

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成22年 5 月13日
【発行者名】	三井住友アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 前田 良治
【本店の所在の場所】	東京都港区愛宕二丁目 5 番 1 号
【事務連絡者氏名】	古池 典生
【電話番号】	03-5405-0739
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証 券に係るファンドの名称】	三井住友・DC年金バランス30（債券重点型） 三井住友・DC年金バランス50（標準型） 三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証 券の金額】	三井住友・DC年金バランス30（債券重点型） ：5,000億円を上限とします。 三井住友・DC年金バランス50（標準型） ：5,000億円を上限とします。 三井住友・DC年金バランス70（株式重点型） ：5,000億円を上限とします。 合計 1 兆5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）

三井住友・DC年金バランス50（標準型）

三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）

上記3ファンドの愛称として「マイパッケージ」という名称を用いることがあります。

以下3ファンドを総称して、あるいはそれぞれを「当ファンド」または「各ファンド」ということがあります。また、「三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）」、「三井住友・DC年金バランス50（標準型）」、「三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）」をそれぞれ「マイパッケージ30」「マイパッケージ50」「マイパッケージ70」ということがあります。

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

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

当初元本は1口当たり1円です。格付けは取得しておりません。

### （３）【発行（売出）価額の総額】

各ファンドにつき5,000億円を上限とします（合計で1兆5,000億円を上限とします。）。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

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

基準価額は、組入有価証券の値動き等により日々変動します。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、それぞれ「DCマ30」、「DCマ50」、「DCマ70」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
三井住友アセットマネジメント株式会社	0120-88-2976

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

### （５）【申込手数料】

無手数料です。

### （６）【申込単位】

1円以上1円単位

### （７）【申込期間】

平成22年5月14日から平成23年5月12日まで

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

#### （８）【申込取扱場所】

販売会社において申込みを取り扱います。

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

#### （９）【払込期日】

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

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

#### （１０）【払込取扱場所】

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

#### （１１）【振替機関に関する事項】

当ファンドの振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

#### （１２）【その他】

イ 申込証拠金

ありません。

ロ わが国以外の地域における募集

ありません。

ハ クーリングオフ制度（金融商品取引法第37条の6）の適用

ありません。

ニ 振替受益権について

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

（参考：投資信託振替制度）

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

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

イ 当ファンドは、「国内株式インデックス・マザーファンド（B号）」、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「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。）の受益証券への投資を通じて、わが国を含む世界各国の株式、公社債に分散投資することにより、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。

ロ 各ファンドの運用にあたっては、株式、債券、短期金融資産を各ファンド毎の基本資産配分の比率により独自に作成した合成指数をベンチマークとして、中長期的にベンチマークに連動する投資成果を目指します。詳細については、後述の「2 投資方針」をご参照ください。

ハ 委託会社は、受託会社と合意の上、各ファンドそれぞれ金5,000億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。
補足分類	インデックス型	目論見書または信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す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）資産配分固定型））	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載しています。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は株式および債券であり、ファンドの収益は株式市場、債券市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「資産複合」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル（日本を含む）	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。
為替ヘッジ	為替ヘッジなし	目論見書または信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。

対象インデックス	その他の指数（合成指数）	目論見書または信託約款において、委託会社が定める合成指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。
----------	--------------	--

《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)	補足分類
単 位 型  追 加 型	国 内  海 外  内 外	株 式  債 券  不 動 産 投 信  そ の 他 資 産 ( 資 産 複 合	インデックス型    特 殊 型

(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	対象インデックス
株 式 一 般 株 大 型 株 中 小 型 株	年 1 回 年 2 回 年 4 回	グ ロ ー バ ル (日本を含む) 日 本 北 米			日 経 2 2 5
債 券 一 般 債 公 債 社 債 そ の 他 債 券 ク レ ジ ッ ト 属 性 ( )	年 6 回 (隔月) 年 12 回 (毎月) 日 々	欧 州 ア ジ ア オ セ ア ニ ア	ファミリーファンド	あ り	T O P I X
不動産投信  その他資産 (投資信託以外(資産複合(株式、 債券)資産配分固定型))	そ の 他 ( )	中 南 米 ア フ リ カ 中 近 東 (中 東) エ マ ー ジ ン グ	ファンド・オブ・ファンズ	な し	そ の 他 (合成指数)
資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型					

