

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	平成27年3月19日提出
【計算期間】	第14期(自 平成25年12月21日至 平成26年12月22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 横山 邦男
【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】	該当事項はありません。

## 第一部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

イ 当ファンドは、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せん。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
	海外	債券
追加型	内外	不動産投信
		その他資産 ( )
		資産複合

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式	年1回	グローバル		
一般		(日本を含む)		
大型株	年2回	日本		
中小型株	年4回	北米		
債券	年6回(隔月)	欧州	ファミリーファンド	あり
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		
その他債券	( )	アフリカ	ファンド・オブ・ファンズ	なし
クレジット属性 ( )		中近東(中東)		
不動産投信		エマージング		
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))				
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、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27年 1月30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

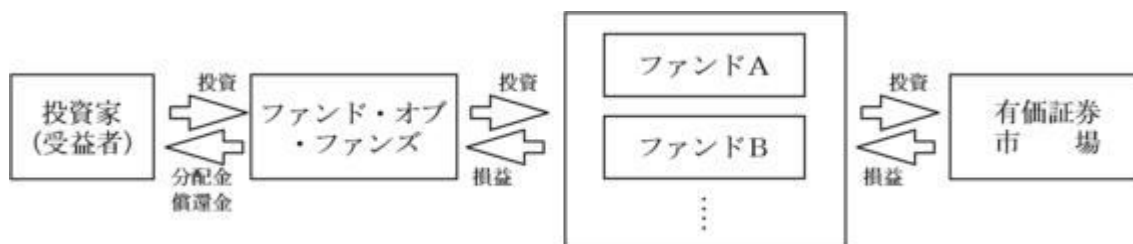
（平成27年 1月30日現在）

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。

（二）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 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 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。

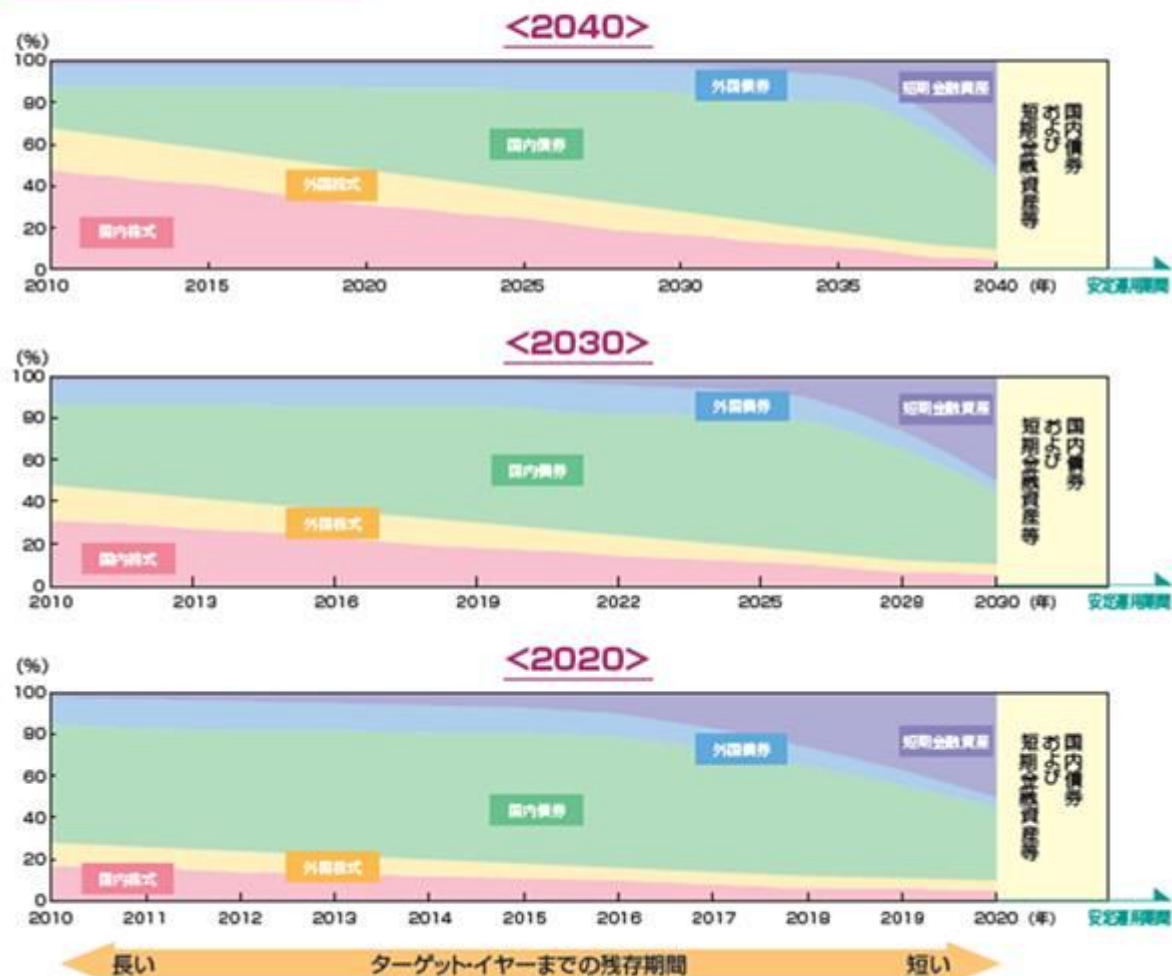
※ターゲット・イヤー到達後の安定運用期間においても国内債券および短期金融資産の他、国内外の株式および外国債券への配分が予定されています。

### 基本的な投資資産配分（基本アロケーション）

2015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	42%	26%	12%	5%
外国株式	18%	14%	8%	5%
国内債券	28%	47%	61%	35%
外国債券	10%	11%	13%	5%
短期金融資産	2%	2%	6%	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、上記のような運用ができない場合があります。

## ★ 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・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）

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

#### SMAM・年金国内債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>

- わが国の公社債および短期金融資産を主要投資対象とし、NOMURA－BPI（総合）と連動する投資成果を目指して運用を行います。
- ポートフォリオの作成にあたっては、層化抽出法により、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・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）

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

#### SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>

- 主として日本を除く世界各国の債券に投資し、シティ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、層化抽出法により、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、Citigroup Index LLCが公表している指数で各社の知的財産です。
- ・指数を公表する各社は当ファンドの運用と何ら関係ありません。

## （２）【投資対象】

### イ 投資対象とする資産の種類

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

- 1．有価証券
  - 2．金銭債権
  - 3．約束手形
- ロ 投資対象とする有価証券
- 委託会社は、信託金を、主として別に定める証券投資信託の受益証券ならびに次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。
- 1．コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
  - 2．外国または外国の者の発行する本邦通貨表示の証券で、前号の性質を有するもの。
- ハ 投資対象とする金融商品
- 委託会社は、信託金を、上記ロに掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
- 1．預金
  - 2．指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
  - 3．コール・ローン
  - 4．手形割引市場において売買される手形

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

### （3）【運用体制】

#### イ 運用体制

当ファンドの運用は、次のプロセスに基づいて行われます。

##### （イ）計画（Plan）

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

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

##### （ロ）実行（Do）

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

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

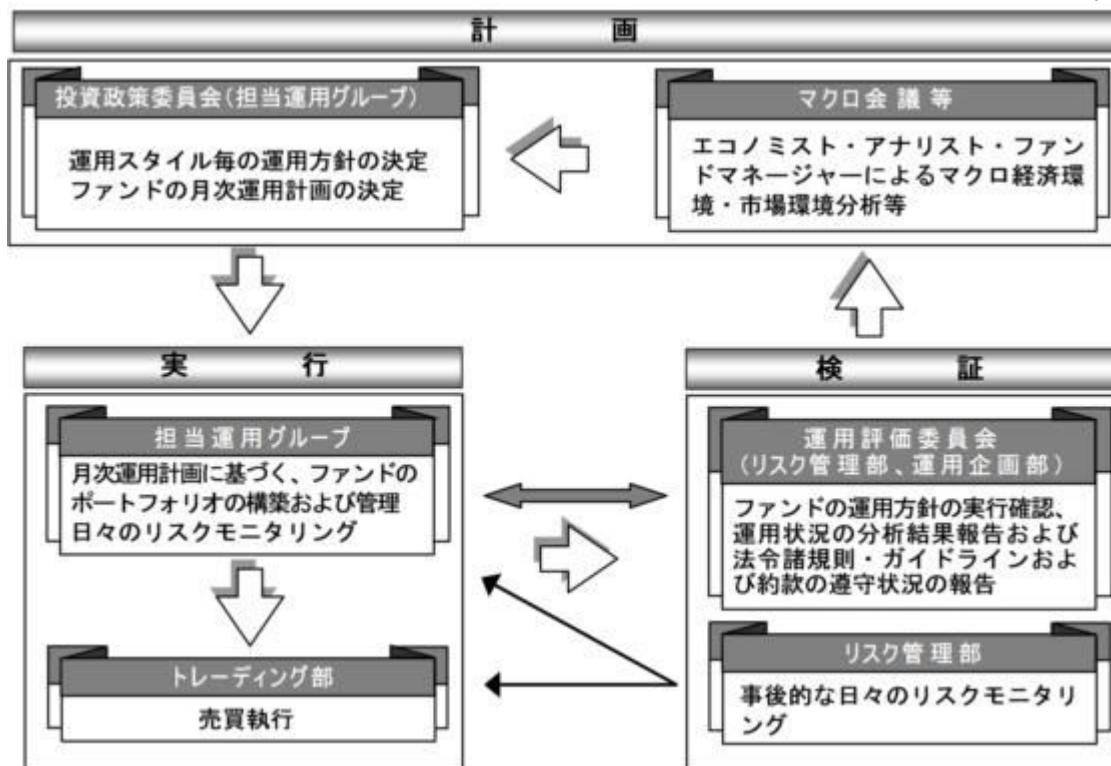
##### （ハ）検証（Check）

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

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

### 〔ファンドの運用体制〕





リスク管理部は9名程度、運用企画部は8名程度で構成されています。

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

□ 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

（４）【分配方針】

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

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

（５）【投資制限】

ファンドの信託約款に基づく投資制限

- イ 投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。
- 投資信託証券への投資を除いては、CP、預金、指定金銭信託、コール・ローンおよび手形割引市場において売買される手形以外には投資を行いません。
- ハ 外貨建資産への直接投資は行いません。
- ニ 資金の借入れ
  - （イ）委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みま

す。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金の借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

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

#### 法令に基づく投資制限

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

〔参考情報：投資対象とする投資信託の概要〕

〔S M A M・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)〕

#### (1) 運用会社等

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

#### (2) 投資方針等

##### イ 基本方針

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

##### ロ 投資態度

- (イ) 主としてマザーファンド受益証券への投資を通じて、東京証券取引所第1部に上場している株

式に投資を行い、T O P I X ( 東証株価指数、配当込み ) と連動する投資成果を目指して運用を行います。

( 口 ) 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。

( 八 ) 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せん。 ) への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。

マザーファンドにおいては、主として東京証券取引所第1部に上場している株式に投資を行い、T O P I X ( 東証株価指数、配当込み ) と連動する投資成果を目指して運用を行います。

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

## 八 主な投資制限

( イ ) 外貨建資産への投資は行いません。

( 口 ) 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0.081% ( 税抜き0.075% ) を乗じて得た額 |
| ロ | 手数料     | 取得申込時および換金時には手数料はかかりません。                        |
| ハ | 信託財産留保額 | 取得申込時および解約請求時にそれぞれ受付日の翌営業日の基準価額に対して0.08%        |
| ニ | 決算日     | 毎年1回 ( 原則として11月30日 )                            |

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

## ( 1 ) 運用会社等

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

## ( 2 ) 投資方針等

### イ 基本方針

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

### ロ 投資態度

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

( 口 ) 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。

( 八 ) 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0.054% (税抜き0.05%) を乗じて得た額 |
| ロ 手数料     | 取得申込時および換金時には手数料はかかりません。                     |
| ハ 信託財産留保額 | 取得申込時および解約請求時にそれぞれ受付日の基準価額に対して0.03%          |
| ニ 決算日     | 毎年1回(原則として6月20日)                             |

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

#### (1) 運用会社等

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

#### (2) 投資方針等

##### イ 基本方針

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

##### ロ 投資態度

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

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

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

#### 八 主な投資制限

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

#### (3) その他

- |           |   |
|-----------|---|
| イ 信託報酬    | このファンドの信託財産の純資産総額に年0.081% (税抜き0.075%) を乗じて得た額 |
| ロ 手数料     | 取得申込時および換金時には手数料はかかりません。                      |
| ハ 信託財産留保額 | 取得申込時および解約請求時にそれぞれ受付日の翌営業日の基準価額に対して0.15%      |
| ニ 決算日     | 毎年1回(原則として11月30日)                             |

[ 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 > ]

( 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、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
- (ホ) 公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。
- (ヘ) 資金動向、市況動向等の急変により上記の運用が困難となった場合、暫定的に上記と異なる運用を行う場合があります。

マザーファンドにおいては、シティ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Citigroup Index LLC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、Citigroup Index LLCが有しています。Citigroup Index LLCは「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 > 」および当ファンドとは何ら関係なく、その運用成果に対して一切の責任を負うものではありません。

ハ 主な投資制限

- (イ) 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- (ロ) 投資信託証券(マザーファンド受益証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ハ) 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
- (ニ) 同一発行体の発行する債券への実質投資割合は、国債を除き、取得時において信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ホ) 同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- (ヘ) 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ト) 同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、取得時において



信託財産の純資産総額の10%以内とします。

(3) その他

- イ 信託報酬 このファンドの信託財産の純資産総額に年0.0648% (税抜き0.06%) を乗じて得た額
- ロ 手数料 取得申込時および換金時には手数料はかかりません。
- ハ 信託財産留保額 取得申込時および解約請求時にそれぞれ受付日の翌営業日の基準価額に対して0.1%
- ニ 決算日 毎年1回(原則として12月17日)

[ 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いません。

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

#### （イ）株式市場リスク

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

#### （ロ）債券市場リスク

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

#### （ハ）為替変動リスク

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

#### （二）信用リスク

ファンドが投資している有価証券や金融商品に債務不履行が発生あるいは懸念される場合に、当該有価証券や金融商品の価格が下がったり、投資資金を回収できなくなったりすることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。有価証券等の格付けが低い場合は、格付けの高い場合に比べてこうしたリスクがより高いものになると想定されます。

#### （ホ）カントリーリスク

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

#### （ヘ）市場流動性リスク

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。

(チ) 換金制限等に関する留意点

投資資産の市場流動性が低下することにより投資資産の取引等が困難となった場合は、ファンドの換金申込みの受け付けを中止すること、および既に受け付けた換金申込みを取り消すことがあります。

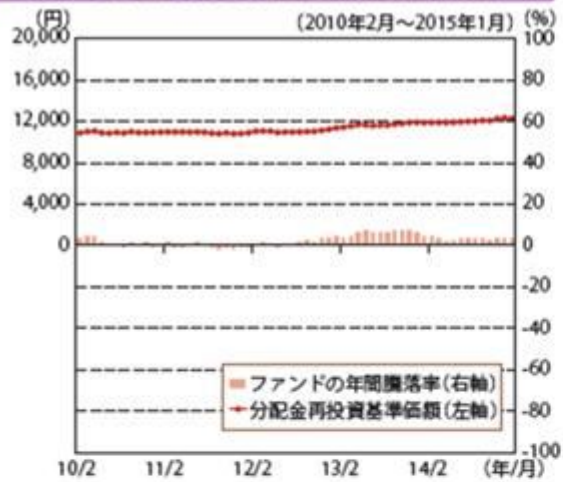
ロ 投資リスクの管理体制

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

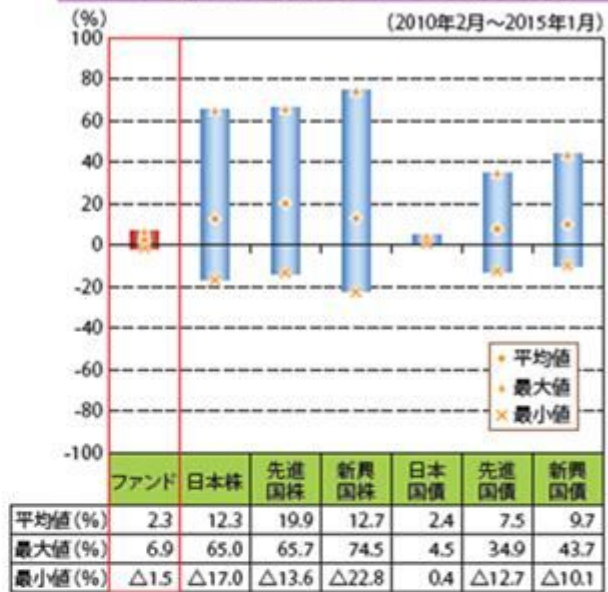
(参考情報) 投資リスクの定量的比較

## &lt; 2010 &gt;

## ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



## ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

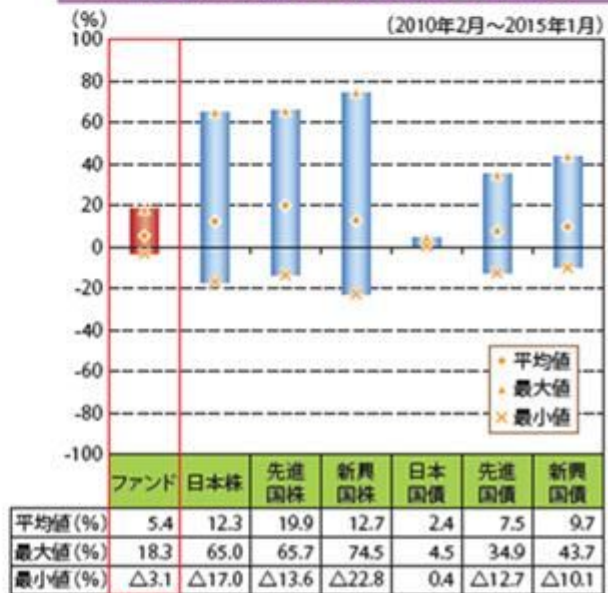


## &lt; 2020 &gt;

## ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



## ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



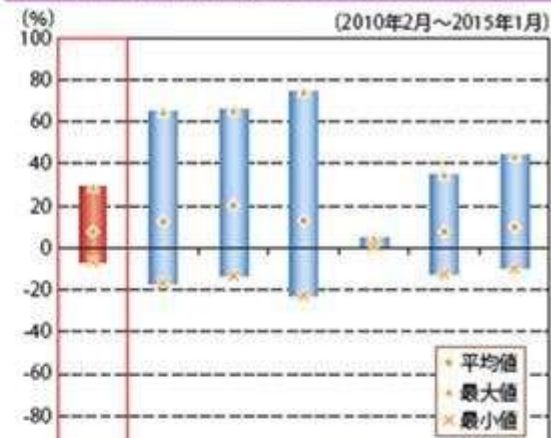


## &lt;2030&gt;

## ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



## ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



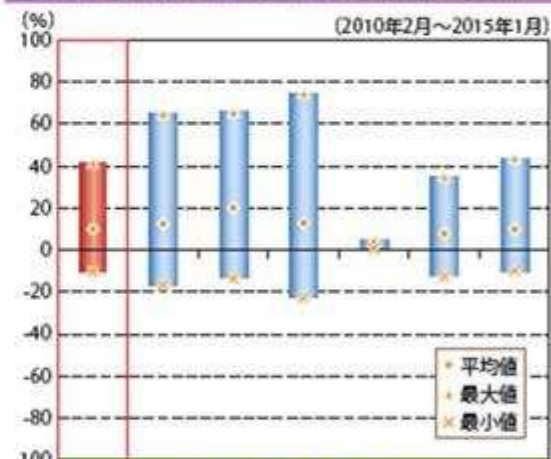
	ファンド	日本株	先進 国株	新興 国株	日本 国債	先進 国債	新興 国債
平均値(%)	7.6	12.3	19.9	12.7	2.4	7.5	9.7
最大値(%)	29.3	65.0	65.7	74.5	4.5	34.9	43.7
最小値(%)	△6.7	△17.0	△13.6	△22.8	0.4	△12.7	△10.1

## &lt;2040&gt;

## ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



## ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較



	ファンド	日本株	先進 国株	新興 国株	日本 国債	先進 国債	新興 国債
平均値(%)	9.8	12.3	19.9	12.7	2.4	7.5	9.7
最大値(%)	41.6	65.0	65.7	74.5	4.5	34.9	43.7
最小値(%)	△10.5	△17.0	△13.6	△22.8	0.4	△12.7	△10.1

※左グラフは2010年2月～2015年1月の各月末におけるファンドの直近1年間の騰落率および分配金再投資基準価額の推移を表示したものです。右グラフは同期間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。  
 ※ファンドの分配金再投資基準価額は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものと仮定して計算しており、実際の基準価額とは異なります。分配実績がない場合は、分配金再投資基準価額は基準価額と同じです。  
 ※ファンドの騰落率は、分配金再投資基準価額をもとに計算しており、実際の基準価額をもとに計算したものと異なります。  
 ※右グラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものであり、すべての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

※各資産クラスの指数

日本株…TOPIX（配当込み）

先進国株…MSCIコクサイインデックス（グロス配当込み、円ベース）

新興国株…MSCIエマージング・マーケット・インデックス（グロス配当込み、円ベース）

日本国債…NOMJRA-BPI（国債）

先進国債…シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）

新興国債…JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケット・グローバル・ダイバーシファイド（円ベース）

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

※上記各指数に関する知的所有権その他の一切の権利は、その発行者および許諾者に帰属します。

## 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0.5292%（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0.432%（税抜き0.4%）となります。

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

信託報酬 = 運用期間中の基準価額 × 信託報酬率

信託報酬の実質的配分は以下の通りです。

< 信託報酬の配分（税抜き） >

	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。

支払先	役務の内容
委託会社	ファンド運用の指図等の対価
販売会社	運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
受託会社	ファンド財産の保管および管理、委託会社からの指図の実行等の対価

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27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0.55944%（税抜き0.518%）程度

< 2020 > 年0.598428%（税抜き0.5541%）程度

< 2030 > 年0.597996%（税抜き0.5537%）程度

< 2040 > 年0.603288%（税抜き0.5586%）程度

## (4) 【その他の手数料等】

- イ 信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、原則として、計算期間を通じて毎日、純資産総額に年0.00324%（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。
- 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

ものとしします。

上記口、八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。）

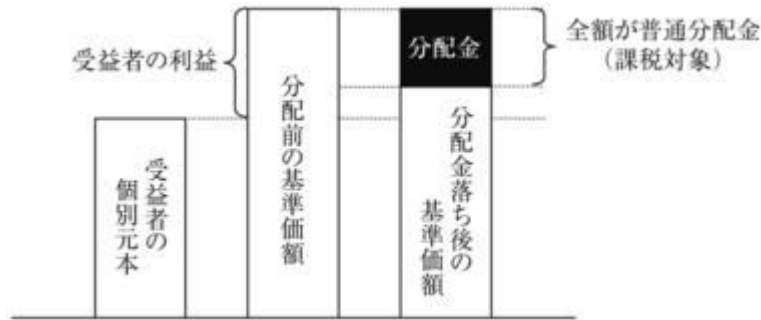
##### ロ 一部解約時および償還時の課税について

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。

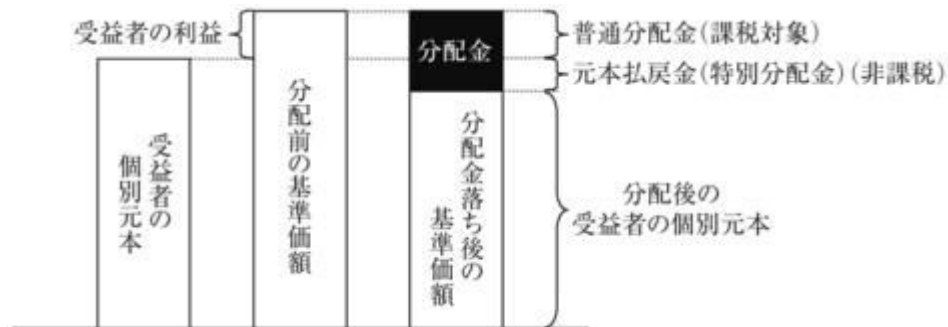
##### ハ 収益分配金の課税について

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27年1月末現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

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

## 5【運用状況】

### (1)【投資状況】

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

平成27年 1月30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	486,292,105	98.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,180,242	1.05
合計(純資産総額)		491,472,347	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。

#### 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27年 1月30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	1,030,212,864	99.93
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		710,882	0.07
合計(純資産総額)		1,030,923,746	100.00

#### 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27年 1月30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	785,267,605	97.56
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		19,625,285	2.44
合計(純資産総額)		804,892,890	100.00

## 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27年 1月30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	613,135,257	99.74
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,621,463	0.26
合計(純資産総額)		614,756,720	100.00

## (2)【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010

## イ 主要投資銘柄

平成27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	投資信託受益証券	S M A M ・ マネーインカムファンド <適格機関投資家限定>	242,763,232	1.009	244,972,319	1.0089	244,923,824	49.83
日本	投資信託受益証券	S M A M ・ 年金国内債券パッシブ ファンド<適格機関投資家限定>	138,169,721	1.2302	169,980,536	1.2335	170,432,350	34.68
日本	投資信託受益証券	S M A M ・ 国内株式パッシブ・ファ ンド(適格機関投資家専用)	18,068,462	1.324	23,924,414	1.3292	24,016,599	4.89
日本	投資信託受益証券	S M A M ・ 年金外国債券パッシブ・ ファンド<適格機関投資家限定>	13,075,987	1.8363	24,012,613	1.7953	23,475,319	4.78
日本	投資信託受益証券	S M A M ・ 外国株式パッシブ・ファ ンド(適格機関投資家専用)	10,987,493	2.1862	24,021,703	2.1337	23,444,013	4.77

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

## ロ 種類別の投資比率

平成27年 1月30日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	98.95
合計	98.95

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2020

## イ 主要投資銘柄

平成27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	投資信託受益証券	S M A M・年金国内債券バッシブファンド<適格機関投資家限定>	508,437,817	1.2302	625,485,633	1.2335	627,158,047	60.83
日本	投資信託受益証券	S M A M・年金外国債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	73,325,893	1.8371	134,706,998	1.7953	131,641,975	12.77
日本	投資信託受益証券	S M A M・国内株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	96,541,790	1.3242	127,841,024	1.3292	128,323,347	12.45
日本	投資信託受益証券	S M A M・外国株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	39,697,168	2.1876	86,841,524	2.1337	84,701,847	8.22
日本	投資信託受益証券	S M A M・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	57,872,583	1.009	58,398,298	1.0089	58,387,648	5.66

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

#### ロ 種類別の投資比率

平成27年 1月30日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	99.93
合計	99.93

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

#### イ 主要投資銘柄

平成27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	投資信託受益証券	S M A M・年金国内債券バッシブファンド<適格機関投資家限定>	299,131,189	1.2306	368,125,432	1.2335	368,978,321	45.84
日本	投資信託受益証券	S M A M・国内株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	156,097,055	1.3243	206,726,354	1.3292	207,484,205	25.78
日本	投資信託受益証券	S M A M・外国株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	52,200,064	2.1876	114,196,148	2.1337	111,379,276	13.84
日本	投資信託受益証券	S M A M・年金外国債券バッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	46,558,704	1.8351	85,440,482	1.7953	83,586,841	10.38
日本	投資信託受益証券	S M A M・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	13,716,882	1.0091	13,841,705	1.0089	13,838,962	1.72

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

#### ロ 種類別の投資比率

平成27年 1月30日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	97.56
合計	97.56

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

## イ 主要投資銘柄

平成27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	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)	196,702,265	1.3228	260,200,432	1.3292	261,456,650	42.53
日本	投資信託受益 証券	S M A M ・ 年金国内債券パッシブ ファンド<適格機関投資家限定>	138,272,971	1.2309	170,207,189	1.2335	170,559,709	27.74
日本	投資信託受益 証券	S M A M ・ 外国株式パッシブ・ファ ンド(適格機関投資家専用)	51,350,663	2.1874	112,325,112	2.1337	109,566,909	17.82
日本	投資信託受益 証券	S M A M ・ 年金外国債券パッシブ・ ファンド<適格機関投資家限定>	33,332,370	1.8351	61,169,480	1.7953	59,841,603	9.73
日本	投資信託受益 証券	S M A M ・ マネーインカムファンド <適格機関投資家限定>	11,607,083	1.009	11,712,661	1.0089	11,710,386	1.90

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

## ロ 種類別の投資比率

平成27年 1月30日現在

種類	投資比率(%)
投資信託受益証券	99.74
合計	99.74

## 【投資不動産物件】

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。

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。

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。

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】

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。

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。

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。

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】

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)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第5期 (平成17年12月20日)	118,527,624	118,527,624	10,782	10,782
第6期 (平成18年12月20日)	160,590,675	160,590,675	11,048	11,048
第7期 (平成19年12月20日)	217,158,042	217,158,042	11,245	11,245
第8期 (平成20年12月22日)	238,566,878	238,566,878	10,578	10,578
第9期 (平成21年12月21日)	301,495,735	301,495,735	10,921	10,921
第10期 (平成22年12月20日)	324,751,925	324,751,925	10,941	10,941
第11期 (平成23年12月20日)	329,392,588	329,392,588	10,818	10,818
第12期 (平成24年12月20日)	348,417,250	348,417,250	11,198	11,198
第13期 (平成25年12月20日)	406,358,497	406,358,497	11,884	11,884
第14期 (平成26年12月22日)	490,170,412	490,170,412	12,303	12,303
平成26年 1月末日	420,215,803		11,868	
2月末日	423,445,937		11,892	
3月末日	426,346,169		11,889	
4月末日	434,120,463		11,888	
5月末日	439,509,536		11,919	
6月末日	445,853,644		11,962	
7月末日	447,810,280		11,997	
8月末日	449,825,181		12,018	
9月末日	465,092,201		12,078	
10月末日	472,052,994		12,065	
11月末日	476,961,873		12,268	
12月末日	492,365,564		12,334	

平成27年 1月末日	491,472,347		12,282	
------------	-------------	--	--------	--

## 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)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第5期 (平成17年12月20日)	116,847,054	116,847,054	11,660	11,660
第6期 (平成18年12月20日)	156,345,353	156,345,353	12,355	12,355
第7期 (平成19年12月20日)	244,051,631	244,051,631	12,244	12,244
第8期 (平成20年12月22日)	258,579,003	258,579,003	10,124	10,124
第9期 (平成21年12月21日)	364,838,536	364,838,536	10,782	10,782
第10期 (平成22年12月20日)	460,154,017	460,154,017	10,871	10,871
第11期 (平成23年12月20日)	503,354,494	503,354,494	10,466	10,466
第12期 (平成24年12月20日)	605,756,824	605,756,824	11,419	11,419
第13期 (平成25年12月20日)	792,418,477	792,418,477	13,210	13,210
第14期 (平成26年12月22日)	1,042,332,411	1,042,332,411	14,223	14,223
平成26年 1月末日	805,086,615		13,160	
2月末日	817,557,652		13,210	
3月末日	813,385,603		13,207	
4月末日	826,339,180		13,197	
5月末日	844,616,571		13,279	
6月末日	875,993,629		13,394	
7月末日	893,745,086		13,489	
8月末日	932,254,181		13,538	
9月末日	964,936,162		13,709	
10月末日	987,000,362		13,644	
11月末日	1,020,121,653		14,140	
12月末日	1,034,779,526		14,300	
平成27年 1月末日	1,030,923,746		14,173	

## 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)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第5期 (平成17年12月20日)	55,989,814	55,989,814	12,178	12,178
第6期 (平成18年12月20日)	101,147,764	101,147,764	13,183	13,183
第7期 (平成19年12月20日)	149,262,430	149,262,430	12,809	12,809
第8期 (平成20年12月22日)	146,078,912	146,078,912	9,332	9,332
第9期 (平成21年12月21日)	214,049,126	214,049,126	10,168	10,168

第10期	(平成22年12月20日)	266,798,732	266,798,732	10,308	10,308
第11期	(平成23年12月20日)	273,003,638	273,003,638	9,525	9,525
第12期	(平成24年12月20日)	367,329,083	367,329,083	10,766	10,766
第13期	(平成25年12月20日)	541,345,607	541,345,607	13,445	13,445
第14期	(平成26年12月22日)	773,129,050	773,129,050	14,814	14,814
	平成26年 1月末日	542,476,751		13,314	
	2月末日	564,464,243		13,378	
	3月末日	574,173,738		13,352	
	4月末日	582,313,893		13,309	
	5月末日	597,964,157		13,459	
	6月末日	613,097,472		13,661	
	7月末日	635,653,086		13,820	
	8月末日	663,724,339		13,855	
	9月末日	687,020,361		14,143	
	10月末日	696,560,814		13,979	
	11月末日	742,782,842		14,727	
	12月末日	787,323,255		14,926	
	平成27年 1月末日	804,892,890		14,747	

## 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)		
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)	
第5期	(平成17年12月20日)	64,001,577	64,001,577	12,443	12,443
第6期	(平成18年12月20日)	113,160,193	113,160,193	13,668	13,668
第7期	(平成19年12月20日)	143,523,897	143,523,897	13,111	13,111
第8期	(平成20年12月22日)	134,815,396	134,815,396	8,596	8,596
第9期	(平成21年12月21日)	188,270,881	188,270,881	9,559	9,559
第10期	(平成22年12月20日)	231,956,041	231,956,041	9,713	9,713
第11期	(平成23年12月20日)	230,424,744	230,424,744	8,586	8,586
第12期	(平成24年12月20日)	287,659,579	287,659,579	10,038	10,038
第13期	(平成25年12月20日)	445,842,340	445,842,340	13,541	13,541
第14期	(平成26年12月22日)	588,648,311	588,648,311	15,256	15,256
	平成26年 1月末日	443,175,190		13,325	
	2月末日	444,660,763		13,395	
	3月末日	448,857,095		13,343	
	4月末日	452,181,191		13,257	
	5月末日	474,671,422		13,479	
	6月末日	491,524,156		13,776	
	7月末日	508,692,182		14,006	
	8月末日	516,479,426		14,022	

9月末日	542,243,034		14,439
10月末日	536,583,161		14,166
11月末日	576,693,272		15,160
12月末日	599,043,197		15,404
平成27年 1月末日	614,756,720		15,181

## 【分配の推移】

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型) 2010

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第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
第14期	平成25年12月21日～平成26年12月22日	0

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型) 2020

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第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
第14期	平成25年12月21日～平成26年12月22日	0

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型) 2030

	計算期間	1万口当たり分配金(円)
第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
第14期	平成25年12月21日～平成26年12月22日	0

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040

	計算期間	1万口当たり分配金（円）
第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
第14期	平成25年12月21日～平成26年12月22日	0

## 【収益率の推移】

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2010

	収益率（％）
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
第14期	3.5

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

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020

	収益率（％）
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
第14期	7.7

（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。

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030

	収益率（％）
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
第14期	10.2

（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。

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040

	収益率（％）
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
第14期	12.7

(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基準価額を控除した額を前期末分配基準価額で除したものをいいます。

#### (4) 【設定及び解約の実績】

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

	設定口数(口)	解約口数(口)
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
第14期	84,271,259	27,787,920

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

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

	設定口数(口)	解約口数(口)
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
第14期	174,116,846	41,116,178

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

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

	設定口数(口)	解約口数(口)
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
第14期	146,378,903	27,109,912

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

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

	設定口数(口)	解約口数(口)
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
第14期	92,910,684	36,318,727

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

(参考)

(1) 投資状況

### SMA M・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)

平成27年 1月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	49,652,987,116	100.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,744,933	0.01

合計(純資産総額)	49,646,242,183	100.00
-----------	----------------	--------

## 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

平成27年 1月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	262,969,111,260	98.27
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,633,047,206	1.73
合計(純資産総額)		267,602,158,466	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	日本	4,183,960,000	1.56
合計	買建		4,183,960,000	1.56

## 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;

平成27年 1月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	43,890,667,006	100.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,811,519	0.01
合計(純資産総額)		43,887,855,487	100.00

## 国内債券（NOMURA - B P I）マザーファンド

平成27年 1月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	108,108,705,120	77.13
地方債証券	日本	8,752,085,185	6.24
特殊債券	日本	13,065,694,079	9.32

社債券	日本	7,612,435,000	5.43
	アメリカ	604,572,000	0.43
	オランダ	505,245,000	0.36
	オーストラリア	302,392,000	0.22
	小計	9,024,644,000	6.44
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,217,430,471	0.87
合計(純資産総額)		140,168,558,855	100.00

## 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)

平成27年 1月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	31,910,718,093	100.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,495,861	0.01
合計(純資産総額)		31,906,222,232	100.00

## 外国株式インデックス・マザーファンド

平成27年 1月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	112,318,793,930	57.24
	イギリス	15,861,901,784	8.08
	スイス	7,971,910,798	4.06
	カナダ	7,696,165,466	3.92
	ドイツ	7,458,209,429	3.80
	フランス	7,194,034,959	3.67
	オーストラリア	5,154,781,429	2.63
	オランダ	2,957,281,815	1.51
	アイルランド	2,886,872,105	1.47
	スペイン	2,733,221,181	1.39
	スウェーデン	2,473,909,581	1.26
	香港	2,256,689,727	1.15
	イタリア	1,651,787,391	0.84

	シンガポール	1,271,240,386	0.65
	デンマーク	1,241,061,779	0.63
	ジャージー	1,139,467,406	0.58
	ベルギー	1,086,424,283	0.55
	フィンランド	724,087,142	0.37
	キュラソー	679,195,942	0.35
	バミューダ	629,193,264	0.32
	ノルウェー	507,723,845	0.26
	イスラエル	451,030,810	0.23
	ルクセンブルク	278,022,930	0.14
	ケイマン諸島	163,821,584	0.08
	オーストリア	147,468,988	0.08
	ニュージーランド	124,366,374	0.06
	ポルトガル	121,550,539	0.06
	英ヴァージン諸島	94,592,121	0.05
	リベリア	77,640,414	0.04
	ガーンジー	56,193,669	0.03
	マン島	30,082,800	0.02
	モーリシャス	14,236,685	0.01
	小計	187,452,960,556	95.52
投資証券	アメリカ	3,395,517,195	1.73
	オーストラリア	666,555,658	0.34
	フランス	300,732,408	0.15
	イギリス	299,879,171	0.15
	香港	123,057,435	0.06
	シンガポール	109,019,694	0.06
	カナダ	43,897,484	0.02
	小計	4,938,659,045	2.52
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,845,131,081	1.96
合計(純資産総額)		196,236,750,682	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	買建/ 売建	国/地域	時価合計(円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	買建	アメリカ	2,506,220,062	1.27
	買建	ドイツ	713,280,508	0.36
	買建	イギリス	325,126,078	0.16

	買建	オーストラリア	190,080,885	0.09
合計	買建		3,734,707,533	1.88

## 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;

平成27年 1月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	3,002,366,276	100.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		257,095	0.01
合計(純資産総額)		3,002,109,181	100.00

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

平成27年 1月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	92,407,018,866	40.83
	フランス	21,681,152,300	9.58
	イタリア	21,460,418,480	9.48
	イギリス	19,274,921,077	8.52
	ドイツ	17,919,703,518	7.92
	スペイン	11,773,617,645	5.20
	オランダ	5,731,117,905	2.53
	ベルギー	5,721,915,394	2.53
	カナダ	4,853,773,326	2.14
	オーストラリア	3,612,872,053	1.60
	オーストリア	3,589,820,699	1.59
	メキシコ	2,467,328,779	1.09
	アイルランド	1,816,166,168	0.80
	デンマーク	1,611,827,182	0.71
	フィンランド	1,484,266,242	0.66
	ポーランド	1,319,474,848	0.58
	南アフリカ	1,304,460,100	0.58
	スウェーデン	1,091,004,060	0.48
	マレーシア	1,029,362,189	0.45
	スイス	865,102,103	0.38
シンガポール	852,077,382	0.38	



	ノルウェー	624,171,435	0.28
	小計	222,491,571,751	98.31
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,827,136,859	1.69
合計(純資産総額)		226,318,708,610	100.00

## 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;

平成27年 1月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	日本	359,374,954	100.01
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		27,667	0.01
合計(純資産総額)		359,347,287	100.00

## マネーインカム・マザーファンド

平成27年 1月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	1,296,088,150	97.47
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		33,593,709	2.53
合計(純資産総額)		1,329,681,859	100.00

## (2) 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## 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)

## イ 主要投資銘柄

平成27年 1月29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)	24,549,088,854	2.0318	49,878,838,734	2.0226	49,652,987,116	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。

## □ 種類別の投資比率

平成27年 1月29日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.01
合計	100.01

## 国内株式インデックス・マザーファンド(B号)

## イ 主要投資銘柄(上位30銘柄)

平成27年 1月29日現在

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	投資比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,756,400	7,429.00	13,048,295,600	7,729.00	13,575,215,600	5.07
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	10,083,000	690.00	6,957,270,000	630.80	6,360,356,400	2.38
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	664,500	7,966.00	5,293,407,000	7,206.00	4,788,387,000	1.79
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,145,600	3,595.50	4,119,004,800	3,609.00	4,134,470,400	1.55
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	950,200	4,477.50	4,254,520,500	4,002.00	3,802,700,400	1.42
日本	株式	KDDI	情報・通信業	425,400	7,544.00	3,209,217,600	8,214.00	3,494,235,600	1.31
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	491,600	6,230.00	3,062,668,000	6,928.00	3,405,804,800	1.27
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	17,392,500	204.30	3,553,287,750	195.80	3,405,451,500	1.27
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	499,200	5,015.00	2,503,488,000	5,860.00	2,925,312,000	1.09
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,518,500	1,713.50	2,601,949,750	1,823.00	2,768,225,500	1.03
日本	株式	キヤノン	電気機器	738,100	3,906.00	2,883,018,600	3,741.00	2,761,232,100	1.03
日本	株式	日立製作所	電気機器	3,057,000	920.10	2,812,745,700	899.20	2,748,854,400	1.03
日本	株式	ファナック	電気機器	132,500	20,260.00	2,684,450,000	20,130.00	2,667,225,000	1.00
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	790,600	3,798.00	3,002,698,800	3,213.00	2,540,197,800	0.95
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	114,000	17,515.00	1,996,710,000	20,345.00	2,319,330,000	0.87
日本	株式	ソニー	電気機器	823,800	2,640.00	2,174,832,000	2,775.00	2,286,045,000	0.85
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	525,400	4,456.00	2,341,182,400	4,331.00	2,275,507,400	0.85
日本	株式	三菱地所	不動産業	935,000	2,685.00	2,510,475,000	2,398.00	2,242,130,000	0.84
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	233,200	8,954.00	2,088,072,800	9,207.00	2,147,072,400	0.80
日本	株式	パナソニック	電気機器	1,551,200	1,554.00	2,410,564,800	1,370.50	2,125,919,600	0.79
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	516,800	3,970.50	2,051,954,400	4,110.50	2,124,306,400	0.79
日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	1,034,800	1,866.00	1,930,936,800	1,977.00	2,045,799,600	0.76
日本	株式	三井不動産	不動産業	667,000	3,430.00	2,287,810,000	3,037.50	2,026,012,500	0.76
日本	株式	三菱商事	卸売業	962,500	2,222.00	2,138,675,000	2,088.00	2,009,700,000	0.75
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	417,600	4,122.00	1,721,347,200	4,673.50	1,951,653,600	0.73
日本	株式	信越化学工業	化学	239,000	8,118.00	1,940,202,000	7,883.00	1,884,037,000	0.70
日本	株式	富士重工業	輸送用機器	433,100	4,381.00	1,897,411,100	4,291.00	1,858,432,100	0.69
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	1,786,100	1,105.00	1,973,640,500	1,028.00	1,836,110,800	0.69
日本	株式	花王	化学	358,600	4,440.00	1,592,184,000	5,031.00	1,804,116,600	0.67
日本	株式	村田製作所	電気機器	133,600	12,980.00	1,734,128,000	12,995.00	1,736,132,000	0.65

## □ 種類別・業種別の投資比率

平成27年 1月29日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.08
		鉱業	0.41
		建設業	2.61
		食料品	4.13
		繊維製品	0.78
		パルプ・紙	0.23
		化学	6.09
		医薬品	4.82
		石油・石炭製品	0.46
		ゴム製品	0.98
		ガラス・土石製品	0.90
		鉄鋼	1.53
		非鉄金属	0.92
		金属製品	0.63
		機械	5.03
		電気機器	12.59
		輸送用機器	11.76
		精密機器	1.46
		その他製品	1.29
		電気・ガス業	2.11
		陸運業	4.21
		海運業	0.34
		空運業	0.68
		倉庫・運輸関連業	0.23
		情報・通信業	6.88
		卸売業	3.90
		小売業	4.19
		銀行業	8.47
		証券、商品先物取引業	1.28
		保険業	2.34
その他金融業	1.14		
不動産業	2.83		
サービス業	2.97		
合計			98.27

## イ 主要投資銘柄

平成27年 1月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受 益証券	国内債券（NOMURA - BPI） マザーファンド	33,020,363,381	1.2926	42,682,405,239	1.3292	43,890,667,006	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。

## ロ 種類別の投資比率

平成27年 1月29日現在

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	100.01
合計	100.01

## 国内債券（NOMURA - BPI）マザーファンド

## イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成27年 1月29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286回利付国 債（10年）	2,845,000,000	104.97	2,986,396,500	104.26	2,966,424,600	1.800	2017/6/20	2.12
日本	国債証券	第285回利付国 債（10年）	2,704,000,000	104.34	2,821,454,900	103.60	2,801,425,120	1.700	2017/3/20	2.00
日本	国債証券	第297回利付国 債（10年）	2,494,000,000	105.57	2,632,915,800	105.30	2,626,381,520	1.400	2018/12/20	1.87
日本	国債証券	第305回利付国 債（10年）	2,300,000,000	106.12	2,440,850,600	106.08	2,439,932,000	1.300	2019/12/20	1.74
日本	国債証券	第288回利付国 債（10年）	2,333,000,000	105.13	2,452,759,900	104.44	2,436,655,190	1.700	2017/9/20	1.74
日本	国債証券	第296回利付国 債（10年）	2,226,000,000	105.73	2,353,549,800	105.34	2,345,068,740	1.500	2018/9/20	1.67
日本	国債証券	第289回利付国 債（10年）	2,183,000,000	104.82	2,288,310,200	104.28	2,276,628,870	1.500	2017/12/20	1.62
日本	国債証券	第293回利付国 債（10年）	2,086,000,000	106.53	2,222,318,400	106.02	2,211,702,360	1.800	2018/6/20	1.58
日本	国債証券	第303回利付国 債（10年）	1,880,000,000	106.22	1,996,941,400	106.26	1,997,688,000	1.400	2019/9/20	1.43
日本	国債証券	第333回利付国 債（10年）	1,780,000,000	100.43	1,787,654,000	103.21	1,837,209,200	0.600	2024/3/20	1.31
日本	国債証券	第315回利付国 債（10年）	1,600,000,000	106.19	1,699,040,000	107.20	1,715,344,000	1.200	2021/6/20	1.22
日本	国債証券	第328回利付国 債（10年）	1,610,000,000	101.10	1,627,843,500	103.40	1,664,820,500	0.600	2023/3/20	1.19
日本	国債証券	第306回利付国 債（10年）	1,550,000,000	106.80	1,655,400,000	106.90	1,656,981,000	1.400	2020/3/20	1.18
日本	国債証券	第310回利付国 債（10年）	1,540,000,000	104.72	1,612,777,200	105.30	1,621,681,600	1.000	2020/9/20	1.16
日本	国債証券	第301回利付国 債（10年）	1,523,000,000	106.58	1,623,270,100	106.38	1,620,167,400	1.500	2019/6/20	1.16

日本	国債証券	第299回利付国債(10年)	1,525,000,000	105.35	1,606,737,400	105.21	1,604,467,750	1.300	2019/3/20	1.14
日本	国債証券	第329回利付国債(10年)	1,420,000,000	102.62	1,457,304,000	105.03	1,491,426,000	0.800	2023/6/20	1.06
日本	国債証券	第300回利付国債(10年)	1,390,000,000	106.28	1,477,292,000	106.03	1,473,886,500	1.500	2019/3/20	1.05
日本	国債証券	第317回利付国債(10年)	1,380,000,000	105.53	1,456,426,000	106.79	1,473,798,600	1.100	2021/9/20	1.05
日本	国債証券	第335回利付国債(10年)	1,440,000,000	100.53	1,447,737,200	102.15	1,471,075,200	0.500	2024/9/20	1.05
日本	国債証券	第312回利付国債(10年)	1,340,000,000	106.03	1,420,802,000	106.74	1,430,329,400	1.200	2020/12/20	1.02
日本	国債証券	第326回利付国債(10年)	1,350,000,000	102.26	1,380,586,600	104.20	1,406,713,500	0.700	2022/12/20	1.00
日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	1,300,000,000	106.87	1,389,310,600	107.56	1,398,384,000	1.300	2021/3/20	1.00
日本	国債証券	第332回利付国債(10年)	1,330,000,000	100.58	1,337,714,000	103.26	1,373,411,200	0.600	2023/12/20	0.98
日本	国債証券	第292回利付国債(10年)	1,280,000,000	105.89	1,355,392,000	105.26	1,347,379,200	1.700	2018/3/20	0.96
日本	国債証券	第330回利付国債(10年)	1,280,000,000	102.58	1,313,024,000	105.04	1,344,576,000	0.800	2023/9/20	0.96
日本	国債証券	第334回利付国債(10年)	1,290,000,000	100.91	1,301,753,300	103.15	1,330,751,100	0.600	2024/6/20	0.95
日本	国債証券	第290回利付国債(10年)	1,252,000,000	104.68	1,310,690,600	104.32	1,306,174,040	1.400	2018/3/20	0.93
日本	国債証券	第321回利付国債(10年)	1,040,000,000	104.76	1,089,553,000	106.29	1,105,436,800	1.000	2022/3/20	0.79
日本	国債証券	第280回利付国債(10年)	893,000,000	103.61	925,237,300	102.62	916,441,250	1.900	2016/6/20	0.65

