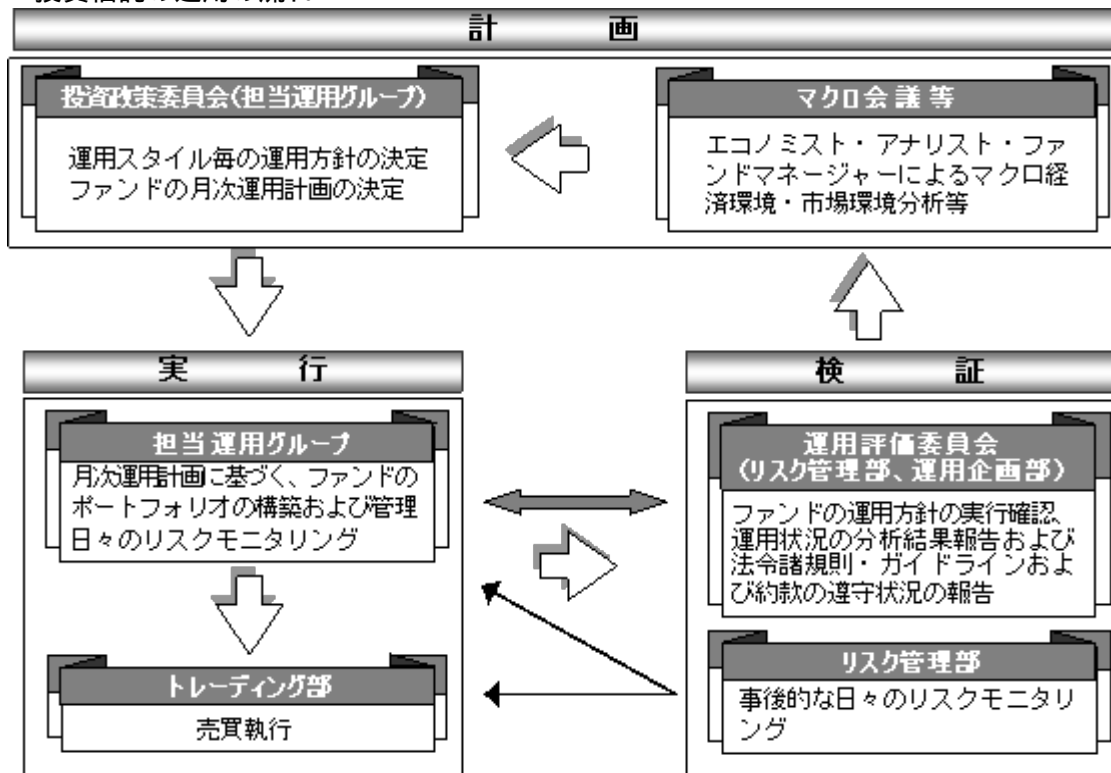
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役を若干名を選定します。

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

##### ニ 投資信託の運用の流れ





## 2【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行っています。

平成26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26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	23 ( 7 )	182,956 ( 32,744 )
	追加型	391 ( 159 )	5,213,220 ( 3,315,764 )
	計	414 ( 166 )	5,396,176 ( 3,348,508 )
公社債投資信託	単位型	4 ( 4 )	12,580 ( 12,580 )
	追加型	4 ( 1 )	271,515 ( 186,561 )
	計	8 ( 5 )	284,095 ( 199,141 )
合 計		422 ( 171 )	5,680,271 ( 3,547,649 )

（ ）内は、私募投資信託分であり、内書き表記しております。

### 3【委託会社等の経理状況】

- 1 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。  
また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
- 2 当社は、第28期（平成24年4月1日から平成25年3月31日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の監査を受けており、第29期中間会計期間（平成25年4月1日から平成25年9月30日まで）の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の中間監査を受けております。

## ( 1 ) 【貸借対照表】

(単位：千円)

		第 27 期 (平成24年3月31日)	第 28 期 (平成25年3月31日)
(資産の部)			
流動資産			
現金及び預金	2	15,970,870	17,748,821
有価証券		3,999,305	3,999,613
前払費用		259,411	260,095
未収入金		32,426	7,550
未収委託者報酬		3,392,765	3,641,029
未収運用受託報酬		305,910	439,648
未収投資助言報酬	2	452,618	470,228
未収収益		14,092	12,379
繰延税金資産		155,946	230,101
その他の流動資産		9,011	15,233
流動資産計		24,592,358	26,824,700
固定資産			
有形固定資産	1		
建物		130,525	138,920
器具備品		201,264	153,518
有形固定資産合計		331,789	292,438
無形固定資産	1		
ソフトウェア		241,251	487,128
ソフトウェア仮勘定		32,852	1,805
電話加入権		126	115
商標権		2,271	809
無形固定資産合計		276,502	489,857
投資その他の資産			
投資有価証券		6,720,330	6,914,557
関係会社株式		234,921	234,311
長期差入保証金		681,196	553,412
長期前払費用		16,958	13,881
会員権		9,480	9,480
繰延税金資産		589,332	409,440
投資その他の資産合計		8,252,219	8,135,083
固定資産計		8,860,511	8,917,379
資産合計		33,452,870	35,742,080

(単位：千円)

	第 27 期 (平成24年 3月31日)	第 28 期 (平成25年 3月31日)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	47,840	47,693
未払金		
未払収益分配金	403	425
未払償還金	106,771	149,880
未払手数料	2 1,893,658	1,899,876
その他未払金	86,141	127,465
未払費用	930,998	1,235,323
未払消費税等	35,683	93,482
未払法人税等	264,114	630,796
賞与引当金	279,981	253,750
その他の流動負債	10	-
流動負債計	3,645,603	4,438,695
固定負債		
退職給付引当金	1,489,315	1,605,470
固定負債計	1,489,315	1,605,470
負債合計	5,134,919	6,044,166
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	8,628,984	8,628,984
資本剰余金合計	8,628,984	8,628,984
利益剰余金		
利益準備金	284,245	284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金	60,000	60,000
別途積立金	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金	15,791,435	16,718,237
利益剰余金合計	17,612,639	18,539,441
株主資本計	28,241,623	29,168,425
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	76,327	529,488
評価・換算差額等計	76,327	529,488
純資産合計	28,317,951	29,697,914
負債・純資産合計	33,452,870	35,742,080

## ( 2 ) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第 27 期 (自 平成23年 4 月 1 日 至 平成24年 3 月31日)	第 28 期 (自 平成24年 4 月 1 日 至 平成25年 3 月31日)
営業収益		
委託者報酬	25,467,198	24,965,627
運用受託報酬	2,001,039	2,123,129
投資助言報酬	1,743,437	1,675,512
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	31,647	28,389
サービス支援手数料	99,134	39,868
その他	48,776	51,597
営業収益計	29,396,234	28,889,125
営業費用		
支払手数料	13,259,090	12,702,099
広告宣伝費	475,028	323,773
公告費	4,092	5,176
調査費		
調査費	503,839	628,953
委託調査費	2,285,064	2,491,384
営業雑経費		
通信費	35,155	34,811
印刷費	199,733	208,926
協会費	28,233	27,115
諸会費	12,025	13,918
情報機器関連費	1,855,475	1,992,553
販売促進費	28,021	14,507
その他	123,714	103,926
営業費用計	18,809,475	18,547,147
一般管理費		
給料		
役員報酬	154,738	145,461
給料・手当	4,427,312	4,393,347
賞与	937,970	767,474
賞与引当金繰入額	279,981	253,750
交際費	20,938	17,677
寄付金	10,026	24
事務委託費	245,311	252,472
旅費交通費	230,691	184,318
租税公課	80,136	83,374
不動産賃借料	683,098	670,888
退職給付費用	205,957	173,008
固定資産減価償却費	170,410	189,990
諸経費	268,760	260,890
一般管理費計	7,715,334	7,392,682
営業利益	2,871,423	2,949,295
営業外収益		

受取配当金		29,042	36,741
有価証券利息		3,731	3,643
受取利息	1	5,916	5,921
時効成立分配金・償還金		3,563	961
原稿・講演料		2,745	2,696
還付加算金		-	78
雑収入		5,096	4,508
営業外収益計		50,095	54,551
営業外費用			
為替差損		15,834	25,770
営業外費用計		15,834	25,770
経常利益		2,905,684	2,978,076
特別利益			
投資有価証券売却益		13,806	52,516
受取和解金		108,451	-
特別利益計		122,258	52,516
特別損失			
固定資産除却損	2	12,873	2,409
投資有価証券償還損		3,180	3,224
投資有価証券評価損		301	18,303
投資有価証券売却損		6,578	61,282
関係会社株式評価損		-	610
ゴルフ会員権評価損		10,633	-
合併関連費用		-	70,655
事務所移転費用		-	13,795
特別損失計		33,566	170,280
税引前当期純利益		2,994,376	2,860,311
法人税、住民税及び事業税		1,195,768	1,223,890
法人税等調整額		136,130	119,459
法人税等合計		1,331,898	1,104,430
当期純利益		1,662,477	1,755,881

## ( 3 ) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	第 27 期 (自 平成23年 4 月 1 日 至 平成24年 3 月31日)	第 28 期 (自 平成24年 4 月 1 日 至 平成25年 3 月31日)
株主資本		
資本金		
当期首残高	2,000,000	2,000,000
当期末残高	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金		
当期首残高	8,628,984	8,628,984
当期末残高	8,628,984	8,628,984
資本剰余金合計		
当期首残高	8,628,984	8,628,984
当期末残高	8,628,984	8,628,984
利益剰余金		
利益準備金		
当期首残高	284,245	284,245
当期末残高	284,245	284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金		
当期首残高	60,000	60,000
当期末残高	60,000	60,000
別途積立金		
当期首残高	1,476,959	1,476,959
当期末残高	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金		
当期首残高	15,381,398	15,791,435
当期変動額		
剰余金の配当	1,252,440	829,080
当期純利益	1,662,477	1,755,881
当期変動額合計	410,037	926,801
当期末残高	15,791,435	16,718,237
利益剰余金合計		
当期首残高	17,202,602	17,612,639
当期変動額		
剰余金の配当	1,252,440	829,080
当期純利益	1,662,477	1,755,881
当期変動額合計	410,037	926,801
当期末残高	17,612,639	18,539,441
株主資本合計		
当期首残高	27,831,586	28,241,623
当期変動額		
剰余金の配当	1,252,440	829,080
当期純利益	1,662,477	1,755,881
当期変動額合計	410,037	926,801
当期末残高	28,241,623	29,168,425
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	76,327
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	34,170	453,160
当期変動額合計	34,170	453,160
当期末残高	76,327	529,488
評価・換算差額合計		
当期首残高	110,498	76,327
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	34,170	453,160
当期変動額合計	34,170	453,160
当期末残高	76,327	529,488
純資産合計		
当期首残高	27,942,085	28,317,951
当期変動額		
剰余金の配当	1,252,440	829,080
当期純利益	1,662,477	1,755,881
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	34,170	453,160
当期変動額合計	375,866	1,379,962
当期末残高	28,317,951	29,697,914