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

## （２）【ファンドの仕組み】

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。

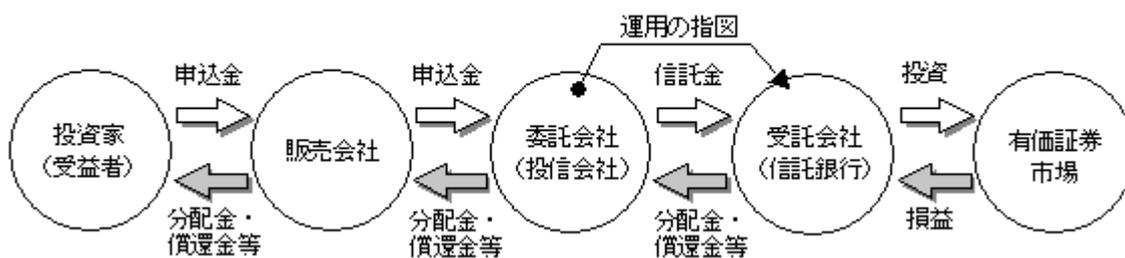
（ロ）受託会社 「住友信託銀行株式会社」

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

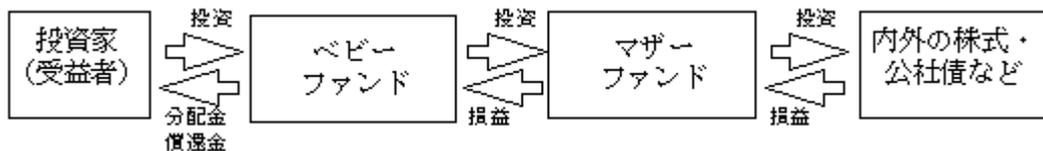
委託会社との間で締結される販売契約（名称の如何を問いません。）に基づき、当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書（目論見書）の提供、受益者からの一部解約実行請求の受付、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を行います。

### 運営の仕組み



当ファンドの運用は、「ファミリーファンド方式」で行われます。

「ファミリーファンド方式」とは、複数のファンドを合同運用する仕組みで、受益者の資金をまとめて「ベビーファンド」とし、「ベビーファンド」の資金の全部または一部を「マザーファンド」に投資することにより、実質的な運用は「マザーファンド」において行う仕組みです。



ロ 委託会社の概況

（イ）資本金の額

2,000百万円（平成22年3月31日現在）

（ロ）会社の沿革

昭和60年7月 三生投資顧問株式会社設立

昭和62年2月 証券投資顧問業の登録

昭和62年6月 投資一任契約にかかる業務の認可

平成11年1月 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 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 証券投資信託委託業の認可取得

平成14年12月 住友ライフ・インベストメント株式会社、スミセイ グローバル投信株式会社、三井住友海上アセットマネジメント株式会社およびさくら投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友アセットマネジメント株式会社に商号変更

## (八) 大株主の状況

(平成22年3月31日現在)

名称	住所	所有 株式数	比率 (%)
住友生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区城見一丁目4番35号	7,056	40.0
三井住友海上火災保険株式会社	東京都中央区新川二丁目27番2号	4,851	27.5
株式会社三井住友銀行	東京都千代田区有楽町一丁目1番2号	4,851	27.5
三井生命保険株式会社	東京都千代田区大手町二丁目1番1号	882	5.0

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### イ 基本方針

内外の株式・公社債に投資する4つのマザーファンドの組入れを通じて、わが国を含む世界各国の株式、公社債に分散投資することにより、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。

国内株式	国内株式インデックス・マザーファンド（B号）
国内債券	国内債券バッシブ・マザーファンド
外国株式	外国株式インデックス・マザーファンド
外国債券	外国債券バッシブ・マザーファンド

#### ロ 投資態度

(イ) 各ファンドにつき、マザーファンド受益証券への投資を通じて行う各資産への実質的な基本資産配分は下記の通りとします。

ただし、それぞれの資産の時価変動等に伴う各資産比率の変化については、一定の範囲（±3%）を設けて調整を行います。

		マイパッケージ30	マイパッケージ50	マイパッケージ70
株 式		30%	50%	70%
	国内株式	20%	35%	50%
	外国株式	10%	15%	20%
債 券		65%	45%	25%
	国内債券	55%	35%	15%
	外国債券	10%	10%	10%
短期金融資産		5%	5%	5%

(ロ) 各ファンドの運用は、以下の比率により委託会社が独自に作成した合成指数をベンチマークとし、中長期的にベンチマークに連動する投資成果を目指します。

	マイパッケージ30	マイパッケージ50	マイパッケージ70
TOPIX（東証株価指数、配当込み）	20%	35%	50%
NOMURA - BPI（総合）	55%	35%	15%
MSCI - KOKUSAIインデックス（円ベース）	10%	15%	20%
シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）	10%	10%	10%
有担保コール翌日物	5%	5%	5%

(ハ) 実質外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行わないことを基本とします。

#### (ニ) 非株式割合に関する制限

##### a. マイパッケージ30

制限はありません。

##### b. マイパッケージ50

株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資割合は、原則として信託財産総額の75%以下とします。

##### c. マイパッケージ70

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

(ホ) 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。

## <各マザーファンドの運用プロセス>

### 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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。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。T O P I X（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。

### 国内債券パッシブ・マザーファンド

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

### 外国株式インデックス・マザーファンド

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。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。M S C I - K O K U S A I 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。

### 外国債券パッシブ・マザーファンド

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

**（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、次に掲げるものとします。

（イ）次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律第２条第１項の「特定資産」をいいます。以下同じ。）