## □ 種類別の投資比率

平成27年 1月29日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	77.13
地方債証券	6.24
特殊債券	9.32
社債券	6.44
合計	99.13

## 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)

### イ 主要投資銘柄

平成27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	外国株式インデックス・マザーファンド	11,617,415,936	2.8349	32,934,212,437	2.7468	31,910,718,093	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。

## □ 種類別の投資比率

平成27年 1月30日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	100.01
合計	100.01

## 外国株式インデックス・マザーファンド

## イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成27年 1月30日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	324,205	14,056.58	4,557,216,735	14,059.92	4,558,297,985	2.32
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	230,698	10,701.80	2,468,884,599	10,356.33	2,389,185,772	1.22
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	424,149	5,640.33	2,392,344,251	4,967.68	2,107,037,565	1.07
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	152,886	12,785.12	1,954,666,401	12,106.43	1,850,904,421	0.94
アメリカ	株式	WELLS FARGO & COMPANY	銀行	268,627	6,437.73	1,729,350,193	6,238.86	1,675,928,931	0.85
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	174,637	9,304.44	1,624,899,880	9,087.18	1,586,957,854	0.81
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	544,125	3,126.30	1,701,101,609	2,847.46	1,549,374,173	0.79
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	146,838	10,681.11	1,568,393,300	10,130.47	1,487,539,055	0.76
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	124,092	11,991.30	1,488,025,145	11,679.84	1,449,375,946	0.74
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	204,047	7,102.39	1,449,221,725	6,582.97	1,343,236,810	0.68
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	344,014	3,685.48	1,267,859,310	3,763.89	1,294,833,435	0.66
アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION	エネルギー	102,677	12,863.09	1,320,743,614	12,179.75	1,250,580,191	0.64
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	38,005	37,056.81	1,408,344,193	32,434.04	1,232,655,880	0.63
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	224,236	5,972.47	1,339,244,707	5,452.50	1,222,648,472	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	156,399	7,144.91	1,117,457,987	7,342.14	1,148,303,745	0.59
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	1,037,710	1,135.14	1,177,947,894	1,102.01	1,143,567,306	0.58
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	280,536	4,177.72	1,172,001,599	3,897.52	1,093,394,671	0.56

アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	268,745	4,397.17	1,181,717,929	4,045.33	1,087,162,883	0.55
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	各種金融	62,409	17,572.39	1,096,675,392	17,298.79	1,079,600,341	0.55
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	214,298	5,293.47	1,134,381,338	4,978.32	1,066,845,091	0.54
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	570,936	2,010.88	1,148,087,834	1,824.59	1,041,728,398	0.53
アメリカ	株式	GILEAD SCIENCES INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	82,082	11,868.58	974,196,930	12,319.28	1,011,191,551	0.52
アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	107,184	9,184.35	984,416,082	9,223.50	988,611,624	0.50
アメリカ	株式	ORACLE CORPORATION	ソフトウェア・サービス	193,265	5,015.70	969,360,782	5,068.19	979,504,707	0.50
アメリカ	株式	THE WALT DISNEY CO.	メディア	88,213	10,939.60	965,015,719	11,023.26	972,395,275	0.50
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	51,477	19,147.36	985,648,709	18,385.50	946,430,898	0.48
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL C	ソフトウェア・サービス	15,613	63,984.24	998,985,945	60,385.54	942,799,514	0.48
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	15,390	64,828.00	997,703,060	60,689.44	934,010,597	0.48
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	81,844	11,824.73	967,783,512	11,355.54	929,383,430	0.47
アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	164,678	6,363.35	1,047,904,973	5,631.06	927,312,522	0.47

□ 種類別・業種別の投資比率

平成27年 1月30日現在

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	外国	エネルギー	7.99
		素材	4.93
		資本財	6.97
		商業・専門サービス	0.88
		運輸	2.03
		自動車・自動車部品	1.71
		耐久消費財・アパレル	1.67
		消費者サービス	1.67
		メディア	2.99
		小売	3.31
		食品・生活必需品小売り	2.22
		食品・飲料・タバコ	6.31
		家庭用品・パーソナル用品	1.79
		ヘルスケア機器・サービス	3.50
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	10.03
銀行	8.79		

	各種金融	3.97
	保険	4.17
	不動産	0.82
	ソフトウェア・サービス	6.79
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.64
	電気通信サービス	3.16
	公益事業	3.48
	半導体・半導体製造装置	1.72
投資証券		2.52
合計		98.04

## 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;

## イ 主要投資銘柄

平成27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	外国債券パッシブ・マザーファンド	1,660,692,669	1.8344	3,046,433,093	1.8079	3,002,366,276	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。

## ロ 種類別の投資比率

平成27年 1月30日現在

種類	投資比率 (%)
親投資信託受益証券	100.01
合計	100.01

## 外国債券パッシブ・マザーファンド

## イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成27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 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	13,000,000	11,927.54	1,550,580,847	12,850.44	1,670,558,398	2.750	2042/11/15	0.74
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	9,000,000	12,285.06	1,105,655,976	12,599.16	1,133,925,117	2.500	2024/5/15	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	8,200,000	12,552.97	1,029,344,078	12,839.36	1,052,827,789	2.750	2023/11/15	0.47
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.25	6,400,000	15,770.12	1,009,288,118	15,779.09	1,009,862,195	4.250	2019/4/25	0.45
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 5.5	4,500,000	20,805.62	936,252,963	21,563.78	970,370,273	5.500	2029/4/25	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.25	8,000,000	11,812.06	944,965,312	11,825.00	946,000,000	0.250	2016/4/15	0.42



アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	7,500,000	12,411.63	930,872,318	12,598.24	944,868,314	2.625	2020/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3	7,000,000	12,544.66	878,126,352	13,485.11	943,958,344	3.000	2042/5/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	7,000,000	13,105.42	917,379,804	13,294.81	930,636,742	3.625	2021/2/15	0.41
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	7,000,000	12,972.39	908,067,617	13,078.63	915,504,438	3.625	2019/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2	7,500,000	11,867.49	890,062,206	12,137.25	910,294,042	2.000	2023/2/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	6,000,000	14,040.33	842,420,390	15,088.88	905,333,089	3.625	2043/8/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	7,000,000	12,552.97	878,708,359	12,853.22	899,725,453	2.750	2024/2/15	0.40
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.25	5,000,000	17,481.38	874,069,050	17,735.48	886,774,262	4.250	2023/10/25	0.39
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	7,000,000	12,144.64	850,125,118	12,475.37	873,276,250	2.375	2024/8/15	0.39
イギリス	国債証券	TREASURY 4.5	4,200,000	20,369.63	855,524,565	20,485.52	860,391,882	4.500	2019/3/7	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	7,000,000	12,041.17	842,882,304	12,257.35	858,014,609	2.125	2021/8/15	0.38
イタリア	国債証券	BTPS 6	4,100,000	19,045.76	780,876,521	20,346.14	834,191,955	6.000	2031/5/1	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.625	7,000,000	11,854.56	829,819,375	11,868.41	830,789,399	0.625	2016/8/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.375	7,000,000	11,833.31	828,332,015	11,843.47	829,043,359	0.375	2016/3/15	0.37
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3	5,000,000	15,798.50	789,925,470	15,950.06	797,503,078	3.000	2022/4/25	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	6,000,000	13,034.29	782,057,465	13,173.78	790,427,344	3.625	2020/2/15	0.35
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.5	5,000,000	15,679.35	783,967,810	15,744.28	787,214,400	3.500	2020/4/25	0.35
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.75	5,000,000	15,677.08	783,854,012	15,717.51	785,875,600	3.750	2019/10/25	0.35
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.375	6,500,000	11,862.87	771,087,006	11,962.65	777,572,279	1.375	2018/9/30	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.875	6,000,000	12,907.72	774,463,594	12,948.37	776,902,500	3.875	2018/5/15	0.34
イギリス	国債証券	TREASURY 4.25	2,900,000	24,726.32	717,063,482	26,732.98	775,256,446	4.250	2046/12/7	0.34
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.25	4,800,000	15,933.46	764,806,101	16,047.92	770,300,536	3.250	2021/10/25	0.34
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.75	4,700,000	16,216.21	762,162,105	16,319.70	767,026,099	3.750	2021/4/25	0.34
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 5.75	3,200,000	22,357.96	715,454,720	23,432.34	749,835,104	5.750	2032/10/25	0.33

## ロ 種類別の投資比率

平成27年 1月30日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	98.31
合計	98.31

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

### イ 主要投資銘柄

平成27年 1月29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	355,078,505	1.0114	359,129,122	1.0121	359,374,954	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。

#### ロ 種類別の投資比率

平成27年 1月29日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.01
合計	100.01

#### マネーインカム・マザーファンド

#### イ 主要投資銘柄

平成27年 1月29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88回利付国債(5年)	380,000,000	100.17	380,653,600	100.06	380,239,400	0.500	2015/3/20	28.60
日本	国債証券	第273回利付国債(10年)	228,000,000	101.57	231,582,540	100.94	230,154,600	1.500	2015/9/20	17.31
日本	国債証券	第270回利付国債(10年)	228,000,000	101.36	231,103,950	100.49	229,119,480	1.300	2015/6/20	17.23
日本	国債証券	第268回利付国債(10年)	228,000,000	101.32	231,016,440	100.18	228,430,920	1.500	2015/3/20	17.18
日本	国債証券	第276回利付国債(10年)	200,000,000	101.74	203,496,000	101.40	202,814,000	1.600	2015/12/20	15.25
日本	国債証券	第274回利付国債(10年)	25,000,000	101.68	25,422,450	101.31	25,329,750	1.500	2015/12/20	1.90

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

#### ロ 種類別の投資比率

平成27年 1月29日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	97.47
合計	97.47

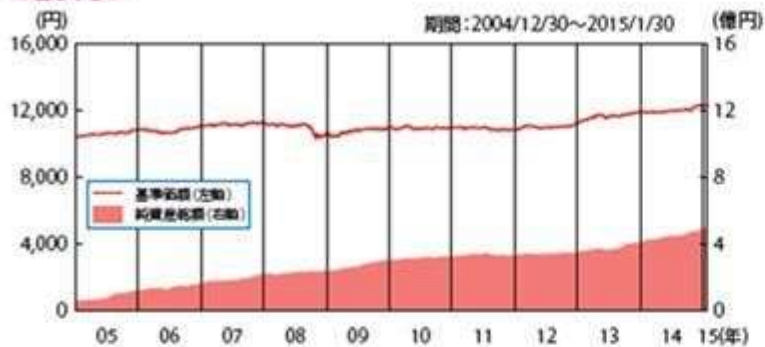
#### 参考情報

基準日2015年1月30日

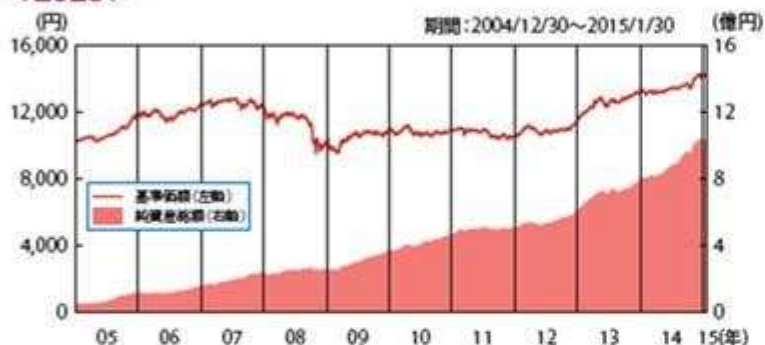
※ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。  
 ※委託会社ホームページにおいてもファンドの運用状況は適宜開示しています。

## ★ 基準価額・純資産の推移

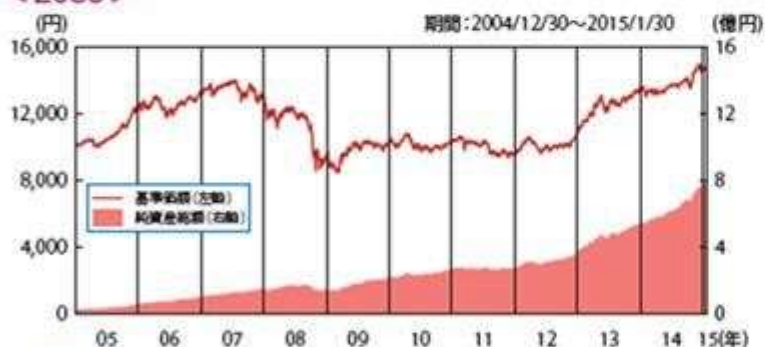
### < 2010 >



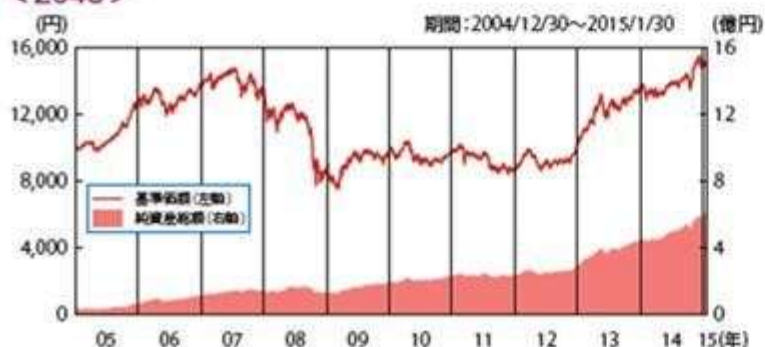
### < 2020 >



### < 2030 >



### < 2040 >



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

基準価額	12,282円
純資産総額	5億円

## ★ 分配の推移

決算期	分配金
2014年12月	0円
2013年12月	0円
2012年12月	0円
2011年12月	0円
2010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	14,173円
純資産総額	10億円

## ★ 分配の推移

決算期	分配金
2014年12月	0円
2013年12月	0円
2012年12月	0円
2011年12月	0円
2010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	14,747円
純資産総額	8億円

## ★ 分配の推移

決算期	分配金
2014年12月	0円
2013年12月	0円
2012年12月	0円
2011年12月	0円
2010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	15,181円
純資産総額	6億円

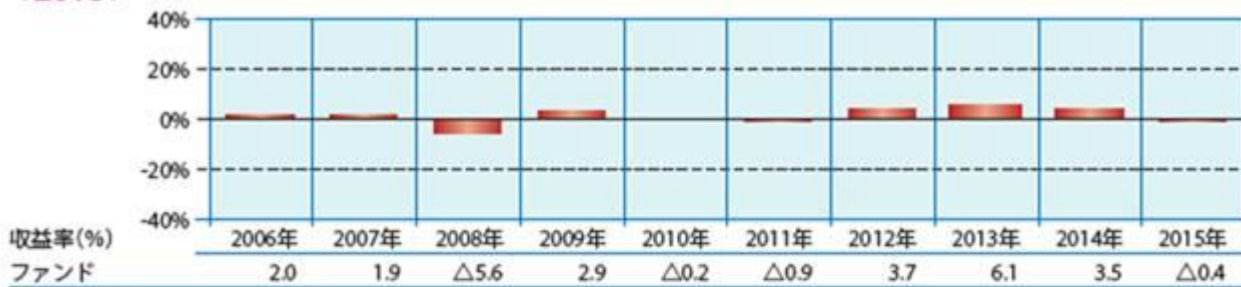
## ★ 分配の推移

決算期	分配金
2014年12月	0円
2013年12月	0円
2012年12月	0円
2011年12月	0円
2010年12月	0円
設定来累計	0円

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

## ★年間収益率の推移（暦年ベース）

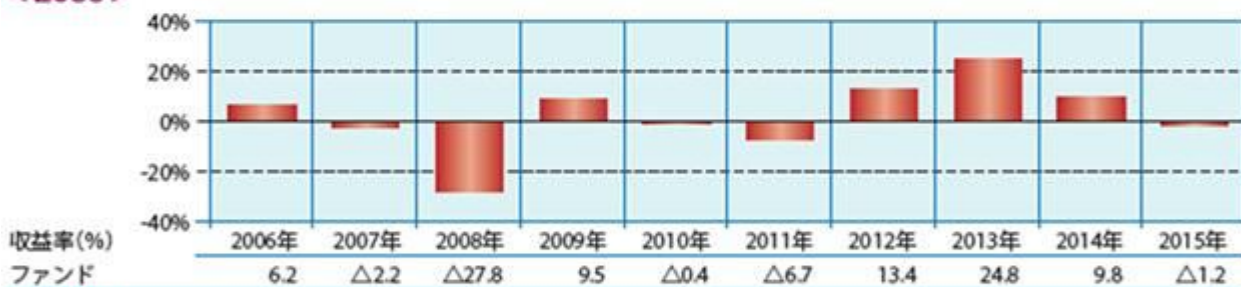
## &lt;2010&gt;



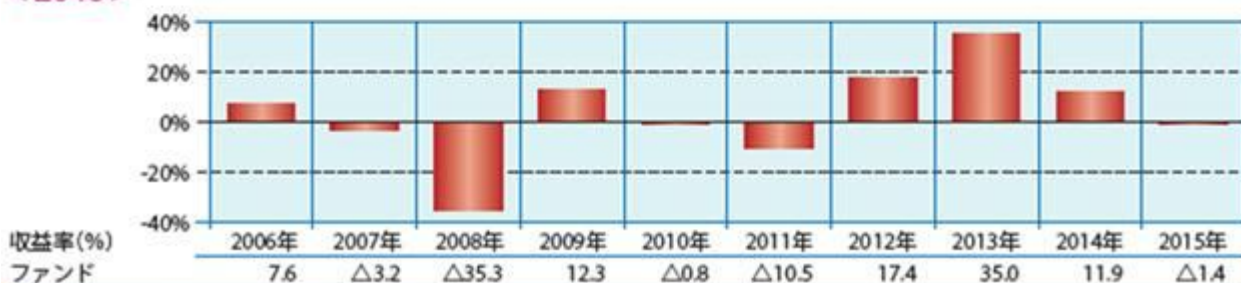
## &lt;2020&gt;



## &lt;2030&gt;



## &lt;2040&gt;



※2015年のファンドの収益率は、年初から2015年1月30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。

販売会社によっては一部のファンド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	http://www.smam-jp.com

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

#### ヘ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

#### ト 払込期日

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

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

## 2【換金（解約）手続等】

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

お買付けの販売会社にお申し出ください。

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

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

一部解約金は、解約請求受付日から起算して6営業日目からお支払いします。

一部解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

委託会社は、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるとき



は、一部解約の実行の請求の受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て)に支払われます。

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

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

#### (ロ) 償還金

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

#### 八 信託約款の変更

- (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(全体版)および運用報告書(全体版)の記載事項のうち重要なものを記載した交付運用報告書を作成します。交付運用報告書は、原則として、あらかじめ受益者が申し出た住所に販売会社から届けられます。なお、運用報告書(全体版)は、委託会社のホームページで閲覧できます。

## 4【受益者の権利等】



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

受益者の有する主な権利は次の通りです。

イ 分配金請求権

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

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

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

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

ロ 償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

ハ 一部解約実行請求権

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

ニ 信託約款変更等に対する異議申立権および受益権の買取請求権

委託会社が、当ファンドの解約(監督官庁の命令による解約等の場合を除きます。)または重大な信託約款の変更を行おうとする場合において、当該解約または信託約款変更に関する異議のある受益者は、それぞれの手続きにおいて設けられる異議申立期間中に異議を申し立てることができます。異議を申し立てた受益者の受益権の口数が、受益権の総口数の過半数となる場合は、当該解約または信託約款変更は行われません。

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

ホ 帳簿閲覧・謄写請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第14期（平成25年12月21日から平成26年12月22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13期 （平成25年12月20日現在）	第14期 （平成26年12月22日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	2,399,322	13,536,984
投資信託受益証券	405,283,667	485,909,114
未収入金	-	1,640,000
未収利息	1	3
流動資産合計	407,682,990	501,086,101
資産合計	407,682,990	501,086,101
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金	510,000	7,270,000
未払解約金	-	2,631,698
未払受託者報酬	80,852	100,646
未払委託者報酬	727,636	905,855
その他未払費用	6,005	7,490
流動負債合計	1,324,493	10,915,689
負債合計	1,324,493	10,915,689
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	341,924,743	398,408,082
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	64,433,754	91,762,330
元本等合計	406,358,497	490,170,412
純資産合計	406,358,497	490,170,412
負債純資産合計	407,682,990	501,086,101

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第13期		第14期	
	自	平成24年12月21日 至 平成25年12月20日	自	平成25年12月21日 至 平成26年12月22日
営業収益				
受取利息		472		1,062
有価証券売買等損益		23,562,548		18,005,447
営業収益合計		23,563,020		18,006,509
営業費用				
受託者報酬		156,513		190,918
委託者報酬		1,408,539		1,718,160
その他費用		11,622		14,196
営業費用合計		1,576,674		1,923,274
営業利益又は営業損失（ ）		21,986,346		16,083,235
経常利益又は経常損失（ ）		21,986,346		16,083,235
当期純利益又は当期純損失（ ）		21,986,346		16,083,235
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		1,628,326		436,169
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		37,273,494		64,433,754
剰余金増加額又は欠損金減少額		11,799,648		16,936,446
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		11,799,648		16,936,446
剰余金減少額又は欠損金増加額		4,997,408		5,254,936
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		4,997,408		5,254,936
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		64,433,754		91,762,330

## ( 3 ) 【注記表】

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	第14期	
	自 平成25年12月21日 至 平成26年12月22日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券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. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>計算期間の取扱い</p> <p>当計算期間は当期末が休日のため、平成25年12月21日から平成26年12月22日までとなっております。</p>	

## ( 貸借対照表に関する注記 )

項 目	第13期		第14期	
	( 平成25年12月20日現在 )		( 平成26年12月22日現在 )	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	341,924,743口		398,408,082口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.1884円	1口当たり純資産額	1.2303円
	(10,000口当たりの純資産額)	11,884円)	(10,000口当たりの純資産額)	12,303円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項 目	第13期		第14期	
	自 平成24年12月21日 至 平成25年12月20日		自 平成25年12月21日 至 平成26年12月22日	

分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(457円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(20,357,563円)、収益調整金(34,670,047円)、および分配準備積立金(9,405,687円)より、分配対象収益は64,433,754円(1万口当たり1,884.44円)であります。分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(870円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(15,646,196円)、収益調整金(48,471,626円)、および分配準備積立金(27,643,638円)より、分配対象収益は91,762,330円(1万口当たり2,303.19円)であります。分配を行っておりません。
----------	--	---

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	第14期 自 平成25年12月21日 至 平成26年12月22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せん。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</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	第14期 (平成26年12月22日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

## 第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

## 第14期（自 平成25年12月21日 至 平成26年12月22日）

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
投資信託受益証券	16,555,139円
合計	16,555,139円

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

項 目	第13期 （平成25年12月20日現在）	第14期 （平成26年12月22日現在）
期首元本額	311,143,756円	341,924,743円
期中追加設定元本額	71,424,035円	84,271,259円
期中一部解約元本額	40,643,048円	27,787,920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）	18,480,103	24,471,352	
	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）	11,379,413	24,893,603	
	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＞	12,913,221	23,722,878	
	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＞	138,131,084	169,928,859	
	S M A M ・ マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞	240,702,034	242,892,422	
合計		421,605,855	485,909,114	

## 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13期 （平成25年12月20日現在）	第14期 （平成26年12月22日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	8,470,136	5,681,624
投資信託受益証券	787,824,974	1,041,036,358
未収入金	230,000	-
未収利息	6	1
流動資産合計	796,525,116	1,046,717,983
資産合計	796,525,116	1,046,717,983
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金	1,960,000	1,780,000
未払解約金	227,435	48,006
未払受託者報酬	155,725	207,524
未払委託者報酬	1,751,861	2,334,534
その他未払費用	11,618	15,508
流動負債合計	4,106,639	4,385,572
負債合計	4,106,639	4,385,572
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	599,859,697	732,860,365
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	192,558,780	309,472,046
元本等合計	792,418,477	1,042,332,411
純資産合計	792,418,477	1,042,332,411
負債純資産合計	796,525,116	1,046,717,983

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第13期		第14期	
	自	平成24年12月21日 至 平成25年12月20日	自	平成25年12月21日 至 平成26年12月22日
営業収益				
受取利息		1,418		2,165
有価証券売買等損益		103,249,601		75,341,384
営業収益合計		103,251,019		75,343,549
営業費用				
受託者報酬		297,183		381,377
委託者報酬		3,343,177		4,290,366
その他費用		22,167		28,489
営業費用合計		3,662,527		4,700,232
営業利益又は営業損失（ ）		99,588,492		70,643,317
経常利益又は経常損失（ ）		99,588,492		70,643,317
当期純利益又は当期純損失（ ）		99,588,492		70,643,317
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		5,616,493		1,018,258
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		75,289,620		192,558,780
剰余金増加額又は欠損金減少額		31,680,836		60,549,249
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		31,680,836		60,549,249
剰余金減少額又は欠損金増加額		8,383,675		13,261,042
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		8,383,675		13,261,042
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		192,558,780		309,472,046

## （ 3 ）【注記表】

## （ 重要な会計方針の注記 ）

項 目	第14期	
	自 平成25年12月21日 至 平成26年12月22日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券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. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>計算期間の取扱い 当計算期間は当期末が休日のため、平成25年12月21日から平成26年12月22日までとなっております。</p>	

## （ 貸借対照表に関する注記 ）

項 目	第13期		第14期	
	（平成25年12月20日現在）		（平成26年12月22日現在）	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	599,859,697口		732,860,365口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.3210円	1口当たり純資産額	1.4223円
	(10,000口当たりの純資産額	13,210円)	(10,000口当たりの純資産額	14,223円)

## （ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

項 目	第13期		第14期	
	自 平成24年12月21日 至 平成25年12月20日		自 平成25年12月21日 至 平成26年12月22日	

分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（1,365円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（93,970,634円）、収益調整金（132,331,376円）、および分配準備積立金（18,851,201円）より、分配対象収益は245,154,576円（1万口当たり4,086.86円）ですが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（2,165円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（69,622,894円）、収益調整金（193,550,796円）、および分配準備積立金（105,959,146円）より、分配対象収益は369,135,001円（1万口当たり5,036.88円）ですが、分配を行っておりません。
----------	---	--

## （金融商品に関する注記）

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	第14期 自 平成25年12月21日 至 平成26年12月22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せん。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</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	第14期 (平成26年12月22日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

## 第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

## 第14期（自 平成25年12月21日 至 平成26年12月22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	73,138,653円
合計	73,138,653円

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

項 目	第13期 （平成25年12月20日現在）	第14期 （平成26年12月22日現在）
期首元本額	530,467,204円	599,859,697円
期中追加設定元本額	124,684,453円	174,116,846円
期中一部解約元本額	55,291,960円	41,116,178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）	102,511,172	135,745,293	
	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）	43,414,436	94,973,420	
	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＞	73,325,893	134,706,998	
	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＞	507,138,961	623,882,349	
	S M A M ・ マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞	51,261,816	51,728,298	
合計		777,652,278	1,041,036,358	

## 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13期 （平成25年12月20日現在）	第14期 （平成26年12月22日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	3,942,574	23,689,551
投資信託受益証券	539,715,089	754,888,842
未収利息	3	6
流動資産合計	543,657,666	778,578,399
資産合計	543,657,666	778,578,399
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金	1,020,000	2,660,000
未払解約金	-	964,873
未払受託者報酬	104,844	148,041
未払委託者報酬	1,179,409	1,665,397
その他未払費用	7,806	11,038
流動負債合計	2,312,059	5,449,349
負債合計	2,312,059	5,449,349
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	402,636,309	521,905,300
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	138,709,298	251,223,750
元本等合計	541,345,607	773,129,050
純資産合計	541,345,607	773,129,050
負債純資産合計	543,657,666	778,578,399

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第13期		第14期	
	自 至	平成24年12月21日 平成25年12月20日	自 至	平成25年12月21日 平成26年12月22日
営業収益				
受取利息		1,088		1,875
有価証券売買等損益		100,080,562		70,403,753
営業収益合計		100,081,650		70,405,628
営業費用				
受託者報酬		193,887		268,818
委託者報酬		2,181,058		3,024,069
その他費用		14,429		20,032
営業費用合計		2,389,374		3,312,919
営業利益又は営業損失（ ）		97,692,276		67,092,709
経常利益又は経常損失（ ）		97,692,276		67,092,709
当期純利益又は当期純損失（ ）		97,692,276		67,092,709
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		6,158,323		1,008,775
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		26,148,584		138,709,298
剰余金増加額又は欠損金減少額		24,529,750		55,805,249
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		24,529,750		55,805,249
剰余金減少額又は欠損金増加額		3,502,989		9,374,731
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		9,374,731
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		138,709,298		251,223,750

## ( 3 ) 【注記表】

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	第14期	
	自 平成25年12月21日 至 平成26年12月22日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券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. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>計算期間の取扱い 当計算期間は当期末が休日のため、平成25年12月21日から平成26年12月22日までとなっております。</p>	

## ( 貸借対照表に関する注記 )

項 目	第13期		第14期	
	( 平成25年12月20日現在 )		( 平成26年12月22日現在 )	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	402,636,309口		521,905,300口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.3445円	1口当たり純資産額	1.4814円
	(10,000口当たりの純資産額	13,445円)	(10,000口当たりの純資産額	14,814円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項 目	第13期		第14期	
	自 平成24年12月21日 至 平成25年12月20日		自 平成25年12月21日 至 平成26年12月22日	

分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（1,045円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（83,105,096円）、収益調整金（121,463,880円）、および分配準備積立金（9,394,930円）より、分配対象収益は213,964,951円（1万口当たり5,314.09円）ですが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（1,875円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（66,082,059円）、収益調整金（190,246,414円）、および分配準備積立金（87,099,856円）より、分配対象収益は343,430,204円（1万口当たり6,580.28円）ですが、分配を行っておりません。
----------	--	---

## （金融商品に関する注記）

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	第14期 自 平成25年12月21日 至 平成26年12月22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せん。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</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	第14期 (平成26年12月22日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

## 第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

## 第14期(自平成25年12月21日 至平成26年12月22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	68,476,715円
合計	68,476,715円

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

項 目	第13期 (平成25年12月20日現在)	第14期 (平成26年12月22日現在)
期首元本額	341,180,499円	402,636,309円
期中追加設定元本額	97,849,986円	146,378,903円
期中一部解約元本額	36,394,176円	27,109,912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）	153,611,218	203,411,974	
	S M A M ・ 外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	51,563,014	112,799,249	
	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＞	44,684,820	82,090,482	
	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＞	278,609,521	342,745,432	
	S M A M ・ マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞	13,716,882	13,841,705	
合計		542,185,455	754,888,842	

## 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13期 （平成25年12月20日現在）	第14期 （平成26年12月22日現在）
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン	2,407,691	5,310,387
投資信託受益証券	445,635,441	585,659,654
未収入金	1,020,000	150,000
未収利息	1	1
<b>流動資産合計</b>	<b>449,063,133</b>	<b>591,120,042</b>
<b>資産合計</b>	<b>449,063,133</b>	<b>591,120,042</b>
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払金	1,170,000	890,000
未払解約金	995,550	149,614
未払受託者報酬	85,631	116,212
未払委託者報酬	963,256	1,307,251
その他未払費用	6,356	8,654
<b>流動負債合計</b>	<b>3,220,793</b>	<b>2,471,731</b>
<b>負債合計</b>	<b>3,220,793</b>	<b>2,471,731</b>
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	329,245,529	385,837,486
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	116,596,811	202,810,825
<b>元本等合計</b>	<b>445,842,340</b>	<b>588,648,311</b>
<b>純資産合計</b>	<b>445,842,340</b>	<b>588,648,311</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>449,063,133</b>	<b>591,120,042</b>



## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第13期		第14期	
	自	平成24年12月21日 至 平成25年12月20日	自	平成25年12月21日 至 平成26年12月22日
営業収益				
受取利息		777		1,464
有価証券売買等損益		108,595,281		66,844,213
営業収益合計		108,596,058		66,845,677
営業費用				
受託者報酬		158,151		212,478
委託者報酬		1,779,047		2,390,213
その他費用		11,736		15,822
営業費用合計		1,948,934		2,618,513
営業利益又は営業損失（ ）		106,647,124		64,227,164
経常利益又は経常損失（ ）		106,647,124		64,227,164
当期純利益又は当期純損失（ ）		106,647,124		64,227,164
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		8,368,880		1,034,701
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		1,078,838		116,596,811
剰余金増加額又は欠損金減少額		18,296,312		35,912,762
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		-
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		35,912,762
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,056,583		12,891,211
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		12,891,211
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		116,596,811		202,810,825

## ( 3 ) 【注記表】

## ( 重要な会計方針の注記 )

項 目	第14期	
	自 平成25年12月21日 至 平成26年12月22日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>投資信託受益証券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. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>計算期間の取扱い 当計算期間は当期末が休日のため、平成25年12月21日から平成26年12月22日までとなっております。</p>	

## ( 貸借対照表に関する注記 )

項 目	第13期		第14期	
	( 平成25年12月20日現在 )		( 平成26年12月22日現在 )	
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	329,245,529口		385,837,486口	
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額	1.3541円	1口当たり純資産額	1.5256円
	(10,000口当たりの純資産額	13,541円)	(10,000口当たりの純資産額	15,256円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

項 目	第13期		第14期	
	自 平成24年12月21日 至 平成25年12月20日		自 平成25年12月21日 至 平成26年12月22日	

分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（743円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（81,431,782円）、収益調整金（101,532,276円）、および分配準備積立金（6,558,097円）より、分配対象収益は189,522,898円（1万口当たり5,756.27円）ですが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（1,464円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（63,190,999円）、収益調整金（142,682,349円）、および分配準備積立金（79,416,586円）より、分配対象収益は285,291,398円（1万口当たり7,394.06円）ですが、分配を行っておりません。
----------	--	---

## （金融商品に関する注記）

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	第14期 自 平成25年12月21日 至 平成26年12月22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せん。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</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	第14期 (平成26年12月22日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

## 第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

## 第14期（自 平成25年12月21日 至 平成26年12月22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	65,277,175円
合計	65,277,175円

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

項 目	第13期 （平成25年12月20日現在）	第14期 （平成26年12月22日現在）
期首元本額	286,580,741円	329,245,529円
期中追加設定元本額	84,609,174円	92,910,684円
期中一部解約元本額	41,944,386円	36,318,727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）	189,514,584	250,955,212	
	S M A M ・ 外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	51,268,565	112,155,112	
	S M A M ・ 年金外国債券パッシブ・ファンド＜適格機関投資家限定＞	31,647,423	58,139,480	
	S M A M ・ 年金国内債券パッシブファンド＜適格機関投資家限定＞	124,497,797	153,157,189	
	S M A M ・ マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞	11,151,186	11,252,661	
合計		408,079,555	585,659,654	

## 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）

「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）

## 貸借対照表

（単位：円）

	（平成25年12月19日現在）	（平成26年12月19日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	4	-
親投資信託受益証券	70,468,395,347	51,465,116,868
流動資産合計	70,468,395,351	51,465,116,868
資産合計	70,468,395,351	51,465,116,868
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬	1,365,191	1,107,152
未払委託者報酬	1,194,539	968,750
その他未払費用	28,322	30,852
流動負債合計	2,588,052	2,106,754
負債合計	2,588,052	2,106,754
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	60,530,799,244	38,863,813,165
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	9,935,008,055	12,599,196,949
元本等合計	70,465,807,299	51,463,010,114
純資産合計	70,465,807,299	51,463,010,114
負債純資産合計	70,468,395,351	51,465,116,868

## 注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自平成26年12月2日 至平成26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)	(平成26年12月19日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	60,530,799,244口	38,863,813,165口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.1641円 (10,000口当たりの純資産額 11,641円)	1口当たり純資産額 1.3242円 (10,000口当たりの純資産額 13,242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26年12月 2日 至 平成26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せん。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p>



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

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成26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)

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項 目	（平成25年12月19日現在）	（平成26年12月19日現在）
期首元本額	61,759,775,625円	39,886,737,708円
期中追加設定元本額	4,488,101円	14,845,640円
期中一部解約元本額	1,233,464,482円	1,037,770,183円

附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
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）	25,543,536,266	51,465,116,868	
合計		25,543,536,266	51,465,116,868	

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）

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）

### 貸借対照表

	（単位：円）	
	（平成25年12月19日現在）	（平成26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	5,221,673,004
株式	314,315,115,160	265,203,072,840
派生商品評価勘定	13,007,950	44,053,160
未収入金	255,800	-
未収配当金	23,571,280	21,732,725
未収利息	2,300	1,430
差入委託証拠金	14,360,000	123,800,000
流動資産合計	317,165,731,870	270,614,333,159
資産合計	317,165,731,870	270,614,333,159
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	36,050	517,880
前受金	13,205,000	43,599,000
未払解約金	46,641,439	30,000
流動負債合計	59,882,489	44,146,880
負債合計	59,882,489	44,146,880
純資産の部		
元本等		
元本	179,170,543,338	134,290,845,936
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	137,935,306,043	136,279,340,343
元本等合計	317,105,849,381	270,570,186,279
純資産合計	317,105,849,381	270,570,186,279
負債純資産合計	317,165,731,870	270,614,333,159

### 注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 平成26年12月 2日 至 平成26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</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(平成25年12月19日現在)	(平成26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> <p>株式 11,160,000,000円</p>	<p>代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p>株式 3,781,000,000円</p>
2. 当計算期間の末日における受益権の総数	179,170,543,338口	134,290,845,936口
3. 1単位当たり純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.7699円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 17,699円)</p>	<p>1口当たり純資産額 2.0148円</p> <p>(10,000口当たりの純資産額 20,148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26年12月2日 至平成26年12月19日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係る	(1) 金融商品の内容

リスク	<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 (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26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	(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）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,783,118,100	-	2,796,090,000	12,971,900
	東証株価指数先物	2,783,118,100	-	2,796,090,000	12,971,900
	合計	2,783,118,100	-	2,796,090,000	12,971,900

（平成26年12月19日現在）

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

（単位：円）

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評 価 損 益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	5,308,944,720	-	5,352,480,000	43,535,280
	東証株価指数先物	5,308,944,720	-	5,352,480,000	43,535,280
	合計	5,308,944,720	-	5,352,480,000	43,535,280

（注）1.時価の算定方法

(1)株価指数先物取引の時価の算定方法について

1)原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

2)株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

## ( 関連当事者との取引に関する注記 )

該当事項はありません。

## ( その他の注記 )

( 平成25年12月19日現在 )	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	180,811,975,262円
同期中における追加設定元本額	352,746,404円
同期中における一部解約元本額	1,994,178,328円
平成25年12月19日現在における元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	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

(平成26年12月19日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	137,241,405,220円
同期中における追加設定元本額	598,965,986円
同期中における一部解約元本額	3,549,525,270円
平成26年12月19日現在における元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,382,897,834円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	428,942,345円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,220,145,291円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,685,954,988円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	78,506,259円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	6,553,383円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	11,651,025円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	12,073,659円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	18,172,736円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	9,258,206円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	19,632,467円
国内株式指数ファンド(TOPIX)	1,846,775,110円
三井住友・DC日本株式インデックスファンドS	590,981,548円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	25,543,536,266円
バランスファンドVA(安定運用型)<適格機関投資家限定>	301,514,598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>	29,902,554,426円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	10,641,634,750円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	4,764,295,415円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	17,520,518,753円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	103,726,785円



S M A M ・ バランスファンド V L 5 0 < 適格機関投資家限定 >	398,636,465円
世界 6 資産バランスファンド V A < 適格機関投資家限定 >	48,266,767円
S M A M ・ バランスファンド V A 7 5 < 適格機関投資家専用 >	2,008,659,813円
S M A M ・ バランスファンド V L 国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	96,939,284円
S M A M ・ インデックス・バランス V A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	631,148,654円
S M A M ・ インデックス・バランス V A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	2,028,456,159円
S M A M ・ バランスファンド V A 4 0 < 適格機関投資家専用 >	3,540,303,075円
S M A M ・ バランスファンド V A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	6,173,058,649円
S M A M ・ バランス V A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	448,414,724円
三井住友・ 5 資産バランスファンド・ V A S ( 適格機関投資家専用 )	5,072,681,210円
S M A M ・ グローバルバランス 4 0 V A < 適格機関投資家限定 >	120,311,735円
S M A M ・ バランスファンド V A 2 0 < 適格機関投資家専用 >	229,839,533円
三井住友・ 7 資産バランスファンド・ V A S ( 適格機関投資家専用 )	4,046,903,029円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	176,214,003円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	89,393,967円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	37,655,174円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	418,009,634円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	715,144,856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 >	297,790,547円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	201,087,008円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 >	102,539,216円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	13,787,833円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 0 L 2 < 適格機関投資家専用 >	147,931,998円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 >	1,770,415,440円
S M A M ・ 国内株式インデックスファンド・ V A ( 適格機関投資家専用 )	325,932,390円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 T 2 < 適格機関投資家専用 >	58,134,050円
S M A M ・ F G 新興国重視型バランス 2 0 V A < 適格機関投資家限定 >	631,285円
S M A M ・ F G グローバルバランス 2 5 V A < 適格機関投資家限定 >	3,145,074円
S M A M ・ グローバル・ マルチアセット・ グロース・ ファンド ( 安定成長型 ) < 適格機関投資家限定 >	88,520円
合計	134,290,845,936円

## 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

(単位：円)

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	
極洋	62,000	269.00	16,678,000	
日本水産	177,800	383.00	68,097,400	
マル八二チ口	28,000	1,712.00	47,936,000	
サカタのタネ	21,200	1,932.00	40,958,400	

ホクト	16,200	1,948.00	31,557,600	
住石ホールディングス	48,300	118.00	5,699,400	
日鉄鉱業	40,000	416.00	16,640,000	
三井松島産業	102,000	126.00	12,852,000	
国際石油開発帝石	759,500	1,319.00	1,001,780,500	
日本海洋掘削	4,500	3,990.00	17,955,000	
石油資源開発	20,400	3,675.00	74,970,000	
K & O エナジーグループ	9,500	1,453.00	13,803,500	
ショーボンドホールディングス	12,800	4,710.00	60,288,000	
ミライト・ホールディングス	44,600	1,364.00	60,834,400	
タマホーム	11,200	570.00	6,384,000	
安藤・間	96,600	751.00	72,546,600	
東急建設	52,100	537.00	27,977,700	
コムシスホールディングス	64,400	1,740.00	112,056,000	
ミサワホーム	17,500	1,015.00	17,762,500	
高松コンストラクショングループ	10,900	2,366.00	25,789,400	
東建コーポレーション	5,400	4,825.00	26,055,000	
ヤマウラ	9,800	388.00	3,802,400	
大成建設	728,000	665.00	484,120,000	
大林組	432,000	768.00	331,776,000	
清水建設	441,000	818.00	360,738,000	
長谷工コーポレーション	180,800	981.00	177,364,800	
松井建設	18,000	551.00	9,918,000	
銭高組	24,000	373.00	8,952,000	
鹿島建設	634,000	491.00	311,294,000	
不動テトラ	112,400	241.00	27,088,400	
鉄建建設	88,000	468.00	41,184,000	
日鉄住金テックスエンジニア	29,000	519.00	15,051,000	
西松建設	156,000	482.00	75,192,000	
三井住友建設	587,700	133.00	78,164,100	
大豊建設	40,000	514.00	20,560,000	
前田建設工業	97,000	993.00	96,321,000	
佐田建設	55,000	139.00	7,645,000	
ナカノフドー建設	13,900	403.00	5,601,700	
奥村組	138,000	541.00	74,658,000	
大和小田急建設	8,900	827.00	7,360,300	

東鉄工業	17,400	2,690.00	46,806,000	
イチケン	18,000	324.00	5,832,000	
戸田建設	182,000	466.00	84,812,000	
熊谷組	182,000	381.00	69,342,000	
青木あすなる建設	10,100	797.00	8,049,700	
北野建設	34,000	392.00	13,328,000	
植木組	23,000	260.00	5,980,000	
三井ホーム	20,000	494.00	9,880,000	
矢作建設工業	18,700	918.00	17,166,600	
ピーエス三菱	17,300	474.00	8,200,200	
東日本ハウス	19,400	499.00	9,680,600	
大東建託	54,800	13,360.00	732,128,000	
新日本建設	18,400	464.00	8,537,600	
N I P P O	33,000	1,966.00	64,878,000	
東亜道路工業	28,000	454.00	12,712,000	
前田道路	45,000	1,735.00	78,075,000	
日本道路	43,000	587.00	25,241,000	
東亜建設工業	111,000	198.00	21,978,000	
若築建設	87,000	198.00	17,226,000	
東洋建設	40,300	478.00	19,263,400	
五洋建設	162,300	379.00	61,511,700	
大林道路	17,000	760.00	12,920,000	
世紀東急工業	22,100	604.00	13,348,400	
福田組	22,000	979.00	21,538,000	
住友林業	106,400	1,185.00	126,084,000	
日本基礎技術	19,600	394.00	7,722,400	
日成ビルド工業	42,000	280.00	11,760,000	
ヤマダ・エスバイエルホーム	75,000	93.00	6,975,000	
巴コーポレーション	20,700	450.00	9,315,000	
パナホーム	54,000	773.00	41,742,000	
大和ハウス工業	422,100	2,281.50	963,021,150	
ライト工業	23,700	971.00	23,012,700	
積水ハウス	443,400	1,591.50	705,671,100	
日特建設	20,700	509.00	10,536,300	
ユアテック	24,000	685.00	16,440,000	
西部電気工業	15,000	474.00	7,110,000	

四電工	16,000	438.00	7,008,000	
中電工	20,700	1,816.00	37,591,200	
関電工	66,000	678.00	44,748,000	
きんでん	96,000	1,184.00	113,664,000	
東京エネシス	17,000	833.00	14,161,000	
トーエネック	22,000	591.00	13,002,000	
住友電設	11,800	1,461.00	17,239,800	
日本電設工業	23,800	1,502.00	35,747,600	
協和エクシオ	61,400	1,339.00	82,214,600	
新日本空調	13,800	929.00	12,820,200	
N D S	28,000	304.00	8,512,000	
九電工	27,000	1,323.00	35,721,000	
三機工業	30,100	772.00	23,237,200	
日揮	145,000	2,527.50	366,487,500	
中外炉工業	47,000	267.00	12,549,000	
ヤマト	16,000	419.00	6,704,000	
太平電業	20,000	959.00	19,180,000	
高砂熱学工業	40,700	1,507.00	61,334,900	
朝日工業社	22,000	412.00	9,064,000	
明星工業	26,000	738.00	19,188,000	
大気社	20,800	2,644.00	54,995,200	
ダイダン	21,000	679.00	14,259,000	
日比谷総合設備	19,000	1,634.00	31,046,000	
東芝プラントシステム	24,000	1,845.00	44,280,000	
O S J Bホールディングス	22,400	276.00	6,182,400	
東洋エンジニアリング	69,000	428.00	29,532,000	
千代田化工建設	105,000	994.00	104,370,000	
新興プランテック	30,800	816.00	25,132,800	
日本製粉	87,000	524.00	45,588,000	
日清製粉グループ本社	157,600	1,186.00	186,913,600	
日東富士製粉	18,000	315.00	5,670,000	
昭和産業	59,000	475.00	28,025,000	
鳥越製粉	14,100	785.00	11,068,500	
中部飼料	15,300	667.00	10,205,100	
フィード・ワンホールディングス	100,200	109.00	10,921,800	
日本甜菜製糖	79,000	207.00	16,353,000	