## 重要な会計方針

### 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

#### (1) 満期保有目的の債券

償却原価法

#### (2) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

#### (3) その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

時価のないもの

移動平均法による原価法

### 2. 固定資産の減価償却の方法

#### (1) 有形固定資産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 3～50年

器具備品 3～20年

（会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更）

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

#### (2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

### 3. 引当金の計上基準

#### (1) 賞与引当金

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

#### (2) 退職給付引当金

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

過去勤務債務については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

### 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

#### 消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

## 5. 未適用の会計基準等

「退職給付に関する会計基準」（企業会計基準第26号 平成24年5月17日）及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第25号 平成24年5月17日）

### (1) 概要

退職給付債務及び勤務費用の計算方法並びに開示の拡充の改正（退職給付見込額の期間帰属方法について、期間定額基準のほか給付算定式基準の適用が可能となったほか、割引率の算定方法の改正等）

### (2) 適用予定日

平成25年4月1日以後開始する事業年度の期末から適用予定であります。ただし、退職給付債務及び勤務費用の計算方法の改正については、平成26年4月1日以後開始する事業年度の期首から適用予定であります。

### (3) 当該会計基準等の適用による影響

財務諸表作成時において財務諸表に与える影響は、現在評価中であります。

## 注 記 事 項

## (貸借対照表関係)

第27期 (平成24年3月31日)	第28期 (平成25年3月31日)
<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p style="padding-left: 20px;">建 物 210,710千円</p> <p style="padding-left: 20px;">器具備品 624,552千円</p> <p>無形固定資産の減価償却累計額</p> <p style="padding-left: 20px;">ソフトウェア 127,910千円</p> <p style="padding-left: 20px;">電話加入権 107千円</p> <p style="padding-left: 20px;">商標権 17,170千円</p>	<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p style="padding-left: 20px;">建 物 223,463千円</p> <p style="padding-left: 20px;">器具備品 698,449千円</p> <p>無形固定資産の減価償却累計額</p> <p style="padding-left: 20px;">ソフトウェア 206,084千円</p> <p style="padding-left: 20px;">電話加入権 118千円</p> <p style="padding-left: 20px;">商標権 18,632千円</p>
<p>2 関係会社に対する債権債務</p> <p style="padding-left: 20px;">現金及び預金 10,360,214千円</p> <p style="padding-left: 20px;">未収投資助言報酬 283,244千円</p> <p style="padding-left: 20px;">未払手数料 436,830千円</p>	<p>2 関係会社に対する債権債務</p> <p style="padding-left: 20px;">現金及び預金 13,031,110千円</p> <p style="padding-left: 20px;">未収投資助言報酬 289,597千円</p> <p style="padding-left: 20px;">未払手数料 446,096千円</p>
<p>3 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座貸越契約を締結しております。</p> <p>当事業年度末における当座貸越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。</p> <p style="padding-left: 20px;">当座貸越極度額の総額 10,000,000千円</p> <p style="padding-left: 20px;">借入実行残高 - 千円</p> <p style="padding-left: 20px;">差引額 10,000,000千円</p>	<p>3 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座貸越契約を締結しております。</p> <p>当事業年度末における当座貸越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。</p> <p style="padding-left: 20px;">当座貸越極度額の総額 10,000,000千円</p> <p style="padding-left: 20px;">借入実行残高 - 千円</p> <p style="padding-left: 20px;">差引額 10,000,000千円</p>
<p>4 当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York)Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成27年6月までの賃借料総額56,653千円の支払保証を行っております。</p>	<p>4 当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York)Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成27年6月までの賃借料総額45,184千円の支払保証を行っております。</p>

## (損益計算書関係)

第27期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)	第28期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)
<p>1 関係会社との取引に係るもの</p> <p style="padding-left: 20px;">受取利息 2,455千円</p>	<p>1 関係会社との取引に係るもの</p> <p style="padding-left: 20px;">受取利息 2,015千円</p>
<p>2 固定資産除却損は、器具備品12,873千円です。</p>	<p>2 固定資産除却損は、建物1,889千円、器具備品519千円です。</p>

(株主資本等変動計算書関係)

第27期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

## 1. 発行済株式数に関する事項

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

## 2. 剰余金の配当に関する事項

## (1) 配当金支払額等

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

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生が翌事業年度になるもの  
平成24年6月25日開催の第27回定時株主総会において次の通り付議いたします。

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

第28期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

## 1. 発行済株式数に関する事項

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

## 2. 剰余金の配当に関する事項

## (1) 配当金支払額等

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

(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25年6月24日開催の第28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25年6月24日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	864,360	49,000	平成25年 3月31日	平成25年 6月25日

## (リース取引関係)

第27期 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)	第28期 (自 平成24年 4月 1日 至 平成25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.オペレーティング・リース取引 (借主側) 未経過リース料(解約不能のもの)(単位:千円)
1年以内 672,641	1年以内 516,612
1年超 286,301	1年超 1,218,728
合計 958,942	合計 1,735,341

## (金融商品関係)

## 1.金融商品の状況に関する事項

## (1)金融商品に対する取組方針

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

## (2)金融商品の内容及びそのリスク

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

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

営業債務である未払手数料は、すべて1年以内の支払期日であります。

## (3)金融商品に係るリスク管理体制

## 信用リスクの管理

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

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

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

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

## 市場リスクの管理

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

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

## (4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

第27期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

平成24年3月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれていません(注2)参照)。

(単位：千円)

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

### (注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

#### 資 産

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

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

#### (5)有価証券及び投資有価証券

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

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

#### (6)長期差入保証金

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

#### 負 債

#### (1)未払金

#### 未払手数料

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

## (注2)時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

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

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

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

## (注3)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：千円)

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	15,970,870	-	-	-
未収委託者報酬	3,392,765	-	-	-
未収運用受託報酬	305,910	-	-	-
未収投資助言報酬	452,618	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券	4,000,000	-	-	-
その他有価証券のうち満期があるもの	-	-	-	-
長期差入保証金	13,877	667,318	-	-
合計	24,136,043	667,318	-	-

第28期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

平成25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	17,748,821	17,748,821	-
(2)未収委託者報酬	3,641,029	3,641,029	-
(3)未収運用受託報酬	439,648	439,648	-
(4)未収投資助言報酬	470,228	470,228	-
(5)有価証券及び投資有価証券			
満期保有目的の債券	3,999,613	3,999,200	413
その他有価証券	6,881,219	6,881,219	-
(6)長期差入保証金	553,412	553,412	-
資産計	33,733,972	33,733,559	413
(1)未払金			
未払手数料	1,899,876	1,899,876	-
負債計	1,899,876	1,899,876	-

(注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

#### 資 産

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

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

(5)有価証券及び投資有価証券

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

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

(6)長期差入保証金

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

#### 負 債

(1)未払金

未払手数料

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



## (注2)時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

	貸借対照表計上額
その他有価証券 非上場株式 投資証券	 298 33,040
合計	33,338
子会社株式 非上場株式	 234,311
合計	234,311

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

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

## (注3)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：千円)

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	17,748,821	-	-	-
未収委託者報酬	3,641,029	-	-	-
未収運用受託報酬	439,648	-	-	-
未収投資助言報酬	470,228	-	-	-
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	27,733	525,679	-	-
合計	26,327,460	525,679	-	-

## (有価証券関係)

第27期(平成24年3月31日)

## 1.満期保有目的の債券

(単位：千円)

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

## 2.子会社株式及び関連会社株式

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

## 3.その他有価証券

(単位：千円)

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

(注)非上場株式等（貸借対照表計上額 48,741千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。また、上記「貸借対照表計上額」は、減損処理後の帳簿価額です。当事業年度における減損処理額は、301千円です。

## 4.当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：千円)

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

第28期(平成25年3月31日)

## 1. 満期保有目的の債券

(単位：千円)

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 貸借対照表日の時価が貸借対照表計上額を超えるもの	-	-	-
小計	-	-	-
(2) 貸借対照表日の時価が貸借対照表計上額を超えないもの	3,999,613	3,999,200	413
小計	3,999,613	3,999,200	413
合計	3,999,613	3,999,200	413

## 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234,311千円)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、610千円です。

## 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	6,212,805	5,419,133	793,672
小計	6,212,805	5,419,133	793,672
(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	668,413	670,000	1,586
小計	668,413	670,000	1,586
合計	6,881,219	6,089,133	792,086

(注) 非上場株式等(貸借対照表計上額 33,338千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。また、上記「貸借対照表計上額」は、減損処理後の帳簿価額です。当事業年度における減損処理額は、18,303千円です。

## 4. 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
1,042,233	52,516	61,282

(デリバティブ取引関係)