- １．有価証券
- ２．デリバティブ取引にかかる権利
- ３．金銭債権
- ４．約束手形

（ロ）特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

- １．為替手形

**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、マザーファンドの受益証券または次の有価証券（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．株券または新株引受権証書
  - ２．国債証券
  - ３．地方債証券
  - ４．特別の法律により法人の発行する債券
  - ５．社債券（新株引受権証書と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
  - ６．特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第２条第１項第４号で定めるものをいいます。）
  - ７．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第２条第１項第６号で定めるものをいいます。）
  - ８．協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第２条第１項第７号で定めるものをいいます。）
  - ９．特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第２条第１項第８号で定めるものをいいます。）
  - １０．コマーシャル・ペーパー
  - １１．新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
  - １２．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
  - １３．投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第10号で定めるものをいいます。）
  - １４．投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。）
  - １５．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第２条第１項第18号で定めるものをいいます。）
  - １６．オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第２条第１項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）
  - １７．預託証書（金融商品取引法第２条第１項第20号で定めるものをいいます。）
  - １８．外国法人が発行する譲渡性預金証書
  - １９．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
  - ２０．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  - ２１．外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
- なお、第１号の証券または証書、第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第１号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第２号から第６号までの証券および第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第２号から第６号までの証券の性質を有するもの、および第14号の証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、第13号の証券および第14号の証券（ただし、投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

**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  
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
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

### （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、ファンドマネジャーが、マクロ経済環境、市場環境に関する分析・検討を行います。

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

##### （ロ）実行（Do）

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

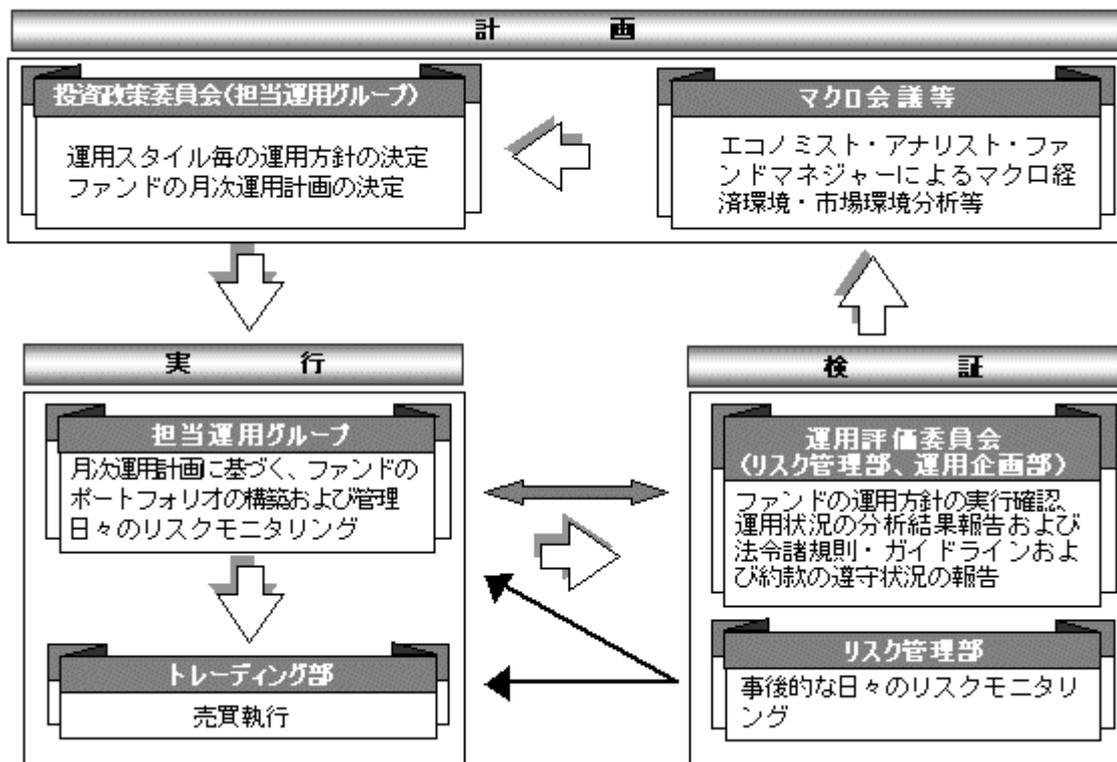
売買執行については、組織的に分離されたトレーディング部が、最良と思われる手法をもって売買を執行します。

##### （ハ）検証（Check）

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

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

#### 【ファンドの運用体制】



リスク管理部は8名程度、運用企画部は9名程度で構成されています。

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

#### ロ 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

**（４）【分配方針】**

毎決算時（原則として毎年２月18日、ただし決算当日が休業日の場合は翌営業日）に、原則として以下の方針に基づき収益分配を行います。

- イ 分配対象額の範囲は、繰越分を含めた利子、配当収益と売買益（評価損益を含みます。）等の全額とします。
- ロ 収益分配金額は、委託会社が基準価額水準等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には、委託会社の判断により収益分配を行わない場合があります。
- ハ 留保益の運用については特に制限を定めず、委託会社の判断に基づき、前記「（１）投資方針」と同一の運用を行います。

**（５）【投資制限】****ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限**

イ 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に対して、以下の通りとします。

マイパッケージ30 50%未満

マイパッケージ50 25%以上

マイパッケージ70 50%以上

実質投資割合とは、当ファンドが保有するある種類の資産の評価額が当ファンドの純資産総額に占める比率（「組入比率」といいます。）と、当該同一種類の資産のマザーファンドにおける組入比率に当該マザーファンド受益証券の当ファンドにおける組入比率を乗じて得た率を合計したものをいいます（以下同じ）。

- ロ 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、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ハ 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。
- ニ 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。
- 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。

**ファンドの信託約款に基づくその他の投資制限**

イ 投資する株式等の範囲

（イ）委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場している株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。