三井製糖	57,000	397.00	22,629,000	
塩水港精糖	18,900	259.00	4,895,100	
森永製菓	132,000	310.00	40,920,000	
中村屋	39,000	457.00	17,823,000	
江崎グリコ	33,400	4,145.00	138,443,000	
名糖産業	8,600	1,158.00	9,958,800	
不二家	78,000	200.00	15,600,000	
山崎製パン	106,000	1,498.00	158,788,000	
モロゾフ	32,000	365.00	11,680,000	
亀田製菓	8,200	3,510.00	28,782,000	
寿スピリッツ	4,100	2,216.00	9,085,600	
カルビー	53,400	4,280.00	228,552,000	
森永乳業	131,000	409.00	53,579,000	
ヤクルト本社	77,400	6,360.00	492,264,000	
明治ホールディングス	42,700	11,000.00	469,700,000	
雪印メグミルク	34,100	1,418.00	48,353,800	
プリマハム	82,000	268.00	21,976,000	
日本ハム	106,000	2,610.00	276,660,000	
伊藤ハム	79,000	638.00	50,402,000	
丸大食品	75,000	415.00	31,125,000	
米久	5,100	1,829.00	9,327,900	
S Foods	8,800	2,394.00	21,067,200	
サッポロホールディングス	236,000	539.00	127,204,000	
アサヒグループホールディングス	290,000	3,854.00	1,117,660,000	
キリンホールディングス	616,700	1,512.00	932,450,400	
宝ホールディングス	113,900	797.00	90,778,300	
オエノンホールディングス	44,000	217.00	9,548,000	
養命酒製造	11,000	888.00	9,768,000	
コカ・コーラウエスト	48,800	1,681.00	82,032,800	
コカ・コーライーストジャパン	44,000	1,756.00	77,264,000	
サントリー食品インターナショナル	86,500	4,150.00	358,975,000	
ダイドードリンコ	7,300	4,840.00	35,332,000	
伊藤園	39,500	2,127.00	84,016,500	
キーコーヒー	12,300	1,649.00	20,282,700	
日清オイリオグループ	68,000	420.00	28,560,000	
不二製油	38,700	1,589.00	61,494,300	

J - オイルミルズ	61,000	386.00	23,546,000	
キッコーマン	118,000	3,005.00	354,590,000	
味の素	333,000	2,225.00	740,925,000	
キューピー	73,400	2,228.00	163,535,200	
ハウス食品グループ本社	53,300	2,074.00	110,544,200	
カゴメ	56,000	1,850.00	103,600,000	
焼津水産化学工業	9,500	1,003.00	9,528,500	
アリアケジャパン	13,200	2,842.00	37,514,400	
ニチレイ	154,000	530.00	81,620,000	
東洋水産	75,400	3,875.00	292,175,000	
日清食品ホールディングス	60,900	5,700.00	347,130,000	
永谷園	16,000	1,052.00	16,832,000	
フジッコ	14,000	1,976.00	27,664,000	
ロック・フィールド	8,000	1,930.00	15,440,000	
日本たばこ産業	799,800	3,410.00	2,727,318,000	
ケンコーマヨネーズ	5,900	1,374.00	8,106,600	
わらべや日洋	8,200	1,963.00	16,096,600	
なとり	8,500	1,230.00	10,455,000	
ミヨシ油脂	58,000	137.00	7,946,000	
片倉工業	17,800	1,237.00	22,018,600	
ゲンゼ	110,000	311.00	34,210,000	
東洋紡	539,000	163.00	87,857,000	
ユニチカ	407,000	60.00	24,420,000	
富士紡ホールディングス	67,000	327.00	21,909,000	
日清紡ホールディングス	86,000	1,290.00	110,940,000	
倉敷紡績	139,000	185.00	25,715,000	
シキボウ	85,000	122.00	10,370,000	
日本毛織	43,000	789.00	33,927,000	
トーア紡コーポレーション	84,000	80.00	6,720,000	
ダイドーリミテッド	20,600	498.00	10,258,800	
帝国繊維	14,400	2,666.00	38,390,400	
帝人	553,000	312.00	172,536,000	
東レ	1,044,000	932.00	973,008,000	
サカイオーベックス	41,000	167.00	6,847,000	
住江織物	40,000	292.00	11,680,000	
イチカワ	17,000	277.00	4,709,000	

日本バイリーン	21,000	607.00	12,747,000	
芦森工業	34,000	180.00	6,120,000	
アツギ	123,000	114.00	14,022,000	
ダイニック	36,000	175.00	6,300,000	
セーレン	34,600	919.00	31,797,400	
小松精練	25,000	556.00	13,900,000	
ワコールホールディングス	81,000	1,204.00	97,524,000	
ホギメディカル	8,600	5,520.00	47,472,000	
T S Iホールディングス	61,000	685.00	41,785,000	
三陽商会	74,000	306.00	22,644,000	
オンワードホールディングス	97,000	699.00	67,803,000	
ルック	27,000	230.00	6,210,000	
ゴールドウイン	32,000	624.00	19,968,000	
デサント	31,000	1,173.00	36,363,000	
特種東海製紙	77,000	246.00	18,942,000	
王子ホールディングス	551,000	430.00	236,930,000	
日本製紙	63,100	1,749.00	110,361,900	
三菱製紙	207,000	86.00	17,802,000	
北越紀州製紙	84,800	516.00	43,756,800	
中越パルプ工業	55,000	176.00	9,680,000	
巴川製紙所	31,000	193.00	5,983,000	
大王製紙	60,000	1,023.00	61,380,000	
レンゴー	119,000	488.00	58,072,000	
トーモク	45,000	279.00	12,555,000	
ザ・パック	9,700	2,278.00	22,096,600	
クラレ	229,200	1,438.00	329,589,600	
旭化成	840,000	1,078.50	905,940,000	
共和レザー	8,700	748.00	6,507,600	
昭和電工	898,000	152.00	136,496,000	
住友化学	992,000	477.00	473,184,000	
住友精化	29,000	790.00	22,910,000	
日産化学工業	90,200	2,176.00	196,275,200	
ラサ工業	57,000	136.00	7,752,000	
クレハ	95,000	519.00	49,305,000	
テイカ	25,000	443.00	11,075,000	
石原産業	234,000	100.00	23,400,000	

片倉チッカリン	11,000	256.00	2,816,000	
日本曹達	87,000	676.00	58,812,000	
東ソー	336,000	556.00	186,816,000	
トクヤマ	211,000	252.00	53,172,000	
セントラル硝子	138,000	440.00	60,720,000	
東亜合成	168,000	491.00	82,488,000	
ダイソー	54,000	379.00	20,466,000	
関東電化工業	33,000	639.00	21,087,000	
電気化学工業	280,000	450.00	126,000,000	
信越化学工業	241,700	7,956.00	1,922,965,200	
日本カーバイド工業	49,000	226.00	11,074,000	
堺化学工業	55,000	367.00	20,185,000	
エア・ウォーター	119,000	1,916.00	228,004,000	
大陽日酸	173,000	1,255.00	217,115,000	
日本化学工業	52,000	284.00	14,768,000	
日本パーカラライジング	32,000	2,552.00	81,664,000	
高圧ガス工業	21,000	574.00	12,054,000	
チタン工業	23,000	226.00	5,198,000	
四国化成工業	20,000	834.00	16,680,000	
戸田工業	28,000	478.00	13,384,000	
ステラ ケミファ	7,900	1,322.00	10,443,800	
保土谷化学工業	44,000	192.00	8,448,000	
日本触媒	106,000	1,524.00	161,544,000	
大日精化工業	56,000	652.00	36,512,000	
カネカ	181,000	624.00	112,944,000	
三菱瓦斯化学	232,000	611.00	141,752,000	
三井化学	613,000	334.00	204,742,000	
J S R	133,300	2,105.00	280,596,500	
東京応化工業	28,000	3,780.00	105,840,000	
三菱ケミカルホールディングス	840,900	603.00	507,062,700	
日本合成化学工業	32,000	679.00	21,728,000	
ダイセル	190,000	1,420.00	269,800,000	
住友ベークライト	126,000	473.00	59,598,000	
積水化学工業	319,000	1,429.00	455,851,000	
日本ゼオン	116,000	1,079.00	125,164,000	
アイカ工業	40,600	2,496.00	101,337,600	



宇部興産	679,000	178.00	120,862,000
積水樹脂	20,900	1,565.00	32,708,500
タキロン	30,000	540.00	16,200,000
旭有機材工業	51,000	287.00	14,637,000
日立化成	66,500	2,191.00	145,701,500
ニチバン	16,000	405.00	6,480,000
リケンテクノス	23,100	437.00	10,094,700
大倉工業	35,000	353.00	12,355,000
積水化成成品工業	39,000	428.00	16,692,000
群栄化学工業	38,000	320.00	12,160,000
タイガースポリマー	7,900	745.00	5,885,500
ミライアル	5,600	1,765.00	9,884,000
ダイキョーニシカワ	3,400	3,790.00	12,886,000
日本化薬	87,000	1,450.00	126,150,000
カーリットホールディングス	12,100	586.00	7,090,600
日本精化	12,400	864.00	10,713,600
A D E K A	62,200	1,395.00	86,769,000
日油	112,000	754.00	84,448,000
新日本理化	24,800	214.00	5,307,200
ハリマ化成グループ	12,800	458.00	5,862,400
花王	371,300	4,669.00	1,733,599,700
第一工業製薬	27,000	383.00	10,341,000
三洋化成工業	42,000	869.00	36,498,000
大日本塗料	82,000	159.00	13,038,000
日本ペイントホールディングス	117,000	3,420.00	400,140,000
関西ペイント	163,000	1,862.00	303,506,000
中国塗料	40,000	987.00	39,480,000
日本特殊塗料	11,300	768.00	8,678,400
藤倉化成	19,900	584.00	11,621,600
太陽ホールディングス	11,100	4,175.00	46,342,500
D I C	540,000	286.00	154,440,000
サカタインクス	27,800	1,376.00	38,252,800
東洋インキＳＣホールディングス	133,000	597.00	79,401,000
T & K T O K A	4,500	2,383.00	10,723,500
富士フイルムホールディングス	308,500	3,611.50	1,114,147,750
資生堂	240,000	1,684.00	404,160,000

ライオン	155,000	637.00	98,735,000
高砂香料工業	45,000	527.00	23,715,000
マンダム	13,600	3,830.00	52,088,000
ミルボン	7,900	3,145.00	24,845,500
ファンケル	31,800	1,708.00	54,314,400
コーセー	21,800	4,695.00	102,351,000
ドクターシーラボ	9,400	3,990.00	37,506,000
ポーラ・オルビスホールディングス	16,100	4,820.00	77,602,000
ノエビアホールディングス	8,800	2,130.00	18,744,000
エステー	10,800	1,004.00	10,843,200
アグロ カネショウ	4,200	1,185.00	4,977,000
コニシ	10,600	1,856.00	19,673,600
長谷川香料	17,200	1,638.00	28,173,600
星光P M C	8,100	920.00	7,452,000
小林製薬	22,000	6,970.00	153,340,000
荒川化学工業	12,000	1,194.00	14,328,000
メック	11,100	942.00	10,456,200
日本高純度化学	3,900	2,352.00	9,172,800
J C U	3,800	5,690.00	21,622,000
新田ゼラチン	9,100	769.00	6,997,900
アース製薬	9,700	4,160.00	40,352,000
イハラケミカル工業	21,200	1,296.00	27,475,200
北興化学工業	18,000	376.00	6,768,000
大成ラミック	3,700	2,650.00	9,805,000
クミアイ化学工業	28,000	749.00	20,972,000
日本農薬	31,100	1,442.00	44,846,200
アキレス	117,000	148.00	17,316,000
有沢製作所	23,200	855.00	19,836,000
日東電工	104,200	6,681.00	696,160,200
レック	5,500	1,276.00	7,018,000
きもと	27,100	302.00	8,184,200
藤森工業	11,700	3,285.00	38,434,500
前澤化成工業	9,900	1,200.00	11,880,000
J S P	10,100	1,963.00	19,826,300
エフピコ	12,100	4,080.00	49,368,000
天馬	10,800	1,571.00	16,966,800

信越ポリマー	28,100	501.00	14,078,100	
東リ	39,000	248.00	9,672,000	
ニフコ	30,200	3,880.00	117,176,000	
日本バルカー工業	59,000	314.00	18,526,000	
ユニ・チャーム	273,100	2,860.50	781,202,550	
協和発酵キリン	161,000	1,145.00	184,345,000	
武田薬品工業	504,900	5,001.00	2,525,004,900	
アステラス製薬	1,536,200	1,702.50	2,615,380,500	
大日本住友製薬	95,700	1,198.00	114,648,600	
塩野義製薬	210,600	3,115.00	656,019,000	
田辺三菱製薬	156,600	1,764.00	276,242,400	
わかもと製薬	22,000	263.00	5,786,000	
あすか製薬	16,600	1,269.00	21,065,400	
日本新薬	31,000	3,950.00	122,450,000	
中外製薬	134,300	3,150.00	423,045,000	
科研製薬	47,000	2,357.00	110,779,000	
エーザイ	177,800	4,680.00	832,104,000	
ロート製薬	61,700	1,553.00	95,820,100	
小野薬品工業	61,300	10,390.00	636,907,000	
久光製薬	37,800	3,705.00	140,049,000	
有機合成薬品工業	16,000	279.00	4,464,000	
持田製薬	9,700	6,540.00	63,438,000	
参天製薬	49,600	6,510.00	322,896,000	
扶桑薬品工業	50,000	301.00	15,050,000	
日本ケミファ	20,000	548.00	10,960,000	
ツムラ	42,800	2,714.00	116,159,200	
日医工	32,100	1,883.00	60,444,300	
キッセイ薬品工業	25,200	3,265.00	82,278,000	
生化学工業	26,200	1,937.00	50,749,400	
栄研化学	11,900	1,822.00	21,681,800	
鳥居薬品	9,300	2,962.00	27,546,600	
JCRファーマ	10,800	2,434.00	26,287,200	
東和薬品	7,100	5,380.00	38,198,000	
富士製薬工業	4,500	1,992.00	8,964,000	
沢井製薬	21,400	6,890.00	147,446,000	
ゼリア新薬工業	28,100	2,030.00	57,043,000	

第一三共	453,200	1,689.50	765,681,400	
キョーリン製薬ホールディングス	35,900	2,231.00	80,092,900	
大幸薬品	6,200	2,104.00	13,044,800	
ダイト	5,900	1,864.00	10,997,600	
大塚ホールディングス	267,500	3,703.00	990,552,500	
大正製薬ホールディングス	32,400	7,360.00	238,464,000	
日本コークス工業	129,300	109.00	14,093,700	
昭和シェル石油	120,300	1,020.00	122,706,000	
コスモ石油	372,000	157.00	58,404,000	
ニチレキ	17,000	882.00	14,994,000	
東燃ゼネラル石油	203,000	1,057.00	214,571,000	
ユシロ化学工業	8,700	1,682.00	14,633,400	
ピーピー・カストロール	6,300	1,314.00	8,278,200	
富士石油	32,400	347.00	11,242,800	
MORESCO	4,100	1,836.00	7,527,600	
出光興産	63,600	2,025.00	128,790,000	
JXホールディングス	1,492,600	451.40	673,759,640	
横浜ゴム	150,000	1,170.00	175,500,000	
東洋ゴム工業	61,200	2,500.00	153,000,000	
ブリヂストン	422,300	4,325.00	1,826,447,500	
住友ゴム工業	105,000	1,853.00	194,565,000	
藤倉ゴム工業	12,200	814.00	9,930,800	
オカモト	48,000	426.00	20,448,000	
フコク	6,200	1,278.00	7,923,600	
ニッタ	13,600	2,753.00	37,440,800	
住友理工	24,900	962.00	23,953,800	
三ツ星ベルト	35,000	879.00	30,765,000	
バンドー化学	50,000	434.00	21,700,000	
日東紡績	100,000	431.00	43,100,000	
旭硝子	663,000	598.00	396,474,000	
日本板硝子	655,000	114.00	74,670,000	
日本山村硝子	62,000	167.00	10,354,000	
日本電気硝子	259,000	544.00	140,896,000	
住友大阪セメント	252,000	342.00	86,184,000	
太平洋セメント	842,000	382.00	321,644,000	
デイ・シイ	15,500	488.00	7,564,000	

日本ヒューム	15,000	951.00	14,265,000
日本コンクリート工業	24,200	556.00	13,455,200
三谷セキサン	7,100	1,976.00	14,029,600
ジャパンパイル	18,900	757.00	14,307,300
東海カーボン	119,000	363.00	43,197,000
日本カーボン	78,000	236.00	18,408,000
東洋炭素	8,100	1,968.00	15,940,800
ノリタケカンパニーリミテド	78,000	259.00	20,202,000
TOTO	198,000	1,371.00	271,458,000
日本碍子	170,000	2,484.00	422,280,000
日本特殊陶業	116,200	3,655.00	424,711,000
MARUWA	4,200	3,560.00	14,952,000
品川リフラクトリーズ	38,000	268.00	10,184,000
黒崎播磨	33,000	252.00	8,316,000
ニッカトー	11,100	400.00	4,440,000
フジインコーポレーテッド	13,900	1,791.00	24,894,900
ニチアス	61,000	677.00	41,297,000
ニチハ	18,700	1,202.00	22,477,400
新日鐵住金	5,695,000	308.40	1,756,338,000
神戸製鋼所	2,327,000	205.00	477,035,000
中山製鋼所	112,000	81.00	9,072,000
合同製鐵	70,000	183.00	12,810,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	343,400	2,681.00	920,655,400
日新製鋼	57,100	1,176.00	67,149,600
東京製鐵	68,000	736.00	50,048,000
共英製鋼	14,600	2,142.00	31,273,200
大和工業	30,700	3,395.00	104,226,500
東京鐵鋼	27,000	530.00	14,310,000
大阪製鐵	8,500	2,010.00	17,085,000
淀川製鋼所	96,000	435.00	41,760,000
東洋鋼鋳	32,000	635.00	20,320,000
丸一鋼管	41,000	2,551.00	104,591,000
モリ工業	23,000	408.00	9,384,000
大同特殊鋼	227,000	454.00	103,058,000
日本高周波鋼業	61,000	112.00	6,832,000
日本冶金工業	106,200	250.00	26,550,000

山陽特殊製鋼	80,000	385.00	30,800,000	
愛知製鋼	79,000	417.00	32,943,000	
日立金属	137,000	2,054.00	281,398,000	
日本金属	40,000	149.00	5,960,000	
大平洋金属	86,000	366.00	31,476,000	
新日本電工	82,900	301.00	24,952,900	
栗本鐵工所	73,000	230.00	16,790,000	
虹技	22,000	214.00	4,708,000	
三菱製鋼	88,000	245.00	21,560,000	
日亜鋼業	21,000	343.00	7,203,000	
日本精線	12,000	698.00	8,376,000	
シンニッタン	15,100	514.00	7,761,400	
新家工業	30,000	183.00	5,490,000	
大紀アルミニウム工業所	26,000	329.00	8,554,000	
日本軽金属ホールディングス	327,600	171.00	56,019,600	
三井金属鉱業	370,000	294.00	108,780,000	
東邦亜鉛	79,000	405.00	31,995,000	
三菱マテリアル	842,000	405.00	341,010,000	
住友金属鉱山	372,000	1,817.00	675,924,000	
D O W Aホールディングス	161,000	952.00	153,272,000	
古河機械金属	214,000	209.00	44,726,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	13,900	2,287.00	31,789,300	
東邦チタニウム	23,900	785.00	18,761,500	
U A C J	155,000	309.00	47,895,000	
古河電気工業	399,000	198.00	79,002,000	
住友電気工業	507,600	1,522.50	772,821,000	
フジクラ	189,000	495.00	93,555,000	
昭和電線ホールディングス	160,000	102.00	16,320,000	
タツタ電線	26,800	495.00	13,266,000	
沖電線	17,000	308.00	5,236,000	
リョービ	77,000	318.00	24,486,000	
アーレスティ	12,700	659.00	8,369,300	
アサヒホールディングス	20,700	1,803.00	37,322,100	
稲葉製作所	6,200	1,314.00	8,146,800	
宮地エンジニアリンググループ	42,000	202.00	8,484,000	
トーカロ	9,300	2,030.00	18,879,000	

アルファＣο	5,400	1,126.00	6,080,400	
SUMCO	93,100	1,753.00	163,204,300	
川田テクノロジーズ	2,700	3,890.00	10,503,000	
東洋製罐グループホールディングス	95,000	1,617.00	153,615,000	
ホッカンホールディングス	33,000	288.00	9,504,000	
コロナ	7,500	1,148.00	8,610,000	
横河ブリッジホールディングス	25,900	1,355.00	35,094,500	
駒井ハルテック	27,000	297.00	8,019,000	
三和ホールディングス	130,100	868.00	112,926,800	
文化シャッター	38,000	977.00	37,126,000	
三協立山	16,400	2,159.00	35,407,600	
LIXILグループ	200,300	2,539.00	508,561,700	
日本ファイルコン	13,400	470.00	6,298,000	
ノーリツ	26,500	1,888.00	50,032,000	
長府製作所	14,300	3,020.00	43,186,000	
リンナイ	25,100	8,110.00	203,561,000	
ダイニチ工業	8,200	787.00	6,453,400	
日東精工	22,000	366.00	8,052,000	
三洋工業	24,000	202.00	4,848,000	
岡部	27,100	1,086.00	29,430,600	
東プレ	26,100	1,648.00	43,012,800	
高周波熱錬	23,800	847.00	20,158,600	
東京製綱	94,000	244.00	22,936,000	
パイオラックス	6,800	5,110.00	34,748,000	
日本発條	117,000	1,031.00	120,627,000	
中央発條	20,000	316.00	6,320,000	
アドバネクス	29,000	194.00	5,626,000	
三益半導体工業	12,000	1,147.00	13,764,000	
日本製鋼所	194,000	428.00	83,032,000	
三浦工業	60,400	1,236.00	74,654,400	
タクマ	46,000	827.00	38,042,000	
ツガミ	40,000	649.00	25,960,000	
オークマ	88,000	967.00	85,096,000	
東芝機械	74,000	474.00	35,076,000	
アマダ	200,700	1,032.00	207,122,400	
アイダエンジニアリング	29,500	1,072.00	31,624,000	

滝澤鉄工所	45,000	211.00	9,495,000
富士機械製造	44,300	1,110.00	49,173,000
牧野フライス製作所	68,000	901.00	61,268,000
オーエスジー	61,800	1,892.00	116,925,600
ダイジェット工業	19,000	237.00	4,503,000
旭ダイヤモンド工業	37,200	1,250.00	46,500,000
D M G 森精機	85,300	1,520.00	129,656,000
ディスコ	15,100	9,750.00	147,225,000
日東工器	8,000	2,138.00	17,104,000
パンチ工業	3,700	1,430.00	5,291,000
豊和工業	9,000	740.00	6,660,000
大阪機工	56,000	160.00	8,960,000
津田駒工業	39,000	161.00	6,279,000
島精機製作所	19,400	2,228.00	43,223,200
日阪製作所	18,000	968.00	17,424,000
やまびこ	5,400	5,230.00	28,242,000
ペガサスミシン製造	12,700	625.00	7,937,500
ナブテスコ	82,200	3,000.00	246,600,000
三井海洋開発	13,700	1,935.00	26,509,500
レオン自動機	12,000	520.00	6,240,000
S M C	41,300	31,730.00	1,310,449,000
新川	12,500	655.00	8,187,500
ホソカワミクロン	23,000	700.00	16,100,000
ユニオンツール	6,600	2,686.00	17,727,600
オイレス工業	17,100	2,067.00	35,345,700
日精エー・エス・ビー機械	4,400	2,886.00	12,698,400
サトーホールディングス	16,900	2,686.00	45,393,400
日本エアータック	4,600	709.00	3,261,400
日精樹脂工業	10,200	1,297.00	13,229,400
小松製作所	668,300	2,765.00	1,847,849,500
住友重機械工業	369,000	669.00	246,861,000
日立建機	60,200	2,616.00	157,483,200
日工	20,000	398.00	7,960,000
巴工業	5,400	1,715.00	9,261,000
井関農機	140,000	226.00	31,640,000
T O W A	12,500	682.00	8,525,000



丸山製作所	34,000	234.00	7,956,000	
北川鉄工所	65,000	221.00	14,365,000	
クボタ	650,000	1,761.00	1,144,650,000	
三菱化工機	46,000	448.00	20,608,000	
月島機械	23,800	1,214.00	28,893,200	
帝国電機製作所	9,500	1,308.00	12,426,000	
新東工業	31,500	813.00	25,609,500	
澁谷工業	11,600	2,452.00	28,443,200	
アイチ コーポレーション	19,700	569.00	11,209,300	
小森コーポレーション	33,200	1,324.00	43,956,800	
鶴見製作所	10,300	1,964.00	20,229,200	
住友精密工業	23,000	508.00	11,684,000	
酒井重工業	28,000	321.00	8,988,000	
荏原製作所	280,000	508.00	142,240,000	
石井鐵工所	24,000	228.00	5,472,000	
西島製作所	14,400	825.00	11,880,000	
北越工業	10,400	1,197.00	12,448,800	
ダイキン工業	187,500	7,952.00	1,491,000,000	
オルガノ	29,000	468.00	13,572,000	
トーヨーカネツ	80,000	247.00	19,760,000	
栗田工業	76,200	2,500.00	190,500,000	
椿本チエイン	69,000	981.00	67,689,000	
大同工業	29,000	253.00	7,337,000	
日本コンベヤ	44,000	256.00	11,264,000	
木村化工機	14,300	512.00	7,321,600	
アネスト岩田	21,300	780.00	16,614,000	
ダイフク	63,900	1,353.00	86,456,700	
加藤製作所	29,000	1,005.00	29,145,000	
油研工業	31,000	246.00	7,626,000	
タダノ	62,000	1,479.00	91,698,000	
フジテック	37,700	1,243.00	46,861,100	
C K D	36,400	1,131.00	41,168,400	
キトー	14,800	1,191.00	17,626,800	
平和	28,100	2,338.00	65,697,800	
理想科学工業	7,800	3,660.00	28,548,000	
SANKYO	38,900	4,095.00	159,295,500	

日本金銭機械	12,100	1,703.00	20,606,300
マースエンジニアリング	7,500	2,052.00	15,390,000
福島工業	7,100	1,969.00	13,979,900
ダイコク電機	5,700	1,776.00	10,123,200
アマノ	43,000	1,237.00	53,191,000
J U K I	97,000	450.00	43,650,000
サンデン	79,000	662.00	52,298,000
蛇の目ミシン工業	129,000	142.00	18,318,000
マックス	20,000	1,219.00	24,380,000
グローリー	41,200	2,953.00	121,663,600
新晃工業	10,000	1,023.00	10,230,000
大和冷機工業	19,000	738.00	14,022,000
セガサミーホールディングス	138,400	1,568.00	217,011,200
日本ピストンリング	53,000	243.00	12,879,000
リケン	55,000	468.00	25,740,000
T P R	14,300	2,951.00	42,199,300
ホシザキ電機	28,100	6,190.00	173,939,000
大豊工業	10,800	1,350.00	14,580,000
日本精工	264,000	1,480.00	390,720,000
N T N	298,000	546.00	162,708,000
ジェイテクト	137,100	2,072.00	284,071,200
不二越	120,000	717.00	86,040,000
日本トムソン	45,000	573.00	25,785,000
T H K	85,700	2,901.00	248,615,700
ユースン精機	6,000	2,123.00	12,738,000
前澤給装工業	5,700	1,376.00	7,843,200
イーグル工業	17,900	2,235.00	40,006,500
日本ピラー工業	14,600	928.00	13,548,800
キッツ	59,100	491.00	29,018,100
日立工機	34,100	941.00	32,088,100
マキタ	84,000	5,660.00	475,440,000
日立造船	101,700	675.00	68,647,500
三菱重工業	2,157,000	685.10	1,477,760,700
I H I	927,000	621.00	575,667,000
イビデン	84,500	1,797.00	151,846,500
コニカミノルタ	306,900	1,370.00	420,453,000

ブラザー工業	166,300	2,158.00	358,875,400	
ミネベア	192,000	1,733.00	332,736,000	
日立製作所	3,091,000	905.00	2,797,355,000	
東芝	2,710,000	503.80	1,365,298,000	
三菱電機	1,287,000	1,453.00	1,870,011,000	
富士電機	357,000	492.00	175,644,000	
東洋電機製造	31,000	402.00	12,462,000	
安川電機	151,500	1,600.00	242,400,000	
シンフォニアテクノロジー	95,000	178.00	16,910,000	
明電舎	120,000	382.00	45,840,000	
オリジン電気	21,000	501.00	10,521,000	
山洋電気	29,000	800.00	23,200,000	
デンヨー	11,900	1,783.00	21,217,700	
東芝テック	92,000	840.00	77,280,000	
芝浦メカトロニクス	23,000	340.00	7,820,000	
マブチモーター	19,600	9,840.00	192,864,000	
日本電産	139,300	8,164.00	1,137,245,200	
東光高岳	6,900	1,758.00	12,130,200	
ダイヘン	72,000	595.00	42,840,000	
JVCケンウッド	97,100	254.00	24,663,400	
第一精工	5,000	2,567.00	12,835,000	
日新電機	31,000	663.00	20,553,000	
大崎電気工業	21,000	847.00	17,787,000	
オムロン	145,300	5,350.00	777,355,000	
日東工業	20,800	2,331.00	48,484,800	
I D E C	16,700	1,006.00	16,800,200	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	249,000	507.00	126,243,000	
サクサホールディングス	34,000	278.00	9,452,000	
メルコホールディングス	7,400	1,672.00	12,372,800	
日本電気	1,667,000	356.00	593,452,000	
富士通	1,242,000	665.60	826,675,200	
沖電気工業	447,000	236.00	105,492,000	
岩崎通信機	66,000	94.00	6,204,000	
電気興業	38,000	500.00	19,000,000	
サンケン電気	65,000	1,017.00	66,105,000	
アイホン	8,000	1,929.00	15,432,000	

ルネサスエレクトロニクス	67,100	824.00	55,290,400
セイコーエプソン	87,900	5,160.00	453,564,000
ワコム	102,700	467.00	47,960,900
アルバック	24,000	1,869.00	44,856,000
アクセル	6,600	1,480.00	9,768,000
E I Z O	12,000	2,275.00	27,300,000
ジャパンディスプレイ	199,100	391.00	77,848,100
日本信号	35,900	1,255.00	45,054,500
京三製作所	33,000	369.00	12,177,000
能美防災	17,300	1,589.00	27,489,700
ホーチキ	10,000	937.00	9,370,000
エレコム	4,300	2,322.00	9,984,600
日本無線	29,000	357.00	10,353,000
パナソニック	1,569,400	1,442.50	2,263,859,500
シャープ	1,061,000	263.00	279,043,000
アンリツ	81,100	835.00	67,718,500
富士通ゼネラル	40,000	1,112.00	44,480,000
日立国際電気	34,000	1,705.00	57,970,000
ソニー	827,700	2,446.50	2,024,968,050
T D K	77,700	7,350.00	571,095,000
帝国通信工業	35,000	234.00	8,190,000
ミツミ電機	46,000	1,006.00	46,276,000
タムラ製作所	51,000	445.00	22,695,000
アルプス電気	101,700	2,327.00	236,655,900
池上通信機	50,000	135.00	6,750,000
パイオニア	195,400	222.00	43,378,800
日本電波工業	13,000	978.00	12,714,000
日本トリム	3,400	2,547.00	8,659,800
ローランド ディー . ジー .	5,300	4,000.00	21,200,000
フォスター電機	13,500	2,043.00	27,580,500
クラリオン	70,000	374.00	26,180,000
S M K	40,000	482.00	19,280,000
ヨコオ	11,200	682.00	7,638,400
東光	34,000	306.00	10,404,000
ティアック	84,000	59.00	4,956,000
ホシデン	41,300	679.00	28,042,700

ヒロセ電機	20,800	13,790.00	286,832,000	
日本航空電子工業	37,000	2,805.00	103,785,000	
TOA	14,100	1,240.00	17,484,000	
日立マクセル	19,300	1,920.00	37,056,000	
古野電気	16,100	952.00	15,327,200	
ユニデン	38,000	225.00	8,550,000	
アルパイン	30,800	1,958.00	60,306,400	
スミダコーポレーション	13,100	841.00	11,017,100	
アイコム	7,200	2,925.00	21,060,000	
リオン	4,300	1,361.00	5,852,300	
船井電機	13,200	1,448.00	19,113,600	
横河電機	129,000	1,354.00	174,666,000	
新電元工業	50,000	716.00	35,800,000	
アズビル	41,900	2,803.00	117,445,700	
日本光電工業	27,400	6,280.00	172,072,000	
チノー	5,700	1,190.00	6,783,000	
共和電業	18,900	478.00	9,034,200	
日本電子材料	6,800	691.00	4,698,800	
堀場製作所	23,900	4,095.00	97,870,500	
アドバンテスト	88,200	1,531.00	135,034,200	
小野測器	7,900	1,024.00	8,089,600	
エスベック	14,600	1,094.00	15,972,400	
パナソニック デバイスSUNX	12,000	789.00	9,468,000	
キーエンス	29,200	53,870.00	1,573,004,000	
日置電機	7,700	1,729.00	13,313,300	
シスメックス	99,600	5,350.00	532,860,000	
メガチップス	13,900	1,383.00	19,223,700	
OBARA GROUP	8,400	5,180.00	43,512,000	
コーセル	18,700	1,209.00	22,608,300	
オブテックス	9,100	1,946.00	17,708,600	
千代田インテグレ	6,000	2,056.00	12,336,000	
レーザーテック	13,600	1,368.00	18,604,800	
スタンレー電気	92,800	2,610.00	242,208,000	
岩崎電気	46,000	243.00	11,178,000	
ウシオ電機	78,400	1,310.00	102,704,000	
日本セラミック	7,900	1,803.00	14,243,700	

遠藤照明	6,500	1,295.00	8,417,500	
日本デジタル研究所	10,800	1,654.00	17,863,200	
古河電池	10,000	1,048.00	10,480,000	
双信電機	9,700	407.00	3,947,900	
山一電機	15,700	760.00	11,932,000	
図研	10,100	1,143.00	11,544,300	
日本電子	56,000	624.00	34,944,000	
カシオ計算機	129,300	1,893.00	244,764,900	
ファナック	134,100	20,395.00	2,734,969,500	
日本シイエムケイ	36,200	317.00	11,475,400	
エンプラス	6,000	4,270.00	25,620,000	
大真空	26,000	327.00	8,502,000	
ローム	63,500	7,750.00	492,125,000	
浜松ホトニクス	53,500	5,970.00	319,395,000	
三井ハイテック	17,400	846.00	14,720,400	
新光電気工業	49,000	811.00	39,739,000	
京セラ	211,000	5,672.00	1,196,792,000	
太陽誘電	67,600	1,412.00	95,451,200	
村田製作所	135,100	12,900.00	1,742,790,000	
ユーシン	18,600	688.00	12,796,800	
双葉電子工業	22,300	1,779.00	39,671,700	
北陸電気工業	61,000	175.00	10,675,000	
ニチコン	40,800	1,003.00	40,922,400	
日本ケミコン	106,000	359.00	38,054,000	
K O A	18,100	1,151.00	20,833,100	
市光工業	33,000	260.00	8,580,000	
小糸製作所	77,100	3,705.00	285,655,500	
ミツバ	23,700	2,117.00	50,172,900	
スター精密	24,800	1,569.00	38,911,200	
S C R E E Nホールディングス	123,000	734.00	90,282,000	
キャノン電子	11,000	1,936.00	21,296,000	
キャノン	746,200	3,918.00	2,923,611,600	
リコー	386,900	1,243.50	481,110,150	
M U T O Hホールディングス	19,000	466.00	8,854,000	
東京エレクトロン	108,400	9,116.00	988,174,400	
トヨタ紡織	45,300	1,531.00	69,354,300	

鬼怒川ゴム工業	31,000	513.00	15,903,000	
ユニプレス	25,000	2,026.00	50,650,000	
豊田自動織機	117,000	6,090.00	712,530,000	
モリタホールディングス	23,300	1,128.00	26,282,400	
三櫻工業	18,100	751.00	13,593,100	
デンソー	317,900	5,694.00	1,810,122,600	
東海理化電機製作所	34,100	2,552.00	87,023,200	
三井造船	502,000	217.00	108,934,000	
川崎重工業	936,000	557.00	521,352,000	
名村造船所	36,400	1,327.00	48,302,800	
サノヤスホールディングス	17,700	385.00	6,814,500	
日本車輛製造	49,000	356.00	17,444,000	
ニチユ三菱フォークリフト	15,800	772.00	12,197,600	
近畿車輛	26,000	318.00	8,268,000	
日産自動車	1,806,800	1,049.00	1,895,333,200	
いすゞ自動車	407,000	1,446.00	588,522,000	
トヨタ自動車	1,776,900	7,562.00	13,436,917,800	代用有価証券 500,000株
日野自動車	183,600	1,570.00	288,252,000	
三菱自動車工業	472,400	1,133.00	535,229,200	
エフテック	8,200	1,205.00	9,881,000	
武蔵精密工業	14,100	2,231.00	31,457,100	
日産車体	56,700	1,455.00	82,498,500	
新明和工業	53,000	1,134.00	60,102,000	
極東開発工業	24,200	1,432.00	34,654,400	
日信工業	23,900	1,659.00	39,650,100	
トピー工業	107,000	231.00	24,717,000	
ティラド	54,000	244.00	13,176,000	
曙ブレーキ工業	57,200	413.00	23,623,600	
タチエス	20,800	1,581.00	32,884,800	
N O K	62,400	3,055.00	190,632,000	
フタバ産業	40,300	569.00	22,930,700	
カヤバ工業	145,000	515.00	74,675,000	
シロキ工業	33,000	253.00	8,349,000	
大同メタル工業	18,000	1,237.00	22,266,000	
プレス工業	65,000	420.00	27,300,000	

カルソニックカンセイ	99,000	668.00	66,132,000	
太平洋工業	27,200	909.00	24,724,800	
ケーヒン	29,700	1,728.00	51,321,600	
河西工業	16,800	1,027.00	17,253,600	
アイシン精機	117,700	4,380.00	515,526,000	
富士機工	16,000	562.00	8,992,000	
マツダ	383,700	2,991.00	1,147,646,700	
ダイハツ工業	153,700	1,591.00	244,536,700	
今仙電機製作所	11,400	1,556.00	17,738,400	
本田技研工業	1,158,600	3,580.50	4,148,367,300	
スズキ	269,200	3,686.00	992,271,200	
富士重工業	438,000	4,354.00	1,907,052,000	
ヤマハ発動機	196,100	2,452.00	480,837,200	
ショーワ	30,800	1,121.00	34,526,800	
T B K	17,700	678.00	12,000,600	
エクセディ	17,700	3,020.00	53,454,000	
豊田合成	41,600	2,458.00	102,252,800	
愛三工業	20,300	1,013.00	20,563,900	
ヨロズ	12,500	2,006.00	25,075,000	
エフ・シー・シー	19,000	2,120.00	40,280,000	
シマノ	55,600	15,800.00	878,480,000	
タカタ	23,700	1,330.00	31,521,000	
テイ・エス テック	27,100	2,795.00	75,744,500	
テルモ	197,100	2,837.00	559,172,700	
日機装	42,200	1,136.00	47,939,200	
島津製作所	154,000	1,280.00	197,120,000	
J M S	27,000	286.00	7,722,000	
長野計器	10,400	687.00	7,144,800	
ブイ・テクノロジー	2,800	2,373.00	6,644,400	
東京計器	46,000	283.00	13,018,000	
愛知時計電機	21,000	322.00	6,762,000	
東京精密	23,200	2,406.00	55,819,200	
マニー	3,700	7,140.00	26,418,000	
ニコン	240,200	1,697.00	407,619,400	
トプコン	38,900	2,557.00	99,467,300	
オリンパス	191,900	4,405.00	845,319,500	



理研計器	12,100	1,165.00	14,096,500	
タムロン	10,000	2,312.00	23,120,000	
H O Y A	306,400	4,044.00	1,239,081,600	
ノーリツ鋼機	12,700	604.00	7,670,800	
エー・アンド・デイ	13,300	493.00	6,556,900	
シチズンホールディングス	158,500	956.00	151,526,000	
リズム時計工業	61,000	155.00	9,455,000	
大研医器	9,600	1,135.00	10,896,000	
松風	6,900	1,567.00	10,812,300	
セイコーホールディングス	91,000	707.00	64,337,000	
ニプロ	82,500	1,055.00	87,037,500	
パラマウントベッドホールディングス	13,800	3,270.00	45,126,000	
前田工織	12,800	1,235.00	15,808,000	
永大産業	20,000	449.00	8,980,000	
アートネイチャー	10,200	1,326.00	13,525,200	
ダンロップスポーツ	8,800	1,431.00	12,592,800	
バンダイナムコホールディングス	142,200	2,612.00	371,426,400	
共立印刷	28,200	289.00	8,149,800	
フランスベッドホールディングス	91,000	180.00	16,380,000	
パイロットコーポレーション	11,300	6,750.00	76,275,000	
トッパン・フォームズ	22,900	1,193.00	27,319,700	
フジシールインターナショナル	15,800	3,470.00	54,826,000	
タカラトミー	47,900	639.00	30,608,100	
廣済堂	13,800	426.00	5,878,800	
アーク	44,800	139.00	6,227,200	
プロネクサス	15,100	702.00	10,600,200	
ウッドワン	27,000	257.00	6,939,000	
大建工業	55,000	258.00	14,190,000	
凸版印刷	361,000	778.00	280,858,000	
大日本印刷	391,000	1,088.00	425,408,000	
図書印刷	22,000	334.00	7,348,000	
共同印刷	41,000	385.00	15,785,000	
日本写真印刷	21,600	1,890.00	40,824,000	
光村印刷	24,000	260.00	6,240,000	
アシックス	128,100	2,984.00	382,250,400	
ツツミ	6,700	2,442.00	16,361,400	

小松ウオール工業	4,300	2,664.00	11,455,200
ヤマハ	94,600	1,812.00	171,415,200
河合楽器製作所	4,800	2,484.00	11,923,200
クリナップ	13,800	866.00	11,950,800
ピジョン	24,500	6,980.00	171,010,000
キングジム	14,300	720.00	10,296,000
リンテック	30,800	2,683.00	82,636,400
イトーキ	27,900	588.00	16,405,200
任天堂	79,300	12,640.00	1,002,352,000
三菱鉛筆	10,800	3,580.00	38,664,000
タカラスタンダード	54,000	900.00	48,600,000
コクヨ	66,600	896.00	59,673,600
ナカバヤシ	34,000	205.00	6,970,000
グローブライド	68,000	193.00	13,124,000
岡村製作所	50,200	828.00	41,565,600
美津濃	69,000	590.00	40,710,000
アデランス	14,900	1,173.00	17,477,700
東京電力	1,092,900	459.00	501,641,100
中部電力	393,800	1,421.50	559,786,700
関西電力	525,700	1,206.00	633,994,200
中国電力	177,900	1,583.00	281,615,700
北陸電力	126,300	1,543.00	194,880,900
東北電力	321,600	1,431.00	460,209,600
四国電力	116,400	1,466.00	170,642,400
九州電力	284,700	1,257.00	357,867,900
北海道電力	121,500	970.00	117,855,000
沖縄電力	8,500	3,715.00	31,577,500
電源開発	86,600	3,990.00	345,534,000
東京瓦斯	1,564,000	643.90	1,007,059,600
大阪瓦斯	1,331,000	445.00	592,295,000
東邦瓦斯	328,000	593.00	194,504,000
北海道瓦斯	30,000	287.00	8,610,000
西部瓦斯	147,000	261.00	38,367,000
静岡瓦斯	37,600	742.00	27,899,200
SBSホールディングス	10,000	1,009.00	10,090,000
東武鉄道	686,000	520.00	356,720,000

相鉄ホールディングス	221,000	486.00	107,406,000	
東京急行電鉄	696,000	737.00	512,952,000	
京浜急行電鉄	354,000	897.00	317,538,000	
小田急電鉄	411,000	1,058.00	434,838,000	
京王電鉄	358,000	877.00	313,966,000	
京成電鉄	193,000	1,456.00	281,008,000	
富士急行	36,000	1,147.00	41,292,000	
新京成電鉄	18,000	387.00	6,966,000	
東日本旅客鉄道	235,900	9,050.00	2,134,895,000	
西日本旅客鉄道	123,700	5,730.00	708,801,000	
東海旅客鉄道	115,200	17,995.00	2,073,024,000	
西武ホールディングス	102,700	2,507.00	257,468,900	
鴻池運輸	8,100	2,216.00	17,949,600	
西日本鉄道	166,000	495.00	82,170,000	
ハマキョウレックス	4,300	3,835.00	16,490,500	
サカイ引越センター	2,500	3,505.00	8,762,500	
近畿日本鉄道	1,295,000	397.00	514,115,000	
阪急阪神ホールディングス	862,000	643.00	554,266,000	
南海電気鉄道	271,000	461.00	124,931,000	
京阪電気鉄道	290,000	622.00	180,380,000	
神戸電鉄	35,000	348.00	12,180,000	
名糖運輸	7,800	669.00	5,218,200	
名古屋鉄道	464,000	439.00	203,696,000	
山陽電気鉄道	49,000	447.00	21,903,000	
日本通運	508,000	603.00	306,324,000	
ヤマトホールディングス	236,100	2,445.00	577,264,500	
山九	158,000	500.00	79,000,000	
丸運	13,800	255.00	3,519,000	
丸全昭和運輸	45,000	376.00	16,920,000	
センコー	53,000	581.00	30,793,000	
トナミホールディングス	30,000	315.00	9,450,000	
日本梱包運輸倉庫	42,000	1,774.00	74,508,000	
日本石油輸送	23,000	231.00	5,313,000	
福山通運	79,000	639.00	50,481,000	
セイノーホールディングス	100,000	1,181.00	118,100,000	
神奈川中央交通	18,000	571.00	10,278,000	

日立物流	27,000	1,487.00	40,149,000
日本郵船	1,097,000	346.00	379,562,000
商船三井	681,000	368.00	250,608,000
川崎汽船	570,000	316.00	180,120,000
N S ユナイテッド海運	61,000	330.00	20,130,000
飯野海運	69,600	670.00	46,632,000
日本航空	247,200	3,735.00	923,292,000
A N A ホールディングス	2,544,000	298.30	758,875,200
パスコ	17,000	337.00	5,729,000
トランコム	3,900	4,815.00	18,778,500
日新	54,000	275.00	14,850,000
三菱倉庫	85,000	1,866.00	158,610,000
三井倉庫ホールディングス	77,000	430.00	33,110,000
住友倉庫	95,000	656.00	62,320,000
澁澤倉庫	38,000	339.00	12,882,000
東陽倉庫	27,000	308.00	8,316,000
乾汽船	9,900	982.00	9,721,800
日本トランスシティ	34,000	366.00	12,444,000
安田倉庫	11,400	1,025.00	11,685,000
東洋埠頭	47,000	203.00	9,541,000
宇徳	12,100	582.00	7,042,200
上組	153,000	1,073.00	164,169,000
サンリツ	10,900	524.00	5,711,600
郵船ロジスティクス	12,400	1,385.00	17,174,000
近鉄エクスプレス	11,600	4,560.00	52,896,000
東海運	16,300	268.00	4,368,400
N E C ネットズエスアイ	16,100	2,500.00	40,250,000
システナ	13,700	851.00	11,658,700
デジタルアーツ	7,800	1,041.00	8,119,800
新日鉄住金ソリューションズ	10,800	3,135.00	33,858,000
コア	7,600	831.00	6,315,600
I T ホールディングス	42,400	1,833.00	77,719,200
電算システム	5,400	1,625.00	8,775,000
グリー	77,700	727.00	56,487,900
コーエーテクモホールディングス	29,300	1,769.00	51,831,700
三菱総合研究所	5,300	2,762.00	14,638,600

K L a b	13,800	1,328.00	18,326,400	
ポルトウウィン・ピットクルーホールディングス	9,500	806.00	7,657,000	
イーブックイニシアティブジャパン	3,700	1,106.00	4,092,200	
ネクソン	120,900	1,152.00	139,276,800	
エイチーム	1,600	5,900.00	9,440,000	
e n i s h	3,600	1,663.00	5,986,800	
コロブラ	22,400	2,822.00	63,212,800	
モバイルクリエイト	6,600	835.00	5,511,000	
ブロードリーフ	11,000	1,770.00	19,470,000	
ハーツユナイテッドグループ	4,100	1,814.00	7,437,400	
ティーガイア	13,300	1,193.00	15,866,900	
豆蔵ホールディングス	11,200	689.00	7,716,800	
GMOペイメントゲートウェイ	11,500	2,245.00	25,817,500	
ザッパラス	11,100	569.00	6,315,900	
インターネットイニシアティブ	20,800	2,339.00	48,651,200	
ビットアイル	18,000	464.00	8,352,000	
S R Aホールディングス	8,100	1,419.00	11,493,900	
朝日ネット	18,100	504.00	9,122,400	
コムチュア	2,500	1,829.00	4,572,500	
パナソニック インフォメーションシステムズ	3,400	3,105.00	10,557,000	
フェイス	5,100	1,129.00	5,757,900	
野村総合研究所	72,000	3,755.00	270,360,000	
サイバネットシステム	12,600	478.00	6,022,800	
インテージホールディングス	8,200	1,710.00	14,022,000	
ソースネクスト	7,300	790.00	5,767,000	
クレスコ	3,900	1,664.00	6,489,600	
フジ・メディア・ホールディングス	132,600	1,509.00	200,093,400	
オーピック	44,000	3,875.00	170,500,000	
ジャストシステム	18,400	772.00	14,204,800	
TDCソフトウェアエンジニアリング	5,200	977.00	5,080,400	
ヤフー	912,700	432.00	394,286,400	
トレンドマイクロ	67,500	3,630.00	245,025,000	
日本オラクル	20,500	4,690.00	96,145,000	
アルファシステムズ	5,100	1,593.00	8,124,300	
フューチャーアーキテクト	15,600	665.00	10,374,000	