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

## (退職給付関係)

第27期 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)	第28期 (自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日)																				
<p>1．採用している退職給付制度の概要 当社は、確定給付型の制度として、退職一時金制度を設けております。</p>	<p>1．採用している退職給付制度の概要 当社は、確定給付型の制度として、退職一時金制度を設けております。</p>																				
<p>2．退職給付債務の額</p> <p style="text-align: right;">(単位：千円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">退職給付債務</td> <td style="text-align: right;">1,489,315</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td style="text-align: right;"><u>1,489,315</u></td> </tr> </table>	退職給付債務	1,489,315	退職給付引当金	<u>1,489,315</u>	<p>2．退職給付債務の額</p> <p style="text-align: right;">(単位：千円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">退職給付債務</td> <td style="text-align: right;">1,605,470</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td style="text-align: right;"><u>1,605,470</u></td> </tr> </table>	退職給付債務	1,605,470	退職給付引当金	<u>1,605,470</u>												
退職給付債務	1,489,315																				
退職給付引当金	<u>1,489,315</u>																				
退職給付債務	1,605,470																				
退職給付引当金	<u>1,605,470</u>																				
<p>3．退職給付費用の額</p> <p style="text-align: right;">(単位：千円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">勤務費用</td> <td style="text-align: right;">167,222</td> </tr> <tr> <td>利息費用</td> <td style="text-align: right;">19,662</td> </tr> <tr> <td>数理計算上の差異の費用処理額</td> <td style="text-align: right;">5,053</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">14,018</td> </tr> <tr> <td>退職給付費用</td> <td style="text-align: right;"><u>205,957</u></td> </tr> </table> <p>(注)その他は、その他の関係会社からの出向者の年金掛金負担分と退職給付引当額相当額負担分になります。</p>	勤務費用	167,222	利息費用	19,662	数理計算上の差異の費用処理額	5,053	その他	14,018	退職給付費用	<u>205,957</u>	<p>3．退職給付費用の額</p> <p style="text-align: right;">(単位：千円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">勤務費用</td> <td style="text-align: right;">171,214</td> </tr> <tr> <td>利息費用</td> <td style="text-align: right;">22,339</td> </tr> <tr> <td>数理計算上の差異の費用処理額</td> <td style="text-align: right;">36,910</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">16,364</td> </tr> <tr> <td>退職給付費用</td> <td style="text-align: right;"><u>173,008</u></td> </tr> </table> <p>(注)その他は、その他の関係会社からの出向者の年金掛金負担分と退職給付引当額相当額負担分になります。</p>	勤務費用	171,214	利息費用	22,339	数理計算上の差異の費用処理額	36,910	その他	16,364	退職給付費用	<u>173,008</u>
勤務費用	167,222																				
利息費用	19,662																				
数理計算上の差異の費用処理額	5,053																				
その他	14,018																				
退職給付費用	<u>205,957</u>																				
勤務費用	171,214																				
利息費用	22,339																				
数理計算上の差異の費用処理額	36,910																				
その他	16,364																				
退職給付費用	<u>173,008</u>																				
<p>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）</p>	<p>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）</p>																				

## (税効果会計関係)

第27期 (平成24年3月31日)	第28期 (平成25年3月31日)																																																																																		
<p>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)</p> <p>(1) 流動の部</p> <p>繰延税金資産</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr><td>賞与引当金</td><td style="text-align: right;">106,421</td></tr> <tr><td>未払社会保険料</td><td style="text-align: right;">12,691</td></tr> <tr><td>未払事業税</td><td style="text-align: right;">27,381</td></tr> <tr><td>未払事業所税</td><td style="text-align: right;">5,808</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;">3,644</td></tr> <tr><td>繰延税金資産計</td><td style="text-align: right;"><u>155,946</u></td></tr> <tr><td>評価性引当額</td><td style="text-align: right;">-</td></tr> <tr><td>繰延税金資産合計</td><td style="text-align: right;"><u>155,946</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産の純額</td><td style="text-align: right;"><u><u>155,946</u></u></td></tr> </table> <p>(2) 固定の部</p> <p>繰延税金資産</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr><td>退職給付引当金</td><td style="text-align: right;">530,792</td></tr> <tr><td>ソフトウェア償却</td><td style="text-align: right;">95,129</td></tr> <tr><td>投資有価証券評価損</td><td style="text-align: right;">61,204</td></tr> <tr><td>特定外国子会社留保金額</td><td style="text-align: right;">222,604</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;">7,328</td></tr> <tr><td>繰延税金資産計</td><td style="text-align: right;"><u>917,059</u></td></tr> <tr><td>評価性引当額</td><td style="text-align: right;"><u>290,326</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産合計</td><td style="text-align: right;"><u>626,732</u></td></tr> </table> <p>繰延税金負債</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr><td>その他有価証券評価差額金</td><td style="text-align: right;">37,399</td></tr> <tr><td>繰延税金負債合計</td><td style="text-align: right;"><u>37,399</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産の純額</td><td style="text-align: right;"><u><u>589,332</u></u></td></tr> </table>	賞与引当金	106,421	未払社会保険料	12,691	未払事業税	27,381	未払事業所税	5,808	その他	3,644	繰延税金資産計	<u>155,946</u>	評価性引当額	-	繰延税金資産合計	<u>155,946</u>	繰延税金資産の純額	<u><u>155,946</u></u>	退職給付引当金	530,792	ソフトウェア償却	95,129	投資有価証券評価損	61,204	特定外国子会社留保金額	222,604	その他	7,328	繰延税金資産計	<u>917,059</u>	評価性引当額	<u>290,326</u>	繰延税金資産合計	<u>626,732</u>	その他有価証券評価差額金	37,399	繰延税金負債合計	<u>37,399</u>	繰延税金資産の純額	<u><u>589,332</u></u>	<p>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)</p> <p>(1) 流動の部</p> <p>繰延税金資産</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr><td>賞与引当金</td><td style="text-align: right;">96,450</td></tr> <tr><td>未払社会保険料</td><td style="text-align: right;">12,409</td></tr> <tr><td>未払事業税</td><td style="text-align: right;">56,165</td></tr> <tr><td>未払事業所税</td><td style="text-align: right;">5,778</td></tr> <tr><td>調査費</td><td style="text-align: right;">48,698</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;">10,598</td></tr> <tr><td>繰延税金資産計</td><td style="text-align: right;"><u>230,101</u></td></tr> <tr><td>評価性引当額</td><td style="text-align: right;">-</td></tr> <tr><td>繰延税金資産合計</td><td style="text-align: right;"><u>230,101</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産の純額</td><td style="text-align: right;"><u><u>230,101</u></u></td></tr> </table> <p>(2) 固定の部</p> <p>繰延税金資産</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr><td>退職給付引当金</td><td style="text-align: right;">572,189</td></tr> <tr><td>ソフトウェア償却</td><td style="text-align: right;">75,827</td></tr> <tr><td>投資有価証券評価損</td><td style="text-align: right;">51,622</td></tr> <tr><td>特定外国子会社留保金額</td><td style="text-align: right;">226,275</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;">6,428</td></tr> <tr><td>繰延税金資産計</td><td style="text-align: right;"><u>932,342</u></td></tr> <tr><td>評価性引当額</td><td style="text-align: right;"><u>260,304</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産合計</td><td style="text-align: right;"><u>672,038</u></td></tr> </table> <p>繰延税金負債</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr><td>その他有価証券評価差額金</td><td style="text-align: right;">262,597</td></tr> <tr><td>繰延税金負債合計</td><td style="text-align: right;"><u>262,597</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産の純額</td><td style="text-align: right;"><u><u>409,440</u></u></td></tr> </table>	賞与引当金	96,450	未払社会保険料	12,409	未払事業税	56,165	未払事業所税	5,778	調査費	48,698	その他	10,598	繰延税金資産計	<u>230,101</u>	評価性引当額	-	繰延税金資産合計	<u>230,101</u>	繰延税金資産の純額	<u><u>230,101</u></u>	退職給付引当金	572,189	ソフトウェア償却	75,827	投資有価証券評価損	51,622	特定外国子会社留保金額	226,275	その他	6,428	繰延税金資産計	<u>932,342</u>	評価性引当額	<u>260,304</u>	繰延税金資産合計	<u>672,038</u>	その他有価証券評価差額金	262,597	繰延税金負債合計	<u>262,597</u>	繰延税金資産の純額	<u><u>409,440</u></u>
賞与引当金	106,421																																																																																		
未払社会保険料	12,691																																																																																		
未払事業税	27,381																																																																																		
未払事業所税	5,808																																																																																		
その他	3,644																																																																																		
繰延税金資産計	<u>155,946</u>																																																																																		
評価性引当額	-																																																																																		
繰延税金資産合計	<u>155,946</u>																																																																																		
繰延税金資産の純額	<u><u>155,946</u></u>																																																																																		
退職給付引当金	530,792																																																																																		
ソフトウェア償却	95,129																																																																																		
投資有価証券評価損	61,204																																																																																		
特定外国子会社留保金額	222,604																																																																																		
その他	7,328																																																																																		
繰延税金資産計	<u>917,059</u>																																																																																		
評価性引当額	<u>290,326</u>																																																																																		
繰延税金資産合計	<u>626,732</u>																																																																																		
その他有価証券評価差額金	37,399																																																																																		
繰延税金負債合計	<u>37,399</u>																																																																																		
繰延税金資産の純額	<u><u>589,332</u></u>																																																																																		
賞与引当金	96,450																																																																																		
未払社会保険料	12,409																																																																																		
未払事業税	56,165																																																																																		
未払事業所税	5,778																																																																																		
調査費	48,698																																																																																		
その他	10,598																																																																																		
繰延税金資産計	<u>230,101</u>																																																																																		
評価性引当額	-																																																																																		
繰延税金資産合計	<u>230,101</u>																																																																																		
繰延税金資産の純額	<u><u>230,101</u></u>																																																																																		
退職給付引当金	572,189																																																																																		
ソフトウェア償却	75,827																																																																																		
投資有価証券評価損	51,622																																																																																		
特定外国子会社留保金額	226,275																																																																																		
その他	6,428																																																																																		
繰延税金資産計	<u>932,342</u>																																																																																		
評価性引当額	<u>260,304</u>																																																																																		
繰延税金資産合計	<u>672,038</u>																																																																																		
その他有価証券評価差額金	262,597																																																																																		
繰延税金負債合計	<u>262,597</u>																																																																																		
繰延税金資産の純額	<u><u>409,440</u></u>																																																																																		
<p>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 (%)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr><td>法定実効税率</td><td style="text-align: right;">40.6</td></tr> <tr><td>(調整)</td><td></td></tr> <tr><td>評価性引当額の増減</td><td style="text-align: right;">1.0</td></tr> <tr><td>交際費等永久に損金に算入されない項目</td><td style="text-align: right;">0.3</td></tr> <tr><td>住民税均等割等</td><td style="text-align: right;">0.2</td></tr> <tr><td>外国税額控除</td><td style="text-align: right;">0.5</td></tr> <tr><td>税率変更による</td><td></td></tr> <tr><td>期末繰延税金資産の減額修正</td><td style="text-align: right;">4.5</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;">0.2</td></tr> <tr><td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td><td style="text-align: right;"><u>44.4</u></td></tr> </table>	法定実効税率	40.6	(調整)		評価性引当額の増減	1.0	交際費等永久に損金に算入されない項目	0.3	住民税均等割等	0.2	外国税額控除	0.5	税率変更による		期末繰延税金資産の減額修正	4.5	その他	0.2	税効果会計適用後の法人税等の負担率	<u>44.4</u>	<p>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</p> <p>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。</p>																																																														
法定実効税率	40.6																																																																																		
(調整)																																																																																			
評価性引当額の増減	1.0																																																																																		
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.3																																																																																		
住民税均等割等	0.2																																																																																		
外国税額控除	0.5																																																																																		
税率変更による																																																																																			
期末繰延税金資産の減額修正	4.5																																																																																		
その他	0.2																																																																																		
税効果会計適用後の法人税等の負担率	<u>44.4</u>																																																																																		