（ロ）上記（イ）にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録することが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができるものとします。

ロ 信用取引の指図

（イ）委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

（ロ）信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

（ハ）信託財産の一部解約等の事由により、信用取引の売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

ハ 先物取引等の指図

（イ）委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるも

のをいいます。以下同じ。) ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとします(以下同じ。)

- (ロ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに為替変動リスクを回避するために、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引および通貨にかかるオプション取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- (ハ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するために、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

## ニ スワップ取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するために、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。)を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこのかぎりではありません。
- (ハ) スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ニ) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- (ホ) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

## ホ 金利先渡取引および為替先渡取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するために、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- (ロ) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- (ハ) 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかる金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、金利先渡取引および為替先渡取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかに、その超える額に相当する金利先渡取引および為替先渡取引の一部の解約を指図するものとします。
- (ニ) 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- (ホ) 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。
- (ヘ) 「金利先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日(以下「決済日」といいます。)における決済日から一定の期間を経過した日(以下「満期日」といいます。)までの期間にかかる国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率(以下「指標利率」といいます。)の数値を取り決め、その取決めにかかる数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。
- (ト) 「為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間にかかる為替スワップ取引(同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下同じ。)のスワップ幅(当該直物外国為替取引にかかる外国為替相場と当該先物外国為替取引にかかる外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下同じ。)を取り決め、その取決めにかかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取決めにかかるスワップ幅から決済日

における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金にかかる決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

#### へ 有価証券の貸付けの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。
1. 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
  2. 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- (ロ) 上記(イ)に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- (ハ) 委託会社は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

#### ト 有価証券の空売りの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または借り入れた有価証券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売り付けた有価証券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- (ロ) 有価証券の売付けの指図は、当該売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。
- (ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

#### チ 有価証券の借入れの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入れの指図をすることができます。なお、当該有価証券の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図をするものとします。
- (ロ) 有価証券の借入れの指図は、当該借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。
- (ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた有価証券の一部を返還するための指図をするものとします。
- (ニ) 有価証券の借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

#### リ 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

#### ヌ 外国為替予約取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- (ロ) 予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- (ハ) 上記(ロ)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

#### ル 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に資するため、信託財産において一部解約金の支払資金の不足額が生じるときは、資金借入れ(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) 上記(イ)の資金借入れ額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。
1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内
  2. 一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内

## 3. 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%以内

- (八) 上記(ロ)の借入期間は、有価証券等の売却代金または償還金の入金日までに限るものとします。
- (二) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

**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：マザーファンドの投資方針等）****（国内株式インデックス・マザーファンド（B号））****（1）投資方針等**

## イ 基本方針

主としてわが国の株式に投資し、TOPIX（東証株価指数、配当込み）と連動する投資成果を目指して運用を行います。

## ロ 投資態度

（イ）主として東京証券取引所第1部に上場している株式に投資を行い、TOPIX（東証株価指数、配当込み）と連動する投資成果を目指して運用を行います。

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

（ハ）株式以外の資産への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。

**（2）投資対象**

## イ 投資対象とする資産の種類

前記「2 投資方針（2）投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載したベビーファンドが投資対象とする資産の種類に同じです。

## ロ 投資対象とする有価証券

前記「2 投資方針（2）投資対象 ロ 投資対象とする有価証券」において記載したベビーファンドが投資対象とする有価証券の各号のうち、第1号、第2号、第4号、第10号、第13号、第18号および第19号に掲げるものに投資します。

## ハ 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針（2）投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載したベビーファンドが投資対象とする金融商品の各号のうち、第1号から第4号に掲げるものに投資します。

**（3）投資制限**

## イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

（イ）外貨建資産への投資は行いません。

（ロ）株式への投資割合には制限を設けません。

## ロ 法令に基づく投資制限

ベビーファンドにつき上述した法令に基づく制限は、当マザーファンドについても課されます。

**（国内債券バッシブ・マザーファンド）****（１）投資方針等**

## イ 基本方針

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 - 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）NOMURA - B P I（総合）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）公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

（ハ）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。

**（２）投資対象**

## イ 投資対象とする資産の種類

前記「２ 投資方針（２）投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載したベビーファンドが投資対象とする資産の種類に同じです。

## ロ 投資対象とする有価証券

前記「２ 投資方針（２）投資対象 ロ 投資対象とする有価証券」において記載したベビーファンドが投資対象とする各号（第1号から第21号まで）の有価証券に投資します。

## ハ 投資対象とする金融商品

前記「２ 投資方針（２）投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載したベビーファンドが投資対象とする金融商品に同じです。

**（３）投資制限**

## イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

（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。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

（ロ）新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

（ハ）投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

（ニ）外貨建資産への投資は行いません。

（ホ）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、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。

## ロ 法令に基づく投資制限

ベビーファンドにつき上述した法令に基づく制限は、当マザーファンドについても課されます。

**(外国株式インデックス・マザーファンド)****(1) 投資方針等**

## イ 基本方針

主として日本を除く世界各国の株式に投資し、MSCI - KOKUSAIインデックス(円ベース)と連動する投資成果を目指して運用を行います。

## ロ 投資態度

(イ) 主として世界各国の株式に投資し、MSCI - KOKUSAIインデックス(円ベース)と連動する投資成果を目指して運用を行います。

(ロ) 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行わないものとします。

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

**(2) 投資対象**

## イ 投資対象とする資産の種類

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載したベビーファンドが投資対象とする資産の種類に同じです。