C A C H o l d i n g s	9,800	1,179.00	11,554,200
ソフトバンク・テクノロジー	4,400	1,252.00	5,508,800
オービックビジネスコンサルタント	8,300	3,285.00	27,265,500
伊藤忠テクノソリューションズ	14,600	4,365.00	63,729,000
アイティフォー	18,700	448.00	8,377,600
大塚商会	34,300	3,930.00	134,799,000
サイボウズ	20,100	386.00	7,758,600
ソフトブレーン	20,200	190.00	3,838,000
電通国際情報サービス	8,800	1,195.00	10,516,000
ウェザーニューズ	4,500	2,911.00	13,099,500
C I J	15,500	497.00	7,703,500
日本エンタープライズ	8,900	389.00	3,462,100
WOWOW	3,200	5,040.00	16,128,000
ネットワンシステムズ	53,200	693.00	36,867,600
アルゴグラフィックス	6,100	1,823.00	11,120,300
マーベラス	21,600	1,759.00	37,994,400
エイベックス・グループ・ホールディングス	25,800	1,922.00	49,587,600
日本ユニシス	35,800	1,037.00	37,124,600
兼松エレクトロニクス	8,900	1,698.00	15,112,200
東京放送ホールディングス	76,200	1,429.00	108,889,800
日本テレビホールディングス	116,200	1,797.00	208,811,400
朝日放送	12,100	932.00	11,277,200
テレビ朝日ホールディングス	34,900	1,916.00	66,868,400
スカパーJ S A Tホールディングス	97,400	714.00	69,543,600
テレビ東京ホールディングス	10,800	2,709.00	29,257,200
コネクシオ	9,900	1,115.00	11,038,500
日本電信電話	497,400	6,287.00	3,127,153,800
K D D I	430,400	7,946.00	3,419,958,400
光通信	11,500	7,130.00	81,995,000
N T T ドコモ	1,046,400	1,775.50	1,857,883,200
G M O インターネット	43,300	1,057.00	45,768,100
K A D O K A W A ・ D W A N G O	33,400	1,995.00	66,633,000
学研ホールディングス	47,000	249.00	11,703,000
ゼンリン	17,600	1,342.00	23,619,200
アイネット	8,400	889.00	7,467,600
松竹	85,000	1,129.00	95,965,000

東宝	90,400	2,728.00	246,611,200
東映	48,000	689.00	33,072,000
AOI Pro.	8,900	753.00	6,701,700
エヌ・ティ・ティ・データ	78,500	4,420.00	346,970,000
DTS	13,500	2,404.00	32,454,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	46,500	2,484.00	115,506,000
シーイーシー	9,400	1,098.00	10,321,200
カプコン	33,000	1,810.00	59,730,000
ジャステック	11,000	776.00	8,536,000
SCSK	30,500	2,973.00	90,676,500
アイネス	18,500	904.00	16,724,000
TKC	10,800	1,973.00	21,308,400
富士ソフト	17,900	2,520.00	45,108,000
NSD	27,600	1,690.00	46,644,000
コナミ	51,900	2,246.00	116,567,400
JBCCHoldings	13,200	755.00	9,966,000
ソフトバンク	672,400	7,371.00	4,956,260,400
高千穂交易	5,900	1,013.00	5,976,700
伊藤忠食品	3,400	3,700.00	12,580,000
エレマテック	6,500	2,768.00	17,992,000
JALUX	3,800	1,570.00	5,966,000
あらた	31,000	323.00	10,013,000
双日	849,100	161.00	136,705,100
アルフレッサホールディングス	150,200	1,412.00	212,082,400
横浜冷凍	31,400	803.00	25,214,200
神栄	26,000	197.00	5,122,000
アルコニクス	7,800	1,926.00	15,022,800
神戸物産	2,300	9,730.00	22,379,000
あいホールディングス	20,700	2,160.00	44,712,000
ディーブイエックス	5,000	1,074.00	5,370,000
ダイワボウホールディングス	118,000	210.00	24,780,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	24,200	909.00	21,997,800
UKCHoldings	8,600	1,706.00	14,671,600
TOKAIHoldings	64,300	531.00	34,143,300
三洋貿易	5,900	1,290.00	7,611,000
ウイン・パートナーズ	4,500	1,517.00	6,826,500

シップヘルスケアホールディングス	23,500	2,687.00	63,144,500	
協栄産業	21,000	225.00	4,725,000	
小野建	11,900	944.00	11,233,600	
佐島電機	12,400	777.00	9,634,800	
コンドーテック	10,700	815.00	8,720,500	
ナガイレーベン	18,900	1,929.00	36,458,100	
三菱食品	13,900	2,688.00	37,363,200	
松田産業	10,100	1,276.00	12,887,600	
メディバルホールディングス	127,200	1,368.00	174,009,600	
アドヴァン	8,100	1,167.00	9,452,700	
S P K	3,900	2,037.00	7,944,300	
アズワン	9,500	3,170.00	30,115,000	
尾家産業	6,900	844.00	5,823,600	
シモジマ	9,100	1,019.00	9,272,900	
ドウシシャ	16,700	1,628.00	27,187,600	
小津産業	3,200	1,694.00	5,420,800	
高速	9,600	899.00	8,630,400	
黒田電気	21,900	1,558.00	34,120,200	
丸文	12,800	800.00	10,240,000	
ハビネット	8,300	1,587.00	13,172,100	
橋本総業	2,300	1,818.00	4,181,400	
エクセル	6,200	1,484.00	9,200,800	
ガリバーインターナショナル	39,500	831.00	32,824,500	
日本エム・ディ・エム	12,100	555.00	6,715,500	
進和	9,400	1,257.00	11,815,800	
ダイトエレクトロン	8,300	593.00	4,921,900	
シークス	8,500	2,426.00	20,621,000	
田中商事	7,400	678.00	5,017,200	
オーハシテクニカ	8,700	1,574.00	13,693,800	
マクニカ	6,600	3,250.00	21,450,000	
白銅	4,900	1,045.00	5,120,500	
伊藤忠商事	1,063,500	1,252.00	1,331,502,000	
丸紅	1,110,600	691.90	768,424,140	
高島	29,000	246.00	7,134,000	
長瀬産業	77,500	1,415.00	109,662,500	
蝶理	8,800	1,771.00	15,584,800	



豊田通商	141,200	2,722.00	384,346,400	
三共生興	25,800	460.00	11,868,000	
兼松	257,000	169.00	43,433,000	
ツカモトコーポレーション	33,000	129.00	4,257,000	
三井物産	1,077,100	1,547.50	1,666,812,250	
日本紙パルプ商事	67,000	324.00	21,708,000	
日立ハイテクノロジーズ	44,200	3,515.00	155,363,000	
カメイ	17,200	722.00	12,418,400	
スターゼン	51,000	402.00	20,502,000	
山善	49,500	834.00	41,283,000	
椿本興業	23,000	306.00	7,038,000	
住友商事	749,900	1,209.00	906,629,100	
内田洋行	34,000	364.00	12,376,000	
三菱商事	973,500	2,145.50	2,088,644,250	
第一実業	32,000	597.00	19,104,000	
キャノンマーケティングジャパン	36,400	2,099.00	76,403,600	
西華産業	50,000	269.00	13,450,000	
佐藤商事	13,100	730.00	9,563,000	
菱洋エレクトロ	15,100	1,234.00	18,633,400	
東京産業	15,900	476.00	7,568,400	
ユアサ商事	11,300	2,346.00	26,509,800	
神鋼商事	35,000	263.00	9,205,000	
阪和興業	129,000	413.00	53,277,000	
カナデン	15,000	801.00	12,015,000	
菱電商事	22,000	817.00	17,974,000	
フルサト工業	7,600	1,661.00	12,623,600	
岩谷産業	142,000	781.00	110,902,000	
すてきナイスグループ	58,000	191.00	11,078,000	
昭光通商	54,000	183.00	9,882,000	
三愛石油	33,000	797.00	26,301,000	
稲畑産業	30,400	1,051.00	31,950,400	
G S I クレオス	44,000	135.00	5,940,000	
明和産業	12,500	455.00	5,687,500	
ワキタ	27,600	1,123.00	30,994,800	
東邦ホールディングス	44,200	1,710.00	75,582,000	
サンゲツ	24,400	2,905.00	70,882,000	

ミツウロコグループホールディングス	22,500	525.00	11,812,500	
シナネン	31,000	443.00	13,733,000	
伊藤忠エネクス	27,900	859.00	23,966,100	
サンリオ	35,900	3,020.00	108,418,000	
サンワテクノス	9,400	1,214.00	11,411,600	
リョーサン	21,800	2,593.00	56,527,400	
新光商事	15,400	1,185.00	18,249,000	
トーヨー	35,000	428.00	14,980,000	
三信電気	18,800	796.00	14,964,800	
東陽テクニカ	19,500	1,010.00	19,695,000	
モスフードサービス	16,800	2,176.00	36,556,800	
加賀電子	12,100	1,424.00	17,230,400	
ソーダニッカ	11,000	480.00	5,280,000	
立花エレテック	8,500	1,638.00	13,923,000	
P a l t a c	20,500	1,350.00	27,675,000	
ヤマタネ	69,000	176.00	12,144,000	
日鉄住金物産	83,000	410.00	34,030,000	
トラスコ中山	16,000	3,195.00	51,120,000	
オートバックスセブン	47,100	1,666.00	78,468,600	
加藤産業	18,400	2,195.00	40,388,000	
イノテック	14,600	483.00	7,051,800	
イエローハット	12,300	2,449.00	30,122,700	
富士エレクトロニクス	7,700	1,350.00	10,395,000	
J Kホールディングス	14,600	567.00	8,278,200	
日伝	5,700	2,404.00	13,702,800	
北沢産業	17,200	176.00	3,027,200	
杉本商事	8,200	1,162.00	9,528,400	
因幡電機産業	19,000	3,865.00	73,435,000	
ミスミグループ本社	47,500	3,860.00	183,350,000	
江守グループホールディングス	6,000	1,081.00	6,486,000	
タキヒヨー	27,000	405.00	10,935,000	
スズケン	52,600	3,285.00	172,791,000	
ジェコス	9,200	1,825.00	16,790,000	
ルネサスイーストン	6,900	715.00	4,933,500	
ローソン	48,100	7,310.00	351,611,000	
サンエー	9,700	4,145.00	40,206,500	

カワチ薬品	9,800	1,752.00	17,169,600
エービーシー・マート	18,100	5,860.00	106,066,000
ハードオフコーポレーション	8,800	890.00	7,832,000
アスクル	13,600	2,074.00	28,206,400
ゲオホールディングス	24,200	966.00	23,377,200
アダストリアホールディングス	11,000	2,935.00	32,285,000
くらコーポレーション	7,800	3,020.00	23,556,000
キャンドウ	7,500	1,579.00	11,842,500
パル	7,600	3,260.00	24,776,000
エディオン	58,600	895.00	52,447,000
サーラコーポレーション	13,600	598.00	8,132,800
あみやき亭	2,500	3,895.00	9,737,500
ひらまつ	19,500	613.00	11,953,500
ゲンキー	1,400	7,350.00	10,290,000
大黒天物産	3,400	3,490.00	11,866,000
ハニーズ	10,800	934.00	10,087,200
アルペン	11,100	1,713.00	19,014,300
クオール	14,000	792.00	11,088,000
ジェイアイエヌ	8,800	2,929.00	25,775,200
ビックカメラ	55,600	1,256.00	69,833,600
DCMホールディングス	62,100	740.00	45,954,000
Monotaro	25,000	2,636.00	65,900,000
アークランドサービス	1,700	3,560.00	6,052,000
J.フロント リテイリング	160,500	1,470.00	235,935,000
ドトール・日レスホールディングス	22,300	1,689.00	37,664,700
マツモトキヨシホールディングス	28,400	3,350.00	95,140,000
ブロンコビリー	2,700	3,110.00	8,397,000
スタートトゥデイ	39,900	2,499.00	99,710,100
物語コーポレーション	3,600	3,610.00	12,996,000
ココカラファイン	13,300	2,932.00	38,995,600
三越伊勢丹ホールディングス	252,300	1,559.00	393,335,700
ウエルシアホールディングス	11,500	3,585.00	41,227,500
クリエイトSDホールディングス	5,300	3,890.00	20,617,000
チムニー	2,900	2,350.00	6,815,000
ジョイフル本田	7,100	4,215.00	29,926,500
キリン堂ホールディングス	7,200	715.00	5,148,000

すかいらーく	46,900	1,240.00	58,156,000
あさひ	9,300	1,103.00	10,257,900
日本調剤	1,900	4,130.00	7,847,000
コスモス薬品	7,200	16,370.00	117,864,000
セブン&アイ・ホールディングス	531,300	4,394.00	2,334,532,200
クリエイト・レストランツ・ホールディング	9,300	1,590.00	14,787,000
ツルハホールディングス	25,200	6,770.00	170,604,000
サンマルクホールディングス	4,600	6,850.00	31,510,000
トリドール	14,200	1,704.00	24,196,800
クスリのアオキ	5,700	6,040.00	34,428,000
メディカルシステムネットワーク	15,000	345.00	5,175,000
総合メディカル	3,200	5,870.00	18,784,000
はるやま商事	6,400	694.00	4,441,600
カッパ・クリエイトホールディングス	20,900	1,080.00	22,572,000
ライトオン	10,900	707.00	7,706,300
良品計画	15,700	14,650.00	230,005,000
三城ホールディングス	19,000	464.00	8,816,000
コナカ	16,000	611.00	9,776,000
コジマ	20,900	289.00	6,040,100
ヒマラヤ	4,600	954.00	4,388,400
コーナン商事	19,600	1,328.00	26,028,800
ワタミ	15,800	1,120.00	17,696,000
ドンキホーテホールディングス	44,000	8,380.00	368,720,000
西松屋チェーン	25,500	927.00	23,638,500
ゼンショーホールディングス	66,200	966.00	63,949,200
幸楽苑	10,600	1,530.00	16,218,000
サイゼリヤ	19,100	1,598.00	30,521,800
ユナイテッドアローズ	16,800	3,205.00	53,844,000
ハイデイ日高	8,200	3,640.00	29,848,000
京都きもの友禅	10,300	1,007.00	10,372,100
コロワイド	43,300	1,598.00	69,193,400
壱番屋	5,200	5,020.00	26,104,000
スギホールディングス	22,800	4,900.00	111,720,000
ヨンドシーホールディングス	10,100	1,822.00	18,402,200
ファミリーマート	43,000	4,580.00	196,940,000
木曽路	16,100	1,930.00	31,073,000

サトレストランシステムズ	16,500	907.00	14,965,500
千趣会	22,800	857.00	19,539,600
タカキュー	14,000	214.00	2,996,000
ケーヨー	28,500	537.00	15,304,500
上新電機	28,000	959.00	26,852,000
日本瓦斯	20,700	2,444.00	50,590,800
ベスト電器	46,000	135.00	6,210,000
マルエツ	32,000	537.00	17,184,000
ロイヤルホールディングス	21,500	1,723.00	37,044,500
東天紅	18,000	181.00	3,258,000
いなげや	14,200	1,177.00	16,713,400
島忠	30,700	2,872.00	88,170,400
チヨダ	15,200	2,252.00	34,230,400
ライフコーポレーション	8,400	1,693.00	14,221,200
カスミ	26,000	1,035.00	26,910,000
リンガーハット	12,700	1,853.00	23,533,100
テンアライド	21,600	355.00	7,668,000
A O K Iホールディングス	29,600	1,202.00	35,579,200
オークワ	20,000	933.00	18,660,000
コメリ	21,900	2,517.00	55,122,300
青山商事	31,900	2,610.00	83,259,000
しまむら	14,700	10,130.00	148,911,000
C F S コーポレーション	10,300	645.00	6,643,500
高島屋	184,000	1,001.00	184,184,000
松屋	26,100	1,620.00	42,282,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	60,100	1,973.00	118,577,300
近鉄百貨店	53,000	317.00	16,801,000
ニッセンホールディングス	31,000	337.00	10,447,000
パルコ	12,500	978.00	12,225,000
丸井グループ	152,600	1,083.00	165,265,800
アクシアル リテイリング	10,100	2,581.00	26,068,100
井筒屋	85,000	63.00	5,355,000
ダイエー	160,500	136.00	21,828,000
イオン	505,000	1,181.50	596,657,500
ユニーグループ・ホールディングス	121,300	601.00	72,901,300
イズミ	28,400	4,180.00	118,712,000

東武ストア	22,000	277.00	6,094,000	
平和堂	25,700	2,166.00	55,666,200	
フジ	14,300	2,148.00	30,716,400	
ヤオコー	7,300	6,990.00	51,027,000	
ゼビオ	17,300	1,971.00	34,098,300	
ケーズホールディングス	29,400	2,965.00	87,171,000	
O l y m p i cグループ	8,900	854.00	7,600,600	
日産東京販売ホールディングス	23,400	274.00	6,411,600	
アインファーマシーズ	14,200	3,380.00	47,996,000	
元気寿司	5,000	2,391.00	11,955,000	
ヤマダ電機	502,700	377.00	189,517,900	
アークランドサカモト	9,300	2,286.00	21,259,800	
ニトリホールディングス	55,000	6,840.00	376,200,000	
グルメ杵屋	13,000	879.00	11,427,000	
愛眼	18,400	251.00	4,618,400	
吉野家ホールディングス	37,000	1,345.00	49,765,000	
松屋フーズ	7,000	2,365.00	16,555,000	
サガミチェーン	18,000	1,047.00	18,846,000	
王将フードサービス	9,600	4,355.00	41,808,000	
プレナス	14,400	2,057.00	29,620,800	
ミニストップ	10,000	1,582.00	15,820,000	
アークス	22,200	2,493.00	55,344,600	
パロー	27,500	2,125.00	58,437,500	
ベルク	5,700	3,695.00	21,061,500	
大庄	8,700	1,360.00	11,832,000	
ファーストリテイリング	25,400	44,730.00	1,136,142,000	
サンドラッグ	26,900	4,800.00	129,120,000	
サックスパー ホールディングス	9,800	1,509.00	14,788,200	
ヤマザワ	3,500	1,660.00	5,810,000	
ベルーナ	32,500	501.00	16,282,500	
島根銀行	4,200	1,383.00	5,808,600	
じもとホールディングス	91,700	228.00	20,907,600	
足利ホールディングス	80,400	487.00	39,154,800	
東京ＴＹフィナンシャルグループ	16,600	3,325.00	55,195,000	
新生銀行	1,210,000	210.00	254,100,000	
あおぞら銀行	858,000	376.00	322,608,000	

三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,199,500	676.40	6,898,941,800	
りそなホールディングス	1,487,000	615.60	915,397,200	
三井住友トラスト・ホールディングス	2,809,000	463.90	1,303,095,100	
三井住友フィナンシャルグループ	961,200	4,324.50	4,156,709,400	
第四銀行	160,000	405.00	64,800,000	
北越銀行	139,000	220.00	30,580,000	
西日本シティ銀行	446,000	349.00	155,654,000	
千葉銀行	489,000	793.00	387,777,000	
横浜銀行	877,000	662.90	581,363,300	
常陽銀行	458,000	596.00	272,968,000	
群馬銀行	300,000	783.00	234,900,000	
武蔵野銀行	20,100	4,045.00	81,304,500	
千葉興業銀行	26,400	854.00	22,545,600	
筑波銀行	53,200	376.00	20,003,200	
七十七銀行	214,000	650.00	139,100,000	
青森銀行	102,000	350.00	35,700,000	
秋田銀行	85,000	332.00	28,220,000	
山形銀行	77,000	515.00	39,655,000	
岩手銀行	9,000	5,110.00	45,990,000	
東邦銀行	115,000	411.00	47,265,000	
東北銀行	79,000	155.00	12,245,000	
みちのく銀行	66,000	223.00	14,718,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	514,000	636.00	326,904,000	
静岡銀行	371,000	1,116.00	414,036,000	
十六銀行	158,000	436.00	68,888,000	
スルガ銀行	134,300	2,259.00	303,383,700	
八十二銀行	227,000	779.00	176,833,000	
山梨中央銀行	81,000	497.00	40,257,000	
大垣共立銀行	158,000	370.00	58,460,000	
福井銀行	111,000	268.00	29,748,000	
北國銀行	142,000	385.00	54,670,000	
清水銀行	4,600	2,983.00	13,721,800	
滋賀銀行	127,000	648.00	82,296,000	
南都銀行	124,000	421.00	52,204,000	
百五銀行	120,000	499.00	59,880,000	
京都銀行	242,000	1,020.00	246,840,000	

紀陽銀行	50,200	1,528.00	76,705,600	
三重銀行	60,000	272.00	16,320,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	862,000	245.00	211,190,000	
広島銀行	374,000	581.00	217,294,000	
山陰合同銀行	77,000	896.00	68,992,000	
中国銀行	90,500	1,691.00	153,035,500	
鳥取銀行	38,000	238.00	9,044,000	
伊予銀行	135,000	1,317.00	177,795,000	
百十四銀行	139,000	402.00	55,878,000	
四国銀行	101,000	254.00	25,654,000	
阿波銀行	104,000	642.00	66,768,000	
鹿児島銀行	88,000	756.00	66,528,000	
大分銀行	79,000	435.00	34,365,000	
宮崎銀行	86,000	376.00	32,336,000	
肥後銀行	103,000	643.00	66,229,000	
佐賀銀行	81,000	276.00	22,356,000	
十八銀行	80,000	344.00	27,520,000	
沖縄銀行	10,200	4,950.00	50,490,000	
琉球銀行	26,800	1,698.00	45,506,400	
セブン銀行	430,000	496.00	213,280,000	
みずほフィナンシャルグループ	17,566,800	202.10	3,550,250,280	
高知銀行	54,000	158.00	8,532,000	
山口フィナンシャルグループ	127,000	1,234.00	156,718,000	
長野銀行	49,000	207.00	10,143,000	
名古屋銀行	115,000	448.00	51,520,000	
北洋銀行	190,700	472.00	90,010,400	
愛知銀行	4,700	5,950.00	27,965,000	
第三銀行	75,000	200.00	15,000,000	
中京銀行	56,000	217.00	12,152,000	
東日本銀行	57,000	339.00	19,323,000	
大光銀行	48,000	220.00	10,560,000	
愛媛銀行	77,000	246.00	18,942,000	
トマト銀行	49,000	179.00	8,771,000	
みなと銀行	118,000	214.00	25,252,000	
京葉銀行	104,000	691.00	71,864,000	
関西アーバン銀行	18,000	1,268.00	22,824,000	



栃木銀行	64,000	548.00	35,072,000	
北日本銀行	4,400	2,892.00	12,724,800	
東和銀行	178,000	103.00	18,334,000	
福島銀行	157,000	95.00	14,915,000	
大東銀行	81,000	142.00	11,502,000	
トモニホールディングス	97,900	517.00	50,614,300	
フィデアホールディングス	74,900	225.00	16,852,500	
池田泉州ホールディングス	105,500	553.00	58,341,500	
F P G	11,200	1,492.00	16,710,400	
S B I ホールディングス	153,100	1,364.00	208,828,400	
ジャフコ	17,600	4,190.00	73,744,000	
大和証券グループ本社	1,188,000	972.80	1,155,686,400	
野村ホールディングス	2,597,300	707.10	1,836,550,830	
岡三証券グループ	109,000	943.00	102,787,000	
丸三証券	42,100	829.00	34,900,900	
東洋証券	54,000	357.00	19,278,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	146,400	872.00	127,660,800	
光世証券	36,000	251.00	9,036,000	
水戸証券	41,400	441.00	18,257,400	
いちよし証券	27,700	1,353.00	37,478,100	
松井証券	65,900	1,079.00	71,106,100	
マネックスグループ	151,500	293.00	44,389,500	
カブドットコム証券	58,500	614.00	35,919,000	
極東証券	17,800	1,932.00	34,389,600	
岩井コスモホールディングス	13,700	1,355.00	18,563,500	
マネースクウェアHD	4,300	1,489.00	6,402,700	
マネーパートナーズグループ	15,100	463.00	6,991,300	
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	282,200	3,024.00	853,372,800	
アニコムホールディングス	6,000	1,437.00	8,622,000	
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	404,900	2,857.50	1,157,001,750	
ソニーフィナンシャルホールディングス	122,200	1,797.00	219,593,400	
第一生命保険	814,500	1,861.00	1,515,784,500	
東京海上ホールディングス	523,100	3,915.50	2,048,198,050	
T & D ホールディングス	463,700	1,476.00	684,421,200	
全国保証	33,300	3,415.00	113,719,500	

クレディセゾン	103,800	2,216.00	230,020,800	
芙蓉総合リース	13,400	4,035.00	54,069,000	
興銀リース	24,000	2,369.00	56,856,000	
東京センチュリーリース	29,700	2,975.00	88,357,500	
日本証券金融	61,600	616.00	37,945,600	
アイフル	213,200	425.00	90,610,000	
ポケットカード	10,400	587.00	6,104,800	
リコーリース	10,200	3,030.00	30,906,000	
イオンフィナンシャルサービス	83,400	2,381.00	198,575,400	
アコム	256,800	340.00	87,312,000	
ジャックス	70,000	602.00	42,140,000	
オリエントコーポレーション	294,900	199.00	58,685,100	
日立キャピタル	25,200	2,638.00	66,477,600	
アプラスフィナンシャル	63,600	135.00	8,586,000	
オリックス	899,700	1,537.00	1,382,838,900	
三菱UFJリース	321,800	551.00	177,311,800	
日本取引所グループ	186,800	2,865.00	535,182,000	
イー・ギャランティ	4,300	1,768.00	7,602,400	
NECキャピタルソリューション	5,300	1,948.00	10,324,400	
日本駐車場開発	153,500	117.00	17,959,500	
ヒューリック	215,200	1,178.00	253,505,600	
野村不動産ホールディングス	76,800	2,011.00	154,444,800	
プレサンスコーポレーション	4,600	3,745.00	17,227,000	
常和ホールディングス	5,600	3,600.00	20,160,000	
日本管理センター	3,300	2,544.00	8,395,200	
フージャースホールディングス	23,600	490.00	11,564,000	
オープンハウス	8,400	2,212.00	18,580,800	
東急不動産ホールディングス	334,200	809.00	270,367,800	
飯田グループホールディングス	82,600	1,425.00	117,705,000	
パーク24	64,700	1,781.00	115,230,700	
三井不動産	674,000	3,255.00	2,193,870,000	
三菱地所	945,000	2,566.50	2,425,342,500	
平和不動産	24,800	1,799.00	44,615,200	
東京建物	277,000	889.00	246,253,000	
ダイビル	33,800	1,149.00	38,836,200	
京阪神ビルディング	25,100	615.00	15,436,500	

住友不動産	305,000	4,155.00	1,267,275,000
大京	206,000	185.00	38,110,000
テオーシー	45,800	680.00	31,144,000
東京楽天地	27,000	505.00	13,635,000
レオパレス21	140,000	735.00	102,900,000
スターツコーポレーション	15,000	1,596.00	23,940,000
フジ住宅	19,300	675.00	13,027,500
空港施設	17,800	710.00	12,638,000
住友不動産販売	9,500	2,728.00	25,916,000
ゴールドクレスト	12,000	2,115.00	25,380,000
日神不動産	19,500	467.00	9,106,500
タカラレーベン	58,900	529.00	31,158,100
サンヨーハウジング名古屋	8,900	1,258.00	11,196,200
イオンモール	82,600	2,015.00	166,439,000
トーセイ	18,800	668.00	12,558,400
エヌ・ティ・ティ都市開発	80,000	1,215.00	97,200,000
サンフロンティア不動産	14,200	1,101.00	15,634,200
エフ・ジェー・ネクスト	11,300	546.00	6,169,800
日本空港ビルデング	44,200	4,940.00	218,348,000
日本工営	47,000	482.00	22,654,000
ネクスト	16,600	881.00	14,624,600
日本M&Aセンター	21,000	3,525.00	74,025,000
アコーディア・ゴルフ	51,600	1,049.00	54,128,400
タケエイ	14,000	926.00	12,964,000
トラスト・テック	2,800	1,816.00	5,084,800
パソナグループ	11,300	530.00	5,989,000
GCAサヴィアン	11,300	1,187.00	13,413,100
エス・エム・エス	7,900	2,743.00	21,669,700
テンプホールディングス	26,600	3,690.00	98,154,000
クックパッド	7,400	4,115.00	30,451,000
エスクリ	6,200	920.00	5,704,000
学情	5,700	1,055.00	6,013,500
スタジオアリス	7,000	1,663.00	11,641,000
シミックホールディングス	5,800	1,693.00	9,819,400
総合警備保障	45,100	2,776.00	125,197,600
カカクコム	90,000	1,825.00	164,250,000

ルネサンス	8,300	1,202.00	9,976,600	
ディップ	3,100	4,760.00	14,756,000	
オプト	7,200	761.00	5,479,200	
新日本科学	13,600	764.00	10,390,400	
ツクイ	17,100	958.00	16,381,800	
キャリアデザインセンター	4,800	921.00	4,420,800	
エムスリー	116,700	2,098.00	244,836,600	
ツカダ・グローバルホールディング	11,300	794.00	8,972,200	
アウトソーシング	5,500	1,727.00	9,498,500	
ディー・エヌ・エー	66,800	1,503.00	100,400,400	
博報堂D Yホールディングス	186,200	1,171.00	218,040,200	
ぐるなび	17,000	1,685.00	28,645,000	
一休	11,500	1,356.00	15,594,000	
ジャパンベストレスキューシステム	15,100	274.00	4,137,400	
ファンコミュニケーションズ	23,600	1,402.00	33,087,200	
P G Mホールディングス	19,500	1,092.00	21,294,000	
W D Bホールディングス	2,700	1,689.00	4,560,300	
バリューコマース	11,900	627.00	7,461,300	
J Pホールディングス	37,000	361.00	13,357,000	
イーピーエス	16,600	1,285.00	21,331,000	
プレステージ・インターナショナル	11,100	998.00	11,077,800	
アミューズ	4,400	3,280.00	14,432,000	
ドリームインキュベータ	4,600	2,790.00	12,834,000	
クイック	5,500	825.00	4,537,500	
ケネディクス	192,100	559.00	107,383,900	
電通	149,800	5,060.00	757,988,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,100	966.00	5,892,600	
ぴあ	5,100	2,004.00	10,220,400	
イオンファンタジー	4,800	1,513.00	7,262,400	
ネクシィーズ	6,400	577.00	3,692,800	
みらかホールディングス	35,500	5,140.00	182,470,000	
アルプス技研	6,800	1,583.00	10,764,400	
サニックス	16,600	425.00	7,055,000	
オリエンタルランド	36,300	26,960.00	978,648,000	
ダスキン	38,300	1,751.00	67,063,300	
明光ネットワークジャパン	14,400	1,199.00	17,265,600	

ファルコホールディングス	8,100	1,239.00	10,035,900	
ラウンドワン	39,100	696.00	27,213,600	
リゾートトラスト	49,900	2,652.00	132,334,800	
ビー・エム・エル	8,100	3,175.00	25,717,500	
もしもしホットライン	25,300	1,129.00	28,563,700	
ユー・エス・エス	162,900	1,853.00	301,853,700	
サイバーエージェント	24,800	4,615.00	114,452,000	
楽天	584,600	1,668.00	975,112,800	
セントラルスポーツ	6,200	1,800.00	11,160,000	
フルキャストホールディングス	15,200	492.00	7,478,400	
リゾートソリューション	24,000	236.00	5,664,000	
リブセンス	8,800	758.00	6,670,400	
ジャパンマテリアル	5,800	1,856.00	10,764,800	
リクルートホールディングス	152,500	3,475.00	529,937,500	
リロ・ホールディング	4,700	8,200.00	38,540,000	
東祥	3,400	2,484.00	8,445,600	
エイチ・アイ・エス	22,100	3,520.00	77,792,000	
共立メンテナンス	6,800	5,830.00	39,644,000	
イチネンホールディングス	15,700	1,023.00	16,061,100	
建設技術研究所	8,500	1,603.00	13,625,500	
燦ホールディングス	4,000	1,692.00	6,768,000	
東京テアトル	62,000	142.00	8,804,000	
よみうりランド	29,000	489.00	14,181,000	
東京都競馬	94,000	301.00	28,294,000	
常磐興産	58,000	150.00	8,700,000	
カナモト	18,800	3,135.00	58,938,000	
東京ドーム	93,000	482.00	44,826,000	
西尾レントオール	10,900	3,755.00	40,929,500	
トランス・コスモス	17,900	2,021.00	36,175,900	
乃村工藝社	27,200	948.00	25,785,600	
藤田観光	52,000	357.00	18,564,000	
KNT-CTホールディングス	68,000	164.00	11,152,000	
日本管財	6,900	2,741.00	18,912,900	
トーカイ	6,000	3,605.00	21,630,000	
白洋舎	28,000	248.00	6,944,000	
セコム	130,300	6,987.00	910,406,100	

セントラル警備保障	8,200	1,160.00	9,512,000	
丹青社	16,200	834.00	13,510,800	
メイテック	18,500	3,440.00	63,640,000	
アサツー ディ・ケイ	25,400	3,150.00	80,010,000	
応用地質	14,400	1,825.00	26,280,000	
船井総研ホールディングス	17,300	1,003.00	17,351,900	
進学会	9,400	460.00	4,324,000	
ベネッセホールディングス	49,300	3,605.00	177,726,500	
イオンディライト	13,200	2,771.00	36,577,200	
ナック	9,900	1,088.00	10,771,200	
ニチイ学館	27,100	931.00	25,230,100	
ダイセキ	22,200	2,070.00	45,954,000	
合 計	212,836,200		265,203,072,840	

## (b) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

## 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＞

## 貸借対照表

（単位：円）

	（平成25年12月19日現在）	（平成26年12月19日現在）
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン	1,241	2,001,306
親投資信託受益証券	55,971,992,217	43,917,747,668
未収入金	1,999,999	-
流動資産合計	55,973,993,457	43,919,748,974
資産合計	55,973,993,457	43,919,748,974
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
未払解約金	1,999,999	2,000,000
未払受託者報酬	7,381,227	5,709,715
未払委託者報酬	7,381,169	5,709,649

その他未払費用	472,500	486,000
流動負債合計	17,234,895	13,905,364
負債合計	17,234,895	13,905,364
純資産の部		
元本等		
元本	47,105,275,939	35,688,617,338
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	8,851,482,623	8,217,226,272
元本等合計	55,956,758,562	43,905,843,610
純資産合計	55,956,758,562	43,905,843,610
負債純資産合計	55,973,993,457	43,919,748,974

## 注記表

## （重要な会計方針の注記）

項目	自 平成26年 6月21日 至 平成26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）	（平成26年12月19日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	47,105,275,939口	35,688,617,338口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.1879円 (10,000口当たりの純資産額 11,879円)	1口当たり純資産額 1.2302円 (10,000口当たりの純資産額 12,302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26年 6月21日 至 平成26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せん。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3.金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。



・金融商品の時価等に関する事項

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

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項目	(平成25年12月19日現在)	(平成26年12月19日現在)
期首元本額	47,706,164,734円	34,809,938,556円
期中追加設定元本額	469,390,247円	1,475,510,646円
期中一部解約元本額	1,070,279,042円	596,831,864円

附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	国内債券（NOMURA - B P I）マザーファンド	33,130,467,463	43,917,747,668	
合計		33,130,467,463	43,917,747,668	

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）

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

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

国内債券（NOMURA - B P I）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	（平成25年12月19日現在）	（平成26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	1,272,590,405
国債証券	125,991,048,410	109,591,646,730
地方債証券	10,135,528,095	8,758,554,475
特殊債券	15,269,112,744	13,169,266,811
社債券	11,745,784,000	9,133,657,000
未収入金	242,746,300	402,659,800
未収利息	805,261,950	621,405,630
前払費用	32,646,364	37,593,110
流動資産合計	165,299,466,413	142,987,373,961
資産合計	165,299,466,413	142,987,373,961
負債の部		
流動負債		
未払解約金	606,882,222	862,204,243
流動負債合計	606,882,222	862,204,243
負債合計	606,882,222	862,204,243
純資産の部		
元本等		
元本	128,732,516,853	107,215,389,922

剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	35,960,067,338	34,909,779,796
元本等合計	164,692,584,191	142,125,169,718
純資産合計	164,692,584,191	142,125,169,718
負債純資産合計	165,299,466,413	142,987,373,961

## 注記表

## （重要な会計方針の注記）

項目	自 平成26年 6月21日 至 平成26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）	（平成26年12月19日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	128,732,516,853口	107,215,389,922口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.2793円 (10,000口当たりの純資産額 12,793円)	1口当たり純資産額 1.3256円 (10,000口当たりの純資産額 13,256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26年 6月21日 至 平成26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	(1) 金融商品の内容

リスク	<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26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	(1) 有価証券(国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券) 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

(平成25年12月19日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	135,230,028,200円
同期中における追加設定元本額	3,508,623,826円
同期中における一部解約元本額	10,006,135,173円
平成25年12月19日現在における元本の内訳	
三井住友・DC年金日本債券インデックス・ファンド	21,685,568,426円
S M A M ・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V A <適格機関投資家限定>	666,847,686円
S M A M ・年金国内債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>	43,752,045,820円
合計	128,732,516,853円

(平成26年12月19日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	109,171,383,866円
同期中における追加設定元本額	9,669,908,057円

同期中における一部解約元本額	11,625,902,001円
平成26年12月19日現在における元本の内訳	
三井住友・DC年金日本債券インデックス・ファンド	29,281,025,699円
SMA・国内債券インデックス・ファンド	44,105,818,912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>	698,077,848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>	33,130,467,463円
合計	107,215,389,922円

## 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第1回利付国債(40年)	40,000,000	51,040,800	
	第2回利付国債(40年)	212,000,000	259,352,320	
	第3回利付国債(40年)	195,000,000	238,853,550	
	第4回利付国債(40年)	285,000,000	349,472,700	
	第5回利付国債(40年)	277,000,000	323,619,100	
	第6回利付国債(40年)	280,000,000	318,836,000	
	第7回利付国債(40年)	230,000,000	247,473,100	
	第277回利付国債(10年)	204,000,000	208,147,320	
	第280回利付国債(10年)	1,093,000,000	1,124,642,350	
	第282回利付国債(10年)	251,000,000	258,602,790	
	第283回利付国債(10年)	1,230,000,000	1,269,396,900	
	第284回利付国債(10年)	490,000,000	506,968,700	
	第285回利付国債(10年)	2,754,000,000	2,861,213,220	
	第286回利付国債(10年)	3,145,000,000	3,287,845,900	
	第288回利付国債(10年)	2,333,000,000	2,442,977,620	
	第289回利付国債(10年)	2,083,000,000	2,177,693,180	
	第290回利付国債(10年)	1,332,000,000	1,393,005,600	

第292回利付国債(10年)	1,280,000,000	1,351,052,800	
第293回利付国債(10年)	2,236,000,000	2,377,181,040	
第296回利付国債(10年)	2,226,000,000	2,351,746,740	
第297回利付国債(10年)	2,594,000,000	2,738,848,960	
第299回利付国債(10年)	1,425,000,000	1,503,132,750	
第300回利付国債(10年)	1,390,000,000	1,477,987,000	
第301回利付国債(10年)	1,523,000,000	1,624,051,050	
第303回利付国債(10年)	2,090,000,000	2,226,560,600	
第305回利付国債(10年)	1,700,000,000	1,807,542,000	
第306回利付国債(10年)	1,550,000,000	1,660,561,500	
第308回利付国債(10年)	770,000,000	823,122,300	
第309回利付国債(10年)	650,000,000	687,726,000	
第310回利付国債(10年)	1,540,000,000	1,624,191,800	
第312回利付国債(10年)	1,360,000,000	1,452,942,400	
第313回利付国債(10年)	1,380,000,000	1,485,832,200	
第315回利付国債(10年)	1,630,000,000	1,748,386,900	
第317回利付国債(10年)	1,380,000,000	1,472,874,000	
第319回利付国債(10年)	610,000,000	651,882,600	
第320回利付国債(10年)	890,000,000	944,930,800	
第321回利付国債(10年)	1,020,000,000	1,083,219,600	
第322回利付国債(10年)	680,000,000	717,270,800	
第323回利付国債(10年)	430,000,000	453,710,200	
第324回利付国債(10年)	930,000,000	974,398,200	
第325回利付国債(10年)	790,000,000	827,698,800	
第326回利付国債(10年)	1,410,000,000	1,466,005,200	
第327回利付国債(10年)	330,000,000	345,704,700	
第328回利付国債(10年)	1,600,000,000	1,649,840,000	
第329回利付国債(10年)	1,460,000,000	1,529,277,000	
第330回利付国債(10年)	1,360,000,000	1,424,572,800	
第332回利付国債(10年)	1,390,000,000	1,430,879,900	
第333回利付国債(10年)	1,780,000,000	1,830,445,200	
第334回利付国債(10年)	1,290,000,000	1,325,088,000	
第335回利付国債(10年)	1,490,000,000	1,514,614,800	
第2回利付国債(30年)	150,000,000	185,838,000	
第4回利付国債(30年)	160,000,000	210,683,200	
第5回利付国債(30年)	110,000,000	133,101,100	

第7回利付国債(30年)	180,000,000	220,235,400	
第10回利付国債(30年)	230,000,000	234,632,200	
第11回利付国債(30年)	150,000,000	167,559,000	
第12回利付国債(30年)	260,000,000	307,808,800	
第14回利付国債(30年)	250,000,000	308,202,500	
第15回利付国債(30年)	250,000,000	312,432,500	
第16回利付国債(30年)	220,000,000	274,628,200	
第18回利付国債(30年)	210,000,000	254,446,500	
第19回利付国債(30年)	170,000,000	206,176,000	
第21回利付国債(30年)	182,000,000	220,745,980	
第22回利付国債(30年)	149,000,000	186,352,810	
第23回利付国債(30年)	181,000,000	226,219,230	
第24回利付国債(30年)	170,000,000	212,500,000	
第25回利付国債(30年)	215,000,000	260,681,050	
第26回利付国債(30年)	239,000,000	294,770,650	
第27回利付国債(30年)	326,000,000	409,015,900	
第28回利付国債(30年)	331,000,000	415,984,250	
第29回利付国債(30年)	320,000,000	396,812,800	
第30回利付国債(30年)	360,000,000	439,714,800	
第31回利付国債(30年)	430,000,000	516,958,900	
第32回利付国債(30年)	440,000,000	538,969,200	
第33回利付国債(30年)	600,000,000	696,444,000	
第34回利付国債(30年)	585,000,000	705,246,750	
第35回利付国債(30年)	410,000,000	476,399,500	
第36回利付国債(30年)	475,000,000	552,434,500	
第37回利付国債(30年)	460,000,000	524,285,000	
第38回利付国債(30年)	295,000,000	329,202,300	
第39回利付国債(30年)	310,000,000	353,068,300	
第40回利付国債(30年)	300,000,000	334,533,000	
第41回利付国債(30年)	315,000,000	343,696,500	
第42回利付国債(30年)	330,000,000	359,868,300	
第43回利付国債(30年)	305,000,000	332,422,550	
第44回利付国債(30年)	390,000,000	424,366,800	
第32回利付国債(20年)	150,000,000	156,949,500	
第33回利付国債(20年)	230,000,000	245,375,500	
第35回利付国債(20年)	315,000,000	338,426,550	



第37回利付国債(20年)	230,000,000	249,669,600	
第39回利付国債(20年)	223,000,000	241,876,950	
第40回利付国債(20年)	492,000,000	534,513,720	
第42回利付国債(20年)	400,000,000	443,860,000	
第43回利付国債(20年)	710,000,000	806,822,700	
第46回利付国債(20年)	289,000,000	323,301,410	
第48回利付国債(20年)	368,000,000	421,985,600	
第50回利付国債(20年)	223,000,000	248,589,250	
第52回利付国債(20年)	210,000,000	238,366,800	
第54回利付国債(20年)	275,000,000	314,971,250	
第56回利付国債(20年)	320,000,000	363,833,600	
第58回利付国債(20年)	300,000,000	339,777,000	
第59回利付国債(20年)	280,000,000	313,395,600	
第61回利付国債(20年)	140,000,000	148,953,000	
第63回利付国債(20年)	156,000,000	176,535,840	
第64回利付国債(20年)	210,000,000	239,941,800	
第65回利付国債(20年)	370,000,000	423,668,500	
第69回利付国債(20年)	200,000,000	233,084,000	
第70回利付国債(20年)	380,000,000	454,453,400	
第72回利付国債(20年)	300,000,000	350,934,000	
第74回利付国債(20年)	388,000,000	454,848,520	
第75回利付国債(20年)	230,000,000	270,307,500	
第78回利付国債(20年)	340,000,000	393,312,000	
第82回利付国債(20年)	303,000,000	357,512,730	
第84回利付国債(20年)	434,000,000	508,431,000	
第85回利付国債(20年)	567,000,000	671,362,020	
第88回利付国債(20年)	479,000,000	578,952,930	
第90回利付国債(20年)	478,000,000	573,188,920	
第92回利付国債(20年)	220,000,000	261,738,400	
第93回利付国債(20年)	407,000,000	479,881,490	
第95回利付国債(20年)	496,000,000	603,418,720	
第97回利付国債(20年)	400,000,000	482,308,000	
第99回利付国債(20年)	594,000,000	709,485,480	
第100回利付国債(20年)	403,000,000	486,836,090	
第102回利付国債(20年)	500,000,000	617,695,000	
第105回利付国債(20年)	497,000,000	594,645,590	

第107回利付国債(20年)	323,000,000	386,524,410	
第109回利付国債(20年)	720,000,000	842,205,600	
第111回利付国債(20年)	583,000,000	705,919,720	
第113回利付国債(20年)	700,000,000	837,648,000	
第114回利付国債(20年)	553,000,000	661,614,730	
第116回利付国債(20年)	490,000,000	593,228,300	
第118回利付国債(20年)	370,000,000	437,206,800	
第119回利付国債(20年)	375,000,000	432,033,750	
第121回利付国債(20年)	380,000,000	443,076,200	
第122回利付国債(20年)	300,000,000	345,315,000	
第123回利付国債(20年)	180,000,000	215,152,200	
第124回利付国債(20年)	505,000,000	595,970,700	
第125回利付国債(20年)	170,000,000	205,676,200	
第126回利付国債(20年)	210,000,000	247,632,000	
第127回利付国債(20年)	230,000,000	267,699,300	
第128回利付国債(20年)	630,000,000	732,545,100	
第129回利付国債(20年)	10,000,000	11,473,300	
第130回利付国債(20年)	340,000,000	389,616,200	
第131回利付国債(20年)	350,000,000	395,626,000	
第132回利付国債(20年)	260,000,000	293,459,400	
第133回利付国債(20年)	425,000,000	486,378,500	
第134回利付国債(20年)	275,000,000	314,272,750	
第135回利付国債(20年)	150,000,000	169,167,000	
第136回利付国債(20年)	270,000,000	300,215,700	
第137回利付国債(20年)	335,000,000	376,915,200	
第138回利付国債(20年)	190,000,000	207,694,700	
第139回利付国債(20年)	180,000,000	199,639,800	
第140回利付国債(20年)	705,000,000	791,877,150	
第141回利付国債(20年)	300,000,000	336,375,000	
第142回利付国債(20年)	340,000,000	386,777,200	
第143回利付国債(20年)	385,000,000	424,554,900	
第144回利付国債(20年)	360,000,000	391,078,800	
第145回利付国債(20年)	660,000,000	737,259,600	
第146回利付国債(20年)	510,000,000	568,583,700	
第147回利付国債(20年)	690,000,000	756,067,500	
第148回利付国債(20年)	700,000,000	752,815,000	