### 3. 法定実効税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の修正

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

平成24年4月1日から平成27年3月31日	38.0%
平成27年4月1日以降	35.6%

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

(資産除去債務関係)

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

第27期(自平成23年4月1日至平成24年3月31日)

#### 1. セグメント情報

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

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

## 2. 関連情報

## (1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への売上高	25,467,198	2,001,039	1,743,437	184,558	29,396,234

## (2) 地域ごとの情報

## 売上高

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

第28期(自 平成24年4月1日 至 平成25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	24,965,627	2,123,129	1,675,512	124,856	28,889,125

## (2) 地域ごとの情報

## 売上高

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## (関連当事者情報)

第27期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

## 1.親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の関係会社	住友生命保険(相)	大阪府大阪市中央区	220,000,000	生命保険業	(被所有) % 直接 40	当社の主要顧客	投資助言報酬	1,082,284	未収投資助言報酬	283,244
その他の関係会社	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	(被所有) % 直接27.5	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	4,294,733	未払手数料	345,061

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

## 2. その他の関係会社の子会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の関係会社の子会社	S M B C 日興証券㈱	東京都千代田区	10,000,000	証券業	- %	投信の販売委託	委託販売手数料	1,765,986	未払手数料	264,970

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

第28期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

## 1.親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の関係会社	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	(被所有) % 直接 40	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	4,030,024	未払手数料	345,107
その他の関係会社	住友生命保険(相)	大阪府大阪市中央区	270,000,000	生命保険業	(被所有) % 直接27.5	当社の主要顧客	投資助言報酬	1,063,467	未収投資助言報酬	289,597

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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



## 2. その他の関係会社の子会社等

(単位：千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の関係会社の子会社	S M B C 日興証券(株)	東京都千代田区	10,000,000	証券業	- %	投信の販売委託	委託販売手数料	1,620,156	未払手数料	195,174

(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27期 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)		第28期 (自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日)	
1株当たり純資産額	1,605,326円06銭	1株当たり純資産額	1,683,555円22銭
1株当たり当期純利益	94,244円73銭	1株当たり当期純利益	99,539円78銭
<p>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。</p> <p>(1株当たり純資産額の算定上の基礎) 貸借対照表の純資産の部の 合計額 28,317,951千円 普通株式に係る純資産額 28,317,951千円 普通株式の発行済株式数 17,640株 1株当たり純資産額の算定に 用いられた普通株式の数 17,640株</p> <p>(1株当たり当期純利益の算定上の基礎) 損益計算書上の当期純利益 1,662,477千円 普通株式に係る当期純利益 1,662,477千円 普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。 普通株式の期中平均株式数 17,640株</p>		<p>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。</p> <p>(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 29,697,914千円 普通株式に係る純資産額 29,697,914千円 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</p> <p>(1株当たり当期純利益の算定上の基礎) 損益計算書上の当期純利益 1,755,881千円 普通株式に係る当期純利益 1,755,881千円 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</p>	

## (重要な後発事象)

第27期(自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)

該当事項はありません。

第28期(自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日)

## 1. トヨタアセットマネジメント株式会社との経営統合

当社は、平成24年9月28日に、トヨタアセットマネジメント株式会社、トヨタファイナンシャルサービス株式会社、あいおいニッセイ同和損害保険株式会社、三井住友海上火災保険株式会社と、平成25年4月1日を効力発生日としてトヨタアセットマネジメント株式会社と経営統合する旨の合意をし、平成25年1月17日の合併契約書の締結を経て、平成25年4月1日に合併が成立致しました。

## (1) 目的

当社とトヨタアセットマネジメント株式会社の経営統合により、地域性や商品性などの相互補完関係を活かすことで、国内における事業基盤の飛躍的な拡大と運用・商品開発力の強

化、更に、経営におけるシナジー発揮などを通じ、お客様サービスのより一層の向上が行えるとの判断に至り、合併致しました。

## (2) 合併する相手会社の概要

名称	トヨタアセットマネジメント株式会社
事業の内容	投資運用業等
資本金	600,000千円
純資産	1,167,378千円
総資産	1,862,260千円
営業損失	26,248千円
当期純損失	214,380千円

## (3) 合併の方法、合併後の会社名

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

## (4) 合併比率、合併交付金の額、合併により発行する株式の種類及び数

当社は、トヨタアセットマネジメント株式会社の発行済株式の全てを所有していたため、合併に際しては新株の発行及び金銭等の交付はありません。

## 2. 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価	760,008千円
取得に直接要した費用	2,145千円
取得原価	762,153千円

## 3. 発生したのれんの金額及び発生原因

### (1) 負ののれん

186,047千円

### (2) 発生原因

受け入れた資産及び引き受けた負債の純額が、被取得企業の取得の対価算定時の企業評価に基づく投資額を上回ったことによります。

## 4. 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

流動資産	1,604,153千円
固定資産	258,107千円
資産合計	1,862,260千円

流動負債	619,705千円
固定負債	75,176千円
負債合計	694,881千円

（参考情報）トヨタアセットマネジメント株式会社の財務諸表

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を四捨五入して表示しております。
2. 当社は、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に準じて、第24期事業年度（平成24年4月1日から平成25年3月31日まで）の財務諸表について、あらた監査法人により監査を受けております。
3. 当社は平成25年4月1日付で三井住友アセットマネジメント株式会社を存続会社として合併しております。なお、財務諸表中に記載されている「当社」は、合併前のトヨタアセットマネジメント株式会社を指しております。

## 独立監査人の監査報告書

平成25年5月22日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士  
業務執行社員

荒川

進



当監査法人は、貴社の委嘱に基づき、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に準じて、トヨタアセットマネジメント株式会社（平成25年4月1日三井住友アセットマネジメント株式会社と合併）の平成24年4月1日から平成25年3月31日までの第24期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、トヨタアセットマネジメント株式会社（平成25年4月1日三井住友アセットマネジメント株式会社と合併）の平成25年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、トヨタアセットマネジメント株式会社と三井住友アセットマネジメント株式会社は平成25年4月1日付で合併している。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

### 利害関係

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

以 上

## ( 1 ) 貸借対照表

(単位：千円)

	前事業年度 (平成24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金	501,562	994,987
有価証券	643,270	-
前払費用	21,817	23,419
未収委託者報酬	372,005	437,440
未収運用受託報酬	92,258	110,402
未収還付法人税等	-	5,415
繰延税金資産	19,857	22,654
その他	-	9,836
流動資産合計	1,650,770	1,604,153
固定資産		
有形固定資産		
建物	*1 17,684 *1	697
器具備品	*1 8,726 *1	3,264
有形固定資産合計	26,411	3,961
無形固定資産		
ソフトウェア	7,672	12,075
その他	1,207	38
無形固定資産合計	8,879	12,113
投資その他の資産		
投資有価証券	40,477	42,695
長期差入保証金	70,406	52,610
長期預け金	574	-
繰延税金資産	35,810	146,728
投資その他の資産合計	147,266	242,033
固定資産合計	182,555	258,108
資産合計	1,833,325	1,862,261

(単位:千円)

	前事業年度 (平成24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	8,489	7,801
未払代行手数料	202,085	237,521
未払金	606	201,189
未払費用	93,163	121,583
未払法人税等	6,403	-
未払消費税等	9,154	4,755
賞与引当金	27,000	46,857
流動負債合計	346,901	619,705
<b>固定負債</b>		
退職給付引当金	100,461	75,177
固定負債合計	100,461	75,177
負債合計	447,362	694,882
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
資本金	600,000	600,000
<b>利益剰余金</b>		
利益準備金	29,284	29,788
<b>その他利益剰余金</b>		
別途積立金	109,000	109,000
繰越利益剰余金	647,689	427,764
利益剰余金合計	785,973	566,552
株主資本合計	1,385,973	1,166,552
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額金	10	827
評価・換算差額等合計	10	827
純資産合計	1,385,963	1,167,379
負債・純資産合計	1,833,325	1,862,261

## ( 2 ) 損益計算書

(単位：千円)