## ロ 投資対象とする有価証券

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ロ 投資対象とする有価証券」において記載したベビーファンドが投資対象とする有価証券の各号のうち、第1号、第2号、第4号、第5号、第10号から第21号(ただし、投資法人債券を除きます。)に掲げるものに投資します。

## ハ 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載したベビーファンドが投資対象とする金融商品に同じです。

**(3) 投資制限**

## イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

(イ) 株式への投資割合には制限を設けません。

(ロ) 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

## ロ 法令に基づく投資制限

ベビーファンドにつき上述した法令に基づく制限は、当マザーファンドについても課されます。

**（外国債券パッシブ・マザーファンド）****（１）投資方針等**

## イ 基本方針

シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）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。

## ロ 投資態度

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

**（２）投資対象**

## イ 投資対象とする資産の種類

前記「２ 投資方針（２）投資対象 イ 投資対象とする資産の種類」において記載したベビーファンドが投資対象とする資産の種類に同じです。

## ロ 投資対象とする有価証券

前記「２ 投資方針（２）投資対象 ロ 投資対象とする有価証券」において記載したベビーファンドが投資対象とする各号（第1号から第21号まで）の有価証券（ただし、投資法人債券を除きます。）に投資します。

## ハ 投資対象とする金融商品

前記「２ 投資方針（２）投資対象 ハ 投資対象とする金融商品」において記載したベビーファンドが投資対象とする金融商品に同じです。

**（３）投資制限**

## イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- （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）投資信託証券への投資割合は、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。

## ロ 法令に基づく投資制限

ベビーファンドにつき上述した法令に基づく制限は、当マザーファンドについても課されます。

### 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、主に内外の株式や債券を投資対象としています（マザーファンドを通じて間接的に投資する場合を含みます。）。当ファンドの基準価額は、組み入れた株式や債券の値動き、為替相場の変動等の影響により上下しますので、これにより投資元本を割り込むことがあります。また、組み入れた株式や債券の発行者の経営・財務状況の変化およびそれらに関する外部評価の変化等により、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、当ファンドは金融機関の預金とは異なり、元金が保証されているものではなく、一定の投資成果を保証するものでもありません。また、当ファンドは、預金や保険契約と異なり、預金保険、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。登録金融機関は、投資者保護基金には加入していません。

当ファンドが有するリスク等（当ファンドが主要投資対象とするマザーファンドへの投資を通じて間接的に受ける実質的なリスク等を含みます。）のうち主要なものは、以下の通りです。

#### （イ）株式市場リスク

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

#### （ロ）債券市場リスク

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

#### （ハ）為替変動リスク

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

#### （ニ）信用リスク

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

#### （ホ）カントリーリスク

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

#### （ヘ）市場流動性リスク

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

#### （ト）インデックスに連動しない要因・留意点

当ファンドは、委託会社が独自に作成した合成指数に連動する投資成果を目指して運用を行います。ただし、有価証券売買時のコストおよび信託報酬その他のファンド運営にかかる費用、追加設定・解約に伴う組入有価証券の売買のタイミング差、インデックス構成銘柄と組入有価証券との誤差の影響等から、上記インデックスに連動しないことがあります。

#### （チ）ファミリーファンド方式にかかる留意点

当ファンドは「ファミリーファンド方式」により運用するため、当ファンドと同じマザーファンドを投資対象とする他のペーパーファンドに追加設定・一部解約により資金の流入が生じた場合、その結果として、当該マザーファンドにおいても組入有価証券の売買等が生じ、当ファンドの基準価額に影響を及ぼすことがあります。

#### 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チェックを行っています。リスク管理部では、主に投資信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングを行います。また、法務コンプライアンス部では、主に法令・諸規則等の遵守状況についてのチェックを行います。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価委員会、リスク管理委員会およびコンプライアンス委員会への報告が義務づけられています。

## 4【手数料等及び税金】

### （１）【申込手数料】

無手数料です。

### （２）【換金（解約）手数料】

解約手数料はありません。

### （３）【信託報酬等】

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

信託報酬の実質的配分は以下の通りです。

		マイパッケージ30	マイパッケージ50	マイパッケージ70
信託報酬率（総額）		年0.2310% （年0.22%）	年0.2415% （年0.23%）	年0.2520% （年0.24%）
配分	委託会社	年0.0945% （年0.09%）	年0.105% （年0.10%）	年0.1155% （年0.11%）
	販売会社	年0.1050% （年0.10%）	年0.1050% （年0.10%）	年0.1050% （年0.10%）
	受託会社	年0.0315% （年0.03%）	年0.0315% （年0.03%）	年0.0315% （年0.03%）

（ ）内は税抜き。

### （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0.00525%（税抜き0.005%）の率を乗じて得た金額が信託財産の費用として計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。監査費用は、将来、監査法人との契約等により変更となることがあります。
- ロ 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立て替えた立替金の利息は、信託財産中から支弁します。
- ハ 有価証券の売買時の手数料、デリバティブ取引等に要する費用、および外国における資産の保管等に要する費用（それらにかかる消費税等相当額を含みます。）等は、信託財産中から支弁するものとします。