	第149回利付国債(20年)	710,000,000	761,680,900	
	第150回利付国債(20年)	635,000,000	668,604,200	
国債証券合計		100,082,000,000	109,591,646,730	
地方債証券	第1回東京都公募公債(20年)	200,000,000	221,204,000	
	第7回東京都公募公債(20年)	100,000,000	117,895,000	
	第8回東京都公募公債(30年)	100,000,000	116,881,000	
	第13回東京都公募公債(30年)	200,000,000	221,554,000	
	第28回東京都公募公債(5年)	100,000,000	100,529,000	
	第629回東京都公募公債	100,000,000	101,396,000	
	第656回東京都公募公債	300,000,000	314,211,000	
	第660回東京都公募公債	200,000,000	210,736,000	
	第668回東京都公募公債	200,000,000	212,724,000	
	第681回東京都公募公債	200,000,000	213,902,000	
	平成19年度第9回北海道公募公債	200,000,000	209,408,000	
	第7回神奈川県公募公債(20年)	200,000,000	239,068,000	
	第47回神奈川県公募公債(5年)	100,000,000	100,516,000	
	第48回神奈川県公募公債(5年)	100,000,000	100,553,000	
	第142回神奈川県公募公債	100,000,000	103,321,000	
	第147回神奈川県公募公債	200,000,000	209,620,000	
	第192回神奈川県公募公債	100,000,000	104,500,000	
	第77回大阪府公募公債(5年)	100,000,000	100,623,000	
	第297回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,464,000	
	第311回大阪府公募公債(10年)	250,000,000	262,662,500	
	第361回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	105,142,000	
	第5回兵庫県公募公債(15年)	100,000,000	108,078,000	
	第9回兵庫県公募公債(20年)	100,000,000	120,125,000	
	平成17年度第4回兵庫県公募公債	200,000,000	201,288,000	
	平成19年度第18回兵庫県公募公債	100,000,000	104,845,000	
	第7回静岡県公募公債(30年)	100,000,000	111,771,000	
	平成19年度第7回静岡県公募公債	100,000,000	105,157,000	
	平成20年度第1回静岡県公募公債	100,000,000	117,980,000	
	平成21年度第7回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	213,826,000	
	平成16年度第2回広島県公募公債	100,000,000	100,382,000	
	平成17年度第4回埼玉県公募公債	200,000,000	201,850,000	
	平成19年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	104,739,000	
平成21年度第2回埼玉県公募公債	146,000,000	155,786,380		

	平成17年度第5回福岡県公募公債	100,000,000	101,605,000	
	平成17年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	100,542,000	
	平成18年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	103,235,000	
	平成18年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	103,499,000	
	第30回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,959,000	
	第31回共同発行市場公募地方債	100,500,000	101,730,120	
	第36回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,914,000	
	第38回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,780,000	
	第40回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,536,000	
	第47回共同発行市場公募地方債	300,000,000	311,424,000	
	第51回共同発行市場公募地方債	200,000,000	209,276,000	
	第66回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,627,000	
	第75回共同発行市場公募地方債	300,000,000	321,414,000	
	第115回共同発行市場公募地方債	300,000,000	313,425,000	
	平成17年度第10回大阪市公募公債	192,500,000	195,516,475	
	平成19年度第7回大阪市公募公債	100,000,000	104,784,000	
	平成21年度第4回大阪市公募公債	200,000,000	214,224,000	
	第464回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	105,829,000	
	平成21年度第1回京都市公募公債	100,000,000	106,910,000	
	第16回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	121,928,000	
	平成17年度第4回横浜市公募公債	300,000,000	304,434,000	
	平成18年度第4回福岡市公募公債	100,000,000	103,226,000	
地方債証券合計		8,289,000,000	8,758,554,475	
特殊債券	第2回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	500,000,000	527,215,000	
	第15回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	112,867,000	
	第22回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	116,182,000	
	第39回日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,505,000	
	第4回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	122,394,000	
	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	101,855,000	
	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	222,212,000	
	第10回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	309,039,000	
	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	195,308,600	
	第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	247,610,000	

第 2 7 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	207,700,000	
第 2 7 回道路債券	100,000,000	118,231,000	
第 3 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	311,277,000	
第 3 2 回道路債券	100,000,000	118,986,000	
第 3 6 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	313,947,000	
第 3 7 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	121,894,000	
第 3 8 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,140,000	
第 4 2 回道路債券	100,000,000	117,055,000	
第 5 2 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,961,000	
第 5 8 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	317,118,000	
第 7 9 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,958,000	
第 9 1 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,068,000	
第 9 2 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	118,931,000	
第 9 9 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,342,000	
第 3 回政府保証地方公共団体金融機構債券	700,000,000	747,159,000	
第 4 回公営企業債券（ 2 0 年 ）	200,000,000	230,050,000	
第 7 回地方公営企業等金融機構債券（ 5 年 ）	100,000,000	100,535,000	
第 1 8 回公営企業債券（ 2 0 年 ）	100,000,000	122,488,000	
第 1 9 回公営企業債券	100,000,000	102,404,000	
第 2 2 回公営企業債券（ 2 0 年 ）	200,000,000	240,556,000	
第 2 8 回公営企業債券	100,000,000	105,058,000	
第 8 5 1 回政府保証公営企業債券	400,000,000	402,160,000	
第 8 5 8 回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,484,000	
第 8 6 0 回政府保証公営企業債券	300,000,000	305,475,000	
第 8 6 1 回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,936,000	
第 8 6 3 回政府保証公営企業債券	400,000,000	411,220,000	
第 8 7 5 回政府保証公営企業債券	300,000,000	312,042,000	
第 8 7 6 回政府保証公営企業債券	101,000,000	105,695,490	
第 8 8 2 回政府保証公営企業債券	100,000,000	104,923,000	
第 1 2 回中小企業債券	100,000,000	101,926,000	

第33回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	100,035,000	
第34回株式会社日本政策金融公庫社債	100,000,000	100,599,000	
第29回国際協力銀行債券	100,000,000	104,587,000	
第13回関西国際空港株式会社社債	100,000,000	105,884,000	
第6回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	115,858,000	
第199回政府保証預金保険機構債	100,000,000	100,223,000	
第1回貸付債権担保住宅金融公庫債券	15,885,000	16,610,309	
第1回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	23,306,000	24,590,393	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	27,798,000	30,045,468	
第2回貸付債権担保住宅金融公庫債券	14,922,000	15,534,697	
第2回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	24,262,000	25,724,513	
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	23,977,000	25,634,290	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	24,662,000	26,295,364	
第7回貸付債権担保住宅金融公庫債券	17,089,000	17,865,011	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	26,626,000	28,876,429	
第9回貸付債権担保住宅金融公庫債券	18,061,000	18,788,316	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	26,406,000	28,679,292	
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券	19,404,000	20,176,085	
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	27,143,000	29,440,112	
第12回貸付債権担保住宅金融公庫債券	21,972,000	23,076,752	
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	40,894,000	43,094,097	
第18回貸付債権担保住宅金融公庫債券	24,222,000	25,733,695	
第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	56,991,000	61,472,772	
第30回貸付債権担保住宅金融公庫債券	33,681,000	35,785,052	
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	40,134,000	42,720,234	
第32回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	58,312,000	62,456,233	
第35回貸付債権担保住宅金融公庫債券	39,754,000	42,525,251	
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券	37,395,000	40,149,889	
第37回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	69,625,000	74,245,315	
第40回貸付債権担保住宅金融公庫債券	37,402,000	40,298,036	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	34,996,000	38,365,064	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,105,000	85,158,905	
第48回貸付債権担保住宅金融公庫債券	34,270,000	37,563,689	
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	79,049,000	84,886,768	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,282,000	87,827,806	

	第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,125,000	90,787,807	
	第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,095,000	90,979,169	
	第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,053,000	91,990,646	
	第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,261,000	94,276,263	
	第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,837,000	96,136,808	
	第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	91,599,000	95,709,047	
	第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,169,000	97,698,876	
	第88回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,123,000	101,048,959	
	第130回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	110,714,000	
	第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,726,000	39,866,807	
	第3回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	29,109,000	31,526,502	
	第5回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	100,318,000	
	い第723号商工債	100,000,000	100,248,000	
	い第733号商工債	200,000,000	201,216,000	
	い第720号農林債	200,000,000	200,422,000	
	い第728号農林債	100,000,000	100,415,000	
	い第735号農林債	100,000,000	100,461,000	
	い第749号農林債	100,000,000	100,342,000	
	い第752号農林債	200,000,000	200,678,000	
	第281回信金中金債（5年）	100,000,000	100,340,000	
	第149号商工債（3年）	100,000,000	100,060,000	
	第156号商工債（3年）	400,000,000	400,244,000	
	第171号商工債（3年）	300,000,000	300,369,000	
	第16回政府保証東日本高速道路債券	200,000,000	210,774,000	
	第46回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,650,000	
	第5回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	201,282,000	
特殊債券合計		12,442,722,000	13,169,266,811	
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	100,638,000	
	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	100,500,000	
	第2回ジェー・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニー	100,000,000	101,493,000	
	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	101,241,000	
	第16回シティグループ・インク円貨債券	100,000,000	100,973,000	

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	101,041,000	
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	100,211,000	
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	101,325,000	
第21回コーペラティブ・セントラル・ライフアイゼン・ボエレンリーバンク・ピー・エー	100,000,000	101,133,000	
第10回コーペラティブ・セントラル・ライフアイゼン・ボエレンリーバンク・ピー・エー	200,000,000	201,686,000	
第18回コーペラティブ・セントラル・ライフアイゼン・ボエレンリーバンク・ピー・エー	200,000,000	202,596,000	
第4回ウォルマート・ストアーズ・インク円貨社債(2010)	100,000,000	100,473,000	
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	100,248,000	
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	101,121,000	
第48回住友化学株式会社無担保社債	100,000,000	101,467,000	
第8回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	100,000,000	103,723,000	
第14回武田薬品工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,692,000	
第6回株式会社ブリヂストン無担保社債	100,000,000	100,194,000	
第63回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	107,833,000	
第55回株式会社東芝無担保社債	100,000,000	101,713,000	
第44回三菱電機株式会社無担保社債	100,000,000	100,610,000	
第35回富士通株式会社無担保社債	100,000,000	100,728,000	
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	102,135,000	
第1回明治安田生命2013基金特定目的会社特定社債	100,000,000	101,655,000	
第1回明治安田生命2014基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,417,000	
第1回トヨタ自動車株式会社無担保社債	100,000,000	109,130,000	
第49回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	107,350,000	
第95回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	101,179,000	
第69回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	106,235,000	
第3回株式会社みずほコーポレート銀行無担保	100,000,000	106,322,000	



社債			
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	106,007,000	
第57回株式会社東京三菱銀行無担保社債	100,000,000	114,472,000	
第6回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	100,010,000	
株式会社三井住友フィナンシャル第1回無担保社債	200,000,000	202,780,000	
第4回株式会社りそな銀行無担保社債	100,000,000	110,992,000	
第9回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	108,478,000	
第4回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	100,514,000	
第6回株式会社セブン銀行無担保社債	100,000,000	100,641,000	
第1回株式会社みずほフィナンシャルグループ無担保社債	200,000,000	204,094,000	
第20回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	108,940,000	
第8回株式会社みずほ銀行無担保社債	200,000,000	208,116,000	
第16回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	100,000,000	100,783,000	
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	100,156,000	
第27回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	103,872,000	
第55回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	100,095,000	
第46回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,987,000	
第113回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	104,649,000	
第23回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	101,163,000	
第10回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	104,839,000	
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	100,387,000	
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	100,485,000	
第65回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	113,569,000	
第88回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,884,000	
第101回東武鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	101,013,000	
第22回小田急電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	106,866,000	
第7回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	108,534,000	
第24回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	110,895,000	
第32回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	116,744,000	

第69回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	105,941,000	
第10回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	114,453,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	114,191,000	
第13回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	114,434,000	
第45回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,825,000	
第53回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	104,264,000	
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	102,973,000	
第19回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	105,136,000	
第457回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,661,000	
第528回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,022,000	
第536回東京電力株式会社社債	100,000,000	100,316,000	
第547回東京電力株式会社社債	100,000,000	101,344,000	
第442回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,509,000	
第444回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,250,000	
第448回関西電力株式会社社債	100,000,000	106,207,000	
第491回関西電力株式会社社債	100,000,000	100,453,000	
第376回中国電力株式会社社債	100,000,000	101,513,000	
第303回北陸電力株式会社社債	100,000,000	102,418,000	
第383回東北電力株式会社社債	200,000,000	216,064,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	104,038,000	
第343回九州電力株式会社社債	100,000,000	108,699,000	
第414回九州電力株式会社社債	100,000,000	104,741,000	
第38回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	103,349,000	
第19回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	108,829,000	
社債券合計	8,800,000,000	9,133,657,000	
合計		140,653,125,016	

### デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

S M A M ・ 外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)

貸借対照表

	（平成25年12月20日現在）	（平成26年12月22日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	14	-
親投資信託受益証券	46,141,051,588	33,680,212,761
未収入金	197,349,996	-
流動資産合計	46,338,401,598	33,680,212,761
資産合計	46,338,401,598	33,680,212,761
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	197,349,996	-
未払受託者報酬	1,301,991	1,152,639
未払委託者報酬	473,443	419,134
その他未払費用	31,500	37,800
流動負債合計	199,156,930	1,609,573
負債合計	199,156,930	1,609,573
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	26,385,636,483	15,395,405,944
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	19,753,608,185	18,283,197,244
元本等合計	46,139,244,668	33,678,603,188
純資産合計	46,139,244,668	33,678,603,188
負債純資産合計	46,338,401,598	33,680,212,761

## 注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 平成26年12月 2日 至 平成26年12月22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)	(平成26年12月22日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	26,385,636,483口	15,395,405,944口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額) 1.7487円 17,487円)	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額) 2.1876円 21,876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26年12月2日 至平成26年12月22日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1)金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2)金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

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

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成26年12月22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）

該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

項 目	（平成25年12月20日現在）	（平成26年12月22日現在）
期首元本額	27,309,808,470円	15,758,169,272円
期中追加設定元本額	5,413,703円	5,589,086円
期中一部解約元本額	929,585,690円	368,352,414円

## 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
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	11,960,727,569	33,680,212,761	
合計		11,960,727,569	33,680,212,761	

## 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）

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

### 貸借対照表

	（単位：円）	
	（平成25年12月20日現在）	（平成26年12月22日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	1,025,669,061	271,604,763
コール・ローン	100,613,458	163,287,176
株式	229,249,988,416	189,898,544,938
投資証券	4,575,310,843	4,582,904,442
派生商品評価勘定	64,015,994	60,647,555
未収入金	3,083,203,036	4,702,806,928
未収配当金	332,585,450	246,589,672
未収利息	82	44
差入委託証拠金	1,294,486,362	1,132,693,767
流動資産合計	<u>239,725,872,702</u>	<u>201,059,079,285</u>
資産合計	<u>239,725,872,702</u>	<u>201,059,079,285</u>
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	9,341,780	336,208
前受金	-	60,311,347
未払金	20,043,100	52,822,098
未払解約金	504,134,799	15,622,683
流動負債合計	<u>533,519,679</u>	<u>129,092,336</u>
負債合計	<u>533,519,679</u>	<u>129,092,336</u>
純資産の部		
元本等		
元本	106,343,414,005	71,355,249,023
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	132,848,939,018	129,574,737,926
元本等合計	<u>239,192,353,023</u>	<u>200,929,986,949</u>
純資産合計	<u>239,192,353,023</u>	<u>200,929,986,949</u>
負債純資産合計	<u>239,725,872,702</u>	<u>201,059,079,285</u>

### 注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 平成26年12月 2日 至 平成26年12月22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)	(平成26年12月22日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	106,343,414,005口	71,355,249,023口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 2.2492円 (10,000口当たりの純資産額 22,492円)	1口当たり純資産額 2.8159円 (10,000口当たりの純資産額 28,159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26年12月 2日 至 平成26年12月22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います。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド(外部ファンド)を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p>
4.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

## . 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成26年12月22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（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。 (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20日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	5,133,665,877	-	5,189,572,882	55,907,005
	SP500 1403	3,309,452,595	-	3,339,471,509	30,018,914
	DJ EUR 1403	1,074,258,529	-	1,092,815,035	18,556,506
	FTSE 1403	749,954,753	-	757,286,338	7,331,585
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	買建	2,259,838,276	-	2,264,350,142	4,511,866
	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
	ユーロ	435,859,458	-	435,584,082	275,376
	英ポンド	170,550,000	-	170,770,000	220,000
	オーストラリアドル	184,420,000	-	185,000,000	580,000
	売建	2,999,624,554	-	3,005,369,211	5,744,657
	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
	ユーロ	406,776,150	-	406,519,148	257,002
	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
	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
	オーストラリアド ル	104,286,405	-	104,614,385	327,980
	シンガポールドル	20,425,779	-	20,373,805	51,974
	合計	10,393,128,707	-	10,459,292,235	54,674,214

(平成26年12月22日現在)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等	うち1年超	時 価	評 価 損 益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	6,218,636,318	-	6,278,947,665	60,311,347
	SPMINI 1503	4,390,559,658	-	4,433,981,177	43,421,519
	DJ EUR 1503	1,199,475,817	-	1,208,602,692	9,126,875
	FTSE 1503	553,962,763	-	558,851,092	4,888,329
	SPI200 1503	74,638,080	-	77,512,704	2,874,624
	合計	6,218,636,318	-	6,278,947,665	60,311,347

(注) 1. 時価の算定方法

(1) 株価指数先物取引の時価の算定方法について

1) 原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

2) 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

(2) 為替予約取引の時価の算定方法について

1) 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しています。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しています。

計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっています。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている対顧客先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いています。
  - ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いています。
- 2) 計算期間末日において対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

（平成25年12月20日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	108,558,675,380円
同期中における追加設定元本額	25,439,293円
同期中における一部解約元本額	2,240,700,668円
平成25年12月20日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	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
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）	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
S M A M・バランスファンドVA安定成長型＜適格機関投資家限定＞	13,753,697,375円
S M A M・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	6,625,636,229円
S M A M・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	3,754,991,867円
S M A M・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	15,670,968,529円
S M A M・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	48,918,084円
S M A M・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
S M A M・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	1,911,605,182円
S M A M・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

S M A M ・ インデックス ・ バランス V A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	384,874,235円
S M A M ・ インデックス ・ バランス V A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	1,838,904,052円
S M A M ・ バランスファンド V A 4 0 < 適格機関投資家専用 >	3,147,974,182円
S M A M ・ バランスファンド V A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	4,318,955,513円
S M A M ・ バランス V A 株 4 0 T < 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 ・ V A S ( 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 ・ V A S ( 適格機関投資家専用 )	4,948,984,305円
S M A M ・ グローバルバランス 4 0 V A < 適格機関投資家限定 >	340,831,147円
S M A M ・ バランスファンド V A 2 0 < 適格機関投資家専用 >	946,312,508円
三井住友 ・ 7 資産バランスファンド ・ V A S ( 適格機関投資家専用 )	16,926,898,274円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	56,107,607円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	34,442,671円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	14,687,605円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	131,740,373円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	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 2 0 V 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 2 5 V A < 適格機関投資家限定 >	6,115,783円
合計	106,343,414,005円

(平成26年12月22日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	74,690,132,511円
同期中における追加設定元本額	370,426,890円
同期中における一部解約元本額	3,705,310,378円
平成26年12月22日現在における元本の内訳	
三井住友 ・ D C 外国株式インデックスファンド S	7,251,639,912円
三井住友 ・ D C 年金バランス 3 0 ( 債券重点型 )	153,435,843円
三井住友 ・ D C 年金バランス 5 0 ( 標準型 )	682,324,481円
三井住友 ・ D C 年金バランス 7 0 ( 株式重点型 )	483,886,866円
スミセイ ・ D C バランスファンド ( 機動的資産配分型 )	32,709,007円
スミセイ ・ D C ターゲットイヤーファンド 2 0 2 0	2,372,866円
スミセイ ・ D C ターゲットイヤーファンド 2 0 2 5	4,329,278円
スミセイ ・ D C ターゲットイヤーファンド 2 0 3 0	5,505,839円
スミセイ ・ D C ターゲットイヤーファンド 2 0 3 5	9,167,391円
スミセイ ・ D C ターゲットイヤーファンド 2 0 4 0	5,044,868円
スミセイ ・ D C ターゲットイヤーファンド 2 0 4 5	10,797,705円
外国株式指数ファンド	322,926,534円
三井住友 ・ D C 全海外株式インデックスファンド	40,593,324円
S M A M ・ 外国株式パッシブ ・ ファンド ( 適格機関投資家専用 )	11,960,727,569円
バランスファンド V A ( 安定運用型 ) < 適格機関投資家限定 >	106,020,436円
S M A M ・ バランスファンド V A 安定成長型 < 適格機関投資家限定 >	10,784,829,076円
S M A M ・ バランスファンド V A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	5,073,999,698円
S M A M ・ バランスファンド V A 3 7 . 5 < 適格機関投資家専用 >	2,974,729,253円
S M A M ・ バランスファンド V A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	12,532,500,423円

S M A M ・ バランスファンド V L 3 0 < 適格機関投資家限定 >	37,383,387円
S M A M ・ バランスファンド V L 5 0 < 適格機関投資家限定 >	191,596,027円
世界 6 資産バランスファンド V A < 適格機関投資家限定 >	26,226,513円
S M A M ・ バランスファンド V A 7 5 < 適格機関投資家専用 >	1,651,214,097円
S M A M ・ バランスファンド V L 国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	103,098,450円
S M A M ・ インデックス・バランス V A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	302,822,160円
S M A M ・ インデックス・バランス V A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	1,439,580,239円
S M A M ・ バランスファンド V A 4 0 < 適格機関投資家専用 >	2,553,226,704円
S M A M ・ バランスファンド V A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	3,291,341,974円
S M A M ・ バランス V A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	319,525,250円
三井住友・外国株式インデックスファンド・V A S ( 適格機関投資家専用 )	1,348,758,942円
三井住友・5資産バランスファンド・V A S ( 適格機関投資家専用 )	3,560,497,982円
S M A M ・ グローバルバランス 4 0 V A < 適格機関投資家限定 >	255,199,579円
S M A M ・ バランスファンド V A 2 0 < 適格機関投資家専用 >	167,211,143円
三井住友・7資産バランスファンド・V A S ( 適格機関投資家専用 )	2,904,519,120円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	42,445,096円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	25,845,812円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	11,292,400円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	100,030,538円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	220,229,425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 >	213,343,777円
S M A M ・ F G 新興国重視型バランス 2 0 V A < 適格機関投資家限定 >	443,716円
S M A M ・ F G グローバルバランス 2 5 V A < 適格機関投資家限定 >	4,519,145円
S M A M ・ グローバル・マルチアセット・グロース・ファンド ( 安定成長型 ) < 適格機関投資家限定 >	372,779円
S M A M ・ 外国株式インデックスファンド S A < 適格機関投資家限定 >	146,984,399円
合計	71,355,249,023円

## 附属明細表

### 有価証券明細表

#### (a) 株式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	ANADARKO PETROLEUM CORP	27,174	84.86	2,305,985.64	
	ANTERO RESOURCES CORP	2,800	44.01	123,228.00	
	APACHE CORPORATION	20,288	64.82	1,315,068.16	
	BAKER HUGHES INC	23,134	57.15	1,322,108.10	
	CABOT OIL & GAS CORPORATION	22,293	31.78	708,471.54	
	CAMERON INTERNATIONAL CORP	11,443	50.21	574,553.03	
	CHENIERE ENERGY INC	11,565	70.40	814,176.00	

CHESAPEAKE ENERGY CORPORATION	29,438	19.86	584,638.68
CHEVRON CORPORATION	100,859	112.93	11,390,006.87
CIMAREX ENERGY CO	4,866	113.62	552,874.92
COBALT INTERNATIONAL ENERGY	17,725	9.37	166,083.25
CONCHO RESOURCES INC	6,189	98.98	612,587.22
CONOCOPHILLIPS	65,027	70.98	4,615,616.46
CONSOL ENERGY INC	12,655	34.88	441,406.40
CONTINENTAL RESOURCES, INC.	5,714	38.63	220,731.82
CORE LABORATORIES N.V.	2,101	122.26	256,868.26
DENBURY RESOURCES INC	21,916	8.32	182,341.12
DEVON ENERGY CORPORATION	21,188	61.31	1,299,036.28
DIAMOND OFFSHORE DRILLING, INC.	3,594	39.00	140,166.00
ENERGEN CORPORATION	4,400	64.85	285,340.00
ENSCO PLC-CL A	12,455	32.77	408,150.35
EOG RESOURCES INC	28,816	95.02	2,738,096.32
EQT CORPORATION	8,471	80.59	682,677.89
EXXON MOBIL CORPORATION	227,260	93.64	21,280,626.40
FMC TECHNOLOGIES INC	13,132	48.20	632,962.40
HALLIBURTON CO	44,504	40.49	1,801,966.96
HELMERICH & PAYNE INC	6,052	71.85	434,836.20
HESS CORPORATION	15,113	74.50	1,125,918.50
HOLLYFRONTIER CORP	9,973	37.34	372,391.82
KINDER MORGAN INC	95,111	41.63	3,959,470.93
MARATHON OIL CORP	34,742	28.23	980,766.66
MARATHON PETROLEUM CORPORATION	15,084	87.20	1,315,324.80
MURPHY OIL CORPORATION	9,071	50.66	459,536.86
NABORS INDUSTRIES LTD	15,776	13.63	215,026.88
NATIONAL-OILWELL VARCO INC.	22,424	67.07	1,503,977.68
NOBLE CORPORATION PLC	13,895	18.63	258,863.85
NOBLE ENERGY INC	18,608	51.19	952,543.52
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	41,124	81.52	3,352,428.48
OCEANEERING INTL INC	5,931	58.97	349,751.07
ONEOK INC	11,351	49.54	562,328.54
PHILLIPS 66	30,142	71.81	2,164,497.02
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	7,623	152.70	1,164,032.10

QEP RESOURCES INC	9,623	20.53	197,560.19
RANGE RESOURCES CORPORATION	8,475	59.87	507,398.25
SCHLUMBERGER LTD	68,680	87.52	6,010,873.60
SOUTHWESTERN ENERGY COMPANY	19,747	31.00	612,157.00
SPECTRA ENERGY CORPORATION	34,827	37.07	1,291,036.89
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	8,900	21.77	193,753.00
TESORO CORPORATION	6,406	72.00	461,232.00
VALERO ENERGY CORP	28,839	48.88	1,409,650.32
WEATHERFORD INTL PLC	42,360	12.47	528,229.20
WHITING PETROLEUM CORP	6,889	34.31	236,361.59
WILLIAMS COS INC	38,024	46.00	1,749,104.00
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	11,123	147.04	1,635,525.92
AIRGAS INC	3,636	115.03	418,249.08
ALBEMARLE CORPORATION	4,625	58.69	271,441.25
ALCOA INC	64,192	15.94	1,023,220.48
ASHLAND INC	3,913	116.91	457,468.83
AVERY DENNISON CORP	4,362	51.97	226,693.14
BALL CORPORATION	7,163	68.61	491,453.43
CELANESE CORPORATION	7,717	59.49	459,084.33
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,703	265.95	718,862.85
CROWN HOLDINGS INC	7,579	51.08	387,135.32
DOW CHEMICAL	62,899	45.84	2,883,290.16
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	48,551	73.29	3,558,302.79
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	7,839	75.61	592,706.79
ECOLAB INC	14,408	106.63	1,536,325.04
FMC CORPORATION	6,826	56.96	388,808.96
FREEPORT-MCMORAN INC	55,368	23.40	1,295,611.20
INTERNATIONAL PAPER CO	22,138	53.98	1,195,009.24
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	4,523	102.49	463,562.27
LYONDELLBASELL INDU-CL A	22,779	82.00	1,867,878.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,293	119.26	392,723.18
MEADWESTVACO CORP	9,637	44.96	433,279.52
MONSANTO CO	27,678	121.12	3,352,359.36
MOSAIC CO/THE	16,507	46.01	759,487.07
NEWMONT MINING CORP	26,108	19.12	499,184.96



NUCOR CORP	17,399	49.40	859,510.60
OWENS-ILLINOIS INC	8,965	27.01	242,144.65
PPG INDUSTRIES INC	7,200	227.90	1,640,880.00
PRAXAIR INC	15,675	130.05	2,038,533.75
ROCK-TENN COMPANY CL A	7,410	61.80	457,938.00
SEALED AIR CORP	11,262	42.20	475,256.40
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	4,503	260.07	1,171,095.21
SIGMA-ALDRICH	6,398	136.51	873,390.98
VULCAN MATERIALS CO	7,064	66.78	471,733.92
WESTLAKE CHEMICAL CORP	2,815	61.50	173,122.50
3M COMPANY	32,595	165.48	5,393,820.60
AGCO CORP	4,954	45.29	224,366.66
AMETEK INC	13,343	52.36	698,639.48
BE AEROSPACE INC	5,746	59.10	339,588.60
BOEING CO	36,215	126.23	4,571,419.45
CATERPILLAR INC	31,420	91.71	2,881,528.20
CHICAGO BRIDGE & IRON COMPANY NV	5,371	41.31	221,876.01
CUMMINS INC	9,534	143.06	1,363,934.04
DANAHER CORP	33,216	86.27	2,865,544.32
DEERE & CO	17,781	90.10	1,602,068.10
DOVER CORP	9,470	73.68	697,749.60
EATON CORP PLC	24,863	69.16	1,719,525.08
EMERSON ELECTRIC CO	36,648	62.33	2,284,269.84
FASTENAL COMPANY	15,385	47.31	727,864.35
FLOWERVE CORPORATION	7,650	58.89	450,508.50
FLUOR CORP	8,596	59.90	514,900.40
GENERAL DYNAMICS CORP	14,907	139.83	2,084,445.81
GENERAL ELECTRIC CO	533,463	25.62	13,667,322.06
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	39,278	101.16	3,973,362.48
ILLINOIS TOOL WORKS	20,145	96.02	1,934,322.90
INGERSOLL-RAND PLC	14,598	63.99	934,126.02
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	7,290	43.25	315,292.50
JOY GLOBAL INC	4,635	47.07	218,169.45
KLX INC NEW	2,873	42.74	122,792.02
L-3 COMMUNICATIONS HLDGS INC	4,436	125.35	556,052.60

LOCKHEED MARTIN CORPORATION	14,200	192.85	2,738,470.00
MASCO CORP	19,452	25.31	492,330.12
NORTHROP GRUMMAN CORP	10,523	149.90	1,577,397.70
PACCAR INC	18,990	69.24	1,314,867.60
PALL CORPORATION	6,006	100.14	601,440.84
PARKER HANNIFIN CORPORATIOM	7,670	128.27	983,830.90
PENTAIR PLC-REGISTERED	10,819	66.61	720,653.59
PRECISION CASTPARTS CORP	7,507	237.00	1,779,159.00
QUANTA SERVICES INC	10,839	27.61	299,264.79
RAYTHEON COMPANY	16,956	106.82	1,811,239.92
ROCKWELL AUTOMATION INC	7,524	111.79	841,107.96
ROCKWELL COLLINS INC.	6,635	84.98	563,842.30
ROPER INDUSTRIES INC	5,376	156.40	840,806.40
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	9,135	52.55	480,044.25
SNAP-ON INC	3,055	136.96	418,412.80
SPX CORP	1,648	84.74	139,651.52
STANLEY BLACK & DECKER INC	8,107	96.90	785,568.30
TEXTRON INC	14,093	42.71	601,912.03
TRANSDIGM GROUP INC	2,733	197.80	540,587.40
UNITED RENTALS INC	5,162	101.33	523,065.46
UNITED TECHNOLOGIES CORP	46,018	115.59	5,319,220.62
WABTEC CORP	5,100	87.40	445,740.00
WW GRAINGER INC	3,149	257.81	811,843.69
XYLEM INC	9,969	38.59	384,703.71
CINTAS CORP	5,399	79.23	427,762.77
DUN & BRADSTREET CORP	1,961	121.00	237,281.00
EQUIFAX INC	6,645	81.06	538,643.70
IHS INC-CLASS A	3,519	116.67	410,561.73
MANPOWERGROUP	4,458	68.39	304,882.62
NIELSEN NV	17,675	44.27	782,472.25
REPUBLIC SERVICES INC	15,678	40.26	631,196.28
ROBERT HALF INTL INC	7,741	58.65	454,009.65
STERICYCLE, INC.	4,628	132.07	611,219.96
THE ADT CORPORATION	9,496	34.55	328,086.80
TOWERS WATSON & CO-CL A	3,710	113.69	421,789.90

TYCO INTERNATIONAL PLC	24,445	43.16	1,055,046.20
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	8,004	64.70	517,858.80
WASTE MANAGEMENT INC	24,179	50.78	1,227,809.62
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	10,472	50.71	531,035.12
C.H.ROBINSON WORLDWIDE, INC.	7,839	76.31	598,194.09
CSX CORPORATION	52,362	35.76	1,872,465.12
DELTA AIR LINES INC	11,501	47.38	544,917.38
EXPEDITORS INTL WASH INC	10,140	43.73	443,422.20
FEDEX CORP	14,536	174.22	2,532,461.92
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	23,601	22.68	535,270.68
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	4,585	83.83	384,360.55
KANSAS CITY SOUTHERN	6,021	120.29	724,266.09
NORFOLK SOUTHERN CORP	16,890	109.05	1,841,854.50
SOUTHWEST AIRLINES	9,271	40.26	373,250.46
UNION PACIFIC CORP	47,531	118.47	5,630,997.57
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	5,097	64.14	326,921.58
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	37,336	110.96	4,142,802.56
AUTOLIV INC	4,744	104.80	497,171.20
BORGWARNER INC	12,772	54.82	700,161.04
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	15,515	73.51	1,140,507.65
FORD MOTOR COMPANY	190,499	15.03	2,863,199.97
GENERAL MOTORS CO	67,368	32.81	2,210,344.08
HARLEY-DAVIDSON INC	11,382	64.79	737,439.78
JOHNSON CONTROLS INC	35,663	48.22	1,719,669.86
TESLA MOTORS INC	4,493	219.29	985,269.97
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	5,615	102.80	577,222.00
COACH INC	13,743	36.49	501,482.07
D.R.HORTON INC	17,613	24.83	437,330.79
FOSSIL GROUP INC	2,431	107.13	260,433.03
GARMIN LTD	6,916	53.30	368,622.80
HANESBRANDS INC	5,533	111.68	617,925.44
HASBRO INC	6,173	54.63	337,230.99
JARDEN CORP	9,645	46.86	451,964.70
LEGGETT & PLATT INC	7,490	42.06	315,029.40
LENNAR CORP-CL A	8,712	43.67	380,453.04

LULULEMON ATHLETICA INC	5,461	53.50	292,163.50
MATTEL INC	18,436	29.19	538,146.84
MICHAEL KORS HOLDINGS LIMITED	11,029	74.61	822,873.69
MOHAWK INDUSTRIES INC	3,089	154.96	478,671.44
NEWELL RUBBERMAID INC	13,702	37.29	510,947.58
NIKE INC -CL B	36,461	94.84	3,457,961.24
POLARIS INDUSTRIES INC	3,576	148.54	531,179.04
PULTE GROUP INC	20,065	20.90	419,358.50
PVH CORP	4,700	122.91	577,677.00
RALPH LAUREN CORPORATION	3,332	178.82	595,828.24
TOLL BROTHERS INC	9,216	32.49	299,427.84
UNDER ARMOUR INC	9,441	69.09	652,278.69
VF CORP	18,815	73.41	1,381,209.15
WHIRLPOOL CORP	3,987	189.73	756,453.51
CARNIVAL CORP	20,261	44.79	907,490.19
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	1,693	651.42	1,102,854.06
DARDEN RESTAURANTS INC	7,021	57.37	402,794.77
H&R BLOCK INC	13,674	34.49	471,616.26
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	21,492	26.18	562,660.56
LAS VEGAS SANDS CORP	21,974	56.44	1,240,212.56
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	12,686	77.43	982,276.98
MCDONALD'S CORPORATION	51,962	93.22	4,843,897.64
MGM MIRAGE	21,220	20.33	431,402.60
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDINGS	5,213	46.86	244,281.18
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	8,495	80.59	684,612.05
STARBUCKS CORP	39,623	79.44	3,147,651.12
STARWOOD HOTELS & RESORTS	10,149	79.63	808,164.87
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	6,945	84.76	588,658.20
WYNN RESORTS LTD	4,424	150.11	664,086.64
YUM! BRANDS INC	23,554	71.17	1,676,338.18
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	9,712	20.10	195,211.20
CBS CORP-CL B	26,643	55.18	1,470,160.74
CHARTER COMMUNICATTION-A	4,051	164.63	666,916.13
COMCAST CORP-CL A	113,937	57.17	6,513,778.29
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	22,281	57.05	1,271,131.05

DIRECTV	25,036	85.47	2,139,826.92
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-A	8,023	35.43	284,254.89
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-C	15,914	34.54	549,669.56
DISH NETWORK CORP.	12,039	72.61	874,151.79
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	21,848	20.09	438,926.32
LIBERTY GLOBAL PLC-A	13,858	50.53	700,244.74
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	33,994	48.53	1,649,728.82
LIBERTY MEDIA CORP-A	5,806	34.38	199,610.28
LIBERTY MEDIA CORP-C	11,612	33.99	394,691.88
NEWS CORP-CLASS A	20,668	15.22	314,566.96
OMNICOM GROUP	13,706	76.71	1,051,387.26
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	4,192	77.83	326,263.36
SIRIUS XM HOLDINGS INC	145,508	3.47	504,912.76
THE WALT DISNEY CO.	86,870	92.89	8,069,354.30
TIME WARNER CABLE, INC.	14,668	149.31	2,190,079.08
TIME WARNER INC	45,152	84.93	3,834,759.36
TWENTY-FIRST CE CL-A	73,277	38.51	2,821,897.27
TWENTY-FIRST CE CL-B	23,396	37.05	866,938.78
VIACOM INC-CLASS B	19,390	75.92	1,472,088.80
ADVANCE AUTO PARTS	3,928	159.85	627,890.80
AMAZON.COM INC	20,815	299.90	6,242,418.50
AUTONATION INC	4,300	58.56	251,808.00
AUTOZONE INC	1,779	618.60	1,100,489.40
BED BATH & BEYOND INC	10,327	73.55	759,550.85
BEST BUY COMPANY INC	15,681	39.01	611,715.81
CARMAX INC	11,964	67.32	805,416.48
DICK'S SPORTING GOODS INC	5,100	50.09	255,459.00
DOLLAR GENERAL CORP	16,556	68.56	1,135,079.36
DOLLAR TREE INC	10,488	68.70	720,525.60
EXPEDIA INC	5,959	88.06	524,749.54
FAMILY DOLLAR STORES	5,804	78.96	458,283.84
FOOT LOCKER INC	7,571	53.86	407,774.06
GAMESTOP CORP-CL A	6,747	34.50	232,771.50
GAP INC/THE	12,463	41.02	511,232.26
GENUINE PARTS CO	8,219	105.88	870,227.72

HOME DEPOT INC	71,378	101.93	7,275,559.54
KOHL'S CORP	10,719	59.59	638,745.21
L BRANDS INC	13,442	83.64	1,124,288.88
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION-A	24,098	28.52	687,274.96
LKQ CORPORATION	16,516	27.61	456,006.76
LOWE'S COMPANIES INC	52,103	66.90	3,485,690.70
MACY'S INC	19,291	62.59	1,207,423.69
NETFLIX INC	3,093	340.12	1,051,991.16
NORDSTROM INC	7,535	77.10	580,948.50
O'REILLY AUTOMOTIVE INC NEW	5,609	193.14	1,083,322.26
PETSMART INC	4,993	81.31	405,980.83
PRICELINE GROUP INC/THE	2,764	1,109.45	3,066,519.80
ROSS STORES INC	11,444	91.02	1,041,632.88
SIGNET JEWELERS LTD	4,054	129.87	526,492.98
STAPLES INC	34,362	17.55	603,053.10
TARGET CORP	31,640	73.95	2,339,778.00
TIFFANY & CO	7,034	103.57	728,511.38
TJX COMPANIES INC	36,429	66.08	2,407,228.32
TRACTOR SUPPLY COMPANY	7,513	76.38	573,842.94
TRIPADVISOR INC-W/I	6,384	75.65	482,949.60
ULTA SALON COSMETICS & FRAGRANCE INC	3,420	129.22	441,932.40
URBAN OUTFITTERS, INC.	5,837	34.02	198,574.74
COSTCO WHOLESALE CORP	23,121	141.77	3,277,864.17
CVS HEALTH CORPORATION	61,358	95.70	5,871,960.60
KROGER CO	24,418	63.55	1,551,763.90
SAFEWAY INC	12,782	34.77	444,430.14
SYSCO CORP	31,258	40.47	1,265,011.26
WAL-MART STORES INC	85,486	85.16	7,279,987.76
WALGREEN CO	47,969	73.23	3,512,769.87
WHOLE FOODS MARKET INC	19,016	48.80	927,980.80
ALTRIA GROUP INC	105,025	50.56	5,310,064.00
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	34,387	52.24	1,796,376.88
BROWN-FORMAN CORPORATION	6,992	88.12	616,135.04
BUNGE LIMITED	7,962	90.39	719,685.18
CAMPBELL SOUP CO	11,696	44.30	518,132.80

COCA-COLA CO/THE	209,515	41.95	8,789,154.25
COCA-COLA ENTERPRISES INC	12,958	44.80	580,518.40
CONAGRA FOODS INC	22,612	36.86	833,478.32
CONSTELLATION BRANDS INC-A	8,880	94.80	841,824.00
DR.PEPPER SNAPPLE GROUP, INC	10,914	71.66	782,097.24
GENERAL MILLS INC	32,186	53.81	1,731,928.66
HORMEL FOODS CORPORATION	8,006	52.28	418,553.68
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	5,227	102.79	537,283.33
KELLOGG CO	14,388	66.82	961,406.16
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	6,718	137.17	921,508.06
KRAFT FOODS GROUP INC	31,858	63.51	2,023,301.58
LORILLARD INC	19,578	62.04	1,214,619.12
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	6,282	76.29	479,253.78
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	10,770	100.35	1,080,769.50
MOLSON COORS BREWING COMPANY	8,238	75.91	625,346.58
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	89,809	37.30	3,349,875.70
MONSTER BEVERAGE CORPORATION	7,792	111.63	869,820.96
PEPSICO INC	79,930	95.44	7,628,519.20
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	82,829	83.05	6,878,948.45
REYNOLDS AMERICAN INC	16,981	64.23	1,090,689.63
THE HERSHEY COMPANY	8,367	105.27	880,794.09
TYSON FOODS INC-CL A	15,863	40.22	638,009.86
AVON PRODUCTS INC	24,724	9.57	236,608.68
CHURCH & DWIGHT CO INC	7,120	78.45	558,564.00
CLOROX COMPANY	6,694	104.41	698,920.54
COLGATE-PALMOLIVE COMPANY	48,653	69.98	3,404,736.94
ENERGIZER HOLDINGS INC	3,347	131.57	440,364.79
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	12,779	76.25	974,398.75
HERBALIFE LTD	3,974	37.96	150,853.04
KIMBERLY-CLARK CORP	20,111	115.84	2,329,658.24
PROCTER & GAMBLE CO	143,957	92.05	13,251,241.85
ABBOTT LABORATORIES	79,387	46.05	3,655,771.35
AETNA INC	18,890	90.84	1,715,967.60
AMERISOURCEBERGEN CORP	11,953	91.68	1,095,851.04
ANTHEM INC	14,609	127.95	1,869,221.55

BARD(C.R.) INC	4,173	169.50	707,323.50
BAXTER INTERNATIONAL INC	28,855	74.48	2,149,120.40
BECTON DICKINSON & CO	10,469	139.81	1,463,670.89
BOSTON SCIENTIFIC CORP	70,119	13.15	922,064.85
CARDINAL HEALTH INC	18,371	83.04	1,525,527.84
CAREFUSION CORPORATION	11,343	59.15	670,938.45
CERNER CORP	16,750	64.37	1,078,197.50
CIGNA CORP	13,742	104.53	1,436,451.26
COOPER COMPANIES INC (THE)	2,544	162.87	414,341.28
COVIDIEN PLC	24,338	102.90	2,504,380.20
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	9,154	75.94	695,154.76
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	7,135	53.70	383,149.50
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	5,929	133.21	789,802.09
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	39,711	80.97	3,215,399.67
HCA HOLDINGS, INC.	16,517	74.47	1,230,020.99
HENRY SCHEIN INC	4,519	137.51	621,407.69
HOLOGIC INC	10,635	26.92	286,347.37
HUMANA INC.	8,217	146.47	1,203,543.99
INTUITIVE SURGICAL INC	1,962	531.96	1,043,705.52
LABORATORY CRP OF AMR HLDGS	4,792	105.80	506,993.60
MALLINCKRODT PLC	6,202	99.52	617,223.04
MCKESSON CORP	12,481	211.12	2,634,988.72
MEDTRONIC INC	52,180	74.62	3,893,671.60
OMNICARE INC	5,368	73.59	395,031.12
PATTERSON COS INC	5,002	49.03	245,248.06
QUEST DIAGNOSTICS	7,894	66.34	523,687.96
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLDINGS INC	3,573	60.39	215,773.47
RESMED INC	8,017	56.24	450,876.08
ST JUDE MEDICAL INC	15,166	67.17	1,018,700.22
STRYKER CORP	18,151	94.79	1,720,533.29
UNITEDHEALTH GROUP INC	51,439	102.49	5,271,983.11
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	4,894	109.87	537,703.78
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	5,543	88.04	488,005.72
ZIMMER HOLDINGS INC	8,998	114.91	1,033,960.18
ABBVIE INC	84,315	67.71	5,708,968.65



ACTAVIS PLC	13,956	265.39	3,703,782.84
AGILENT TECHNOLOGIES INC	18,186	41.38	752,536.68
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	10,538	189.53	1,997,267.14
ALLERGAN INC	15,831	212.63	3,366,145.53
AMGEN INC	40,271	170.17	6,852,916.07
BIOGEN IDEC INC	12,484	360.67	4,502,604.28
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	7,837	93.84	735,424.08
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	87,782	61.30	5,381,036.60
CELGENE CORP	42,310	117.18	4,957,885.80
ELI LILLY & CO	53,568	72.40	3,878,323.20
ENDO INTERNATIONAL PLC	8,152	73.00	595,096.00
GILEAD SCIENCES INC	80,218	108.45	8,699,642.10
HOSPIRA INC	9,208	62.66	576,973.28
ILLUMINA INC	7,426	189.97	1,410,717.22
INCYTE CORP	8,151	76.86	626,485.86
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	3,229	169.03	545,797.87
JOHNSON & JOHNSON	149,934	105.55	15,825,533.70
MEDIVATION INC	4,057	108.34	439,535.38
MERCK & CO. INC.	153,117	59.58	9,122,710.86
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	1,655	300.36	497,095.80
MYLAN INC	19,926	57.51	1,145,944.26
PERRIGO CO PLC	6,929	168.14	1,165,042.06
PFIZER INC	336,764	31.94	10,756,242.16
PHARMACYCLICS INC	3,386	131.45	445,089.70
REGENERON PHARMACEUTICALS	4,223	427.64	1,805,923.72
SALIX PHARMACEUTICALS LTD	3,294	117.20	386,056.80
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	21,274	128.45	2,732,645.30
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	12,399	118.90	1,474,241.10
WATERS CORP	4,743	115.09	545,871.87
ZOETIS INC	26,591	43.51	1,156,974.41
BANK OF AMERICA CORP	560,189	17.62	9,870,530.18
BB & T CORPORATION	37,488	38.33	1,436,915.04
CIT GROUP INC	9,868	47.82	471,887.76
CITIGROUP INC	160,901	54.01	8,690,263.01
COMERICA INC	10,546	46.03	485,432.38

FIFTH THIRD BANCORP	44,440	20.07	891,910.80
FIRST REPUBLIC BANK/CA	7,100	52.15	370,265.00
HUDSON CITY BANCORP INC	24,896	10.01	249,208.96
HUNTINGTON BANCSHARES INC	46,577	10.33	481,140.41
JPMORGAN CHASE & CO	200,367	61.93	12,408,728.31
KEYCORP	48,725	13.80	672,405.00
M & T BANK CORP	6,067	125.11	759,042.37
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	21,566	16.07	346,565.62
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	18,000	15.15	272,790.00
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	29,128	91.71	2,671,328.88
REGIONS FINANCIAL CORPORATION	71,995	10.45	752,347.75
SUNTRUST BANKS INC	27,502	41.95	1,153,708.90
US BANCORP	95,268	45.20	4,306,113.60
WELLS FARGO & COMPANY	264,191	54.45	14,385,199.95
AFFILIATED MANAGERS GROUP	3,032	211.16	640,237.12
ALLY FINANCIAL INC	19,351	23.26	450,104.26
AMERICAN EXPRESS COMPANY	49,826	92.90	4,628,835.40
AMERIPRISE FINANCIAL INC	9,727	134.33	1,306,627.91
BANK OF NEW YORK MELLON CORP(THE)	59,495	40.85	2,430,370.75
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	61,028	151.56	9,249,403.68
BLACKROCK INC	6,983	360.15	2,514,927.45
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	30,229	82.43	2,491,776.47
CME GROUP INC.	16,652	92.36	1,537,978.72
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	24,098	65.09	1,568,538.82
EATON VANCE CORP	5,530	42.14	233,034.20
FRANKLIN RESOURCES INC	21,850	56.69	1,238,676.50
GOLDMAN SACHS GROUP INC	20,952	193.28	4,049,602.56
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	6,191	221.62	1,372,049.42
INVESCO LIMITED	22,740	40.17	913,465.80
LEGG MASON INC	5,828	52.90	308,301.20
LEUCADIA NATIONAL CORPORATION	15,223	22.72	345,866.56
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	14,774	90.05	1,330,398.70
MOODY'S CORP	10,029	97.03	973,113.87
MORGAN STANLEY	77,579	38.51	2,987,567.29
NASDAQ STOCK MARKET INC	6,446	48.69	313,855.74