	前事業年度 (自平成23年 4月 1日 至平成24年 3月31日)	当事業年度 (自平成24年 4月 1日 至平成25年 3月31日)
営業収益		
委託者報酬	1,177,306	1,203,017
運用受託報酬	273,573	306,131
投資助言報酬	*1 529,665	*1 430,339
営業収益合計	1,980,544	1,939,488
営業費用		
支払手数料	550,329	572,174
広告宣伝費	6,366	100
調査費	147,633	138,401
委託調査費	114,623	123,589
委託計算費	42,128	41,985
営業雑経費		
通信費	5,816	5,390
印刷費	21,775	21,494
協会費	4,239	4,591
諸会費	874	763
その他営業雑経費	3,651	3,738
営業費用合計	897,433	912,225
一般管理費		
給料		
役員報酬	83,127	73,927
給料・手当	*1 488,251	*1 475,070
賞与	*1 99,845	*1 100,723
賞与引当金繰入	27,000	46,857
福利厚生費	93,480	90,095
交際費	6,181	10,415
旅費交通費	16,469	23,984
租税公課	9,114	7,490
不動産賃借料	89,783	76,034
退職給付費用	*1 32,884	*1 37,467
固定資産減価償却費	13,584	11,128
業務委託費	49,845	58,172
諸経費	40,787	42,151
一般管理費合計	1,050,351	1,053,511
営業利益又は営業損失( )	32,760	26,248
営業外収益		
受取利息	36	52
有価証券利息	547	392

受取配当金	529	988
その他営業外収益	1,203	1,050
営業外収益合計	2,315	2,481
営業外費用		
雑損失	336	1,115
営業外費用合計	336	1,115
経常利益又は経常損失( )	34,739	24,882
特別利益		
投資有価証券売却益	71	-
特別利益合計	71	-
特別損失		
役員退職慰労金	7,750	40,700
固定資産除売却損	*2 1,020	*2 881
合併関連費用	-	*3 261,274
特別損失合計	8,770	302,855
税引前当期純利益又は税引前当期純損失( )	26,040	327,736
法人税、住民税及び事業税	15,259	823
法人税等調整額	5,146	114,178
法人税等合計	20,405	113,355
当期純利益又は当期純損失( )	5,635	214,381



## ( 3 ) 株主資本等変動計算書

(単位：千円)

	前事業年度 (自平成23年 4月 1日 至平成24年 3月31日)	当事業年度 (自平成24年 4月 1日 至平成25年 3月31日)
株主資本		
資本金		
当期首残高	600,000	600,000
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	600,000	600,000
利益剰余金		
利益準備金		
当期首残高	27,760	29,284
当期変動額		
利益準備金の積立	1,524	504
当期変動額合計	1,524	504
当期末残高	29,284	29,788
その他利益剰余金		
別途積立金		
当期首残高	109,000	109,000
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	109,000	109,000
繰越利益剰余金		
当期首残高	658,818	647,689
当期変動額		
利益準備金の積立	1,524	504
剰余金の配当	15,240	5,040
当期純利益又は当期純損失 ( )	5,635	214,381
当期変動額合計	11,129	219,925
当期末残高	647,689	427,764
利益剰余金合計		
当期首残高	795,578	785,973
当期変動額		
利益準備金の積立	-	-
剰余金の配当	15,240	5,040
当期純利益又は当期純損失 ( )	5,635	214,381
当期変動額合計	9,605	219,421
当期末残高	785,973	566,552
株主資本合計		
当期首残高	1,395,578	1,385,973
当期変動額		
剰余金の配当	15,240	5,040
当期純利益又は当期純損失 ( )	5,635	214,381

当期変動額合計	9,605	219,421
当期末残高	1,385,973	1,166,552
評価・換算差額等		
其他有価証券評価差額金		
当期首残高	111	10
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	121	837
当期変動額合計	121	837
当期末残高	10	827
評価・換算差額等合計		
当期首残高	111	10
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	121	837
当期変動額合計	121	837
当期末残高	10	827
純資産合計		
当期首残高	1,395,689	1,385,963
当期変動額		
剰余金の配当	15,240	5,040
当期純利益又は当期純損失( )	5,635	214,381
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	121	837
当期変動額合計	9,726	218,584
当期末残高	1,385,963	1,167,379

## 重要な会計方針

### 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

#### その他有価証券

決算日の市場価格等による時価法(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)を採用しております。なお、預金と同様の性格を有する有価証券については、移動平均法による原価法を採用しております。

### 2. 固定資産の減価償却の方法

#### (1) 有形固定資産

定率法を採用しております。但し、平成10年4月1日以降に取得した建物(建物附属設備を除く)については定額法を採用しております。

#### (2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における見込み利用可能期間(5年)による定額法を採用しております。

### 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備えて、支給見込額の当事業年度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金規程に基づく自己都合要支給額の全額を計上しております。

### 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

#### 消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は、税抜方式によっております。

## 会計方針の変更

### 減価償却方法の変更

当社は法人税法の改正に伴い、当事業年度より、平成24年4月1日以後に取得した有形固定資産について、改正後の法人税法に基づく減価償却方法に変更しております。

なお、この変更による当事業年度の損益に与える影響は軽微であります。

## 注記事項

## （貸借対照表関係）

前事業年度 (平成24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)												
*1 有形固定資産の減価償却累計額	*1 有形固定資産の減価償却累計額												
<table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 60%;">建物</td> <td style="text-align: right;">63,978千円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td style="text-align: right;">57,853千円</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">計</td> <td style="text-align: right;">121,831千円</td> </tr> </table>	建物	63,978千円	器具備品	57,853千円	計	121,831千円	<table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 60%;">建物</td> <td style="text-align: right;">1,071千円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td style="text-align: right;">22,826千円</td> </tr> <tr> <td style="text-align: right;">計</td> <td style="text-align: right;">23,897千円</td> </tr> </table>	建物	1,071千円	器具備品	22,826千円	計	23,897千円
建物	63,978千円												
器具備品	57,853千円												
計	121,831千円												
建物	1,071千円												
器具備品	22,826千円												
計	23,897千円												

## （損益計算書関係）

前事業年度 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)	当事業年度 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日)																
*1 関係会社との取引額	*1 関係会社との取引額																
<table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 60%;">投資助言報酬</td> <td style="text-align: right;">529,665千円</td> </tr> <tr> <td>給料・手当</td> <td style="text-align: right;">107,355千円</td> </tr> <tr> <td>賞与</td> <td style="text-align: right;">31,907千円</td> </tr> <tr> <td>退職給付費用</td> <td style="text-align: right;">4,200千円</td> </tr> </table>	投資助言報酬	529,665千円	給料・手当	107,355千円	賞与	31,907千円	退職給付費用	4,200千円	<table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 60%;">投資助言報酬</td> <td style="text-align: right;">430,339千円</td> </tr> <tr> <td>給料・手当</td> <td style="text-align: right;">77,490千円</td> </tr> <tr> <td>賞与</td> <td style="text-align: right;">18,286千円</td> </tr> <tr> <td>退職給付費用</td> <td style="text-align: right;">4,857千円</td> </tr> </table>	投資助言報酬	430,339千円	給料・手当	77,490千円	賞与	18,286千円	退職給付費用	4,857千円
投資助言報酬	529,665千円																
給料・手当	107,355千円																
賞与	31,907千円																
退職給付費用	4,200千円																
投資助言報酬	430,339千円																
給料・手当	77,490千円																
賞与	18,286千円																
退職給付費用	4,857千円																
*2 固定資産除売却損は、器具備品1,020千円であります。	*2 固定資産除売却損は、建物881千円であり ます。																
	<p>*3 合併関連費用は三井住友アセットマネジメント株式会社との合併にかかる費用であり、以下の通りです。</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 60%;">希望退職関連費用</td> <td style="text-align: right;">205,102千円</td> </tr> <tr> <td>固定資産除却損</td> <td style="text-align: right;">21,460千円</td> </tr> <tr> <td>原状回復費用</td> <td style="text-align: right;">17,365千円</td> </tr> <tr> <td>IT関連費用</td> <td style="text-align: right;">8,026千円</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">9,321千円</td> </tr> </table>	希望退職関連費用	205,102千円	固定資産除却損	21,460千円	原状回復費用	17,365千円	IT関連費用	8,026千円	その他	9,321千円						
希望退職関連費用	205,102千円																
固定資産除却損	21,460千円																
原状回復費用	17,365千円																
IT関連費用	8,026千円																
その他	9,321千円																

## （株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数（株）	当事業年度 増加株式数（株）	当事業年度 減少株式数（株）	当事業年度末 株式数（株）
発行済株式				
普通株式	12,000	-	-	12,000
合計	12,000	-	-	12,000

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成23年6月28日 定時株主総会	普通株式	15,240	1,270	平成23年 3月31日	平成23年 6月29日

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

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の 総額(千円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成24年6月27日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	5,040	420	平成24年 3月31日	平成24年 6月28日

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

## 1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数（株）	当事業年度 増加株式数（株）	当事業年度 減少株式数（株）	当事業年度末 株式数（株）
発行済株式				
普通株式	12,000	-	-	12,000
合計	12,000	-	-	12,000

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成24年6月27日 定時株主総会	普通株式	5,040	420	平成24年 3月31日	平成24年 6月28日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの  
該当事項はありません。

## （リース取引関係）

該当事項はありません。

## (金融商品関係)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

当社は、資金運用については、合理的な理由がある場合を除いて、銀行預金及び安全性の高い有価証券に限定しており、投機的な取引は行わない方針であります。また、資金調達については、運転資金及び設備投資資金に関しては、原則として自己資金で賄う方針であります。

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

営業債権である未収運用受託報酬には、顧客の信用リスクが存在します。資産管理部門及び営業部門において、日常の営業活動により、顧客等の信用状況を把握するとともに、債権回収の期日管理を行い、経理部門でその回収を確認することで、回収懸念の軽減ないしは早期把握に努めています。

また、未収委託者報酬には、運用を委託されている投資信託の運用資産が悪化した場合に回収できず、当社が損失を被るリスクが存在しますが、過去の回収実績等からリスクは非常に低いものと考えております。

有価証券及び投資有価証券は、当社設定・運用の短期公社債投資信託並びに株式投資信託であり、組入れ有価証券について市場価格の変動リスク及び信用リスク等が存在します。当該リスクに対しては、日々、時価を把握し、組入れ有価証券の発行体の財務状況等の把握等により、リスク管理を実施するとともに、定期的に保有継続について検討を行っています。