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

上記（１）～（４）にかかる手数料等の合計額、その上限額、計算方法等は、手数料等に保有期間に応じて異なるものが含まれていたり、発生時・請求時に初めて具体的金額を認識するものがあったりすることから、あらかじめ具体的に記載することはできません。

### （５）【課税上の取扱い】

- イ 個別元本について
  - （イ）追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。
  - （ロ）受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合については、各販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても同一受益者の顧客口座が複数存在する場合や、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」を併用するファンドの場合には、別々に個別元本の算出が行われることがあります。

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

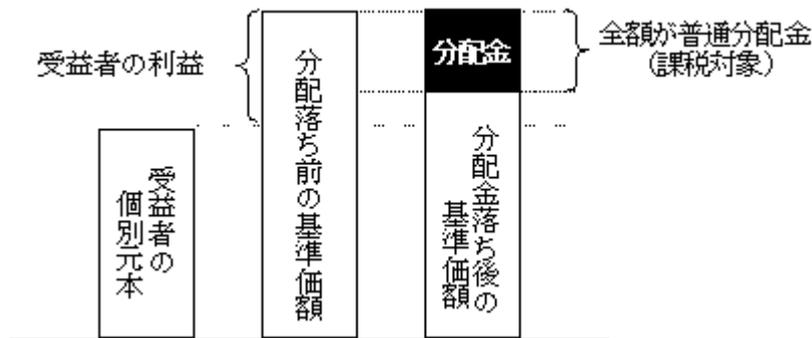
ロ 一部解約時および償還時の課税について

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

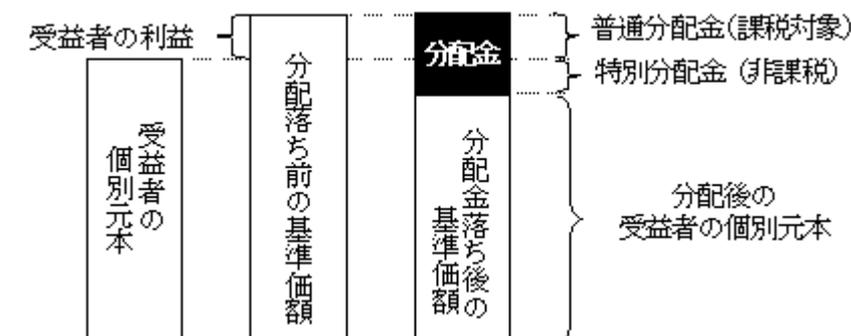
ハ 収益分配金の課税について

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

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



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



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

二 個人、法人別の課税の取扱いについて

(イ) 個人の受益者に対する課税

・ 収益分配時

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、平成23年12月31日までは10%（所得税7%および地方税3%）、平成24年1月1日以降は20%（所得税15%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行われ、申告不要制度が適用されます。確定申告による総合課税または申告分離課税の選択も可能です。

・ 一部解約時および償還時

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

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

(ロ) 法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額につい

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

<受取配当にかかる益金不算入制度の適用の可否>

a. マイパッケージ30

受取配当にかかる益金不算入制度の適用はありません。

外貨建資産割合および非株式割合

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。

非株式割合に関する制限はありません(約款規定なし)。

b. マイパッケージ50

原則として受取配当にかかる益金不算入制度の適用が可能です。

外貨建資産割合および非株式割合

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。

株式以外の資産(他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。)への投資割合は、原則として信託財産総額の75%以下とします。

c. マイパッケージ70

原則として受取配当にかかる益金不算入制度の適用が可能です。

外貨建資産割合および非株式割合

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。

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

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22年3月末現在の情報をもとに作成しています。税法の改正等により、変更されることがあります。

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

## 5【運用状況】

## (1)【投資状況】

## a. 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)

平成22年3月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国内株式インデックス・マザーファンド(B号)受益証券	日本	319,486,720	21.18
国内債券パッシブ・マザーファンド受益証券	日本	813,892,826	53.94
外国株式インデックス・マザーファンド受益証券	日本	161,796,713	10.72
外国債券パッシブ・マザーファンド受益証券	日本	151,536,732	10.04
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		62,046,201	4.11
合計(純資産総額)		1,508,759,192	100.00

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

## b. 三井住友・DC年金バランス50(標準型)

平成22年3月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国内株式インデックス・マザーファンド(B号)受益証券	日本	1,791,810,670	36.15
国内債券パッシブ・マザーファンド受益証券	日本	1,689,091,662	34.08
外国株式インデックス・マザーファンド受益証券	日本	777,945,322	15.69
外国債券パッシブ・マザーファンド受益証券	日本	486,400,769	9.81
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		211,706,273	4.27
合計(純資産総額)		4,956,954,696	100.00

## c. 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)

平成22年3月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国内株式インデックス・マザーファンド(B号)受益証券	日本	1,148,840,251	50.56
国内債券パッシブ・マザーファンド受益証券	日本	338,592,002	14.90
外国株式インデックス・マザーファンド受益証券	日本	464,252,952	20.43
外国債券パッシブ・マザーファンド受益証券	日本	227,718,630	10.02
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		92,758,286	4.08
合計(純資産総額)		2,272,162,121	100.00