NAVIENT CORPORATION	22,825	22.35	510,138.75
NORTHERN TRUST CORP	11,922	67.30	802,350.60
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	6,761	56.73	383,551.53
SCHWAB (CHARLES) CORP	62,897	29.90	1,880,620.30
SEI INVESTMENTS COMPANY	6,961	40.01	278,509.61
STATE STREET CORP	22,730	79.73	1,812,262.90
SYNCHRONY FINANCIAL	8,299	30.00	248,970.00
T ROWE PRICE GROUP INC	14,150	86.72	1,227,088.00
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	15,306	35.66	545,811.96
ACE LIMITED	17,602	114.70	2,018,949.40
AFLAC INC	24,723	61.18	1,512,553.14
ALLEGHANY CORPORATION	917	482.00	441,994.00
ALLSTATE CORP	23,166	69.89	1,619,071.74
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	75,424	55.78	4,207,150.72
AON PLC	14,714	96.69	1,422,696.66
ARCH CAPITAL GROUP LTD.	7,373	58.83	433,753.59
ASSURANT INC	3,895	68.65	267,391.75
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	5,460	51.05	278,733.00
CHUBB CORP	12,502	103.62	1,295,457.24
CINCINNATI FINANCIAL CORP	8,693	51.58	448,384.94
EVEREST RE GROUP LTD	2,388	171.51	409,565.88
FNF GROUP	12,345	33.78	417,014.10
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	29,830	8.59	256,239.70
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	23,643	41.96	992,060.28
LINCOLN NATIONAL CORP	13,994	58.42	817,529.48
LOEWS CORPORATION	19,062	41.81	796,982.22
MARSH & MCLENNAN COS	29,131	57.99	1,689,306.69
METLIFE INC	51,576	53.82	2,775,820.32
PARTNERRE LTD	2,297	113.42	260,525.74
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	15,657	52.71	825,280.47
PROGRESSIVE CORP	28,683	26.56	761,820.48
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	24,033	89.80	2,158,163.40
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	2,159	97.39	210,265.01
TORCHMARK CORPORATION	6,511	54.46	354,589.06
TRAVELERS COS INC(THE)	18,185	105.75	1,923,063.75

UNUM GROUP	13,692	35.16	481,410.72
VOYA FINANCIAL INC	10,875	42.43	461,426.25
W.R.BERKLEY CORPORATION	6,084	50.52	307,363.68
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	8,004	45.00	360,180.00
XL GROUP PLC	14,846	33.54	497,934.84
CBRE GROUP INC-A	16,260	35.01	569,262.60
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	18,638	77.30	1,440,717.40
REALOGY HOLDINGS CORP	7,236	43.43	314,259.48
WEYERHAEUSER CO	28,486	36.19	1,030,908.34
ACCENTURE PLC-CL A	33,255	90.51	3,009,910.05
ACTIVISION BLIZZARD INC	28,083	20.25	568,680.75
ADOBE SYSTEMS INC	25,320	74.45	1,885,074.00
AKAMAI TECHNOLOGIES	9,769	63.20	617,400.80
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,294	289.50	953,613.00
ANSYS INC	5,145	83.24	428,269.80
AUTODESK INC	12,252	59.90	733,894.80
AUTOMATIC DATA PROCESSING	25,852	84.71	2,189,922.92
CA INC	16,710	30.91	516,589.65
CITRIX SYSTEMS INC	9,197	63.13	580,606.61
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATION	32,603	53.49	1,743,934.47
COMPUTER SCIENCES CORP	7,396	63.84	472,160.64
EBAY INC	58,946	57.14	3,368,174.44
ELECTRONIC ARTS INC	16,331	47.45	774,987.60
EQUINIX INC	2,917	234.10	682,869.70
FACEBOOK INC-A	104,897	79.88	8,379,172.36
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	15,204	63.07	958,916.28
FIREEYE INC	4,072	33.06	134,620.32
FISERV INC	13,711	71.32	977,868.52
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	4,015	148.87	597,713.05
GOOGLE INC-CL A	15,032	520.04	7,817,241.28
GOOGLE INC-CL C	15,251	516.35	7,874,853.85
INTL BUSINESS MACHINES CORP	50,277	158.51	7,969,407.27
INTUIT INC	14,367	93.92	1,349,348.64
LINKEDIN CORP-A	5,685	234.61	1,333,757.85
MASTERCARD INC-CL A	53,426	86.44	4,618,143.44

MICROSOFT CORP	416,997	47.66	19,874,077.02
NETSUITE INC	2,000	109.16	218,320.00
NUANCE COMMUNICATIONS INC	15,621	14.38	224,629.98
ORACLE CORPORATION	189,082	46.00	8,697,772.00
PAYCHEX INC	17,968	46.30	831,918.40
RACKSPACE HOSTING INC	6,279	47.44	297,875.76
RED HAT INC	10,431	68.04	709,725.24
SALESFORCE.COM, INC.	31,496	59.86	1,885,350.56
SERVICENOW INC	6,613	69.10	456,958.30
SYMANTEC CORPORATION	36,626	25.82	945,866.45
SYNOPSYS INC	7,563	43.95	332,393.85
TERADATA CORP	8,411	44.29	372,523.19
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	9,245	34.18	315,994.10
TWITTER INC	20,164	37.08	747,681.12
VANTIV INC-CL A	7,426	34.19	253,894.94
VERISIGN INC	6,641	58.29	387,103.89
VISA INC	26,235	261.67	6,864,912.45
VMWARE INC	4,729	83.99	397,188.71
WESTERN UNION COMPANY	29,091	18.00	523,638.00
WORKDAY INC-CLASS A	5,247	85.45	448,356.15
XEROX CORP	56,002	13.96	781,787.92
YAHOO! INC	50,334	50.88	2,560,993.92
AMPHENOL CORPORATION -CL A	16,748	55.02	921,474.96
APPLE INC	318,979	111.78	35,655,472.62
ARROW ELECTRONICS INC	5,088	57.52	292,661.76
AVNET INC	8,075	43.51	351,343.25
CISCO SYSTEMS INC	271,708	27.77	7,545,331.16
CORNING INC	68,857	22.66	1,560,299.62
EMC CORP/MASS	108,068	30.14	3,257,169.52
F5 NETWORKS INC	3,788	132.75	502,857.00
FLEXTRONICS INTL LTD	34,288	11.01	377,682.32
FLIR SYSTEMS INC	8,521	33.42	284,771.82
HARRIS CORP	5,694	72.85	414,807.90
HEWLETT-PACKARD CO	99,689	39.90	3,977,591.10
JUNIPER NETWORKS INC	22,707	22.48	510,453.36

MOTOROLA SOLUTIONS INC	12,148	65.50	795,694.00
NETAPP INC	17,007	42.94	730,280.58
PALO ALTO NETWORKS INC	3,533	124.36	439,363.88
QUALCOMM INC	88,844	73.43	6,523,814.92
SANDISK CORP	12,150	99.99	1,214,878.50
SEAGATE TECHNOLOGY	17,364	68.40	1,187,697.60
SKYWORKS SOLUTIONS INC	9,649	72.70	701,482.30
TE CONNECTIVITY LTD	21,812	63.57	1,386,588.84
TRIMBLE NAVIGATION LTD	14,945	27.43	409,941.35
WESTERN DIGITAL CORP	11,843	113.88	1,348,680.84
AT&T INC	275,292	33.54	9,233,293.68
CENTURYLINK INC	30,890	39.70	1,226,333.00
FRONTIER COMMUNICATIONS CORPORATION	56,000	6.72	376,320.00
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	15,558	48.42	753,318.36
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	7,040	113.15	796,576.00
SPRINT CORP	44,034	4.16	183,181.44
T-MOBILE US INC	12,874	26.45	340,517.30
VERIZON COMMUNICATIONS INC	220,144	47.02	10,351,170.88
WINDSTREAM HOLDINGS INC	28,542	8.63	246,317.46
AES CORPORATION	39,828	13.50	537,678.00
ALLIANT ENERGY CORP	6,174	65.47	404,211.78
AMEREN CORPORATION	13,289	45.12	599,599.68
AMERICAN ELECTRIC POWER	26,097	59.89	1,562,949.33
AMERICAN WATER WORKS CO INC	8,931	52.36	467,627.16
CALPINE CORP	16,738	21.85	365,725.30
CENTERPOINT ENERGY INC	20,341	23.10	469,877.10
CMS ENERGY CORPORATION	13,772	34.49	474,996.28
CONSOLIDATED EDISON INC	15,819	65.69	1,039,150.11
DOMINION RESOURCES INC/VA	30,611	75.40	2,308,069.40
DTE ENERGY COMPANY	9,659	85.75	828,259.25
DUKE ENERGY CORP	37,287	82.85	3,089,227.95
EDISON INTERNATIONAL	16,752	64.80	1,085,529.60
ENTERGY CORP	9,620	89.03	856,468.60
EXELON CORP	44,903	37.61	1,688,801.83
FIRSTENERGY CORP	22,617	38.72	875,730.24

INTEGRYS ENERGY GROUP, INC.	4,300	76.58	329,294.00
MDU RESOURCES GROUP INC	9,220	23.09	212,889.80
NEXTERA ENERGY INC	23,489	105.87	2,486,780.43
NISOURCE INC	17,471	41.73	729,064.83
NORTHEAST UTILITIES	17,671	52.70	931,261.70
NRG ENERGY INC	19,084	27.02	515,649.68
OGE ENERGY CORP	11,302	34.81	393,422.62
P G & E CORPORATION	25,080	53.06	1,330,744.80
PEPCO HOLDINGS INC	12,800	26.80	343,040.00
PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	5,542	67.39	373,475.38
PPL CORPORATION	34,482	36.01	1,241,696.82
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	26,793	42.07	1,127,181.51
SCANA CORP	7,515	59.63	448,119.45
SEMPRA ENERGY	12,751	110.10	1,403,885.10
SOUTHERN CO	47,058	49.02	2,306,783.16
WISCONSIN ENERGY CORP	11,648	52.32	609,423.36
XCEL ENERGY INC	28,139	35.40	996,120.60
ALTERA CORPORATION	17,205	37.22	640,370.10
ANALOG DEVICES INC	16,738	56.75	949,881.50
APPLIED MATERIALS INC	65,106	24.89	1,620,488.34
AVAGO TECHNOLOGIES LTD.	13,736	100.15	1,375,660.40
BROADCOM CORP-CL A	28,821	42.86	1,235,268.06
CREE INC	7,358	31.21	229,643.18
INTEL CORP	263,744	36.37	9,592,369.28
KLA-TENCOR CORPORATION	9,042	69.72	630,408.24
LAM RESEARCH CORP	8,229	80.50	662,434.50
LINEAR TECHNOLOGY CORP	12,013	45.95	551,997.35
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	18,071	14.18	256,246.78
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	15,785	31.12	491,229.20
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	11,206	45.28	507,407.68
MICRON TECHNOLOGY INC	57,505	34.49	1,983,347.45
NVIDIA CORP	27,294	20.42	557,343.48
TEXAS INSTRUMENTS INC	56,870	54.23	3,084,060.10
XILINX INC	14,302	43.00	615,057.51
	16,639,309		1,008,848,417.85

	米ドル 小計			(120,557,385,933)
カナダドル	ALTAGAS LTD	7,500	41.58	311,850.00
	ARC RESOURCES LTD	18,047	27.61	498,277.67
	BAYTEX ENERGY CORPORATION	10,179	20.89	212,639.31
	CAMECO CORP	19,538	19.05	372,198.90
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	57,107	36.63	2,091,829.41
	CANADIAN OIL SANDS LTD	24,518	11.37	278,769.66
	CENOVUS ENERGY INC	38,638	23.98	926,539.24
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	22,786	28.61	651,907.46
	ENBRIDGE INC	45,496	57.55	2,618,294.80
	ENCANA CORP	37,043	16.41	607,875.63
	ENERPLUS CORP	13,590	11.61	157,779.90
	HUSKY ENERGY INC	18,209	27.33	497,651.97
	IMPERIAL OIL LTD	15,062	51.17	770,722.54
	INTER PIPELINE LTD	16,480	31.68	522,086.40
	KEYERA CORP	4,603	75.75	348,677.25
	MEG ENERGY CORPORATION	8,587	18.90	162,294.30
	PACIFIC RUBIALES ENERGY CORPORATION	18,164	7.48	135,866.72
	PARAMOUNT RESOURCES LTD	3,281	30.64	100,529.84
	PEMBINA PIPELINE CORP	18,218	40.35	735,096.30
	PENN WEST PETROLEUM LTD	30,053	2.62	78,738.86
	PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	8,690	34.76	302,064.40
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	7,411	32.35	239,745.85
	SUNCOR ENERGY INC	78,826	36.10	2,845,618.60
	TALISMAN ENERGY INC	52,153	9.14	476,678.42
	TOURMALINE OIL CORP	9,005	41.85	376,859.25
	TRANSCANADA CORP	37,035	55.27	2,046,924.45
	VERMILION ENERGY INC	5,586	58.78	328,345.08
	AGNICO EAGLE MINES LIMITED	11,631	28.97	336,950.07
	AGRIUM INC	7,300	110.65	807,745.00
	BARRICK GOLD CORP	64,601	12.59	813,326.59
	ELDORADO GOLD CORPORATION	38,218	7.37	281,666.66
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	32,770	15.85	519,404.50
	FRANCO-NEVADA CORPORATION	8,768	56.82	498,197.76
	GOLDCORP INC	42,650	21.30	908,445.00



KINROSS GOLD CORP	51,579	3.24	167,115.96
METHANEX CORPORATION	5,655	54.81	309,950.55
NEW GOLD INC	27,084	5.12	138,670.08
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	43,275	41.49	1,795,479.75
SILVER WHEATON CORPORATION	20,420	23.77	485,383.40
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	29,597	15.41	456,089.77
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	36,017	3.36	121,017.12
YAMANA GOLD INC	51,365	4.77	245,011.05
BOMBARDIER INC 'B'	80,493	3.97	319,557.21
CAE INC	16,932	14.99	253,810.68
FINNING INTERNATIONAL INC	9,139	24.92	227,743.88
SNC-LAVALIN GROUP INC	9,151	42.85	392,120.35
CANADIAN NATL RAILWAY CO	43,167	77.42	3,341,989.14
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	9,021	219.97	1,984,349.37
MAGNA INTERNATIONAL INC	11,585	123.11	1,426,229.35
GILDAN ACTIVEWEAR INC	5,800	65.49	379,842.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	5,625	47.03	264,543.75
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	21,938	30.77	675,032.26
THOMSON REUTERS CORP	18,463	46.64	861,114.32
CANADIAN TIRE CORP -CL A	4,045	123.73	500,487.85
DOLLARAMA INC	6,930	59.36	411,364.80
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B	21,838	49.08	1,071,809.04
EMPIRE CO LTD A	2,745	86.20	236,619.00
LOBLAW COMPANIES LTD	12,325	61.38	756,508.50
METRO INC	4,833	90.20	435,936.60
WESTON (GEORGE) LTD	2,473	98.59	243,813.07
SAPUTO INC	14,892	33.96	505,732.32
CATAMARAN CORPORATION	11,319	58.28	659,671.32
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	16,778	165.46	2,776,087.88
BANK OF MONTREAL	33,952	80.14	2,720,913.28
BANK OF NOVA SCOTIA	64,271	65.09	4,183,399.39
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	21,827	99.07	2,162,400.89
NATIONAL BANK OF CANADA	17,956	48.03	862,426.68
ROYAL BANK OF CANADA	76,328	79.22	6,046,704.16
TORONTO-DOMINION BANK	97,407	54.00	5,259,978.00

	CI FINANCIAL CORP	10,961	32.50	356,232.50	
	IGM FINANCIAL INC	5,296	45.87	242,927.52	
	ONEX CORPORATION	4,665	66.60	310,689.00	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,174	617.50	724,945.00	
	GREAT-WEST LIFE CO INC	16,674	33.03	550,742.22	
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANC	5,692	44.22	251,700.24	
	INTACT FINANCIAL CORPORATION	6,831	81.96	559,868.76	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	97,275	22.20	2,159,505.00	
	POWER CORP OF CANADA	19,050	30.95	589,597.50	
	POWER FINANCIAL CORP	14,030	35.64	500,029.20	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	33,345	41.56	1,385,818.20	
	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	29,600	56.91	1,684,536.00	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	4,000	18.65	74,600.00	
	CGI GROUP INC - CL A	10,991	44.21	485,912.11	
	CONSTELLATION SOFTWARE	1,027	327.03	335,859.81	
	OPEN TEXT CORPORATION	6,339	67.17	425,790.63	
	BLACKBERRY LIMITED	27,051	11.55	312,439.05	
	BCE INC	15,338	53.02	813,220.76	
	ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	19,778	45.12	892,383.36	
	TELUS CORPORATION	10,142	41.57	421,602.94	
	ATCO LTD-CLASS I	3,354	46.20	154,954.80	
	CANADIAN UTILITIES LIMITED	6,384	39.01	249,039.84	
	FORTIS INC	14,821	37.96	562,605.16	
	TRANSALTA CORP	16,343	10.71	175,033.53	
	カナダドル 小計	2,118,129		79,760,533.69 (8,214,537,364)	
ユーロ	ENI SPA	135,206	14.85	2,007,809.10	
	GALP ENERGIA SGPS S.A	21,982	8.89	195,419.98	
	NESTE OIL OYJ	7,560	19.94	150,746.40	
	OMV AG	8,399	22.02	184,945.98	
	REPSOL SA	52,636	16.07	846,123.70	
	SAIPEM	13,459	9.01	121,332.88	
	TECHNIP S.A.	5,450	50.10	273,045.00	
	TENARIS S.A.	26,519	12.32	326,714.08	
	TOTAL SA	113,416	42.86	4,861,009.76	

VOPAK	3,334	43.60	145,362.40
AIR LIQUIDE	18,098	101.20	1,831,517.60
AKZO NOBEL	13,536	55.60	752,601.60
ARCELOR MITTAL	56,442	9.22	520,790.33
ARKEMA	2,963	54.15	160,446.45
BASF SE	48,558	69.52	3,375,752.16
CRH PLC	40,210	19.45	782,084.50
FUCHS PETROLUB SE-PREF	3,702	33.40	123,646.80
HEIDELBERGCEMENT AG	7,746	57.90	448,493.40
IMERYS SA	2,213	60.37	133,598.81
K+S AG	9,644	22.95	221,329.80
KONINKLIJKE DSM NV	8,898	50.27	447,302.46
LAFARGE SA	9,735	57.40	558,789.00
LANXESS	5,489	38.25	209,954.25
LINDE AG	9,958	152.15	1,515,109.70
SOLVAY SA	3,141	109.30	343,311.30
STORA ENSO OYJ-R SHS	28,852	7.31	210,908.12
SYMRISE AG	6,446	49.52	319,205.92
THYSSENKRUPP AG	22,878	21.17	484,441.65
UMICORE	6,244	32.60	203,554.40
UPM-KYMMENE OYJ	28,690	13.55	388,749.50
VOESTALPINE AG	5,374	32.07	172,344.18
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	10,023	28.50	285,655.50
AIRBUS GROUP NV	31,410	41.69	1,309,482.90
ALSTOM RGPT	11,766	26.64	313,505.07
ANDRITZ AG	4,044	44.74	180,948.78
BOSKALIS WESTMINSTER NV	4,309	44.89	193,431.01
BOUYGUES SA	10,515	29.85	313,925.32
BRENTAG AG	8,299	46.00	381,754.00
CNH INDUSTRIAL NV	53,303	6.60	352,066.31
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	24,015	34.85	837,042.82
FERROVIAL SA	23,236	16.14	375,145.22
FINMECCANICA SPA	24,044	7.91	190,308.26
GEA GROUP AG	10,225	36.50	373,263.62
KONE OYJ-B	16,034	37.65	603,680.10

KONINKLIJKE PHILIPS NV	51,071	23.69	1,209,871.99
LEGRAND SA	13,482	43.00	579,726.00
MAN SE	1,807	92.26	166,713.82
METSO OYJ	6,269	24.64	154,468.16
OCI NV	4,649	27.62	128,428.62
OSRAM LICHT AG	4,638	33.19	153,935.22
PRYSMIAN SPA	9,328	14.73	137,401.44
REXEL SA	16,046	14.74	236,518.04
SAFRAN SA	15,205	49.97	759,869.87
SCHNEIDER ELECTRIC SE	27,540	59.99	1,652,124.60
SIEMENS AG-REG	41,958	92.76	3,892,024.08
THALES SA	4,465	45.10	201,371.50
VALLOUREC	5,478	22.47	123,090.66
VINCI S.A.	26,082	45.41	1,184,383.62
WARTSILA OYJ-B SHARES	7,635	36.76	280,662.60
ZARDOYA OTIS SA	6,340	8.99	56,996.60
ZODIAC AEROSPACE	10,335	27.50	284,264.17
BIC	1,337	106.85	142,858.45
BUREAU VERITAS SA	11,223	18.04	202,519.03
EDENRED	11,277	22.83	257,453.91
RANDSTAD HOLDING NV	6,716	38.99	261,856.84
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	20,706	16.35	338,543.10
AEROPORTS DE PARIS (ADP)	1,647	96.17	158,391.99
ATLANTIA SPA	22,079	19.37	427,670.23
BOLLORE	31,800	4.00	127,295.40
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	12,281	13.53	166,223.33
DEUTSCHE POST AG-REG	51,791	26.78	1,387,221.93
FRAPORT AG	2,468	48.27	119,142.70
GROUPE EUROTUNNEL SA	24,524	10.53	258,360.34
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP	57,182	5.98	341,948.36
RYANAIR HOLDINGS PLC	1,656	9.64	15,963.84
TNT EXPRESS NV	24,478	5.38	131,911.94
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	17,345	89.94	1,560,009.30
BAYERISCHE MOTOREN WERKE(BMW)AG-PFD	2,879	67.35	193,900.65
CONTINENTAL AG	5,768	173.60	1,001,324.80

DAIMLER AG	51,053	69.04	3,524,699.12
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	48,903	9.33	456,509.50
MICHELIN (CGDE)-B	9,816	74.00	726,384.00
NOKIAN RENKAAT OYJ	5,578	20.76	115,799.28
PIRELLI & C.	11,369	10.99	124,945.31
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PEF	8,356	67.89	567,288.84
PSA PEUGEOT CITROEN	21,050	10.33	217,446.50
RENAULT SA	10,163	60.66	616,487.58
VALEO	4,009	102.25	409,920.25
VOLKSWAGEN AG	1,615	182.55	294,818.25
VOLKSWAGEN AG PFD	8,938	185.25	1,655,764.50
ADIDAS AG	11,267	56.60	637,712.20
CHRISTIAN DIOR SA	2,799	142.45	398,717.55
HERMES INTERNATIONAL	740	305.00	225,700.00
HERMES INTERNATIONAL -NEW	734	305.00	223,870.00
HUGO BOSS AG	2,083	101.85	212,153.55
KERING	3,867	155.65	601,898.55
LUXOTTICA GROUP SPA	8,530	44.15	376,599.50
LVMH MOET HENNESSY LOUI V SA	15,051	129.95	1,955,877.45
ACCOR SA	9,735	36.78	358,053.30
SODEXO	4,808	80.16	385,409.28
ALTICE SA	4,569	59.00	269,571.00
AXEL SPRINGER SE	2,125	49.36	104,890.00
EUTELSAT COMMUNICATIONS	9,141	26.44	241,688.04
JC DECAUX S.A.	2,962	28.29	83,809.79
KABEL DEUTSCHLAND HOLDINGS AG	1,067	111.00	118,437.00
LAGARDERE S.C.A.	7,266	21.84	158,689.44
NUMERICABLE-SFR	5,832	36.04	210,214.44
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-REG	11,137	34.11	379,883.07
PUBLICIS GROUPE	10,413	59.23	616,761.99
REED ELSEVIER NV	37,878	19.28	730,287.84
RTL GROUP	2,200	77.27	169,994.00
SES	15,312	30.13	461,427.12
TELENET GROUP HOLDINGS NV	2,885	45.51	131,310.77
WOLTERS KLUWER-CVA	15,012	24.86	373,198.32

INDITEX	58,361	23.64	1,379,654.04
CARREFOUR SA	32,216	24.32	783,654.20
CASINO GUICHARD PERRACHON	2,725	75.23	205,001.75
COLRUYT NV	4,338	38.47	166,904.55
DELHAIZE GROUP	5,494	59.39	326,288.66
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	31,663	5.51	174,716.43
JERONIMO MARTINS SGPS S.A.	15,041	8.22	123,697.18
KONINKLIJKE AHOLD NV	48,806	14.40	703,050.43
METRO AG	8,936	24.24	216,653.32
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	42,590	93.57	3,985,146.30
DANONE	31,137	54.12	1,685,134.44
HEINEKEN HOLDING NV	5,730	52.17	298,934.10
HEINEKEN NV	12,033	59.39	714,639.87
KERRY GROUP PLC-A	8,397	57.55	483,247.35
PERNOD-RICARD SA	11,825	91.74	1,084,825.50
REMY COINTREAU	1,273	55.41	70,536.93
UNILEVER NV-CVA	86,122	32.09	2,764,085.59
BEIERSDORF AG	5,118	67.99	347,972.82
HENKEL AG & CO KGAA	6,653	79.66	529,977.98
HENKEL AG & CO KGAA	9,195	89.16	819,826.20
L'OREAL	13,251	137.65	1,824,000.15
CELESIO AG	1,870	26.31	49,209.05
ESSILOR INTERNATIONAL	10,592	90.80	961,753.60
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	12,085	60.55	731,746.75
FRESENIUS SE & CO KGAA	20,040	42.56	852,902.40
BAYER AG	43,824	114.00	4,995,936.00
GRIFOLS S.A.	8,356	33.20	277,460.98
MERCK KGAA	7,201	78.38	564,414.38
ORION OYJ	5,809	26.64	154,751.76
QIAGEN N.V.	13,423	19.20	257,721.60
SANOFI	63,353	75.38	4,775,549.14
UCB SA	7,069	65.79	465,069.51
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	312,940	7.98	2,497,261.20
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	1,717,395	0.07	122,106.78
BANCO DE SABADELL SA	191,393	2.22	425,849.42

BANCO ESPIRITO SANTO,S.A(BES)	187,906	0.10	18,790.60
BANCO POPOLARE SOCIETA COOPERATIVA	19,047	9.82	187,136.77
BANCO POPULAR ESPANOL	101,575	4.33	440,327.62
BANCO SANTANDER SA	654,633	7.09	4,643,311.86
BANK OF IRELAND	1,490,771	0.31	469,592.86
BANKIA SA	253,996	1.26	321,050.94
BANKINTER,S.A.	37,894	6.86	259,952.84
BNP PARIBAS	55,890	48.44	2,707,591.05
CAIXABANK	120,495	4.44	535,841.26
COMMERZBANK AG	51,552	10.89	561,659.04
CREDIT AGRICOLE SA	55,145	10.59	584,261.27
ERSTE GROUP BANK AG	15,326	19.02	291,577.15
INTESA SANPAOLO	624,410	2.43	1,521,062.76
INTESA SANPAOLO-RSP	57,797	2.09	121,026.91
KBC GROUPE SA	12,767	46.21	589,963.07
NATIXIS	50,869	5.47	278,304.29
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	6,561	11.88	77,944.68
SOCIETE GENERALE	37,849	34.46	1,304,276.54
UNICREDIT SPA	239,126	5.31	1,269,759.06
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	43,948	5.90	259,293.20
DEUTSCHE BANK AG -REG	74,240	24.98	1,854,886.40
DEUTSCHE BOERSE AG	10,521	59.25	623,369.25
EURAZEO	1,748	58.21	101,751.08
EXOR SPA	6,651	34.48	229,326.48
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4,130	70.85	292,610.50
ING GROEP NV-CVA	204,709	10.75	2,200,621.75
MEDIOBANCA SPA	33,045	6.73	222,392.85
WENDEL	1,660	90.87	150,844.20
AEGON NV	101,813	6.19	630,222.47
AGEAS	12,405	29.40	364,707.00
ALLIANZ SE-REG	24,190	138.45	3,349,105.50
ASSICURAZIONI GENERALI	62,465	16.93	1,057,532.45
AXA SA	97,725	19.30	1,886,581.12
CNP ASSURANCES	10,242	14.80	151,632.81
DELTA LLOYD NV	9,527	18.81	179,250.50

HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE	2,860	74.16	212,097.60
MAPFRE SA	43,669	2.87	125,330.03
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	9,272	165.10	1,530,807.20
NN GROUP NV	6,663	25.10	167,274.61
SAMPO OYJ-A SHS	23,704	38.89	921,848.56
SCOR SE	8,802	24.75	217,849.50
UNIPOLSAI SPA	49,963	2.22	111,017.78
VIENNA INSURANCE GROUP AG WIENER VERSICH	1,864	36.97	68,921.40
DEUTSCHE ANNINGTON IMMOBILIEN	12,600	26.89	338,877.00
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	16,186	19.25	311,580.50
IMMOFINANZ AG	45,326	2.05	92,918.30
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	23,334	32.58	760,221.72
ATOS	4,509	63.50	286,321.50
CAP GEMINI SA	7,172	59.96	430,033.12
DASSAULT SYSTEMES SA	6,436	49.68	319,740.48
GEMALTO	3,829	66.37	254,130.73
SAP SE	48,673	57.86	2,816,219.78
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	7,020	37.00	259,775.10
ALCATEL-LUCENT	154,115	2.91	448,474.65
NOKIA OYJ	195,455	6.47	1,264,593.85
BELGACOM SA	7,483	30.24	226,285.92
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	167,151	13.31	2,225,615.56
ELISA OYJ	8,666	22.88	198,278.08
ILIAD SA	1,518	191.10	290,089.80
KONINKLIJKE KPN NV	176,807	2.63	465,002.41
ORANGE S.A.	97,521	14.24	1,389,186.64
TELECOM ITALIA SPA	544,021	0.90	489,618.90
TELECOM ITALIA-RNC	318,198	0.70	224,965.98
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	31,936	4.44	141,987.45
TELEFONICA S.A.	222,289	12.06	2,681,916.78
VIVENDI SA	64,912	20.24	1,313,818.88
E.ON SE	106,595	14.35	1,530,171.22
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	120,953	3.21	388,621.98
ELECTRICITE DE FRANCE(EDF)	12,338	22.70	280,134.29
ENAGAS	10,716	25.90	277,544.40



	ENEL GREEN POWER SPA	101,336	1.73	175,716.62
	ENEL SPA	350,648	3.68	1,290,384.64
	FORTUM OYJ	24,063	18.10	435,540.30
	GAS NATURAL SDG SA	19,893	21.17	421,134.81
	GDF SUEZ	77,656	19.49	1,513,903.72
	IBERDROLA SA	277,425	5.60	1,556,076.82
	IBERDROLA SA-RTS	277,425	0.12	33,291.00
	RED ELECTRICA CORPORATION S.A.	5,403	73.60	397,660.80
	RWE AG	25,772	26.25	676,515.00
	SNAM SPA	109,056	4.05	442,331.13
	SUEZ ENVIRONNEMENT SA	14,655	14.82	217,187.10
	TERNA SPA	75,699	3.74	283,568.45
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	23,735	14.76	350,447.27
	ASML HOLDING NV	19,202	86.70	1,664,813.40
	INFINEON TECHNOLOGIES AG	63,809	8.62	550,225.00
	STMICROELECTRONICS NV	36,191	6.16	223,008.94
	ユーロ 小計	13,579,155		163,307,629.77 (23,847,813,175)
英bond	AMEC FOSTER WHEELER PLC	20,038	8.86	177,536.68
	BG GROUP PLC	186,130	9.01	1,677,589.69
	BP PLC	976,288	4.13	4,032,069.44
	PETROFAC LIMITED	14,971	7.22	108,165.47
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	209,930	21.70	4,555,481.00
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	129,063	22.22	2,868,425.17
	TULLOW OIL PLC	54,088	4.24	229,441.29
	ANGLO AMERICAN PLC	74,490	11.93	888,665.70
	ANTOFAGASTA PLC	19,439	7.44	144,723.35
	BHP BILLITON PLC	111,318	13.77	1,533,405.45
	CRODA INTERNATIONAL PLC	6,446	26.03	167,789.38
	FRESNILLO PLC	11,248	7.39	83,122.72
	GLENCORE PLC	572,531	2.97	1,705,569.84
	JOHNSON MATTHEY PLC	11,611	33.51	389,084.61
	RANDGOLD RESOURCES LTD	5,058	44.31	224,119.98
	REXAM PLC	38,106	4.54	173,115.55
	RIO TINTO PLC	67,062	28.72	1,926,020.64

ASHTED GROUP PLC	26,529	11.59	307,471.11
BAE SYSTEMS PLC	167,762	4.62	776,234.77
BUNZL PLC	17,795	17.60	313,192.00
COBHAM PLC	62,443	3.20	200,317.14
IMI PLC	16,100	12.47	200,767.00
MEGGITT PLC	44,518	5.11	227,709.57
MELROSE INDUSTRIES PLC	51,526	2.61	134,637.43
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	100,538	8.70	875,183.29
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-C ENTITLEMENT	10,053,630	0.00	10,053.63
SMITHS GROUP PLC	19,085	10.72	204,591.20
TRAVIS PERKINS PLC	14,281	18.24	260,485.44
WEIR GROUP PLC/THE	12,257	19.05	233,495.85
WOLSELEY PLC	13,629	36.51	497,594.79
AGGREKO PLC	13,848	15.37	212,843.76
BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	11,442	10.55	120,713.10
CAPITA PLC	34,892	10.76	375,437.92
EXPERIAN PLC	50,840	10.88	553,139.20
G4S PLC	93,353	2.75	257,560.92
INTERTEK GROUP PLC	8,190	23.55	192,874.50
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC	22,801	3.89	88,718.69
EASYJET PLC	7,630	16.52	126,047.60
ROYAL MAIL PLC	37,660	4.13	155,799.42
GKN PLC	91,695	3.43	314,972.32
BURBERRY GROUP PLC	24,684	16.21	400,127.64
PERSIMMON PLC	17,395	15.77	274,319.15
CARNIVAL PLC	9,886	28.10	277,796.60
COMPASS GROUP PLC	89,675	10.86	973,870.50
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	13,210	25.79	340,685.90
TUI AG - NEW	12,768	10.73	137,000.64
WHITBREAD PLC	9,658	46.85	452,477.30
WILLIAM HILL PLC	45,985	3.53	162,740.91
ITV PLC	215,575	2.09	452,491.92
PEARSON PLC	44,031	11.81	520,006.11
REED ELSEVIER PLC	60,390	10.78	651,004.20
SKY PLC	57,511	8.89	511,272.79

WPP PLC	71,897	13.28	954,792.16
DIXONS CARPHONE PLC	50,564	4.61	233,403.42
KINGFISHER PLC	119,812	3.24	388,430.50
MARKS & SPENCER GROUP PLC	88,539	4.76	421,445.64
NEXT PLC	8,254	64.95	536,097.30
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	18,318	6.93	127,035.33
SAINSBURY (J) PLC	64,189	2.39	153,925.22
TESCO PLC	443,093	1.85	821,494.42
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	118,375	1.76	208,576.75
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	19,769	31.94	631,421.86
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	98,703	35.00	3,455,098.51
COCA-COLA HBC AG-CDI	13,449	12.34	165,960.66
DIAGEO PLC	132,701	18.35	2,435,063.35
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	50,241	28.57	1,435,385.37
SABMILLER PLC	52,136	33.75	1,759,590.00
TATE & LYLE PLC	24,694	5.98	147,670.12
UNILEVER PLC	67,580	26.29	1,776,678.20
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	34,220	52.80	1,806,816.00
SMITH & NEPHEW PLC	47,568	10.89	518,015.52
ASTRAZENECA PLC	66,804	45.65	3,049,602.60
GLAXOSMITHKLINE PLC	258,339	13.92	3,596,078.88
SHIRE PLC	31,704	46.29	1,467,578.16
BARCLAYS PLC	865,928	2.37	2,058,310.85
HSBC HOLDINGS PLC	1,016,681	6.07	6,176,337.07
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,031,764	0.76	2,308,991.46
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	132,617	3.88	515,482.27
STANDARD CHARTERED PLC	132,573	9.27	1,228,951.71
3I GROUP PLC	52,538	4.48	235,790.54
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	49,855	4.29	214,027.51
HARGREAVES LANSDOWN PLC	13,262	10.02	132,885.24
ICAP PLC	27,845	4.49	125,135.43
INVESTEC PLC	32,289	5.38	173,714.82
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	11,063	22.10	244,492.30
SCHRODERS PLC	5,835	26.91	157,019.85
ADMIRAL GROUP PLC	11,057	13.09	144,736.13

	AVIVA PLC	156,621	4.95	775,273.95	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	84,323	2.88	243,524.82	
	FRIENDS LIFE GROUP LTD	77,938	3.72	290,396.98	
	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	307,652	2.42	746,363.75	
	OLD MUTUAL PLC	263,271	1.88	495,739.29	
	PRUDENTIAL PLC	135,325	15.12	2,046,790.62	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	57,101	4.49	256,726.09	
	STANDARD LIFE PLC	133,437	4.09	546,424.51	
	SAGE GROUP PLC/THE	59,127	4.57	270,565.15	
	BT GROUP PLC	434,054	4.04	1,757,050.59	
	INMARSAT PLC	25,159	7.86	197,749.74	
	VODAFONE GROUP PLC	1,402,455	2.25	3,155,523.75	
	CENTRICA PLC	272,401	2.72	742,837.52	
	NATIONAL GRID PLC	200,714	9.12	1,830,511.68	
	SEVERN TRENT PLC	13,551	20.16	273,188.16	
	SSE PLC	50,717	16.24	823,644.08	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	35,691	9.22	329,071.02	
	ARM HOLDINGS PLC	72,641	9.71	705,707.31	
	英ポンド 小計	25,127,463		87,971,084.43 (16,425,960,884)	
スイスフラン	TRANSOCEAN LTD	17,883	18.63	333,160.29	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	421	398.50	167,768.50	
	GIVAUDAN-REG	492	1,789.00	880,188.00	
	HOLCIM LTD-REG	12,570	70.95	891,841.50	
	SIKA AG	104	2,921.00	303,784.00	
	SYNGENTA AG	4,968	318.00	1,579,824.00	
	ABB LTD	118,725	20.91	2,482,539.75	
	GEBERIT AG-REG	1,919	336.20	645,167.80	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,048	143.90	150,807.20	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	2,395	144.60	346,317.00	
	SULZER AG	1,443	106.80	154,112.40	
	ADECCO SA-REG	8,594	68.50	588,689.00	
	SGS SA	306	2,035.00	622,710.00	
	KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	2,822	134.60	379,841.20	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-REGD A	28,127	88.95	2,501,896.65	

	THE SWATCH GROUP AG-B	1,574	448.20	705,466.80	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	2,816	86.10	242,457.60	
	ARYZTA AG	4,891	78.75	385,166.25	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	127	1,055.00	133,985.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG	45	4,987.00	224,415.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	6	56,535.00	339,210.00	
	NESTLE SA-REGISTERED	171,352	72.25	12,380,182.00	
	SONOVA HOLDING AG	2,928	145.00	424,560.00	
	ACTELION LTD	5,817	118.20	687,569.40	
	LONZA GROUP AG-REG	3,103	109.70	340,399.10	
	NOVARTIS AG-REG SHS	122,192	93.05	11,369,965.60	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	37,316	270.40	10,090,246.40	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	83,176	25.28	2,102,689.28	
	JULIUS BAER GROUP LTD	11,217	45.06	505,438.02	
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,916	78.30	150,022.80	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	813	287.00	233,331.00	
	UBS GROUP AG	193,133	17.04	3,290,986.32	
	BALOISE HOLDING AG	2,805	127.50	357,637.50	
	SWISS LIFE HOLDING AG	1,689	237.40	400,968.60	
	SWISS RE AG	18,383	83.90	1,542,333.70	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	8,048	309.10	2,487,636.80	
	SWISS PRIME SITE-REG	2,983	74.35	221,786.05	
	SWISSCOM AG-REG	1,246	522.50	651,035.00	
	スイスフラン 小計	879,393		61,296,135.51 (7,442,576,773)	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	13,237	110.90	1,467,983.30	
	BOLIDEN AB	15,063	127.50	1,920,532.50	
	ALFA LAVAL AB	17,594	149.00	2,621,506.00	
	ASSA ABLOY AB-B	17,525	410.10	7,187,002.50	
	ATLAS COPCO AB-A SHS	35,487	218.40	7,750,360.80	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	21,365	199.60	4,264,454.00	
	SANDVIK AB	56,437	76.55	4,320,252.35	
	SKANSKA AB-B SHS	21,504	165.80	3,565,363.20	
	SKF AB-B SHARES	20,152	163.10	3,286,791.20	
	VOLVO AB-B SHS	84,545	84.85	7,173,643.25	

	SECURITAS AB-B SHS	15,832	92.20	1,459,710.40	
	ELECTROLUX AB-SER B	13,210	227.80	3,009,238.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	17,292	58.05	1,003,800.60	
	HENNES & MAURITZ AB-B SHS	51,016	322.40	16,447,558.40	
	ICA GRUPPEN AB	3,550	301.80	1,071,390.00	
	SWEDISH MATCH AB	11,029	246.70	2,720,854.30	
	SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	31,935	169.90	5,425,756.50	
	ELEKTA AB-B SHS	16,938	81.00	1,371,978.00	
	GETINGE AB-B SHS	11,418	174.10	1,987,873.80	
	NORDEA BANK AB	158,981	88.50	14,069,818.50	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A	80,153	97.45	7,810,909.85	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	27,200	362.90	9,870,880.00	
	SWEDBANK AB - A SHARES	46,940	192.50	9,035,950.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	8,794	136.00	1,195,984.00	
	INVESTOR AB-B SHS	24,320	281.00	6,833,920.00	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	12,846	256.80	3,298,852.80	
	ERICSSON LM-B SHS	160,191	94.20	15,089,992.20	
	HEXAGON AB-B SHS	14,360	239.60	3,440,656.00	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	3,357	589.00	1,977,273.00	
	TELE2 AB-B SHS	16,838	95.30	1,604,661.40	
	TELIASONERA AB	125,599	50.55	6,349,029.45	
	スウェーデンクローナ 小計	1,154,708		158,633,976.30 (2,450,894,933)	
ノルウェーク ローネ	SEADRILL LID	21,887	88.45	1,935,905.15	
	STATOIL ASA	61,909	132.20	8,184,369.80	
	SUBSEA 7 SA	11,653	79.45	925,830.85	
	NORSK HYDRO ASA	72,459	42.87	3,106,317.33	
	YARA INTERNATIONAL ASA	9,029	331.30	2,991,307.70	
	ORKLA ASA	42,614	50.85	2,166,921.90	
	DNB ASA	51,728	111.30	5,757,326.40	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	10,814	120.20	1,299,842.80	
	TELENOR ASA	40,751	156.10	6,361,231.10	
	ノルウェークローネ 小計	322,844		32,729,053.03 (528,901,496)	
デンマークク	NOVOZYMES A/S-B SHARES	13,384	263.60	3,528,022.40	

ローネ	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	12,229	228.30	2,791,880.70	
	ISS A/S	4,073	172.90	704,221.70	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-A	216	11,740.00	2,535,840.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S-B	381	12,150.00	4,629,150.00	
	DSV A/S	9,120	188.50	1,719,120.00	
	PANDORA A/S	6,314	500.00	3,157,000.00	
	CARLSBERG AS-B	5,545	478.40	2,652,728.00	
	COLOPLAST-B	5,891	515.50	3,036,810.50	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	864	463.30	400,291.20	
	NOVO NORDISK A/S-B	106,911	266.00	28,438,326.00	
	DANSKE BANK A/S	35,162	167.50	5,889,635.00	
	TRYG A/S	1,001	696.00	696,696.00	
	TDC A/S	45,454	47.75	2,170,428.50	
		デンマーククローネ 小計	246,545		62,350,150.00 (1,223,933,444)
オーストラリア ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	7,464	33.94	253,328.16	
	ORIGIN ENERGY LIMITED	56,777	11.51	653,503.27	
	SANTOS LTD	53,628	7.99	428,487.72	
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	38,454	37.77	1,452,407.58	
	WORLEY PARSONS LIMITED	13,351	9.61	128,303.11	
	ALUMINA LTD	146,977	1.82	267,498.14	
	AMCOR LIMITED	63,935	13.30	850,335.50	
	BHP BILLITON LTD	169,678	28.98	4,917,268.44	
	BORAL LIMITED	44,844	5.33	239,018.52	
	FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	83,530	2.55	213,001.50	
	ILUKA RESOURCES LIMITED	28,325	6.17	174,765.25	
	INCITEC PIVOT LTD	85,406	3.21	274,153.26	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	22,958	13.01	298,683.58	
	NEWCREST MINING LIMITED	43,341	10.75	465,915.75	
	ORICA LIMITED	21,033	18.71	393,527.43	
	RIO TINTO LIMITED	22,862	56.29	1,286,901.98	
	LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	4,188	22.71	95,109.48	
	ALS LTD	24,500	5.26	128,870.00	
	BRAMBLES LIMITED	83,288	10.46	871,192.48	
SEEK LIMITED	17,538	16.85	295,515.30		

ASCIANO LTD	53,896	6.02	324,453.92
AURIZON HOLDINGS LTD	107,889	4.61	497,368.29
QANTAS AIRWAYS LIMITED	26,232	2.32	60,858.24
TOLL HOLDINGS LIMITED	42,587	5.98	254,670.26
CROWN RESORTS LTD	19,825	12.44	246,623.00
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	2,650	33.47	88,695.50
TABCORP HOLDINGS LIMITED	36,322	4.04	146,740.88
TATTS GROUP LTD	81,135	3.43	278,293.05
REA GROUP LTD	3,058	42.94	131,310.52
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	23,253	3.40	79,060.20
METCASH LTD	30,234	1.79	54,118.86
WESFARMERS LIMITED	60,409	41.31	2,495,495.79
WOOLWORTHS LIMITED	66,639	30.00	1,999,170.00
COCA-COLA AMATIL LIMITED	31,699	9.10	288,460.90
TREASURY WINE ESTATES LTD	35,541	4.71	167,398.11
COCHLEAR LIMITED	3,067	75.64	231,987.88
HEALTHSCOPE LTD	53,691	2.66	142,818.06
RAMSAY HEALTH CARE LTD	7,779	56.16	436,868.64
SONIC HEALTHCARE LTD	18,464	17.96	331,613.44
CSL LIMITED	25,282	86.36	2,183,353.52
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	145,572	31.68	4,611,720.96
BANK OF QUEENSLAND LIMITED	21,298	12.04	256,427.92
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	26,713	12.64	337,652.32
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	86,311	83.71	7,225,093.81
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	124,788	32.66	4,075,576.08
WESTPAC BANKING CORPORATION	164,382	32.48	5,339,127.36
ASX LTD	9,980	36.47	363,970.60
MACQUARIE GROUP LTD	16,138	57.82	933,099.16
AMP LIMITED	154,322	5.48	845,684.56
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	124,629	6.35	791,394.15
MEDIBANK PRIVATE LTD	150,000	2.29	343,500.00
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	71,487	10.97	784,212.39
SUNCORP GROUP LTD	68,538	13.90	952,678.20
COMPUTERSHARE LIMITED	27,158	11.65	316,390.70
TELSTRA CORPORATION LIMITED	237,695	5.89	1,400,023.55



	TPG TELECOM LTD	13,145	6.66	87,545.70	
	AGL ENERGY LIMITED	35,263	13.38	471,818.94	
	オーストラリアドル 小計	3,239,148		53,263,061.91 (5,181,430,662)	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	32,160	8.15	262,104.00	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	52,820	4.37	230,823.40	
	RYMAN HEALTHCARE LIMITED	22,000	8.25	181,500.00	
	SPARK NEW ZEALAND LIMITED	101,822	3.09	314,629.98	
	CONTACT ENERGY LIMITED	17,965	6.20	111,383.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	71,571	1.75	125,249.25	
	MIGHTY RIVER POWER	39,907	2.99	119,321.93	
	ニュージーランドドル 小計	338,245		1,345,011.56 (124,036,966)	
香港ドル	HUTCHISON WHAMPOA LTD	112,000	90.00	10,080,000.00	
	NWS HOLDINGS LTD	67,500	14.48	977,400.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	74,000	16.62	1,229,880.00	
	MTR CORPORATION	80,000	31.35	2,508,000.00	
	LI & FUNG LTD	317,200	7.30	2,315,560.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	64,500	25.55	1,647,975.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	37,000	27.30	1,010,100.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	122,000	43.35	5,288,700.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	62,400	19.12	1,193,088.00	
	SANDS CHINA LTD	134,000	38.55	5,165,700.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD.	64,000	10.50	672,000.00	
	SJM HOLDINGS LIMITED	120,000	12.38	1,485,600.00	
	WYNN MACAU LTD	78,000	21.20	1,653,600.00	
	WH GROUP LIMITED	158,500	3.95	626,075.00	
	BANK OF EAST ASIA	63,220	30.15	1,906,083.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	197,000	24.95	4,915,150.00	
	HANG SENG BANK LTD	38,800	127.70	4,954,760.00	
	FIRST PACIFIC COMPANY	146,000	7.49	1,093,540.00	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	57,600	170.70	9,832,320.00	
	AIA GROUP LTD	635,600	42.50	27,013,000.00	
CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	74,000	129.50	9,583,000.00		
HANG LUNG PROPERTIES LTD	131,000	21.35	2,796,850.00		