長期差入保証金は、建物賃貸借契約に係る敷金であり、差し入れ先の信用リスクに晒されています。差し入れ先の信用状況を定期的に把握することを通じて、リスクの軽減を図っています。

営業債務である未払費用は、全て1年以内に支払期日が到来します。これらには、流動性リスクが存在します。当社は、現状、自己資金が充分であります。キャッシュ・フローの管理等を通じて、リスクの軽減を図っています。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

## 前事業年度(平成24年3月31日)

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりとなっております。なお、時価を把握するのが極めて困難と認められる金融商品はありません。

(単位：千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	501,562	501,562	
(2)有価証券	643,270	643,270	
(3)未収委託者報酬	372,005	372,005	
(4)未収運用受託報酬	92,258	92,258	
(5)投資有価証券	40,477	40,477	
(6)長期差入保証金	70,406	69,389	1,016
資産計	1,719,978	1,718,962	1,016
(1)未払代行手数料	202,085	202,085	
(2)未払費用	93,163	93,163	
負債計	295,248	295,248	

## (注1)金融商品の時価の算定方法

## 資産

## (1)現金及び預金

預金はすべて短期間で決済されるものであり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

## (2)有価証券及び(5)投資有価証券

有価証券及び投資有価証券は、すべて投資信託であり、その時価については、基準価額によっております。

(3)未収委託者報酬及び(4)未収運用受託報酬

これらはすべて短期間で決済されるものであり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(6)長期差入保証金

長期差入保証金(敷金)の時価の算定は、合理的に見積りした長期差入保証金(敷金)の返還予定時期に基づき、国債の利率で割引いた現在価値によっております。

負債

(1)未払代行手数料及び(2)未払費用

これらはすべて短期間で決済されるものであり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(注2)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合理的に算定された価額が含まれます。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

(注3)金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：千円)

	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	501,562	-	-	-
未収委託者報酬	372,005	-	-	-
未収運用受託報酬	92,258	-	-	-
長期差入保証金	-	-	70,406	-
合計	965,825	-	70,406	-

当事業年度(平成25年3月31日)

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりとなっております。なお、時価を把握するのが極めて困難と認められる金融商品はありません。

(単位：千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	994,987	994,987	
(2)未収委託者報酬	437,440	437,440	
(3)未収運用受託報酬	110,402	110,402	
(4)投資有価証券	42,695	42,695	
(5)長期差入保証金	52,610	52,135	475
資産計	1,638,134	1,637,659	475
(1)未払代行手数料	237,521	237,521	
(2)未払金	201,189	201,189	
(3)未払費用	121,583	121,583	
負債計	560,293	560,293	

(注1)金融商品の時価の算定方法

資産

(1)現金及び預金

預金はすべて短期間で決済されるものであり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(2)未収委託者報酬及び(3)未収運用受託報酬

これらはすべて短期間で決済されるものであり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(4)投資有価証券

投資有価証券は、すべて投資信託であり、その時価については、基準価額によっております。

(5)長期差入保証金

長期差入保証金(敷金)の時価の算定は、合理的に見積りした長期差入保証金(敷金)の返還予定時期に基づき、国債の利率で割引いた現在価値によっております。

負債

(1)未払代行手数料、(2)未払金及び(3)未払費用

これらはすべて短期間で決済されるものであり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(注2)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合理的に算定された価額が含まれます。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

(注3)金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：千円)

	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	994,987	-	-	-
未収委託者報酬	437,440	-	-	-
未収運用受託報酬	110,402	-	-	-
長期差入保証金	50,935	1,675	-	-
合計	1,593,764	1,675	-	-

(有価証券関係)

その他有価証券

前事業年度(平成24年3月31日)

(単位：千円)

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	683,747	683,762	15
合計		683,747	683,762	15

その他有価証券の前事業年度中の売却額は515千円であり、売却益は71千円であります。

当事業年度(平成25年3月31日)

(単位：千円)

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	42,695	41,410	1,285
合計		42,695	41,410	1,285

その他有価証券の当事業年度中の売却額は643,584千円であり、売却損益は生じておりません。



(デリバティブ取引関係)

該当事項はありません。

(退職給付関係)

前事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)	当事業年度 (自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日)																
<p>1. 採用している退職給付制度の概要 当社は確定給付型の制度として、退職一時金制度を採用しております。</p> <p>2. 退職給付債務に関する事項</p> <table><tr><td>(1)退職給付債務</td><td>100,461千円</td></tr><tr><td>(2)退職給付引当金</td><td>100,461千円</td></tr></table> <p>3. 退職給付費用に関する事項</p> <table><tr><td>(1)勤務費用(注)</td><td>32,884千円</td></tr><tr><td>(2)退職給付費用</td><td>32,884千円</td></tr></table> <p>(注)確定拠出年金への掛金支払額を含んでおります。</p>	(1)退職給付債務	100,461千円	(2)退職給付引当金	100,461千円	(1)勤務費用(注)	32,884千円	(2)退職給付費用	32,884千円	<p>1. 採用している退職給付制度の概要 同左</p> <p>2. 退職給付債務に関する事項</p> <table><tr><td>(1)退職給付債務</td><td>75,177千円</td></tr><tr><td>(2)退職給付引当金</td><td>75,177千円</td></tr></table> <p>3. 退職給付費用に関する事項</p> <table><tr><td>(1)勤務費用(注)</td><td>37,467千円</td></tr><tr><td>(2)退職給付費用</td><td>37,467千円</td></tr></table> <p>(注)確定拠出年金への掛金支払額を含んでおります。</p>	(1)退職給付債務	75,177千円	(2)退職給付引当金	75,177千円	(1)勤務費用(注)	37,467千円	(2)退職給付費用	37,467千円
(1)退職給付債務	100,461千円																
(2)退職給付引当金	100,461千円																
(1)勤務費用(注)	32,884千円																
(2)退職給付費用	32,884千円																
(1)退職給付債務	75,177千円																
(2)退職給付引当金	75,177千円																
(1)勤務費用(注)	37,467千円																
(2)退職給付費用	37,467千円																

## ( 税効果会計関係 )

前事業年度 (平成24年3月31日)	当事業年度 (平成25年3月31日)																																																				
<p>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</p> <p style="text-align: right;">(単位：千円)</p> <table border="0"> <tr><td>繰延税金資産</td><td></td></tr> <tr><td>  未払事業税</td><td style="text-align: right;">1,023</td></tr> <tr><td>  少額固定資産</td><td style="text-align: right;">71</td></tr> <tr><td>  賞与引当金超過額</td><td style="text-align: right;">10,263</td></tr> <tr><td>  未払費用</td><td style="text-align: right;">8,270</td></tr> <tr><td>  退職給付引当金超過額</td><td style="text-align: right;">35,804</td></tr> <tr><td>  資産除去債務</td><td style="text-align: right;">1,476</td></tr> <tr><td>  その他</td><td style="text-align: right;">235</td></tr> <tr><td>繰延税金資産小計</td><td style="text-align: right;">57,142</td></tr> <tr><td>評価性引当額</td><td style="text-align: right;">1,475</td></tr> <tr><td>繰延税金資産の純額</td><td style="text-align: right;"><u>55,667</u></td></tr> </table>	繰延税金資産		未払事業税	1,023	少額固定資産	71	賞与引当金超過額	10,263	未払費用	8,270	退職給付引当金超過額	35,804	資産除去債務	1,476	その他	235	繰延税金資産小計	57,142	評価性引当額	1,475	繰延税金資産の純額	<u>55,667</u>	<p>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</p> <p style="text-align: right;">(単位：千円)</p> <table border="0"> <tr><td>繰延税金資産</td><td></td></tr> <tr><td>  未払事業税</td><td style="text-align: right;">66</td></tr> <tr><td>  賞与引当金超過額</td><td style="text-align: right;">17,810</td></tr> <tr><td>  未払費用</td><td style="text-align: right;">4,581</td></tr> <tr><td>  退職給付引当金超過額</td><td style="text-align: right;">26,793</td></tr> <tr><td>  資産除去債務</td><td style="text-align: right;">7,665</td></tr> <tr><td>  税務上の繰越欠損金</td><td style="text-align: right;">112,728</td></tr> <tr><td>  その他</td><td style="text-align: right;">613</td></tr> <tr><td>繰延税金資産小計</td><td style="text-align: right;">170,256</td></tr> <tr><td>評価性引当額</td><td style="text-align: right;">417</td></tr> <tr><td>繰延税金資産合計</td><td style="text-align: right;">169,839</td></tr> <tr><td>繰延税金負債</td><td></td></tr> <tr><td>  その他有価証券評価差額金</td><td style="text-align: right;">457</td></tr> <tr><td>繰延税金負債合計</td><td style="text-align: right;">457</td></tr> <tr><td>繰延税金資産の純額</td><td style="text-align: right;"><u>169,382</u></td></tr> </table>	繰延税金資産		未払事業税	66	賞与引当金超過額	17,810	未払費用	4,581	退職給付引当金超過額	26,793	資産除去債務	7,665	税務上の繰越欠損金	112,728	その他	613	繰延税金資産小計	170,256	評価性引当額	417	繰延税金資産合計	169,839	繰延税金負債		その他有価証券評価差額金	457	繰延税金負債合計	457	繰延税金資産の純額	<u>169,382</u>
繰延税金資産																																																					
未払事業税	1,023																																																				
少額固定資産	71																																																				
賞与引当金超過額	10,263																																																				
未払費用	8,270																																																				
退職給付引当金超過額	35,804																																																				
資産除去債務	1,476																																																				
その他	235																																																				
繰延税金資産小計	57,142																																																				
評価性引当額	1,475																																																				
繰延税金資産の純額	<u>55,667</u>																																																				
繰延税金資産																																																					
未払事業税	66																																																				
賞与引当金超過額	17,810																																																				
未払費用	4,581																																																				
退職給付引当金超過額	26,793																																																				
資産除去債務	7,665																																																				
税務上の繰越欠損金	112,728																																																				
その他	613																																																				
繰延税金資産小計	170,256																																																				
評価性引当額	417																																																				
繰延税金資産合計	169,839																																																				
繰延税金負債																																																					
その他有価証券評価差額金	457																																																				
繰延税金負債合計	457																																																				
繰延税金資産の純額	<u>169,382</u>																																																				
<p>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</p> <table border="0"> <tr><td>法定実効税率 (調整)</td><td style="text-align: right;">40.7%</td></tr> <tr><td>交際費等永久に損金に算入されない項目</td><td style="text-align: right;">10.6%</td></tr> <tr><td>住民税均等割</td><td style="text-align: right;">3.2%</td></tr> <tr><td>評価性引当額</td><td style="text-align: right;">0.2%</td></tr> <tr><td>税率変更による期末繰延税金資産の減額修正</td><td style="text-align: right;">24.9%</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;">0.7%</td></tr> <tr><td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td><td style="text-align: right;"><u>78.4%</u></td></tr> </table>	法定実効税率 (調整)	40.7%	交際費等永久に損金に算入されない項目	10.6%	住民税均等割	3.2%	評価性引当額	0.2%	税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	24.9%	その他	0.7%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	<u>78.4%</u>	<p>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</p> <p>税引前当期純損失であるため、記載を省略しております。</p>																																						
法定実効税率 (調整)	40.7%																																																				
交際費等永久に損金に算入されない項目	10.6%																																																				
住民税均等割	3.2%																																																				
評価性引当額	0.2%																																																				
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	24.9%																																																				
その他	0.7%																																																				
税効果会計適用後の法人税等の負担率	<u>78.4%</u>																																																				
<p>3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産の金額の修正</p> <p>「経済社会の構造の変化に対応した税制の構築を図るための所得税法等の一部を改正する法律」(平成23年法律第114号)及び「東日本大震災からの復興のための施策を実施するために必要な財源の確保に関する特別措置法」(平成23年法律第117号)が平成23年12月2日に公布され、平成24年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率の引下げ及び復興特別法人税の課税が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産の計算に使用する法定実効税率は従来の40.7%から、平成24年4月1日に開始する事業年度から平成26年4月1日に開始する事業年度に見込まれる一時差異については38.0%に、平成27年4月1日に開始する事業年度以降に見込まれる一時差異については35.6%になります。</p> <p>この税率変更により、繰延税金資産の金額が6,474千円、その他有価証券評価差額金が1千円、それぞれ減少し、法人税等調整額が6,473千円増加しております。</p>																																																					