## (2) 【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ 主要投資銘柄

## a . 三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）

平成22年3月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量(口)	帳簿価額 単価/金額 (円)	評価額 単価/金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託 受益証券	国内債券パッシブ・ マザーファンド	764,362,159	1.0654 814,356,575	1.0648 813,892,826	53.94
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)	251,465,345	1.1640 292,705,662	1.2705 319,486,720	21.18
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	121,578,534	1.2226 148,641,916	1.3308 161,796,713	10.72
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	125,548,246	1.1826 148,475,127	1.2070 151,536,732	10.04

## b . 三井住友・DC年金バランス50（標準型）

平成22年3月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量(口)	帳簿価額 単価/金額 (円)	評価額 単価/金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託 受益証券	国内株式インデックス・ マザーファンド(B号)	1,410,319,300	1.1640 1,641,611,666	1.2705 1,791,810,670	36.15
日本	親投資信託 受益証券	国内債券パッシブ・ マザーファンド	1,586,299,458	1.0653 1,690,034,692	1.0648 1,689,091,662	34.08
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	584,569,674	1.2228 714,811,798	1.3308 777,945,322	15.69
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	402,983,239	1.1826 476,582,131	1.2070 486,400,769	9.81

## c . 三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）

平成22年3月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量(口)	帳簿価額 単価/金額 (円)	評価額 単価/金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託 受益証券	国内株式インデックス・ マザーファンド(B号)	904,242,622	1.1640 1,052,610,492	1.2705 1,148,840,251	50.56
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	348,852,534	1.2229 426,611,764	1.3308 464,252,952	20.43
日本	親投資信託 受益証券	国内債券パッシブ・ マザーファンド	317,986,479	1.0653 338,782,206	1.0648 338,592,002	14.90
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	188,664,980	1.1831 223,211,859	1.2070 227,718,630	10.02

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

## □ 種類別の投資比率

## a．三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）

平成22年3月31日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	95.89
合計	95.89

## b．三井住友・DC年金バランス50（標準型）

平成22年3月31日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	95.73
合計	95.73

## c．三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）

平成22年3月31日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	95.92
合計	95.92

## 【投資不動産物件】

各ファンドにつき、該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

各ファンドにつき、該当事項はありません。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

## a. 三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）

年月日	純資産総額 (円)	1万口当たりの 純資産額(円)
第1期(平成18年2月20日)(分配落)	1,035,569	10,356
第1期(平成18年2月20日)(分配付)	1,035,569	10,356
第2期(平成19年2月19日)(分配落)	284,591,517	10,992
第2期(平成19年2月19日)(分配付)	284,591,517	10,992
第3期(平成20年2月18日)(分配落)	709,939,713	10,504
第3期(平成20年2月18日)(分配付)	709,939,713	10,504
第4期(平成21年2月18日)(分配落)	925,997,054	8,783
第4期(平成21年2月18日)(分配付)	925,997,054	8,783
第5期(平成22年2月18日)(分配落)	1,428,892,994	9,699
第5期(平成22年2月18日)(分配付)	1,428,892,994	9,699
平成21年3月末日	994,904,253	8,988
平成21年4月末日	1,028,039,834	9,243
平成21年5月末日	1,133,760,950	9,431
平成21年6月末日	1,155,002,464	9,573
平成21年7月末日	1,311,417,055	9,675
平成21年8月末日	1,340,174,820	9,757
平成21年9月末日	1,346,194,652	9,675
平成21年10月末日	1,373,520,753	9,661
平成21年11月末日	1,367,208,759	9,526
平成21年12月末日	1,432,578,949	9,788
平成22年1月末日	1,426,272,874	9,668
平成22年2月末日	1,420,786,806	9,643
平成22年3月末日	1,508,759,192	9,979

## b. 三井住友・DC年金バランス50（標準型）

年月日	純資産総額 (円)	1万口当たりの 純資産額(円)
第1期(平成18年2月20日)(分配落)	1,057,373	10,574
第1期(平成18年2月20日)(分配付)	1,057,373	10,574
第2期(平成19年2月19日)(分配落)	1,249,567,567	11,564
第2期(平成19年2月19日)(分配付)	1,249,567,567	11,564
第3期(平成20年2月18日)(分配落)	2,650,595,109	10,467
第3期(平成20年2月18日)(分配付)	2,650,595,109	10,467
第4期(平成21年2月18日)(分配落)	2,892,759,889	7,758
第4期(平成21年2月18日)(分配付)	2,892,759,889	7,758
第5期(平成22年2月18日)(分配落)	4,608,495,307	8,983
第5期(平成22年2月18日)(分配付)	4,608,495,307	8,983
平成21年3月末日	3,147,889,397	8,024
平成21年4月末日	3,319,955,447	8,400
平成21年5月末日	3,619,971,732	8,690
平成21年6月末日	3,714,140,521	8,857
平成21年7月末日	4,288,919,168	9,015
平成21年8月末日	4,404,031,566	9,112

平成21年9月末日	4,382,935,163	8,966
平成21年10月末日	4,433,661,721	8,947
平成21年11月末日	4,355,874,405	8,712
平成21年12月末日	4,618,011,859	9,092
平成22年1月末日	4,582,859,668	8,938
平成22年2月末日	4,568,909,453	8,903
平成22年3月末日	4,956,954,696	9,405