	HENDERSON LAND DEVELOPMENT	61,120	51.80	3,166,016.00	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	38,000	33.65	1,278,700.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	27,500	28.20	775,500.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	269,333	8.78	2,364,743.74	
	SINO LAND CO	162,200	12.08	1,959,376.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	87,000	113.30	9,857,100.00	
	SWIRE PACIFIC LTD 'A'	32,000	99.70	3,190,400.00	
	SWIRE PROPERTIES LIMITED	68,600	22.90	1,570,940.00	
	WHARF HOLDINGS LTD	88,000	54.90	4,831,200.00	
	WHEELOCK&COMPANY LTD	46,000	35.55	1,635,300.00	
	PCCW LIMITED	203,000	5.43	1,102,290.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	34,000	57.75	1,963,500.00	
	CLP HOLDINGS LTD	99,600	65.50	6,523,800.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	332,431	17.26	5,737,759.06	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	76,000	73.75	5,605,000.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	12,200	71.85	876,570.00	
	香港ドル 小計	4,471,304		150,386,575.80 (2,317,457,133)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	78,400	8.60	674,240.00	
	NOBLE GROUP LTD	245,400	1.07	262,578.00	
	SEMBICORP INDUSTRIES LTD	54,820	4.33	237,370.60	
	SEMBICORP MARINE LTD	55,400	3.19	176,726.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG	80,000	3.30	264,000.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	90,000	1.21	108,900.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	107,000	2.49	266,430.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	24,266	11.50	279,059.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	320,000	1.06	340,800.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	78,250	4.14	323,955.00	
	CYCLE & CARRIAGE LTD	6,000	41.64	249,840.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	378,600	0.43	164,691.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	105,000	3.17	332,850.00	
	DBS GROUP HOLDINGS LTD	91,000	19.93	1,813,630.00	
	OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	154,000	10.26	1,580,040.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	67,000	23.75	1,591,250.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	45,000	7.73	347,850.00	

	CAPITALAND LTD	137,000	3.17	434,290.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	21,000	10.09	211,890.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LIMITED	180,000	2.42	435,600.00	
	KEPPEL LAND LTD	43,000	3.31	142,330.00	
	UOL GROUP LIMITED	32,000	6.73	215,360.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	416,015	3.82	1,589,177.30	
	STARHUB LIMITED	37,000	4.06	150,220.00	
	シンガポールドル 小計	2,846,151		12,193,076.90	(1,107,009,451)
イスラエルシュケル	DELEK GROUP LTD	213	1,163.00	247,719.00	
	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	28,983	28.99	840,217.17	
	ISRAEL CORPORATION LTD/THE	115	1,990.00	228,850.00	
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	46,178	229.30	10,588,615.40	
	BANK HAPOLIM BM	61,837	18.70	1,156,351.90	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	72,754	12.70	923,975.80	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	4,453	42.74	190,321.22	
	NICE SYSTEMS LTD	3,300	195.60	645,480.00	
	BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	119,157	7.10	846,014.70	
	イスラエルシュケル 小計	336,990		15,667,545.19	(476,606,724)
	合 計	71,299,384		189,898,544,938	(189,898,544,938)

(注) 金額欄の( )内は、外貨建有価証券にかかるものの内書きであり、また邦貨換算金額で表示しております。

通貨	銘柄数	組入株式時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	株式 601銘柄	60.0%	63.5%
カナダドル	株式 93銘柄	4.1%	4.3%
ユーロ	株式 235銘柄	11.9%	12.6%
英ポンド	株式 105銘柄	8.2%	8.6%
スイスフラン	株式 38銘柄	3.7%	3.9%
スウェーデンクローナ	株式 31銘柄	1.2%	1.3%
ノルウェークローネ	株式 9銘柄	0.3%	0.3%
デンマーククローネ	株式 14銘柄	0.6%	0.6%
オーストラリアドル	株式 57銘柄	2.6%	2.7%
ニュージーランドドル	株式 7銘柄	0.1%	0.1%

香港ドル	株式	38銘柄	1.2%	1.2%
シンガポールドル	株式	24銘柄	0.6%	0.6%
イスラエルシェケル	株式	9銘柄	0.2%	0.3%

## (b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	18,793	418,989.93	
		AMERICAN REALTY CAPITAL PROPERTIES	50,757	407,071.14	
		AMERICAN TOWER CORP	21,285	2,118,496.05	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	52,984	600,308.72	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,988	1,157,212.80	
		BOSTON PROPERTIES INC	8,271	1,105,915.41	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,755	356,910.30	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	6,735	443,903.85	
		DUKE REALTY CORP	18,773	379,965.52	
		EQUITY RESIDENTIAL	18,570	1,362,295.20	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,397	707,119.52	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	3,695	495,462.55	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	29,451	829,340.16	
		HCP, INC.	24,808	1,118,592.72	
		HEALTH CARE REIT INC	17,671	1,351,831.50	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	38,974	931,478.60	
		HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	323,000	216,410.00	
		IRON MOUNTAIN INC	8,269	328,692.75	
		KIMCO REALTY CORPORATION	22,451	574,296.58	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	7,065	265,573.35	
		MACERICH COMPANY/THE	7,263	597,817.53	
		PLUM CREEK TIMBER COMPANY	8,860	374,157.80	
		PROLOGIS INC	26,635	1,131,987.50	
PUBLIC STORAGE	7,644	1,413,757.80			
RAYONIER INC	7,400	205,868.00			
REALTY INCOME CORPORATION	11,892	577,951.20			
REGENCY CENTERS CORP	5,415	346,397.55			

	SIMON PROPERTY GROUP INC	16,555	3,038,339.15
	SL GREEN REALTY CORP	5,242	638,370.76
	UDR INC	14,748	458,367.84
	VENTAS INC	15,968	1,147,939.52
	VORNADO REALTY TRUST	9,109	1,056,279.64
	米ドル 合計	823,423	26,157,100.94 (3,125,773,562)
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,500	183,940.00
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	8,647	232,690.77
	カナダドル 合計	17,147	416,630.77 (42,908,803)
ユーロ	CORIO NV	4,225	169,063.37
	FONCIERE DES REGIONS	1,550	118,466.50
	GECINA SA	1,793	186,472.00
	ICADE	1,873	122,306.90
	KLEPIERRE	5,667	199,138.38
	UNIBAIL-RODAMCO SE	5,219	1,096,511.90
	ユーロ 合計	20,327	1,891,959.05 (276,282,780)
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	53,382	409,706.85
	HAMMERSON PLC	45,216	275,817.60
	INTU PROPERTIES PLC	54,855	184,038.52
	LAND SECURITIES GROUP PLC	40,324	465,742.20
	SEGRO PLC	46,280	172,161.60
	英ポンド 合計	240,057	1,507,466.77 (281,474,195)
オーストラリアドル	APA GROUP	54,632	417,934.80
	AUSNET SERVICES	95,413	127,376.35
	DEXUS PROPERTY GROUP	42,722	303,326.20
	FEDERATION CENTRES	90,000	253,800.00
	GOODMAN GROUP	98,927	581,690.76
	GPT GROUP	96,787	422,959.19
	LEND LEASE GROUP	27,382	435,099.98
	MIRVAC GROUP	210,942	386,023.86

	NOVION PROPERTY GROUP	124,971	274,936.20	
	SCENTRE GROUP	272,692	968,056.60	
	STOCKLAND	130,583	549,754.43	
	SYDNEY AIRPORT	57,042	279,505.80	
	TRANSURBAN GROUP	97,725	855,093.75	
	WESTFIELD CORP	103,094	929,907.88	
	オーストラリアドル 合計	1,502,912	6,785,465.80	(660,090,113)
香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	139,000	1,398,340.00	
	LINK REIT	126,500	6,072,000.00	
	香港ドル 合計	265,500	7,470,340.00	(115,117,939)
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	107,000	250,380.00	
	CAPITACOMMERCIAL TRUST	79,000	132,720.00	
	CAPITAMALL TRUST	125,000	250,000.00	
	SUNTEC REIT	135,000	261,900.00	
	シンガポールドル 合計	446,000	895,000.00	(81,257,050)
	合計		4,582,904,442	(4,582,904,442)

（注）金額欄の（ ）内は、外貨建有価証券にかかるものの内書きであり、また邦貨換算金額で表示しております。

通貨	銘柄数	組入投資証券 時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	投資証券 32銘柄	1.6%	68.2%
カナダドル	投資証券 2銘柄	0.0%	0.9%
ユーロ	投資証券 6銘柄	0.1%	6.0%
英ポンド	投資証券 5銘柄	0.1%	6.1%
オーストラリアドル	投資証券 14銘柄	0.3%	14.4%
香港ドル	投資証券 2銘柄	0.1%	2.5%
シンガポールドル	投資証券 4銘柄	0.0%	1.8%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表（デリバティブ取引に関する注記）」に記載しております。

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>

貸借対照表

（単位：円）

	（平成25年12月20日現在）	（平成26年12月22日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	65	65
親投資信託受益証券	4,322,902,803	3,065,278,855
未収入金	959,998	-
流動資産合計	4,323,862,866	3,065,278,920
資産合計	4,323,862,866	3,065,278,920
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	959,998	-
未払受託者報酬	14,854	18,079
未払委託者報酬	7,425	9,038
その他未払費用	1,854	2,259
流動負債合計	984,131	29,376
負債合計	984,131	29,376
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	2,756,364,692	1,668,518,902
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	1,566,514,043	1,396,730,642
元本等合計	4,322,878,735	3,065,249,544
純資産合計	4,322,878,735	3,065,249,544
負債純資産合計	4,323,862,866	3,065,278,920

注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 平成26年12月18日 至 平成26年12月22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）	（平成26年12月22日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	2,756,364,692口	1,668,518,902口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.5683円 (10,000口当たりの純資産額 15,683円)	1口当たり純資産額 1.8371円 (10,000口当たりの純資産額 18,371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26年12月18日 至 平成26年12月22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せん。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク</p>



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

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成26年12月22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）

該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

項 目	（平成25年12月20日現在）	（平成26年12月22日現在）
期首元本額	2,757,123,727円	1,668,126,811円
期中追加設定元本額	-円	392,091円
期中一部解約元本額	759,035円	-円

## 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘 柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	1,656,997,057	3,065,278,855	
合計		1,656,997,057	3,065,278,855	

## 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）

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

## 貸借対照表

（単位：円）

	（平成25年12月20日現在）	（平成26年12月22日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,541,731,613	1,064,816,504
国債証券	259,388,359,504	228,216,325,101
未収入金	3,729,684,634	1,578,665,681
未収利息	2,746,425,692	2,197,950,957
前払費用	69,111,934	45,641,092
流動資産合計	269,475,313,377	233,103,399,335
資産合計	269,475,313,377	233,103,399,335
負債の部		
流動負債		
未払金	1,836,070,006	1,119,678,341
未払解約金	1,127,450,146	9,784,400
流動負債合計	2,963,520,152	1,129,462,741
負債合計	2,963,520,152	1,129,462,741
純資産の部		
元本等		
元本	168,867,973,833	125,396,664,411
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	97,643,819,392	106,577,272,183
元本等合計	266,511,793,225	231,973,936,594
純資産合計	266,511,793,225	231,973,936,594
負債純資産合計	269,475,313,377	233,103,399,335

## 注記表

（重要な会計方針の注記）

項 目	自 平成26年12月18日 至 平成26年12月22日

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

## (貸借対照表に関する注記)

項目	(平成25年12月20日現在)	(平成26年12月22日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	168,867,973,833口	125,396,664,411口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.5782円 (10,000口当たりの純資産額 15,782円)	1口当たり純資産額 1.8499円 (10,000口当たりの純資産額 18,499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26年12月18日 至 平成26年12月22日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係る	(1) 金融商品の内容

<p>リスク</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 (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>
<p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p>	<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>
<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>	<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

<p>項目</p>	<p>（平成26年12月22日現在）</p>
-----------	------------------------

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

## (デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

## (その他の注記)

(平成25年12月20日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	170,049,110,793円
同期中における追加設定元本額	931,555円
同期中における一部解約元本額	1,182,068,515円
平成25年12月20日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	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
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>	2,739,134,966円
S M A M ・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	9,621,594,374円

S M A M ・ バランスファンド V A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	32,150,993,914円
S M A M ・ バランスファンド V A 3 7 . 5 < 適格機関投資家専用 >	9,829,101,529円
S M A M ・ バランスファンド V A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	22,143,586,792円
S M A M ・ バランスファンド V L 3 0 < 適格機関投資家限定 >	69,327,860円
S M A M ・ バランスファンド V L 5 0 < 適格機関投資家限定 >	160,997,541円
世界 6 資産 バランスファンド V A < 適格機関投資家限定 >	32,035,727円
S M A M ・ バランスファンド V A 7 5 < 適格機関投資家専用 >	1,336,175,161円
S M A M ・ バランスファンド V L 国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	182,364,742円
S M A M ・ インデックス ・ バランス V A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	1,917,564,089円
S M A M ・ インデックス ・ バランス V A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	2,592,653,310円
S M A M ・ バランスファンド V A 4 0 < 適格機関投資家専用 >	6,496,007,155円
S M A M ・ バランスファンド V A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	12,207,828,739円
S M A M ・ バランス V A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	889,560,582円
S M A M ・ 外国債券パッシブファンド V A < 適格機関投資家限定 >	18,372,787,853円
三井住友 ・ 外国債券インデックスファンド ・ V A S ( 適格機関投資家専用 )	1,705,209,184円
三井住友 ・ 5 資産 バランスファンド ・ V A S ( 適格機関投資家専用 )	6,915,935,789円
S M A M ・ グローバル バランス 4 0 V A < 適格機関投資家限定 >	313,491,697円
S M A M ・ バランスファンド V A 2 0 < 適格機関投資家専用 >	5,346,105,812円
三井住友 ・ 7 資産 バランスファンド ・ V A S ( 適格機関投資家専用 )	23,692,929,757円
S M A M ・ アセット バランスファンド V A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	238,771,107円
S M A M ・ アセット バランスファンド V A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	73,826,314円
S M A M ・ アセット バランスファンド V A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	20,724,711円
S M A M ・ アセット バランスファンド V A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	276,708,641円
S M A M ・ アセット バランスファンド V A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	990,037,268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 >	299,755,363円
S M A M ・ アセット バランスファンド V A 2 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	275,250,718円
S M A M ・ アセット バランスファンド V A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 >	82,841,102円
S M A M ・ アセット バランスファンド V A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	9,383,177円
S M A M ・ アセット バランスファンド V A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 >	2,374,760,671円
S M A M ・ アセット バランスファンド V A 2 0 T 2 < 適格機関投資家専用 >	63,057,691円
S M A M ・ F G 新興国重視型 バランス 2 0 V A < 適格機関投資家限定 >	8,078,015円
S M A M ・ F G グローバル バランス 2 5 V A < 適格機関投資家限定 >	34,877,333円
S M A M ・ グローバル ・ マルチアセット ・ グロース ・ ファンド ( 安定成長型 ) < 適格機関投資家限定 >	1,374,755円
S M A M ・ 年金マルチ ・ インカム ・ ダイナミック ・ アロケーション ・ ファンド < 適格機関投資家限定 >	1,176,399円
S M A M ・ 年金マルチ ・ インカム ・ ダイナミック ・ アロケーション ・ ファンド < 適格機関投資家限定 >	1,193,905円
合計	168,867,973,833円

(平成26年12月22日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	126,245,890,066円
同期中における追加設定元本額	13,610,030円
同期中における一部解約元本額	862,835,685円
平成26年12月22日現在における元本の内訳	

三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	5,750,369,855円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	235,325,474円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	689,551,532円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	366,254,230円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	53,472,824円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	6,392,117円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	12,135,052円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	10,557,240円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	13,165,584円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	6,561,168円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	13,031,876円
三井住友・DC年金バランスゼロ(債券型)	10,802円
SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	1,656,997,057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>	8,281,231,141円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	27,025,046,033円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	8,402,775,640円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	19,054,810,233円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	57,188,611円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	147,687,231円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	26,486,345円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	1,234,022,023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>	157,427,139円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,612,883,781円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,200,102,287円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	5,808,051,645円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	10,071,431,073円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	492,635,527円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	15,637,050,930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)	1,425,184,434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)	5,455,545,203円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	261,625,761円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	1,013,231,098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)	4,380,029,786円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	190,654,399円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	58,078,380円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	17,987,803円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	229,155,570円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	777,765,012円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	241,490,693円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	220,365,663円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	66,476,984円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	6,182,104円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,949,052,459円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	47,711,844円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定>	4,096,042円
SMAM・FGグローバルバランス25VA<適格機関投資家限定>	28,021,117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>	595,573円



S M A M ・ 年金マルチ ・ インカム ・ ダイナミック ・ アロケーション ・ ファンド < 適格機関投資家限定 >	375,141円
S M A M ・ 年金マルチ ・ インカム ・ ダイナミック ・ アロケーション ・ ファンド < 適格機関投資家限定 >	384,895円
合計	125,396,664,411円

## 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B 0.25	5,000,000.00	4,997,656.25	
		US TREASURY N/B 0.25	5,000,000.00	4,996,875.00	
		US TREASURY N/B 0.25	5,000,000.00	4,995,703.15	
		US TREASURY N/B 0.25	8,000,000.00	7,981,250.00	
		US TREASURY N/B 0.375	4,000,000.00	4,001,250.00	
		US TREASURY N/B 0.375	5,000,000.00	5,000,390.65	
		US TREASURY N/B 0.375	4,000,000.00	4,000,937.52	
		US TREASURY N/B 0.375	7,000,000.00	6,998,359.41	
		US TREASURY N/B 0.5	6,000,000.00	6,001,406.28	
		US TREASURY N/B 0.5	4,000,000.00	3,951,875.00	
		US TREASURY N/B 0.625	4,000,000.00	4,005,937.52	
		US TREASURY N/B 0.625	7,000,000.00	7,004,921.91	
		US TREASURY N/B 0.625	5,000,000.00	4,998,046.90	
		US TREASURY N/B 0.625	4,000,000.00	3,996,875.00	
		US TREASURY N/B 0.625	5,000,000.00	4,968,750.00	
		US TREASURY N/B 0.625	6,000,000.00	5,939,062.50	
		US TREASURY N/B 0.625	5,000,000.00	4,931,250.00	
		US TREASURY N/B 0.75	6,000,000.00	6,000,468.78	
		US TREASURY N/B 0.75	4,000,000.00	3,996,875.00	
		US TREASURY N/B 0.75	5,000,000.00	4,978,125.00	

US TREASURY N/B 0.75	5,000,000.00	4,928,515.65	
US TREASURY N/B 0.75	3,000,000.00	2,953,125.00	
US TREASURY N/B 0.875	5,000,000.00	5,022,656.25	
US TREASURY N/B 0.875	6,000,000.00	6,023,906.28	
US TREASURY N/B 0.875	6,000,000.00	6,019,218.78	
US TREASURY N/B 0.875	5,000,000.00	5,012,500.00	
US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	3,005,390.64	
US TREASURY N/B 0.875	6,000,000.00	6,004,218.78	
US TREASURY N/B 0.875	3,000,000.00	2,993,671.89	
US TREASURY N/B 0.875	4,000,000.00	3,980,000.00	
US TREASURY N/B 1	2,000,000.00	2,014,062.50	
US TREASURY N/B 1	5,000,000.00	5,035,546.90	
US TREASURY N/B 1	4,000,000.00	4,027,500.00	
US TREASURY N/B 1	5,000,000.00	5,019,140.65	
US TREASURY N/B 1	4,000,000.00	3,998,750.00	
US TREASURY N/B 1	3,000,000.00	2,924,296.89	
US TREASURY N/B 1	6,000,000.00	5,829,843.78	
US TREASURY N/B 1	2,000,000.00	1,942,812.50	
US TREASURY N/B 1	6,000,000.00	5,811,093.78	
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,945,625.00	
US TREASURY N/B 1.125	2,800,000.00	2,717,312.50	
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000.00	2,906,250.00	
US TREASURY N/B 1.25	4,000,000.00	3,972,187.52	
US TREASURY N/B 1.25	4,000,000.00	3,958,750.00	
US TREASURY N/B 1.25	4,000,000.00	3,951,250.00	
US TREASURY N/B 1.25	2,000,000.00	1,965,625.00	
US TREASURY N/B 1.25	3,000,000.00	2,932,265.64	
US TREASURY N/B 1.375	2,000,000.00	2,019,687.50	
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	4,003,437.52	
US TREASURY N/B 1.375	6,500,000.00	6,490,351.59	
US TREASURY N/B 1.375	5,000,000.00	4,990,625.00	
US TREASURY N/B 1.375	3,000,000.00	2,989,218.75	
US TREASURY N/B 1.375	5,000,000.00	4,970,312.50	
US TREASURY N/B 1.375	4,000,000.00	3,940,312.52	
US TREASURY N/B 1.375	5,000,000.00	4,899,609.40	

US TREASURY N/B 1.5	5,500,000.00	5,583,359.37	
US TREASURY N/B 1.5	6,000,000.00	6,092,343.78	
US TREASURY N/B 1.5	5,000,000.00	5,021,093.75	
US TREASURY N/B 1.5	4,700,000.00	4,702,937.50	
US TREASURY N/B 1.5	3,000,000.00	2,990,625.00	
US TREASURY N/B 1.625	5,000,000.00	5,016,406.25	
US TREASURY N/B 1.625	5,000,000.00	5,012,500.00	
US TREASURY N/B 1.625	5,000,000.00	5,008,593.75	
US TREASURY N/B 1.625	2,000,000.00	2,001,406.26	
US TREASURY N/B 1.625	3,000,000.00	2,912,578.14	
US TREASURY N/B 1.625	4,500,000.00	4,360,078.12	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,055,546.89	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	3,036,328.14	
US TREASURY N/B 1.75	4,300,000.00	4,275,812.50	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,944,921.89	
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000.00	2,918,437.50	
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000.00	3,068,671.89	
US TREASURY N/B 1.875	6,000,000.00	6,136,875.00	
US TREASURY N/B 1.875	6,000,000.00	6,136,875.00	
US TREASURY N/B 2	4,000,000.00	4,071,875.00	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,033,750.00	
US TREASURY N/B 2	3,300,000.00	3,329,648.45	
US TREASURY N/B 2	5,000,000.00	5,037,500.00	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,016,640.64	
US TREASURY N/B 2	2,000,000.00	2,007,500.00	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,005,859.39	
US TREASURY N/B 2	4,000,000.00	4,005,937.52	
US TREASURY N/B 2	3,000,000.00	3,006,328.14	
US TREASURY N/B 2	4,100,000.00	4,105,445.33	
US TREASURY N/B 2	7,500,000.00	7,464,843.75	
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	3,054,843.75	
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	3,062,578.14	
US TREASURY N/B 2.125	3,500,000.00	3,559,062.50	
US TREASURY N/B 2.125	5,000,000.00	5,067,578.15	
US TREASURY N/B 2.125	2,000,000.00	2,021,250.00	

US TREASURY N/B 2.125	7,000,000.00	7,073,828.16	
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000.00	3,030,000.00	
US TREASURY N/B 2.25	4,000,000.00	4,133,750.00	
US TREASURY N/B 2.25	2,000,000.00	2,064,218.76	
US TREASURY N/B 2.25	5,000,000.00	5,099,218.75	
US TREASURY N/B 2.25	2,000,000.00	2,039,062.50	
US TREASURY N/B 2.25	2,000,000.00	2,036,562.50	
US TREASURY N/B 2.25	3,000,000.00	3,019,453.14	
US TREASURY N/B 2.375	5,500,000.00	5,637,070.34	
US TREASURY N/B 2.375	4,000,000.00	4,145,000.00	
US TREASURY N/B 2.375	2,000,000.00	2,073,906.26	
US TREASURY N/B 2.375	7,000,000.00	7,121,406.25	
US TREASURY N/B 2.5	3,000,000.00	3,117,656.25	
US TREASURY N/B 2.5	5,000,000.00	5,157,421.90	
US TREASURY N/B 2.5	9,000,000.00	9,262,968.75	
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,106,562.52	
US TREASURY N/B 2.625	5,000,000.00	5,146,093.75	
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,178,125.00	
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,181,250.00	
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000.00	4,173,750.00	
US TREASURY N/B 2.625	7,500,000.00	7,819,335.97	
US TREASURY N/B 2.75	4,000,000.00	4,159,375.00	
US TREASURY N/B 2.75	5,000,000.00	5,226,562.50	
US TREASURY N/B 2.75	4,000,000.00	4,190,625.00	
US TREASURY N/B 2.75	5,000,000.00	5,254,296.90	
US TREASURY N/B 2.75	8,200,000.00	8,627,296.91	
US TREASURY N/B 2.75	7,000,000.00	7,363,671.91	
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000.00	1,990,781.26	
US TREASURY N/B 2.75	13,000,000.00	12,929,921.94	
US TREASURY N/B 2.875	3,000,000.00	3,158,671.89	
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	4,165,312.52	
US TREASURY N/B 3	3,000,000.00	3,127,031.25	
US TREASURY N/B 3	4,000,000.00	4,191,250.00	
US TREASURY N/B 3	7,000,000.00	7,324,843.75	
US TREASURY N/B 3	1,000,000.00	1,045,468.75	

US TREASURY N/B 3.125	5,000,000.00	5,230,468.75	
US TREASURY N/B 3.125	3,200,000.00	3,358,000.00	
US TREASURY N/B 3.125	4,000,000.00	4,211,562.52	
US TREASURY N/B 3.125	2,000,000.00	2,132,031.26	
US TREASURY N/B 3.125	5,000,000.00	5,362,109.40	
US TREASURY N/B 3.125	2,000,000.00	2,150,781.26	
US TREASURY N/B 3.125	3,000,000.00	3,216,328.14	
US TREASURY N/B 3.125	3,000,000.00	3,211,875.00	
US TREASURY N/B 3.25	4,000,000.00	4,159,062.52	
US TREASURY N/B 3.25	4,000,000.00	4,168,750.00	
US TREASURY N/B 3.25	4,000,000.00	4,174,687.52	
US TREASURY N/B 3.25	4,000,000.00	4,203,125.00	
US TREASURY N/B 3.25	4,000,000.00	4,220,000.00	
US TREASURY N/B 3.375	5,000,000.00	5,410,156.25	
US TREASURY N/B 3.375	4,000,000.00	4,483,125.00	
US TREASURY N/B 3.5	4,500,000.00	4,824,843.75	
US TREASURY N/B 3.5	4,500,000.00	4,905,351.58	
US TREASURY N/B 3.5	2,000,000.00	2,290,781.26	
US TREASURY N/B 3.625	7,000,000.00	7,632,734.41	
US TREASURY N/B 3.625	6,000,000.00	6,576,562.50	
US TREASURY N/B 3.625	7,000,000.00	7,704,921.91	
US TREASURY N/B 3.625	6,000,000.00	7,025,625.00	
US TREASURY N/B 3.625	3,000,000.00	3,515,390.64	
US TREASURY N/B 3.75	4,000,000.00	4,357,812.52	
US TREASURY N/B 3.75	3,000,000.00	3,599,531.25	
US TREASURY N/B 3.75	3,000,000.00	3,590,390.64	
US TREASURY N/B 3.875	6,000,000.00	6,523,125.00	
US TREASURY N/B 3.875	2,000,000.00	2,434,843.76	
US TREASURY N/B 4	2,500,000.00	2,741,406.25	
US TREASURY N/B 4.25	3,000,000.00	3,271,640.64	
US TREASURY N/B 4.25	2,000,000.00	2,580,781.26	
US TREASURY N/B 4.375	1,200,000.00	1,567,218.75	
US TREASURY N/B 4.375	1,500,000.00	1,960,312.50	
US TREASURY N/B 4.375	3,000,000.00	3,932,109.39	
US TREASURY N/B 4.375	2,000,000.00	2,641,406.26	

	US TREASURY N/B 4.5	2,400,000.00	2,514,187.51	
	US TREASURY N/B 4.5	3,000,000.00	3,257,812.50	
	US TREASURY N/B 4.5	2,500,000.00	3,329,296.87	
	US TREASURY N/B 4.5	1,000,000.00	1,329,531.25	
	US TREASURY N/B 4.5	2,000,000.00	2,657,968.76	
	US TREASURY N/B 4.625	4,200,000.00	4,513,687.50	
	US TREASURY N/B 4.625	3,000,000.00	3,246,796.89	
	US TREASURY N/B 4.625	3,500,000.00	4,742,226.58	
	US TREASURY N/B 4.75	3,000,000.00	3,295,078.14	
	US TREASURY N/B 4.75	3,000,000.00	4,177,265.64	
	US TREASURY N/B 4.875	3,400,000.00	3,641,984.39	
	US TREASURY N/B 5.125	3,700,000.00	3,940,210.95	
	US TREASURY N/B 5.25	1,000,000.00	1,341,250.00	
	US TREASURY N/B 5.25	1,000,000.00	1,344,609.38	
	US TREASURY N/B 5.375	1,320,000.00	1,839,234.38	
	US TREASURY N/B 5.5	1,000,000.00	1,365,703.13	
	US TREASURY N/B 6	1,000,000.00	1,370,234.38	
	US TREASURY N/B 6.125	1,000,000.00	1,422,812.50	
	US TREASURY N/B 6.25	1,500,000.00	1,997,812.50	
	US TREASURY N/B 6.25	1,000,000.00	1,494,218.75	
	US TREASURY N/B 6.5	500,000.00	719,570.31	
	US TREASURY N/B 7.25	4,000,000.00	4,375,937.52	
	US TREASURY N/B 8	1,800,000.00	2,505,093.75	
	US TREASURY N/B 8.75	1,000,000.00	1,187,656.25	
	US TREASURY N/B 8.75	1,000,000.00	1,376,093.75	
	US TREASURY N/B 8.875	2,100,000.00	2,730,328.12	
	米ドル 合計	731,220,000.00	761,528,322.04	(91,002,634,483)
カナダドル	CANADA-GOV'T 1	3,000,000.00	2,999,730.00	
	CANADA-GOV'T 1.25	1,000,000.00	1,000,990.00	
	CANADA-GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,010,100.00	
	CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	2,021,900.00	
	CANADA-GOV'T 1.5	1,000,000.00	1,011,190.00	
	CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000.00	1,963,360.00	
	CANADA-GOV'T 1.75	2,000,000.00	2,039,140.00	

	CANADA-GOV'T 1.75	1,000,000.00	1,016,800.00	
	CANADA-GOV'T 2	2,000,000.00	2,028,500.00	
	CANADA-GOV'T 2.5	2,000,000.00	2,117,000.00	
	CANADA-GOV'T 2.75	2,000,000.00	2,058,640.00	
	CANADA-GOV'T 2.75	1,000,000.00	1,076,500.00	
	CANADA-GOV'T 3	3,000,000.00	3,055,800.00	
	CANADA-GOV'T 3.25	1,000,000.00	1,106,510.00	
	CANADA-GOV'T 3.5	2,000,000.00	2,216,980.00	
	CANADA-GOV'T 3.5	1,000,000.00	1,253,000.00	
	CANADA-GOV'T 3.75	2,500,000.00	2,764,500.00	
	CANADA-GOV'T 4	2,000,000.00	2,085,760.00	
	CANADA-GOV'T 4	2,000,000.00	2,144,760.00	
	CANADA-GOV'T 4	4,000,000.00	5,298,480.00	
	CANADA-GOV'T 4.25	2,500,000.00	2,759,000.00	
	CANADA-GOV'T 5	2,000,000.00	2,933,680.00	
	CANADA-GOV'T 5.75	1,500,000.00	2,174,025.00	
	CANADA-GOV'T 5.75	1,500,000.00	2,290,935.00	
	CANADA-GOV'T 8	1,000,000.00	1,656,620.00	
	カナダドル 合計	46,000,000.00	52,083,900.00 (5,364,120,861)	
メキシコペソ	MEXICAN BONOS 7.25	80,000,000.00	85,524,000.00	
	MEXICAN BONOS 7.75	20,000,000.00	21,910,000.00	
	MEXICAN BONOS 8	50,000,000.00	56,520,000.00	
	MEXICAN BONOS 8	20,000,000.00	22,933,000.00	
	MEXICAN BONOS 8.5	50,000,000.00	59,502,500.00	
	MEXICAN BONOS 8.5	40,000,000.00	48,226,000.00	
	メキシコペソ 合計	260,000,000.00	294,615,500.00 (2,409,954,790)	
ユーロ	BELGIAN 0326 4	1,000,000.00	1,373,980.00	
	BELGIAN 0291 5.5	2,500,000.00	3,793,125.00	
	BELGIAN 0300 5.5	740,000.00	852,665.00	
	BELGIAN 0304 5	2,500,000.00	3,927,325.00	
	BELGIAN 0307 3.25	2,000,000.00	2,115,660.00	
	BELGIAN 0308 4	1,500,000.00	1,872,570.00	
	BELGIAN 0309 4	1,500,000.00	1,636,395.00	
	BELGIAN 0312 4	1,000,000.00	1,129,730.00	

BELGIAN 0315 4	1,500,000.00	1,747,350.00	
BELGIAN 0318 3.75	2,000,000.00	2,394,660.00	
BELGIAN 0319 2.75	1,000,000.00	1,035,080.00	
BELGIAN 0320 4.25	1,500,000.00	2,247,420.00	
BELGIAN 0321 4.25	1,700,000.00	2,133,160.00	
BELGIAN 0323 3.5	2,000,000.00	2,176,100.00	
BELGIAN 0324 4.5	1,000,000.00	1,358,950.00	
BELGIAN 0325 4.25	2,000,000.00	2,552,460.00	
BELGIAN 0327 3	2,000,000.00	2,266,360.00	
BELGIAN 0328 2.25	2,000,000.00	2,251,260.00	
BELGIAN 0329 1.25	1,000,000.00	1,041,680.00	
BELGIAN 0331 3.75	1,000,000.00	1,409,570.00	
BELGIAN 0332 2.6	2,000,000.00	2,309,900.00	
BTAN 1	2,500,000.00	2,565,250.00	
BTAN 1.75	2,500,000.00	2,596,250.00	
BTAN 2.25	4,000,000.00	4,107,000.00	
BTAN 2.5	3,600,000.00	3,744,108.00	
BTPS 1.15	2,000,000.00	2,022,460.00	
BTPS 1.5	2,000,000.00	2,036,100.00	
BTPS 2.25	1,500,000.00	1,536,045.00	
BTPS 3.5	1,000,000.00	1,078,430.00	
BTPS 3.5	3,400,000.00	3,705,932.00	
BTPS 3.5	2,000,000.00	2,201,060.00	
BTPS 3.5	1,000,000.00	1,108,450.00	
BTPS 3.75	3,000,000.00	3,127,350.00	
BTPS 3.75	3,700,000.00	3,889,921.00	
BTPS 3.75	3,000,000.00	3,437,490.00	
BTPS 3.75	2,000,000.00	2,288,200.00	
BTPS 3.75	3,300,000.00	3,781,965.00	
BTPS 3.75	2,000,000.00	2,319,260.00	
BTPS 4	2,500,000.00	2,677,075.00	
BTPS 4	3,500,000.00	4,039,000.00	
BTPS 4	3,500,000.00	4,011,980.00	
BTPS 4.25	4,400,000.00	4,990,172.00	
BTPS 4.25	4,500,000.00	5,169,060.00	



BTPS 4.25	3,300,000.00	3,827,241.00	
BTPS 4.5	4,000,000.00	4,456,200.00	
BTPS 4.5	3,000,000.00	3,388,410.00	
BTPS 4.5	3,700,000.00	4,246,046.00	
BTPS 4.5	2,700,000.00	3,160,134.00	
BTPS 4.5	2,800,000.00	3,395,084.00	
BTPS 4.5	3,000,000.00	3,668,400.00	
BTPS 4.5	3,000,000.00	3,689,250.00	
BTPS 4.75	2,500,000.00	2,679,450.00	
BTPS 4.75	3,000,000.00	3,285,600.00	
BTPS 4.75	2,000,000.00	2,195,600.00	
BTPS 4.75	3,600,000.00	4,363,488.00	
BTPS 4.75	3,500,000.00	4,325,825.00	
BTPS 4.75	2,000,000.00	2,513,200.00	
BTPS 4.75	1,000,000.00	1,284,080.00	
BTPS 5	2,000,000.00	2,473,400.00	
BTPS 5	3,000,000.00	3,819,540.00	
BTPS 5	2,970,000.00	3,878,760.60	
BTPS 5	2,500,000.00	3,292,875.00	
BTPS 5	3,500,000.00	4,593,750.00	
BTPS 5.25	4,000,000.00	4,470,400.00	
BTPS 5.25	3,700,000.00	4,888,440.00	
BTPS 5.5	2,500,000.00	3,194,075.00	
BTPS 5.5	3,000,000.00	3,840,750.00	
BTPS 5.75	2,200,000.00	3,115,420.00	
BTPS 6	4,100,000.00	5,896,210.00	
BTPS 6.5	2,960,000.00	4,286,080.00	
BTPS 7.25	1,000,000.00	1,516,180.00	
BTPS 9	2,000,000.00	3,178,200.00	
BUNDESUBL-159 2	3,000,000.00	3,073,410.00	
BUNDESUBL-160 2.75	4,000,000.00	4,145,920.00	
BUNDESUBL-161 1.25	2,000,000.00	2,047,960.00	
BUNDESUBL-162 0.75	2,500,000.00	2,544,500.00	
BUNDESUBL-163 0.5	2,000,000.00	2,025,700.00	
BUNDESUBL-164 0.5	2,000,000.00	2,031,360.00	

BUNDESUBL-165 0.5	2,000,000.00	2,034,760.00	
BUNDESUBL-166 0.25	2,000,000.00	2,019,760.00	
BUNDESUBL-167 1	2,000,000.00	2,079,040.00	
BUNDESUBL-168 1	1,000,000.00	1,042,200.00	
BUNDESUBL-169 0.5	1,000,000.00	1,021,150.00	
DEUTSCHLAND REP 1	1,000,000.00	1,038,180.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,500,000.00	2,724,825.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,500,000.00	2,727,325.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,000,000.00	2,181,400.00	
DEUTSCHLAND REP 1.5	2,000,000.00	2,172,900.00	
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,500,000.00	2,772,875.00	
DEUTSCHLAND REP 1.75	2,000,000.00	2,219,460.00	
DEUTSCHLAND REP 2	2,000,000.00	2,245,900.00	
DEUTSCHLAND REP 2	2,500,000.00	2,831,250.00	
DEUTSCHLAND REP 2.25	1,500,000.00	1,683,405.00	
DEUTSCHLAND REP 2.25	2,000,000.00	2,273,200.00	
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,000,000.00	2,284,500.00	
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,700,000.00	3,399,840.00	
DEUTSCHLAND REP 3	3,000,000.00	3,481,140.00	
DEUTSCHLAND REP 3.25	3,000,000.00	3,484,110.00	
DEUTSCHLAND REP 3.25	3,000,000.00	3,598,200.00	
DEUTSCHLAND REP 3.25	2,000,000.00	2,846,700.00	
DEUTSCHLAND REP 3.5	4,200,000.00	4,355,484.00	
DEUTSCHLAND REP 3.5	4,000,000.00	4,634,800.00	
DEUTSCHLAND REP 3.75	3,000,000.00	3,233,490.00	
DEUTSCHLAND REP 3.75	4,500,000.00	5,188,635.00	
DEUTSCHLAND REP 4	3,900,000.00	4,143,360.00	
DEUTSCHLAND REP 4	3,000,000.00	3,370,290.00	
DEUTSCHLAND REP 4	2,700,000.00	4,089,285.00	
DEUTSCHLAND REP 4.25	2,000,000.00	2,218,800.00	
DEUTSCHLAND REP 4.25	3,200,000.00	3,687,200.00	
DEUTSCHLAND REP 4.25	2,000,000.00	3,200,500.00	
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,300,000.00	1,938,300.00	
DEUTSCHLAND REP 4.75	2,600,000.00	4,192,760.00	
DEUTSCHLAND REP 4.75	1,900,000.00	3,281,490.00	

DEUTSCHLAND REP 5.5	2,300,000.00	3,800,405.00	
DEUTSCHLAND REP 5.625	2,080,000.00	3,304,184.00	
DEUTSCHLAND REP 6	890,000.00	970,616.20	
DEUTSCHLAND REP 6.25	2,200,000.00	3,328,600.00	
DEUTSCHLAND REP 6.25	1,000,000.00	1,739,930.00	
DEUTSCHLAND REP 6.5	1,500,000.00	2,520,900.00	
FINNISH GOV'T 1.625	2,000,000.00	2,166,660.00	
FINNISH GOV'T 1.75	1,200,000.00	1,228,224.00	
FINNISH GOV'T 2.75	1,100,000.00	1,327,480.00	
FINNISH GOV'T 3.375	1,200,000.00	1,400,520.00	
FINNISH GOV'T 3.5	1,000,000.00	1,196,780.00	
FINNISH GOV'T 3.875	1,000,000.00	1,106,480.00	
FINNISH GOV'T 4	1,000,000.00	1,316,030.00	
FINNISH GOV'T 4.375	1,000,000.00	1,192,200.00	
FRANCE O.A.T. 0.25	2,000,000.00	2,010,900.00	
FRANCE O.A.T. 1	3,000,000.00	3,097,950.00	
FRANCE O.A.T. 1	1,000,000.00	1,035,530.00	
FRANCE O.A.T. 1	1,000,000.00	1,036,800.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	3,000,000.00	3,270,390.00	
FRANCE O.A.T. 1.75	3,000,000.00	3,245,100.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	2,300,000.00	2,593,940.00	
FRANCE O.A.T. 2.25	2,000,000.00	2,262,600.00	
FRANCE O.A.T. 2.5	4,500,000.00	5,067,585.00	
FRANCE O.A.T. 2.5	1,000,000.00	1,144,050.00	
FRANCE O.A.T. 2.75	3,000,000.00	3,533,850.00	
FRANCE O.A.T. 3	5,000,000.00	5,897,900.00	
FRANCE O.A.T. 3.25	3,700,000.00	3,862,171.00	
FRANCE O.A.T. 3.25	4,800,000.00	5,709,840.00	
FRANCE O.A.T. 3.25	1,000,000.00	1,297,130.00	
FRANCE O.A.T. 3.5	5,000,000.00	5,854,750.00	
FRANCE O.A.T. 3.5	4,000,000.00	5,029,400.00	
FRANCE O.A.T. 3.75	5,000,000.00	5,440,000.00	
FRANCE O.A.T. 3.75	5,000,000.00	5,855,500.00	
FRANCE O.A.T. 3.75	4,700,000.00	5,689,256.00	
FRANCE O.A.T. 4	4,000,000.00	4,530,720.00	

FRANCE O.A.T. 4	3,200,000.00	4,554,784.00	
FRANCE O.A.T. 4	2,370,000.00	3,673,215.60	
FRANCE O.A.T. 4	1,500,000.00	2,353,995.00	
FRANCE O.A.T. 4.25	4,500,000.00	5,044,050.00	
FRANCE O.A.T. 4.25	4,000,000.00	4,640,200.00	
FRANCE O.A.T. 4.25	6,400,000.00	7,538,240.00	
FRANCE O.A.T. 4.25	5,000,000.00	6,525,750.00	
FRANCE O.A.T. 4.5	3,200,000.00	4,969,760.00	
FRANCE O.A.T. 4.75	2,600,000.00	3,976,882.00	
FRANCE O.A.T. 5	3,600,000.00	3,932,748.00	
FRANCE O.A.T. 5.5	4,500,000.00	6,948,450.00	
FRANCE O.A.T. 5.75	3,200,000.00	5,296,416.00	
FRANCE O.A.T. 6	2,500,000.00	3,788,575.00	
FRANCE O.A.T. 8.5	850,000.00	1,190,620.50	
FRANCE O.A.T. 8.5	2,200,000.00	3,615,656.00	
IRISH GOVT 3.4	1,000,000.00	1,183,380.00	
IRISH GOVT 3.9	1,000,000.00	1,217,800.00	
IRISH GOVT 4.4	1,500,000.00	1,764,525.00	
IRISH GOVT 4.5	1,000,000.00	1,157,350.00	
IRISH GOVT 4.5	1,490,000.00	1,794,004.70	
IRISH GOVT 4.6	800,000.00	848,240.00	
IRISH GOVT 5	1,000,000.00	1,250,280.00	
IRISH GOVT 5.4	1,500,000.00	2,063,700.00	
IRISH GOVT 5.5	500,000.00	573,575.00	
IRISH GOVT 5.9	1,300,000.00	1,635,270.00	
ITALY GOV'T INT 5.75	1,000,000.00	1,079,150.00	
NETHERLANDS GOVT 0	2,000,000.00	2,000,800.00	
NETHERLANDS GOVT 0.25	1,000,000.00	1,004,380.00	
NETHERLANDS GOVT 0.5	1,000,000.00	1,011,850.00	
NETHERLANDS GOVT 1.25	1,500,000.00	1,556,895.00	
NETHERLANDS GOVT 1.25	2,000,000.00	2,095,700.00	
NETHERLANDS GOVT 1.75	2,200,000.00	2,409,770.00	
NETHERLANDS GOVT 2	2,000,000.00	2,232,160.00	
NETHERLANDS GOVT 2.25	2,000,000.00	2,264,060.00	
NETHERLANDS GOVT 2.5	2,000,000.00	2,103,860.00	

NETHERLANDS GOVT 2.5	1,600,000.00	1,922,608.00	
NETHERLANDS GOVT 2.75	500,000.00	654,865.00	
NETHERLANDS GOVT 3.25	1,500,000.00	1,782,600.00	
NETHERLANDS GOVT 3.5	2,000,000.00	2,362,760.00	
NETHERLANDS GOVT 3.75	1,000,000.00	1,255,330.00	
NETHERLANDS GOVT 3.75	2,000,000.00	3,043,560.00	
NETHERLANDS GOVT 4	2,300,000.00	2,444,509.00	
NETHERLANDS GOVT 4	2,500,000.00	2,852,550.00	
NETHERLANDS GOVT 4	1,500,000.00	1,765,620.00	
NETHERLANDS GOVT 4	1,700,000.00	2,562,325.00	
NETHERLANDS GOVT 4.5	2,000,000.00	2,230,860.00	
NETHERLANDS GOVT 5.5	1,500,000.00	2,325,450.00	
REP OF AUSTRIA 1.65	1,000,000.00	1,084,200.00	
REP OF AUSTRIA 1.95	1,000,000.00	1,082,480.00	
REP OF AUSTRIA 3.15	1,000,000.00	1,379,650.00	
REP OF AUSTRIA 3.2	1,700,000.00	1,819,136.00	
REP OF AUSTRIA 3.4	1,000,000.00	1,224,200.00	
REP OF AUSTRIA 3.5	2,000,000.00	2,421,560.00	
REP OF AUSTRIA 3.65	2,000,000.00	2,464,100.00	
REP OF AUSTRIA 3.8	500,000.00	864,040.00	
REP OF AUSTRIA 3.9	2,000,000.00	2,406,960.00	
REP OF AUSTRIA 4	1,000,000.00	1,069,800.00	
REP OF AUSTRIA 4.15	1,300,000.00	1,978,600.00	
REP OF AUSTRIA 4.3	1,500,000.00	1,676,970.00	
REP OF AUSTRIA 4.35	2,200,000.00	2,597,210.00	
REP OF AUSTRIA 4.65	1,000,000.00	1,142,680.00	
REP OF AUSTRIA 4.85	1,000,000.00	1,426,050.00	
REP OF AUSTRIA 6.25	1,000,000.00	1,628,300.00	
SPANISH GOV'T 2.1	2,000,000.00	2,071,600.00	
SPANISH GOV'T 2.75	1,000,000.00	1,082,780.00	
SPANISH GOV'T 2.75	2,000,000.00	2,189,260.00	
SPANISH GOV'T 3.15	2,800,000.00	2,885,260.00	
SPANISH GOV'T 3.25	2,000,000.00	2,075,960.00	
SPANISH GOV'T 3.3	2,000,000.00	2,090,460.00	
SPANISH GOV'T 3.75	3,200,000.00	3,565,760.00	