（セグメント情報等）

〔セグメント情報〕

当社は「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り、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）を行っております。また「金融商品取引法」に定める投資助言・代理業を行っております。

当社は、投資運用業及び投資助言・代理業にこれらの附帯業務を集約した単一セグメントを報告セグメントとしております。従いまして、開示対象となるセグメントはありませんので、記載を省略しております。

前事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

〔関連情報〕

1．製品及びサービスごとの情報

単一のサービス区分の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2．地域ごとの情報

(1) 営業収益

本邦の外部顧客への営業収益のみであるため、地域ごとの営業収益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みであるため、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

顧客の名称又は氏名	営業収益（千円）	関連するセグメント名
あいおいニッセイ同和損害保険株式会社	529,665	-

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

〔関連情報〕

1．製品及びサービスごとの情報

単一のサービス区分の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2．地域ごとの情報

(1) 営業収益

本邦の外部顧客への営業収益のみであるため、地域ごとの営業収益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みであるため、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

顧客の名称又は氏名	営業収益（千円）	関連するセグメント名
あいおいニッセイ同和損害保険株式会社	430,339	-

## （関連当事者情報）

前事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

## 1．関連当事者との取引

## (1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主(会社等の場合に限る。)等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	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 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
その他の関係会社	あいおいニッセイ同和損害保険株式会社	東京都 渋谷区	100,005 百万円	損害保険 業	(被所有) 直接50%	投資顧問契約  役員の兼任等	投資助言報酬 (注1)	529,665		
							出向者人件費 (注2)	112,755		

(1)上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておりません。

(2)取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 投資助言報酬は、投資資産額に一定料率を乗じる方法等により算定しており、他の投資顧問契約の料率を勘案して決定しております。

(注2) 出向者人件費は、出向元の給与規程を基に計算した人件費相当額を支払っております。

## 2．親会社又は重要な関連会社に関する注記

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

## 1．関連当事者との取引

## (1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主(会社等の場合に限る。)等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	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 (千円)	科目	期末 残高 (千円)
その他の関係会社	あいおいニッセイ同和損害保険株式会社	東京都 渋谷区	100,005 百万円	損害保険 業	(被所有) 直接50%	投資顧問契約  役員の兼任等	投資助言報酬 (注1)	430,339		
							出向者人件費 (注2)	82,689		

(1)上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておりません。

(2)取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 投資助言報酬は、投資資産額に一定料率を乗じる方法等により算定しており、他の投資顧問契約の料率を勘案して決定しております。

(注2) 出向者人件費は、出向元の給与規程を基に計算した人件費相当額を支払っております。

## 2．親会社又は重要な関連会社に関する注記

該当事項はありません。

## （ 1株当たり情報）

前事業年度 (自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日)	当事業年度 (自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日)
1株当たり純資産額 115,496.94円 1株当たり当期純利益 469.62円 なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	1株当たり純資産額 97,281.58円 1株当たり当期純損失 17,865.08円 なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、1株当たり当期純損失であり、また潜在株式が存在しないため記載しておりません。
1株当たり当期純利益の算定上の基礎 損益計算書上の当期純利益 5,635千円 普通株式に係る当期純利益 5,635千円 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。	1株当たり当期純損失の算定上の基礎 損益計算書上の当期純損失 214,381千円 普通株式に係る当期純損失 214,381千円 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 12,000株	普通株式の期中平均株式数 12,000株

## （重要な後発事象）

当事業年度（自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日）

三井住友アセットマネジメント株式会社との経営統合

当社は、平成24年9月28日に、三井住友アセットマネジメント株式会社、トヨタファイナンシャルサービス株式会社、あいおいニッセイ同和損害保険株式会社、三井住友海上火災保険株式会社と、平成25年4月1日を効力発生日として三井住友アセットマネジメント株式会社と経営統合する旨の合意をし、平成25年1月17日の合併契約書の締結を経て、平成25年4月1日に合併が成立致しました。

## 合併の目的

当社と三井住友アセットマネジメント株式会社との経営統合により、地域性や商品性などの相互補完関係を活かすことで、国内における事業基盤の飛躍的な拡大と運用・商品開発力の強化、更に、経営におけるシナジー発揮などを通じ、お客様サービスのより一層の向上が行えるとの判断に至り、合併致しました。

## 合併する相手会社の概要（平成24年3月期）

名称	三井住友アセットマネジメント株式会社
事業の内容	投資運用業等
資本金	2,000,000千円
純資産	28,317,951千円
総資産	33,452,870千円
営業利益	2,871,423千円
当期純利益	1,662,477千円

## 合併の方法、合併後の会社名

当該合併は、三井住友アセットマネジメント株式会社が当社の全株式を取得した後に行い、三井住友アセットマネジメント株式会社を存続会社とする吸収合併方式であり、当社は解散致しました。合併後の名称は、三井住友アセットマネジメント株式会社であります。

## 合併比率、合併交付金の額、合併により発行する株式の種類及び数

三井住友アセットマネジメント株式会社は、当社の発行済株式の全てを所有していたため、合併に際しては新株の発行及び金銭等の交付はありません。

## 中間財務諸表

## (1)中間貸借対照表

(単位：千円)

		第29期中間会計期間 (平成25年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		18,563,045
有価証券		3,999,930
前払費用		273,635
未収委託者報酬		4,336,429
未収運用受託報酬		692,610
未収投資助言報酬		475,080
未収収益		11,626
繰延税金資産		238,053
その他		5,184
流動資産合計		28,595,596
固定資産		
有形固定資産	1	291,283
無形固定資産		476,209
投資その他の資産		
投資有価証券		7,083,959
その他		1,382,419
投資その他の資産合計		8,466,379
固定資産合計		9,233,872
資産合計		37,829,469
負債の部		
流動負債		
預り金		51,432
未払金		2,500,651
未払費用		1,651,568
未払法人税等		772,159
前受収益		6,414
賞与引当金		281,048
その他	2	133,311
流動負債合計		5,396,586
固定負債		
退職給付引当金		1,797,300
固定負債合計		1,797,300
負債合計		7,193,887
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	17,522,317
利益剰余金合計	19,343,521
株主資本合計	29,972,506
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	663,075
評価・換算差額等合計	663,075
純資産合計	30,635,581
負債純資産合計	37,829,469

## (2) 中間損益計算書

(単位：千円)

		第29期中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)	
営業収益			
委託者報酬			15,369,200
運用受託報酬			1,375,297
投資助言報酬			1,045,655
その他の営業収益			56,848
営業収益計			<u>17,847,000</u>
営業費用			11,631,371
一般管理費	1		<u>3,991,038</u>
営業利益			<u>2,224,590</u>
営業外収益	2		40,931
営業外費用	3		<u>19,631</u>
経常利益			<u>2,245,890</u>
特別利益	4		229,144
特別損失	5		<u>21,010</u>
税引前中間純利益			<u>2,454,024</u>
法人税、住民税及び事業税			748,427
法人税等調整額			<u>37,157</u>
法人税等合計			<u>785,584</u>
中間純利益			<u>1,668,440</u>



## (3) 中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

	第29期中間会計期間 (自 平成25年 4月 1日 至 平成25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	16,718,237
当中間期変動額	
剰余金の配当	864,360
中間純利益	1,668,440
当中間期変動額合計	804,080
当中間期末残高	17,522,317
利益剰余金合計	
当期首残高	18,539,441
当中間期変動額	
剰余金の配当	864,360
中間純利益	1,668,440
当中間期変動額合計	804,080
当中間期末残高	19,343,521
株主資本合計	
当期首残高	29,168,425
当中間期変動額	
剰余金の配当	864,360
中間純利益	1,668,440
当中間期変動額合計	804,080