	SPANISH GOV'T 3.8	3,500,000.00	3,739,575.00	
	SPANISH GOV'T 3.8	2,000,000.00	2,375,700.00	
	SPANISH GOV'T 4	3,000,000.00	3,466,590.00	
	SPANISH GOV'T 4.1	2,000,000.00	2,239,000.00	
	SPANISH GOV'T 4.2	2,050,000.00	2,539,601.50	
	SPANISH GOV'T 4.25	3,000,000.00	3,208,800.00	
	SPANISH GOV'T 4.3	3,000,000.00	3,489,390.00	
	SPANISH GOV'T 4.5	2,500,000.00	2,792,875.00	
	SPANISH GOV'T 4.6	3,500,000.00	4,092,550.00	
	SPANISH GOV'T 4.65	2,500,000.00	3,173,075.00	
	SPANISH GOV'T 4.7	1,500,000.00	1,986,120.00	
	SPANISH GOV'T 4.8	4,300,000.00	5,469,944.00	
	SPANISH GOV'T 4.85	3,000,000.00	3,646,200.00	
	SPANISH GOV'T 4.9	1,500,000.00	2,044,980.00	
	SPANISH GOV'T 5.15	1,500,000.00	1,999,080.00	
	SPANISH GOV'T 5.15	1,000,000.00	1,413,680.00	
	SPANISH GOV'T 5.4	3,000,000.00	3,905,640.00	
	SPANISH GOV'T 5.5	3,380,000.00	3,807,130.60	
	SPANISH GOV'T 5.5	3,000,000.00	3,798,600.00	
	SPANISH GOV'T 5.75	2,200,000.00	3,212,506.00	
	SPANISH GOV'T 5.85	2,500,000.00	3,280,075.00	
	SPANISH GOV'T 5.9	1,000,000.00	1,396,880.00	
	SPANISH GOV'T 6	2,400,000.00	3,453,840.00	
	ユーロ 合計	555,380,000.00	667,867,758.70 (97,528,728,802)	
英債券	TREASURY 1	3,300,000.00	3,317,127.00	
	TREASURY 1.25	1,500,000.00	1,509,135.00	
	TREASURY 1.75	2,500,000.00	2,560,000.00	
	TREASURY 1.75	1,000,000.00	1,021,310.00	
	TREASURY 1.75	3,500,000.00	3,525,550.00	
	TREASURY 2	3,000,000.00	3,050,190.00	
	TREASURY 2.25	3,700,000.00	3,842,080.00	
	TREASURY 2.75	2,000,000.00	2,157,980.00	
	TREASURY 3.25	1,500,000.00	1,694,145.00	
	TREASURY 3.5	500,000.00	590,765.00	

	TREASURY 3.5	1,000,000.00	1,258,540.00
	TREASURY 3.75	3,000,000.00	3,339,660.00
	TREASURY 3.75	3,300,000.00	3,720,750.00
	TREASURY 3.75	2,900,000.00	3,305,681.00
	TREASURY 3.75	2,300,000.00	2,931,971.00
	TREASURY 4	3,300,000.00	3,496,680.00
	TREASURY 4	2,000,000.00	2,331,260.00
	TREASURY 4	2,000,000.00	2,753,420.00
	TREASURY 4.25	1,800,000.00	2,240,640.00
	TREASURY 4.25	2,500,000.00	3,181,500.00
	TREASURY 4.25	2,500,000.00	3,227,025.00
	TREASURY 4.25	1,500,000.00	1,966,485.00
	TREASURY 4.25	2,000,000.00	2,632,280.00
	TREASURY 4.25	2,900,000.00	3,939,215.00
	TREASURY 4.25	1,900,000.00	2,626,275.00
	TREASURY 4.25	2,600,000.00	3,705,780.00
	TREASURY 4.5	4,200,000.00	4,777,080.00
	TREASURY 4.5	2,500,000.00	3,301,850.00
	TREASURY 4.5	2,500,000.00	3,457,875.00
	TREASURY 4.75	2,700,000.00	3,160,161.00
	TREASURY 4.75	2,300,000.00	3,062,933.00
	TREASURY 4.75	2,500,000.00	3,501,550.00
	TREASURY 5	3,500,000.00	3,952,200.00
	TREASURY 5	2,500,000.00	3,222,550.00
	TREASURY 6	1,200,000.00	1,765,440.00
	TREASURY 8	1,620,000.00	2,267,514.00
	TREASURY 8.75	800,000.00	969,760.00
	英債券 合計	86,320,000.00	103,364,357.00 (19,300,192,739)
スイスフラン	SWISS (GOVT) 2.25	900,000.00	1,011,870.00
	SWISS (GOVT) 2.5	1,000,000.00	1,034,700.00
	SWISS (GOVT) 3	500,000.00	549,600.00
	SWISS (GOVT) 3	1,000,000.00	1,136,100.00
	SWISS (GOVT) 4	1,000,000.00	1,308,300.00
	SWISS (GOVT) 4	700,000.00	1,021,510.00
	SWISS (GOVT) 4.25	500,000.00	555,850.00

スイスフラン 合計		5,600,000.00	6,617,930.00 (803,549,060)
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVRNMNT 1.5	8,000,000.00	8,430,000.00
	SWEDISH GOVRNMNT 3	6,000,000.00	6,276,600.00
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	11,000,000.00	13,251,260.00
	SWEDISH GOVRNMNT 3.5	9,000,000.00	12,231,360.00
	SWEDISH GOVRNMNT 3.75	13,200,000.00	14,494,920.00
	SWEDISH GOVRNMNT 4.25	12,000,000.00	14,058,840.00
	SWEDISH GOVRNMNT 5	5,000,000.00	6,328,000.00
スウェーデンクローナ 合計		64,200,000.00	75,070,980.00 (1,159,846,641)
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOV'T 2	10,000,000.00	10,374,000.00
	NORWEGIAN GOV'T 3.75	11,000,000.00	12,642,300.00
	NORWEGIAN GOV'T 4.25	10,000,000.00	10,789,500.00
	NORWEGIAN GOV'T 4.5	6,000,000.00	6,893,400.00
ノルウェークローネ 合計		37,000,000.00	40,699,200.00 (657,699,072)
デンマーククローネ	DENMARK - BULLET 3	10,000,000.00	11,800,000.00
	DENMARK - BULLET 4	4,000,000.00	4,144,320.00
	DENMARK - BULLET 4	10,000,000.00	11,155,000.00
	DENMARK - BULLET 4	21,000,000.00	24,962,490.00
	DENMARK - BULLET 4.5	18,000,000.00	29,545,200.00
	DENMARK - BULLET 7	3,080,000.00	4,981,592.00
デンマーククローネ 合計		66,080,000.00	86,588,602.00 (1,699,734,257)
ポーランドズロチ	POLAND GOVT BOND 2.5	5,000,000.00	5,070,000.00
	POLAND GOVT BOND 4	2,000,000.00	2,226,000.00
	POLAND GOVT BOND 5	8,000,000.00	8,352,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.25	5,000,000.00	5,450,500.00
	POLAND GOVT BOND 5.25	2,000,000.00	2,320,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.5	4,000,000.00	4,592,800.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	4,000,000.00	4,840,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	4,200,000.00	5,157,600.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	2,000,000.00	2,704,480.00
ポーランドズロチ 合計		36,200,000.00	40,713,380.00 (1,397,283,201)



オーストラリアドル	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	3,000,000.00	2,953,692.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	2,000,000.00	2,052,400.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.25	1,500,000.00	1,508,250.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 3.75	1,000,000.00	1,031,900.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25	2,000,000.00	2,095,800.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	4,000,000.00	4,397,400.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	1,500,000.00	1,725,600.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.75	3,000,000.00	3,105,600.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.75	1,200,000.00	1,398,960.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.25	3,000,000.00	3,348,150.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	2,000,000.00	2,187,400.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	2,500,000.00	2,988,500.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	3,000,000.00	3,545,100.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	2,000,000.00	2,401,400.00	
AUSTRALIAN GOVT. 6	3,300,000.00	3,549,810.00		
オーストラリアドル 合計		35,000,000.00	38,289,962.00	(3,724,847,503)
シンガポールドル	SINGAPORE GOV'T 2.25	500,000.00	505,200.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.75	400,000.00	384,140.00	
	SINGAPORE GOV'T 2.875	400,000.00	407,760.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.125	1,000,000.00	1,064,700.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.25	1,000,000.00	1,070,950.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.375	500,000.00	539,849.50	
	SINGAPORE GOV'T 3.5	1,500,000.00	1,654,425.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.75	1,500,000.00	1,576,950.00	
	SINGAPORE GOV'T 4	2,100,000.00	2,304,015.00	
シンガポールドル 合計		8,900,000.00	9,507,989.50	(863,230,366)
マレーシアリングット	MALAYSIA GOVT 3.418	8,000,000.00	7,616,000.00	
	MALAYSIA GOVT 3.502	9,000,000.00	8,253,450.00	
	MALAYSIA GOVT 3.814	2,000,000.00	2,006,900.00	
	MALAYSIA GOVT 4.24	5,000,000.00	5,076,000.00	
	MALAYSIA GOVT 4.262	3,000,000.00	3,033,300.00	
	MALAYSIA GOVT 4.378	5,000,000.00	5,106,000.00	
マレーシアリングット 合計		32,000,000.00	31,091,650.00	

				(1,067,687,261)
南アフリカランド	REP SOUTH AFRICA 6.5	40,000,000.00	30,916,000.00	
	REP SOUTH AFRICA 6.75	30,000,000.00	28,797,000.00	
	REP SOUTH AFRICA 7	30,000,000.00	26,115,000.00	
	REP SOUTH AFRICA 8	25,000,000.00	25,642,500.00	
	REP SOUTH AFRICA 8.25	8,000,000.00	8,260,000.00	
南アフリカランド 合計		133,000,000.00	119,730,500.00	(1,236,816,065)
合計			228,216,325,101	(228,216,325,101)

(注) 金額欄の( )内は、外貨建有価証券にかかるものの内書きであり、また邦貨換算金額で表示しております。

通貨	銘柄数	組入債券時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	国債証券 186銘柄	39.2%	39.9%
カナダドル	国債証券 25銘柄	2.3%	2.4%
メキシコペソ	国債証券 6銘柄	1.0%	1.1%
ユーロ	国債証券 241銘柄	42.0%	42.7%
英ポンド	国債証券 37銘柄	8.3%	8.5%
スイスフラン	国債証券 7銘柄	0.3%	0.4%
スウェーデンクローナ	国債証券 7銘柄	0.5%	0.5%
ノルウェークローネ	国債証券 4銘柄	0.3%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 6銘柄	0.7%	0.7%
ポーランドズロチ	国債証券 9銘柄	0.6%	0.6%
オーストラリアドル	国債証券 15銘柄	1.6%	1.6%
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 6銘柄	0.5%	0.5%
南アフリカランド	国債証券 5銘柄	0.5%	0.5%

#### デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

S M A M ・ マネーインカムファンド < 適格機関投資家限定 >

## 貸借対照表

（単位：円）

	（平成25年12月19日現在）	（平成26年12月19日現在）
<b>資産の部</b>		
流動資産		
親投資信託受益証券	296,227,480	351,819,950
流動資産合計	296,227,480	351,819,950
資産合計	296,227,480	351,819,950
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬	1,561	1,651
未払委託者報酬	13,949	14,508
流動負債合計	15,510	16,159
負債合計	15,510	16,159
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	293,785,017	348,639,298
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	2,426,953	3,164,493
元本等合計	296,211,970	351,803,791
純資産合計	296,211,970	351,803,791
負債純資産合計	296,227,480	351,819,950

## 注記表

（重要な会計方針の注記）

項目	自平成26年4月15日 至平成26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）	（平成26年12月19日現在）
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	293,785,017口	348,639,298口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0083円 (10,000口当たりの純資産額 10,083円)	1口当たり純資産額 1.0091円 (10,000口当たりの純資産額 10,091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26年 4月15日 至 平成26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せん。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</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26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)

該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

項目	（平成25年12月19日現在）	（平成26年12月19日現在）
期首元本額	267,383,768円	297,590,675円
期中追加設定元本額	37,364,801円	54,736,624円
期中一部解約元本額	10,963,552円	3,688,001円

## 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

（単位：円）

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	マネーインカム・マザーファンド	347,579,481	351,819,950	
合計		347,579,481	351,819,950	

## 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）

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

### 貸借対照表

	(単位：円)	
	(平成25年12月19日現在)	(平成26年12月19日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	13,613,718	28,032,754
国債証券	1,315,144,500	1,298,018,470
未収利息	4,147,280	3,722,893
前払費用	2,220,638	1,692,396
流動資産合計	1,335,126,136	1,331,466,513
資産合計	1,335,126,136	1,331,466,513
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	10,000
流動負債合計	-	10,000
負債合計	-	10,000
純資産の部		
元本等		
元本	1,320,481,280	1,315,372,664
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	14,644,856	16,083,849
元本等合計	1,335,126,136	1,331,456,513
純資産合計	1,335,126,136	1,331,456,513
負債純資産合計	1,335,126,136	1,331,466,513

### 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 平成26年 4月15日 至 平成26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)	(平成26年12月19日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	1,320,481,280口	1,315,372,664口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 1.0111円 (10,000口当たりの純資産額 10,111円)	1口当たり純資産額 1.0122円 (10,000口当たりの純資産額 10,122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26年 4月15日 至 平成26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</p>



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

#### ・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成26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）</p> <p>「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）</p> <p>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</p> <p>これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## （デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

（平成25年12月19日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	1,616,825,023円
同期中における追加設定元本額	335,345,343円
同期中における一部解約元本額	631,689,086円
平成25年12月19日現在における元本の内訳	
スミセイ・DCバランスファンド（機動的資産配分型）	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CBファンド	29,767,812円
日興ニューバーク米国小型ハイクオリティファンド（毎月決算型）	99,128円
日興ニューバーク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

（平成26年12月19日現在）	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	1,367,531,596円

同期中における追加設定元本額	212,230,306円
同期中における一部解約元本額	264,389,238円
平成26年12月19日現在における元本の内訳	
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	30,042,233円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	15,221,888円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	2,097,358円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	1,789,279円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	2,186,760円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	1,092,946円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	2,165,529円
日興ニューバーク米国小型ハイクオリティファンド(毎月決算型)	99,128円
日興ニューバーク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>	347,579,481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>	665,502,511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>	247,298,167円
合計	1,315,372,664円

## 附属明細表

### 有価証券明細表

#### (a) 株式

該当事項はありません。

#### (b) 株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第88回利付国債(5年)	380,000,000	380,482,600	
	第268回利付国債(10年)	228,000,000	228,825,360	
	第270回利付国債(10年)	228,000,000	229,488,840	
	第273回利付国債(10年)	228,000,000	230,596,920	
	第274回利付国債(10年)	25,000,000	25,380,750	
	第276回利付国債(10年)	200,000,000	203,244,000	
合計		1,289,000,000	1,298,018,470	

### 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】

## 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27年 1月30日現在

資産総額	492,706,262円
負債総額	1,233,915円
純資産総額（ - ）	491,472,347円
発行済口数	400,154,841口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2282円
（1万口当たり純資産額）	（12,282円）

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2020

平成27年 1月30日現在

資産総額	1,036,066,752円
負債総額	5,143,006円
純資産総額（ - ）	1,030,923,746円
発行済口数	727,394,989口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4173円
（1万口当たり純資産額）	（14,173円）

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2030

平成27年 1月30日現在

資産総額	805,835,433円
負債総額	942,543円
純資産総額（ - ）	804,892,890円
発行済口数	545,812,632口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4747円
（1万口当たり純資産額）	（14,747円）

## 三井住友・DC年金プラン・ファンド（ターゲット・イヤー型）2040

平成27年 1月30日現在

資産総額	616,778,625円
負債総額	2,021,905円
純資産総額（ - ）	614,756,720円
発行済口数	404,948,299口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5181円
（1万口当たり純資産額）	（15,181円）

#### 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

##### イ 名義書換

該当事項はありません。

##### ロ 受益者名簿

作成しません。

##### ハ 受益者に対する特典

ありません。

#### ニ 受益権の譲渡および譲渡制限等

##### （イ）受益権の譲渡

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

##### （ロ）受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件

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

##### ホ 受益権の再分割

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

##### ヘ 償還金

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

##### ト 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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



## 第二部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### イ 資本金の額および株式数

	平成27年 1月30日現在
資本金の額	2,000百万円
会社が発行する株式の総数	60,000株
発行済株式総数	17,640株

##### ロ 最近5年間における資本金の額の増減 該当ありません。

#### ハ 会社の機構

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

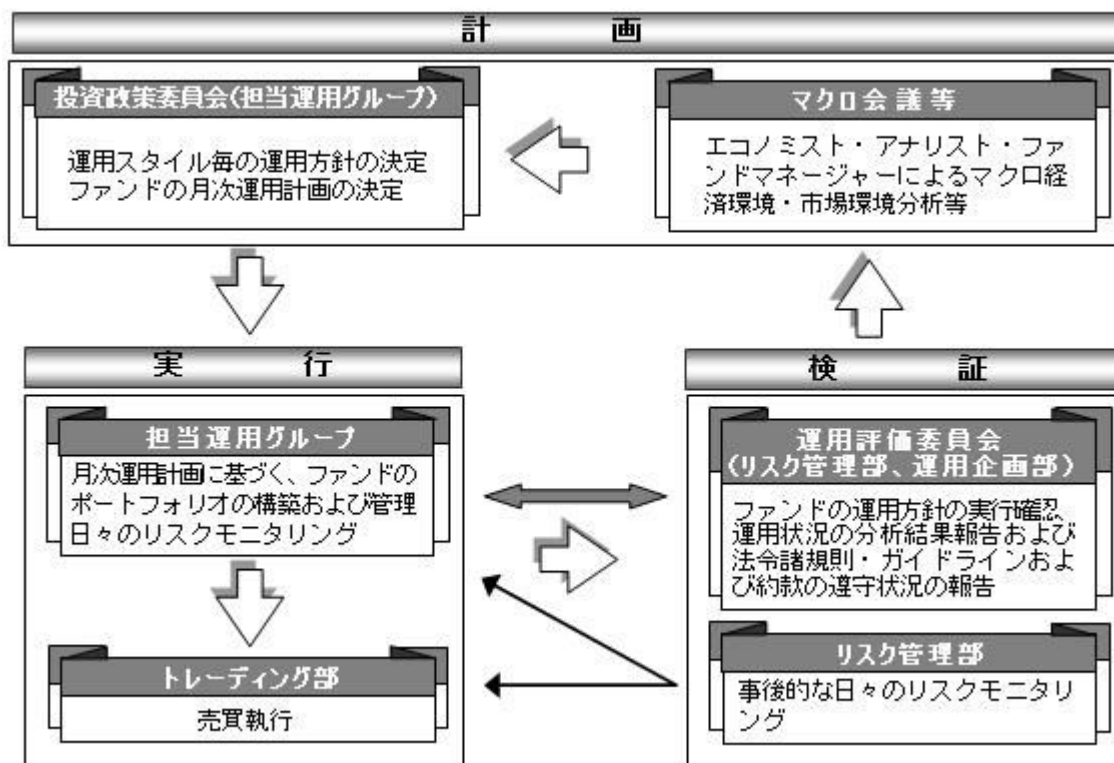
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役を若干名を選定します。

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

#### 二 投資信託の運用の流れ



## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成27年1月30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27年1月30日現在、単位：百万円）

		本 数	純資産総額
株式投資信託	単位型	36 ( 12 )	157,249 ( 51,727 )
	追加型	424 ( 175 )	5,036,109 ( 2,957,281 )
	計	460 ( 187 )	5,193,359 ( 3,009,008 )
公社債投資信託	単位型	22 ( 22 )	84,087 ( 84,087 )
	追加型	4 ( 1 )	254,360 ( 176,444 )
	計	26 ( 23 )	338,447 ( 260,530 )
合 計		486 ( 210 )	5,531,805 ( 3,269,538 )

（ ）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29期（平成25年4月1日から平成26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30期中間会計期間（平成26年4月1日から平成26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）

		前事業年度 (平成25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
(資産の部)			
流動資産			
現金及び預金	2	17,748,821	20,615,467
有価証券		3,999,613	4,999,802
前払費用		260,095	257,741
未収入金		7,550	4,026



未収委託者報酬		3,641,029	4,128,531
未収運用受託報酬		439,648	934,710
未収投資助言報酬	2	470,228	453,941
未収収益		12,379	11,700
繰延税金資産		230,101	548,658
その他の流動資産		15,233	4,577
流動資産計		26,824,700	31,959,157
固定資産			
有形固定資産	1		
建物		138,920	124,723
器具備品		153,518	204,970
有形固定資産合計		292,438	329,694
無形固定資産			
ソフトウェア		487,128	517,480
ソフトウェア仮勘定		1,805	4,595
電話加入権		115	103
商標権		809	468
無形固定資産合計		489,857	522,646
投資その他の資産			
投資有価証券		6,914,557	6,843,224
関係会社株式		234,311	353,036
長期差入保証金		553,412	541,904
長期前払費用		13,881	41,193
会員権		9,480	9,480
繰延税金資産		409,440	463,476
投資その他の資産合計		8,135,083	8,252,316
固定資産計		8,917,379	9,104,657
資産合計		35,742,080	41,063,815

(単位：千円)

	前事業年度 (平成25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	47,693	61,327
未払金		
未払収益分配金	425	671
未払償還金	149,880	143,230
未払手数料	2	1,899,876
その他未払金	127,465	203,170
未払費用	1,235,323	1,615,419
未払消費税等	93,482	215,390
未払法人税等	630,796	1,623,022
賞与引当金	253,750	926,263
その他の流動負債	-	8
流動負債計	4,438,695	6,926,944
固定負債		
退職給付引当金	1,605,470	1,802,340
固定負債計	1,605,470	1,802,340
負債合計	6,044,166	8,729,285
(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	16,718,237	19,227,103
利益剰余金合計	18,539,441	21,048,308
株主資本計	29,168,425	31,677,292
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	529,488	657,238
評価・換算差額等計	529,488	657,238
純資産合計	29,697,914	32,334,530
負債・純資産合計	35,742,080	41,063,815

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自	平成24年4月1日	(自	平成25年4月1日
	至	平成25年3月31日)	至	平成26年3月31日)
営業収益				
委託者報酬		24,965,627		30,300,842
運用受託報酬		2,123,129		3,773,696
投資助言報酬		1,675,512		2,117,669
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		28,389		26,625
サービス支 hands 手数料		39,868		24,883
その他		51,597		56,406
営業収益計		28,889,125		36,305,122
営業費用				
支払手数料		12,702,099		15,695,322
広告宣伝費		323,773		276,591
公告費		5,176		5,637
調査費				
調査費		628,953		1,028,700
委託調査費		2,491,384		3,053,376
営業雑経費				
通信費		34,811		38,776
印刷費		208,926		262,934
協会費		27,115		14,337
諸会費		13,918		32,186
情報機器関連費		1,992,553		2,277,699
販売促進費		14,507		40,388
その他		103,926		117,451
営業費用計		18,547,147		22,843,403

一般管理費		
給料		
役員報酬	145,461	140,440
給料・手当	4,393,347	4,900,885
賞与	767,474	786,372
賞与引当金繰入額	253,750	926,263
交際費	17,677	24,915
寄付金	24	82
事務委託費	252,472	303,945
旅費交通費	184,318	196,933
租税公課	83,374	100,575
不動産賃借料	670,888	546,821
退職給付費用	173,008	330,002
固定資産減価償却費	189,990	227,090
諸経費	260,890	258,736
一般管理費計	7,392,682	8,743,067
営業利益	2,949,295	4,718,652
営業外収益		
受取配当金	36,741	50,559
有価証券利息	3,643	2,660
受取利息	5,921	5,190
時効成立分配金・償還金	961	5,958
原稿・講演料	2,696	2,456
還付加算金	78	182
雑収入	4,508	3,692
営業外収益計	54,551	70,701
営業外費用		
為替差損	25,770	29,406
雑損失	-	38
営業外費用計	25,770	29,444
経常利益	2,978,076	4,759,909
特別利益		
投資有価証券償還益	-	8,250
投資有価証券売却益	52,516	310,894
負ののれん発生益	-	186,047
企業結合に係る特定勘定取崩 益	-	2,870
特別利益計	52,516	508,062
特別損失		
固定資産除却損	1	2,409
投資有価証券償還損		3,224
投資有価証券評価損		18,303
投資有価証券売却損		61,282
関係会社株式評価損		610
合併関連費用		70,655
事務所移転費用		13,795
特別損失計		170,280
税引前当期純利益	2,860,311	5,238,102
法人税、住民税及び事業税	1,223,890	2,147,762
法人税等調整額	119,459	282,886
法人税等合計	1,104,430	1,864,875
当期純利益	1,755,881	3,373,226

## （ 3 ） 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金			利益剰余金 合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金				
				配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金			
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	15,791,435	17,612,639	28,241,623
当期変動額									
剰余金の配当			-				829,080	829,080	829,080
当期純利益			-				1,755,881	1,755,881	1,755,881
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）			-					-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	926,801	926,801	926,801
当期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	16,718,237	18,539,441	29,168,425

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算差額等 合計	
当期首残高	76,327	76,327	28,317,951
当期変動額			
剰余金の配当		-	829,080
当期純利益		-	1,755,881
株主資本以外の項 目の当期変動額 （純額）	453,160	453,160	453,160
当期変動額合計	453,160	453,160	1,379,962
当期末残高	529,488	529,488	29,697,914

当事業年度（自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金			利益剰余金 合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計		その他利益剰余金				
				配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金			
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	16,718,237	18,539,441	29,168,425
当期変動額									
剰余金の配当			-				864,360	864,360	864,360
当期純利益			-				3,373,226	3,373,226	3,373,226
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）			-					-	-
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	2,508,866	2,508,866	2,508,866
当期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	19,227,103	21,048,308	31,677,292

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算差額等 合計	
当期首残高	529,488	529,488	29,697,914
当期変動額			

剰余金の配当		-	864,360
当期純利益		-	3,373,226
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	127,749	127,749	127,749
当期変動額合計	127,749	127,749	2,636,616
当期末残高	657,238	657,238	32,334,530

## [注記事項]

## (重要な会計方針)

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

## (1) 満期保有目的の債券

償却原価法

## (2) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

## (3) その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

時価のないもの

移動平均法による原価法

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 3～50年

器具備品 3～20年

## (2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

## 3. 引当金の計上基準

## (1) 賞与引当金

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

## (2) 退職給付引当金

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

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、期間定額基準によっております。

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

## 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

## (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等について改正されました。

## (2)適用予定日

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。

## (会計上の見積りの変更)

当社は、賞与引当金の計上基準について、業績を反映したものに変更したため、見積りの方法を将来にわたり変更しております。

これにより、従来の方と比べて、当事業年度の営業利益、経常利益及び税引前当期純利益がそれぞれ553,173千円減少しております。

## (貸借対照表関係)

## 1 有形固定資産の減価償却累計額

	前事業年度 (平成25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
建物	223,463千円	241,339千円
器具備品	698,449千円	704,790千円

## 2 関係会社に対する資産及び負債

	前事業年度 (平成25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
現金及び預金	13,031,110千円	14,959,545千円
未収投資助言報酬	289,597千円	290,426千円
未払手数料	446,096千円	360,659千円

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

	前事業年度 (平成25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
当座貸越極度額の総額	10,000,000千円	10,000,000千円
借入実行残高	- 千円	- 千円
差引額	10,000,000千円	10,000,000千円

## 4 保証債務

当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York) Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成27年6月までの賃借料総額の支払保証を行っております。

	前事業年度 (平成25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
Sumitomo Mitsui Asset Management (New York) Inc	45,184千円	27,470千円

## (損益計算書関係)

## 1 固定資産除却損

	前事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	当事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

建物	1,889千円	- 千円
器具備品	519千円	864千円
ソフトウェア	- 千円	5,853千円
計	2,409千円	6,717千円

## (株主資本等変動計算書関係)

前事業年度(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

当事業年度(自 平成25年 4月 1日 至 平成26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

(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26年 6月26日開催の第29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26年 6月26日 定時株主総会	普通株式	利益剰余 金	1,852,200	105,000	平成26年 3月31日	平成26年 6月27日

## (リース取引関係)

オペレーティング・リース取引

(借主側)

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

(単位：千円)

	前事業年度 (平成25年 3月31日)	当事業年度 (平成26年 3月31日)
1年以内	516,612	525,188

1年超	1,218,728	751,482
合計	1,735,341	1,276,671

## (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及び50%出資した海外関連会社の株式であり、発行体の信用リスクに晒されています。また、長期差入保証金は、建物等の賃借契約に関連する敷金等であり、差入先の信用リスクに晒されています。

営業債務である未払手数料は、すべて1年以内の支払期日であります。

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

## 信用リスクの管理

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

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

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

## 市場リスクの管理

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

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

前事業年度(平成25年3月31日)



(単位：千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	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	-

当事業年度(平成26年3月31日)

(単位：千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	20,615,467	20,615,467	-
(2)未収委託者報酬	4,128,531	4,128,531	-
(3)未収運用受託報酬	934,710	934,710	-
(4)未収投資助言報酬	453,941	453,941	-
(5)有価証券及び投資有価証券			
満期保有目的の債券	4,999,802	4,999,500	302
その他有価証券	6,811,166	6,811,166	-
(6)長期差入保証金	541,904	541,904	-
資産計	38,485,524	38,485,221	302
(1)未払金			
未払手数料	2,138,441	2,138,441	-
負債計	2,138,441	2,138,441	-

(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の貸借対照表計上額

(単位:千円)

	前事業年度 (平成25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
その他有価証券		
非上場株式	298	298
投資証券	33,040	31,760
合計	33,338	32,058
子会社株式及び関連会社株式		
非上場株式	234,311	353,036
合計	234,311	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。

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

(注3)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度(平成25年3月31日)

(単位:千円)

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	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	-	-

当事業年度(平成26年3月31日)

(単位:千円)

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	20,615,467	-	-	-
未収委託者報酬	4,128,531	-	-	-
未収運用受託報酬	934,710	-	-	-
未収投資助言報酬	453,941	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券	5,000,000	-	-	-
その他有価証券のうち 満期があるもの	-	-	-	-
長期差入保証金	23,475	518,429	-	-
合計	31,156,125	518,429	-	-

(有価証券関係)

1.満期保有目的の債券

前事業年度(平成25年3月31日)

(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			
国債	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

当事業年度（平成26年3月31日）

（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			
国債	4,999,802	4,999,500	302
小計	4,999,802	4,999,500	302
合計	4,999,802	4,999,500	302

## 2. 子会社株式及び関連会社株式

前事業年度（平成25年3月31日）

子会社株式（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。

当事業年度（平成26年3月31日）

子会社株式及び関連会社株式（貸借対照表計上額 関係会社株式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、記載しておりません。

## 3. その他有価証券

前事業年度（平成25年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1) 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
投資信託等	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。

当事業年度（平成26年3月31日）

（単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1) 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
投資信託等	6,390,685	5,387,490	1,003,195
小計	6,390,685	5,387,490	1,003,195
(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	420,480	424,165	3,684
小計	420,480	424,165	3,684
合計	6,811,166	5,811,655	999,510

(注)非上場株式等(貸借対照表計上額 32,058千円)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、1,280千円です。

#### 4. 当事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

(単位:千円)

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

当事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

(単位:千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
2,097,321	310,894	454

#### (退職給付関係)

前事業年度(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

##### 1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として、退職一時金制度を設けております。

##### 2. 退職給付債務の額

(単位:千円)

退職給付債務	1,605,470
退職給付引当金	<u>1,605,470</u>

##### 3. 退職給付費用の額

(単位:千円)

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>

(注)その他は、その他の関係会社からの出向者の年金掛金負担分と退職給付引当額相当額負担分になります。

##### 4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項

退職給付見込額の期間配分方法	勤務期間を基準とする方法
割引率	1.5%
過去勤務債務の額の処理年数	1年(発生時において費用処理する方法)
数理計算上の差異の処理年数	1年(発生時において費用処理する方法)

当事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

##### 1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として、退職一時金制度を設けております。また、確定拠出型の制度として、確定拠出年金制度を設けております。

##### 2. 確定給付制度

###### (1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

(単位:千円)

退職給付債務の期首残高	1,605,470
勤務費用	184,549
利息費用	25,192
数理計算上の差異の発生額	21,670
過去勤務費用の発生額	27,157
退職給付の支払額	93,535
その他	75,176
退職給付債務の期末残高	1,802,340

(注) その他は、トヨタアセットマネジメント株式会社との合併により引き継いだ退職給付債務額になります。

(2)退職給付債務の期末残高と貸借対照表に記載された退職給付引当金の調整表

	(単位：千円)
非積立型の退職給付債務	1,802,340
未認識数理計算上の差異	-
未認識過去勤務費用	-
退職給付引当金	1,802,340

(3)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	(単位：千円)
勤務費用	184,549
利息費用	25,192
数理計算上の差異の費用処理額	21,670
過去勤務費用の費用処理額	27,157
その他	114,773
退職給付費用合計	330,002

(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及び退職給付引当額相当額負担分、退職定年制度適用による割増退職金並びに確定拠出年金への拠出額になります。

(4)数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎	
割引率	1.5%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、43,539千円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生 of 主な原因別の内訳

	(単位：千円)	
	前事業年度 (平成25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
流動の部		
繰延税金資産		
賞与引当金	96,450	330,120
未払事業税	56,165	123,029
調査費	48,698	62,002
その他	10,598	33,507
繰延税金資産小計	230,101	548,658
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	230,101	548,658

固定の部

繰延税金資産

退職給付引当金	572,189	642,354
特定外国子会社留保金額	226,275	226,680
ソフトウェア償却	75,827	105,651
投資有価証券評価損	51,622	50,143
その他	6,428	6,970
繰延税金資産小計	932,342	1,031,799
評価性引当額	260,304	233,276
繰延税金資産合計	672,038	798,523
繰延税金負債		
その他有価証券評価差額金	262,597	334,588
その他	-	457
繰延税金負債合計	262,597	335,046
繰延税金資産の純額	409,440	1,012,135

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間に重要な差異があるときの、当該差異の原因となった主要な項目別の内訳

	前事業年度 (平成25年3月31日)	当事業年度 (平成26年3月31日)
法定実効税率	-	38.0%
(調整)		
評価性引当額の増減	-	0.5
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	-	0.1
税率変更による期末繰延税金資産の減額修正	-	0.7
負ののれん発生益	-	1.3
企業結合に係る特定勘定取崩	-	1.5
その他	-	0.1
税効果会計適用後の法人税等の負担率	-	35.6

(注) 前事業年度につきましては、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、注記を省略しております。

### 3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成26年法律第10号）が平成26年3月31日に公布され、平成26年4月1日以後に開始する事業年度から復興特別法人税が廃止されることとなりました。これに伴い、平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異等にかかる繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は、平成27年3月31日までについては、従来の38.0%から35.6%となります。この税率変更により、繰延税金資産の純額及び法人税等調整額が、それぞれ40,739千円減少しております。

#### (企業結合等関係)

##### 取得による企業結合

##### (1) 企業結合の概要

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

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。

企業結合日

平成25年4月1日

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、当社を存続会社とする吸収合併方式  
 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  
 取得した議決権比率  
 100%  
 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)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26年3月31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  
 負ののれん  
 186,047千円  
 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)企業結合が当事業年度の開始の日に完了したと仮定した場合の当事業年度の損益計算書に及ぼす影響の概算額及びその算定方法  
 企業結合が当事業年度の開始日に完了しているため、該当事項はありません。

## (セグメント情報等)

前事業年度(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。

当事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)

## 1.セグメント情報

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

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

## 2.関連情報

## (1)製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への売上高	30,300,842	3,773,696	2,117,669	112,914	36,305,122

## (2)地域ごとの情報

## 売上高

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

## 有形固定資産

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

## (3)主要な顧客ごとの情報

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

## 3.報告セグメントごとの負のれん発生益に関する情報

当社は単一セグメントのため、記載を省略しております。

## (関連当事者情報)

前事業年度(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	SMB C日興証券(株)	東京都千代田区	10,000,000	証券業	- %	投信の販売委託	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。

当事業年度(自 平成25年4月1日 至 平成26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 役員兼任	委託販売手数料	3,299,099	未払手数料	257,411
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	1,127,963	未収投資助言報酬	290,426

- (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. 子会社及び関連会社等

(単位: 千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
関連会社	UOB-SM Asset Management Pte. Ltd.	Singapore	3,000,000 (シンガポールドル)	投資運用業	(所有) % 直接 50	投信の販売委託 役員兼任	出資の引受	118,725	-	-

- (注) 1. UOB-SM Asset Management Pte. Ltd. の出資の引受は、新規法人設立のため行ったものであります。

## 3. その他の関係会社の子会社等

(単位: 千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の関係会社の子会社	SMB C日興証券(株)	東京都千代田区	10,000,000	証券業	- %	投信の販売委託 役員兼任	委託販売手数料	4,037,816	未払手数料	403,591

- (注) 1. 上記金額のうち、取引金額には消費税等は含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等
- (1) 投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

(1株当たり情報)

	前事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	当事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
1株当たり純資産額	1,683,555.22円	1,833,023.27円
1株当たり当期純利益金額	99,539.78円	191,226.00円

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	前事業年度 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)	当事業年度 (自 平成25年4月1日 至 平成26年3月31日)
1株当たり当期純利益金額		
当期純利益(千円)	1,755,881	3,373,226
普通株主に帰属しない金額 (千円)	-	-
普通株式に係る当期純利益金額 (千円)	1,755,881	3,373,226
期中平均株式数(株)	17,640	17,640

(重要な後発事象)

該当事項はございません。

(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)
負債の部		
流動負債		
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
固定負債		
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
純資産の部		
株主資本		
資本金	600,000	600,000
利益剰余金		
利益準備金	29,284	29,788
その他利益剰余金		

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
評価・換算差額等		
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	当事業年度
	(自平成23年 4月 1日 至平成24年 3月31日)	(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		
その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
	建物 63,978千円		建物 1,071千円
	器具備品 57,853千円		器具備品 22,826千円
	計 121,831千円		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
	投資助言報酬 529,665千円		投資助言報酬 430,339千円
	給料・手当 107,355千円		給料・手当 77,490千円
	賞与 31,907千円		賞与 18,286千円
	退職給付費用 4,200千円		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。
	*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。  希望退職関連費用 205,102千円 固定資産除売却損 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)
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。	1. 採用している退職給付制度の概要 同左
2. 退職給付債務に関する事項 (1)退職給付債務 100,461千円 (2)退職給付引当金 100,461千円	2. 退職給付債務に関する事項 (1)退職給付債務 75,177千円 (2)退職給付引当金 75,177千円
3. 退職給付費用に関する事項 (1)勤務費用(注) 32,884千円 (2)退職給付費用 32,884千円 (注)確定拠出年金への掛金支払額を含んでおります。	3. 退職給付費用に関する事項 (1)勤務費用(注) 37,467千円 (2)退職給付費用 37,467千円 (注)確定拠出年金への掛金支払額を含んでおります。

## （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 style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <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; border-top: 1px solid black;">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; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">55,667</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	55,667	<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 style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <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; border-top: 1px solid black;">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; border-top: 1px solid black;">169,839</td></tr> <tr><td>繰延税金負債</td><td></td></tr> <tr><td>  <del>その他有価証券評価差額</del></td><td style="text-align: right;">457</td></tr> <tr><td>  <del>金</del></td><td></td></tr> <tr><td>繰延税金負債合計</td><td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">457</td></tr> <tr><td>繰延税金資産の純額</td><td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">169,382</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		<del>その他有価証券評価差額</del>	457	<del>金</del>		繰延税金負債合計	457	繰延税金資産の純額	169,382
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	55,667																																																						
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																																																							
<del>その他有価証券評価差額</del>	457																																																						
<del>金</del>																																																							
繰延税金負債合計	457																																																						
繰延税金資産の純額	169,382																																																						
<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;">40.7%</td></tr> <tr><td>(調整)</td><td></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; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">78.4%</td></tr> </table>	法定実効税率	40.7%	(調整)		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	78.4%	<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	40.7%																																																						
(調整)																																																							
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	78.4%																																																						

### 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

「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解消が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解消が見込まれる一時差異については35.6%になります。

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。

#### （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30期中間会計期間 (平成26年9月30日)
資産の部	



流動資産		
現金及び預金		18,997,518
有価証券		4,999,874
前払費用		304,294
未収委託者報酬		4,589,508
未収運用受託報酬		1,002,478
未収投資助言報酬		455,043
未収収益		13,850
繰延税金資産		521,146
その他		11,538
流動資産合計		30,895,252
固定資産		
有形固定資産	1	316,982
無形固定資産		506,741
投資その他の資産		
投資有価証券		7,334,420
その他		1,602,919
投資その他の資産合計		8,937,340
固定資産合計		9,761,063
資産合計		40,656,316
負債の部		
流動負債		
預り金		54,173
未払金		2,451,219
未払費用		2,016,536
未払法人税等		750,683
前受収益		1,510
賞与引当金		1,003,986
その他	2	301,269
流動負債合計		6,579,379
固定負債		
退職給付引当金		2,578,112
固定負債合計		2,578,112
負債合計		9,157,492
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		18,272,843
利益剰余金合計		20,094,047
株主資本合計		30,723,031
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		775,791

評価・換算差額等合計	775,791
純資産合計	31,498,823
負債純資産合計	40,656,316

## (2)中間損益計算書

(単位：千円)

		第30期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)
営業収益		
委託者報酬		14,854,036
運用受託報酬		1,784,363
投資助言報酬		997,024
その他の営業収益		50,034
営業収益計		17,685,459
営業費用		11,335,716
一般管理費	1	4,468,747
営業利益		1,880,995
営業外収益	2	20,303

営業外費用	3	6,317
経常利益		<u>1,894,982</u>
特別利益	4	197,263
特別損失		1,823
税引前中間純利益		<u>2,090,422</u>
法人税、住民税及び事業税		729,776
法人税等調整額		23,662
法人税等合計		<u>753,439</u>
中間純利益		<u>1,336,983</u>

## (3)中間株主資本等変動計算書

第30期中間会計期間（自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本								株主資本 合計
	資本金	資本剰余金		利益準備金	その他利益剰余金			利益剰余金 合計	
		資本準備金	資本剰余金 合計		配当準備 積立金	別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	19,227,103	21,048,308	31,677,292
会計方針の変更 による累積的影響額							439,043	439,043	439,043
会計方針の変更を反映 した当期首残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	18,788,060	20,609,264	31,238,248
当中間期変動額									
剰余金の配当							1,852,200	1,852,200	1,852,200
中間純利益							1,336,983	1,336,983	1,336,983
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）									
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	-	515,216	515,216	515,216

当中間期末残高	2,000,000	8,628,984	8,628,984	284,245	60,000	1,476,959	18,272,843	20,094,047	30,723,031
---------	-----------	-----------	-----------	---------	--------	-----------	------------	------------	------------

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	657,238	657,238	32,334,530
会計方針の変更 による累積的影 響額			439,043
会計方針の変更を反映 した当期首残高	657,238	657,238	31,895,486
当中間期変動額			
剰余金の配当			1,852,200
中間純利益			1,336,983
株主資本以外の項 目の当中間期変動 額(純額)	118,553	118,553	118,553
当中間期変動額合計	118,553	118,553	396,663
当中間期末残高	775,791	775,791	31,498,823

## 注記事項

### (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。

## 退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

## 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

## 4. その他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。

## (会計方針の変更)

「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。以下「退職給付会計基準」という。）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。以下「退職給付適用指針」という。）を、退職給付会計基準第35項本文及び退職給付適用指針第67項本文に掲げられた定めについて当中間会計期間より適用し、退職給付債務及び勤務費用の計算方法を見直し、退職給付見込額の期間帰属方法を期間定額基準から給付算定式基準へ変更いたしました。

退職給付会計基準等の適用については、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従って、当中間会計期間の期首において、退職給付債務及び勤務費用の計算方法の変更に伴う影響額を繰越利益剰余金に加減しております。

この結果、当中間会計期間の期首の退職給付引当金が682,168千円、繰延税金資産が243,124千円増加し、繰越利益剰余金が439,043千円減少しております。また、当中間会計期間の営業利益、経常利益及び税引前中間純利益はそれぞれ13,457千円減少しております。

なお、1株当たり情報に与える影響は当該箇所に記載しております。

## (中間貸借対照表関係)

第30期中間会計期間 (平成26年9月30日)	
1.有形固定資産の減価償却累計額	983,696千円
2.消費税等の取扱い	
仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債のその他に含めて表示しております。	
3.当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。当中間会計期間末における当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。	
当座借越極度額の総額	10,000,000千円
借入実行残高	-
差引額	10,000,000千円
4.当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York) Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成27年6月までの賃借料総額17,535千円の支払保証を行っております。	

## (中間損益計算書関係)

第30期中間会計期間 (自平成26年4月1日至平成26年9月30日)	
1.減価償却実施額	
有形固定資産	54,319千円
無形固定資産	79,993千円
2.営業外収益のうち主要なもの	
受取配当金	9,738千円
受取利息	2,831千円
3.営業外費用のうち主要なもの	
為替差損	6,317千円

4. 特別利益のうち主要なもの  
投資有価証券売却益 193,313千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第30期中間会計期間（自 平成26年4月1日 至 平成26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26年6月26日 定時株主総会	普通株式	1,852,200	105,000	平成26年 3月31日	平成26年 6月27日

（リース取引関係）

第30期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26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	544,850千円
1年超	1,631,694千円
合計	2,176,544千円

（金融商品関係）

1. 金融商品の時価等に関する事項

第30期中間会計期間（平成26年9月30日）

平成26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	18,997,518	18,997,518	-
(2)未収委託者報酬	4,589,508	4,589,508	-
(3)未収運用受託報酬	1,002,478	1,002,478	-
(4)未収投資助言報酬	455,043	455,043	-
(5)有価証券及び投資有価証券			
満期保有目的の債券	4,999,874	4,999,500	374
その他有価証券	7,319,862	7,319,862	-
(6)投資その他の資産			
長期差入保証金	552,079	552,079	-
資産計	37,916,364	37,915,990	374
(1)未払金			
未払手数料	2,261,403	2,261,403	-
負債計	2,261,403	2,261,403	-

（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おります。

## (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おります。

## 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おります。

(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	14,260
合計	14,558
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。

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30期中間会計期間（平成26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	4,999,874	4,999,500	374
小計	4,999,874	4,999,500	374
合計	4,999,874	4,999,500	374

## 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、記載しておりません。

## 3. その他有価証券

(単位：千円)

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
----	------------	------	----

(1)中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	6,979,830	5,792,552	1,187,277
小計	6,979,830	5,792,552	1,187,277
(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	340,032	343,595	3,563
小計	340,032	343,595	3,563
合計	7,319,862	6,136,147	1,183,714

(注) 非上場株式等（中間貸借対照表計上額 14,558千円）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。

(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30期中間会計期間（自 平成26年4月1日 至 平成26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葉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	14,854,036	1,784,363	997,024	50,034	17,685,459

(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固定資産の減損損失に関する情報

該当事項はありません。

4. 報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報

該当事項はありません。

5. 報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報

該当事項はありません。



## （ 1 株当たり情報）

第30期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)	
1株当たり純資産額	1,785,647円61銭
1株当たり中間純利益	75,792円69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。また、「会計方針の変更」に記載のとおり、退職給付会計基準等を適用し、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従っております。この結果、当中間会計期間の1株当たり純資産額が、24,889円9銭減少し、1株当たり中間純利益金額は、762円88銭減少しております。</p>	
（注）1株当たり純資産額の算定上の基礎	
中間貸借対照表の純資産の部の合計額	31,498,823千円
普通株式に係る純資産額	31,498,823千円
普通株式の発行済株式数	17,640株
1株当たり純資産額の算定に用いられた普通株式の数	17,640株
1株当たり中間純利益の算定上の基礎	
中間損益計算書上の中間純利益	1,336,983千円
普通株式に係る中間純利益	1,336,983千円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳	
該当事項はありません。	
普通株式の期中平均株式数	17,640株

## （重要な後発事象）

該当事項はありません。

## 4【利害関係人との取引制限】

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

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

投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

## 5【その他】

### イ 定款の変更、その他の重要事項

平成26年6月26日に開催された定時株主総会において、株主総会および取締役会の招集者と議長について、取締役社長に加えて取締役会長も招集者および議長となることができることとする定款の変更が決議されました。

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### イ 受託会社

- (イ) 名称 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26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26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	(ロ) 資本金の額	(ハ) 事業の内容
損保ジャパン日本興亜DC証券株式会社	3,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社三井住友銀行	1,770,996百万円	銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。

資本金の額は、平成26年9月末現在。

(注) 損保ジャパン日本興亜DC証券株式会社は、三井住友・DC年金プラン・ファンド(ターゲット・イヤー型)2010の取扱いを行いません。

## 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け付け、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%)保有していません。

### 第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
平成26年 3月19日	有価証券報告書
平成26年 3月19日	有価証券届出書
平成26年 9月19日	半期報告書
平成26年 9月19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6月13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

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士 鈴木 敏 夫

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26年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以 上

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

**独立監査人の監査報告書**

平成27年2月10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25年12月21日から平成26年12月22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26年12月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**利害関係**

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

以 上

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

**独立監査人の監査報告書**

平成27年2月10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25年12月21日から平成26年12月22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26年12月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**利害関係**

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

以 上

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

**独立監査人の監査報告書**

平成27年2月10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25年12月21日から平成26年12月22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26年12月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**利害関係**

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

以 上

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

**独立監査人の監査報告書**

平成27年2月10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25年12月21日から平成26年12月22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26年12月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**利害関係**

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

以上

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



**独立監査人の中間監査報告書**

平成26年11月28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

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士 鈴木 敏 夫 印

公認会計士 池 ヶ 谷 正 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友アセットマネジメント株式会社の平成26年4月1日から平成27年3月31日までの第30期事業年度の中間会計期間（平成26年4月1日から平成26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26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26年4月1日から平成26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

(注) 1. 上記は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。 2. X B R L データは中間監査の対象には含まれていません。