当中間期末残高	29,972,506
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
当期首残高	529,488
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)	133,587
当中間期変動額合計	133,587
当中間期末残高	663,075
評価・換算差額等合計	
当期首残高	529,488
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)	133,587
当中間期変動額合計	133,587
当中間期末残高	663,075
純資産合計	
当期首残高	29,697,914
当中間期変動額	
剰余金の配当	864,360
中間純利益	1,668,440
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	133,587
当中間期変動額合計	937,667
当中間期末残高	30,635,581

## 重要な会計方針

### 1. 資産の評価基準及び評価方法

#### (1) 有価証券

満期保有目的の債券

償却原価法

子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

その他有価証券

時価のあるもの

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法

(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)

時価のないもの

移動平均法による原価法

### 2. 固定資産の減価償却の方法

#### (1) 有形固定資産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 3～50年

器具備品 3～20年

#### (2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

### 3. 引当金の計上基準

#### (1) 賞与引当金

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

#### (2) 退職給付引当金

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

過去勤務債務については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

### 4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

## 注記事項

(中間貸借対照表関係)

第29期中間会計期間 (平成25年9月30日)	
1.有形固定資産の減価償却累計額	986,642千円
2.消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額の重要性が乏しいため、流動負債のその他に含めて表示しております。
3.当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。	当中間会計期間末における当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。
	当座借越極度額の総額 10,000,000千円
	借入実行残高 -
	差引額 10,000,000千円
4.当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York) Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成27年6月までの賃借料総額36,519千円の支払保証を行っております。	

(中間損益計算書関係)

第29期中間会計期間 (自平成25年4月1日至平成25年9月30日)	
1.減価償却実施額	
有形固定資産	43,638千円
無形固定資産	61,323千円
2.営業外収益のうち主要なもの	
受取利息	2,635千円
受取配当金	33,323千円
3.営業外費用のうち主要なもの	
為替差損	19,593千円
4.特別利益のうち主要なもの	
負ののれん発生益	186,047千円
投資有価証券売却益	37,926千円
5.特別損失のうち主要なもの	
合併関連費用	17,127千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第29期中間会計期間(自平成25年4月1日至平成25年9月30日)

## 1.発行済株式数に関する事項

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

## 2.剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成25年6月24日 定時株主総会	普通株式	864,360	49,000	平成25年 3月31日	平成25年 6月25日

## （リース取引関係）

第29期中間会計期間 (自 平成25年4月1日 至 平成25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	519,884千円
1年超	988,505千円
合 計	1,508,389千円

## （金融商品関係）

## 1. 金融商品の時価等に関する事項

第29期中間会計期間（平成25年9月30日）

平成25年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次の通りです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません（（注2）参照）。

（単位：千円）

区分	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	18,563,045	18,563,045	-
(2)未収委託者報酬	4,336,429	4,336,429	-
(3)未収運用受託報酬	692,610	692,610	-
(4)未収投資助言報酬	475,080	475,080	-
(5)有価証券及び投資有価証券			
満期保有目的の債券	3,999,930	3,999,600	330
その他有価証券	7,051,551	7,051,551	-
(6)投資その他の資産			
長期差入保証金	541,954	541,954	-
資産計	35,660,602	35,660,272	330
(1)未払金			
未払手数料	2,285,873	2,285,873	-
負債計	2,285,873	2,285,873	-

## （注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資 産

(1)現金及び預金、(2)未収委託者報酬、(3)未収運用受託報酬 及び

(4)未収投資助言報酬

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

(5)有価証券及び投資有価証券

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

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

(6)投資その他の資産

長期差入保証金

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

**負債****(1) 未払金**

## 未払手数料

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

	中間貸借対照表計上額
その他有価証券	
非上場株式	298
投資証券	32,110
合計	32,408
子会社株式及び関連会社株式	
非上場株式	353,036
合計	353,036

その他有価証券については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであり、「(5) その他有価証券」には含めておりません。また、「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、930千円です。

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

(有価証券関係)

第29期中間会計期間（平成25年9月30日）

## 1. 満期保有目的の債券

(単位：千円)

区分	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 中間貸借対照表日の時価が中間貸借対照表計上額を超えるもの	-	-	-
小計	-	-	-
(2) 中間貸借対照表日の時価が中間貸借対照表計上額を超えないもの	3,999,930	3,999,600	330
小計	3,999,930	3,999,600	330
合計	3,999,930	3,999,600	330

## 2. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額 353,036千円）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、記載していません。

## 3. その他有価証券

(単位：千円)

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	6,299,919	5,292,133	1,007,786
小計	6,299,919	5,292,133	1,007,786
(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	751,631	762,854	11,222
小計	751,631	762,854	11,222
合計	7,051,551	6,054,987	996,563

(注) 非上場株式等（中間貸借対照表計上額 32,408千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

## (デリバティブ取引関係)

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

## (企業結合等関係)

## 取得による企業結合

## 1. 企業結合の概要

## (1)被取得企業の名称及び事業の内容

被取得企業の名称 トヨタアセットマネジメント株式会社

事業の内容 投資運用業等

## (2)企業結合を行った主な理由

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

## (3)企業結合日

平成25年4月1日

## (4)企業結合の法的形式

当社がトヨタアセットマネジメント株式会社の全株式を取得した後に行い、当社を存続会社とする吸収合併方式

## (5)結合後企業の名称

三井住友アセットマネジメント株式会社

## (6)取得した議決権比率

100%

## (7)取得企業を決定するに至った根拠

当社が現金を対価として株式を取得したことによっております。

2. 中間財務諸表に含まれる被取得企業の業績の期間  
平成25年4月1日から平成25年9月30日まで

3. 被取得企業の取得原価及びその内訳

取得の対価	760,008千円
取得に直接要した費用	2,145千円
取得原価	762,153千円

4. 株式の種類別の交換比率及びその算定方法並びに交付した株式数

当社は、トヨタアセットマネジメント株式会社の発行済株式の全てを所有していたため、合併に際しては新株の発行及び金銭等の交付はありません。

5. 発生したのれんの金額及び発生原因

(1) 負ののれん

186,047千円

(2) 発生原因

受け入れた資産及び引き受けた負債の純額が、被取得企業の取得の対価算定時の企業評価に基づく投資額を上回ったことによります。

6. 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

流動資産	1,604,153千円
固定資産	258,107千円
資産合計	1,862,260千円

流動負債	619,705千円
固定負債	75,176千円
負債合計	694,881千円

7. 企業結合が当中間会計期間の開始の日に完了したと仮定した場合の当中間会計期間の中間損益計算書に及ぼす影響の概算額及びその算定方法

企業結合が当中間会計期間の開始日に完了しているため、該当事項はありません。

(資産除去債務等)

該当事項はありません。



## (セグメント情報等)

第29期中間会計期間(自 平成25年4月1日 至 平成25年9月30日)

## 1. セグメント情報

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

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

## 2. 関連情報

## (1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への売上高	15,369,200	1,375,297	1,045,655	56,848	17,847,000

## (2) 地域ごとの情報

## 売上高

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## 3. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

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、報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報の記載を省略しております。

## （ 1 株当たり情報 ）

第29期中間会計期間 (自 平成25年 4 月 1 日 至 平成25年 9 月30日)	
1 株当たり純資産額	1,736,710円96銭
1 株当たり中間純利益	94,582円78銭
<p>なお、潜在株式調整後 1 株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載していません。</p>	
<p>(注) 1 株当たり純資産額の算定上の基礎</p>	
中間貸借対照表の純資産の部の合計額	30,635,581千円
普通株式に係る純資産額	30,635,581千円
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
<p>1 株当たり中間純利益の算定上の基礎</p>	
中間損益計算書上の中間純利益	1,668,440千円
普通株式に係る中間純利益	1,668,440千円
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

#### 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  
委託会社は、平成25年4月1日にトヨタアセットマネジメント株式会社と合併しました。
- ロ 訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実  
該当ありません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### イ 受託会社

- (イ) 名称 三井住友信託銀行株式会社
- (ロ) 資本金の額 342,037百万円（平成25年9月末現在）
- (ハ) 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

#### 〔参考情報：再信託受託会社の概要〕

- ・ 名称 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社
- ・ 資本金の額 51,000百万円（平成25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25年9月末現在）
- (ハ) 事業の内容 「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

### 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7,056株（持株比率40.0%）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25年3月14日	有価証券報告書
平成25年3月14日	有価証券届出書
平成25年9月20日	半期報告書
平成25年9月20日	有価証券届出書の訂正届出書

## 独立監査人の監査報告書

平成26年2月12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24年12月21日から平成25年12月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010の平成25年12月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以上

(注1)上記は、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。(注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。

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成26年2月12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24年12月21日から平成25年12月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020の平成25年12月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以上

(注1)上記は、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。(注2)財務諸表の範囲にはXBR Lデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成26年2月12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24年12月21日から平成25年12月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030の平成25年12月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以上

(注1)上記は、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。(注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。

[次へ](#)



## 独立監査人の監査報告書

平成26年2月12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24年12月21日から平成25年12月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040の平成25年12月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以上

(注1)上記は、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。(注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25年6月14日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 鈴木 敏 夫

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 辰 巳 幸 久

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理の状況」に掲げられている三井住友アセットマネジメント株式会社の平成24年4月1日から平成25年3月31日までの第28期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友アセットマネジメント株式会社の平成25年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、会社は平成24年9月28日に、トヨタアセットマネジメント株式会社、トヨタファイナンシャルサービス株式会社、あいおいニッセイ同和損害保険株式会社、三井住友海上火災保険株式会社と、平成25年4月1日を効力発生日としてトヨタアセットマネジメント株式会社と経営統合する旨の合意書を締結し、平成25年1月17日の合併契約書の締結を経て、平成25年4月1日に合併が成立した。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

### 利害関係

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

以 上

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

[委託会社の中間監査報告書へ](#)

## 独立監査人の中間監査報告書

平成25年11月29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25年4月1日から平成26年3月31日までの第29期事業年度の中間会計期間（平成25年4月1日から平成25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25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25年4月1日から平成25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。