**c. 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)**

年月日	純資産総額 (円)	1万口当たりの 純資産額(円)
第1期(平成18年2月20日)(分配落)	1,079,124	10,791
第1期(平成18年2月20日)(分配付)	1,079,124	10,791
第2期(平成19年2月19日)(分配落)	591,109,514	12,141
第2期(平成19年2月19日)(分配付)	591,109,514	12,141
第3期(平成20年2月18日)(分配落)	1,189,426,390	10,410
第3期(平成20年2月18日)(分配付)	1,189,426,390	10,410
第4期(平成21年2月18日)(分配落)	1,169,406,901	6,771
第4期(平成21年2月18日)(分配付)	1,169,406,901	6,771
第5期(平成22年2月18日)(分配落)	2,060,345,540	8,216
第5期(平成22年2月18日)(分配付)	2,060,345,540	8,216
平成21年3月末日	1,303,197,921	7,080
平成21年4月末日	1,399,738,714	7,544
平成21年5月末日	1,539,243,943	7,912
平成21年6月末日	1,607,486,022	8,098
平成21年7月末日	1,905,212,202	8,301
平成21年8月末日	1,964,468,233	8,408
平成21年9月末日	1,950,099,464	8,209
平成21年10月末日	1,974,881,788	8,185
平成21年11月末日	1,915,196,878	7,869
平成21年12月末日	2,063,887,000	8,340
平成22年1月末日	2,046,067,135	8,160
平成22年2月末日	2,037,271,073	8,116
平成22年3月末日	2,272,162,121	8,751

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

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

## 【分配の推移】

## a．三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）

計算期間	1万口当たり分配金（円）
第1期（平成17年9月30日～平成18年2月20日）	0
第2期（平成18年2月21日～平成19年2月19日）	0
第3期（平成19年2月20日～平成20年2月18日）	0
第4期（平成20年2月19日～平成21年2月18日）	0
第5期（平成21年2月19日～平成22年2月18日）	0

## b．三井住友・DC年金バランス50（標準型）

計算期間	1万口当たり分配金（円）
第1期（平成17年9月30日～平成18年2月20日）	0
第2期（平成18年2月21日～平成19年2月19日）	0
第3期（平成19年2月20日～平成20年2月18日）	0
第4期（平成20年2月19日～平成21年2月18日）	0
第5期（平成21年2月19日～平成22年2月18日）	0

## c．三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）

計算期間	1万口当たり分配金（円）
第1期（平成17年9月30日～平成18年2月20日）	0
第2期（平成18年2月21日～平成19年2月19日）	0
第3期（平成19年2月20日～平成20年2月18日）	0
第4期（平成20年2月19日～平成21年2月18日）	0
第5期（平成21年2月19日～平成22年2月18日）	0

## 【収益率の推移】

## a．三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）

計算期間	収益率（％）
第1期	3.6
第2期	6.1
第3期	4.4
第4期	16.4
第5期	10.4

## b．三井住友・DC年金バランス50（標準型）

計算期間	収益率（％）
第1期	5.7
第2期	9.4
第3期	9.5
第4期	25.9
第5期	15.8

## c. 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)

計算期間	収益率(%)
第1期	7.9
第2期	12.5
第3期	14.3
第4期	35.0
第5期	21.3

(注1) 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。

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

## 【参考情報：マザーファンドの投資状況・投資資産】

## 【国内株式インデックス・マザーファンド（B号）】

## （１）投資状況

平成22年 3月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	345,921,987,332	98.35
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,802,579,346	1.65
合計(純資産総額)		351,724,566,678	100.00

当ファンドは、平成22年3月31日現在、株価指数先物取引を買建てしており、その評価額は5,581,525,000（投資比率1.59%）です。

## （２）投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成22年 3月31日現在

国/地域	種類	銘柄名/業種	数量 (株)	帳簿価額 単価/金額 (円)	評価額 単価/金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車 〔輸送用機器〕	3,653,000	3,440.00 12,566,320,000	3,745.00 13,680,485,000	3.89
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ 〔銀行業〕	19,989,800	480.81 9,611,295,738	490.00 9,795,002,000	2.78
日本	株式	本田技研工業 〔輸送用機器〕	2,268,000	2,700.00 6,123,600,000	3,300.00 7,484,400,000	2.13
日本	株式	キヤノン 〔電気機器〕	1,648,600	3,330.00 5,489,838,000	4,330.00 7,138,438,000	2.03
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ 〔銀行業〕	1,997,300	2,873.75 5,739,740,875	3,090.00 6,171,657,000	1.75
日本	株式	三菱商事 〔卸売業〕	2,096,500	1,950.00 4,088,175,000	2,450.00 5,136,425,000	1.46
日本	株式	ソニー 〔電気機器〕	1,419,000	2,325.00 3,299,175,000	3,580.00 5,080,020,000	1.44
日本	株式	任天堂 〔その他製品〕	150,100	21,210.00 3,183,621,000	31,300.00 4,698,130,000	1.34
日本	株式	日本電信電話 〔情報・通信業〕	1,105,700	3,750.13 4,146,518,741	3,940.00 4,356,458,000	1.24
日本	株式	武田薬品工業 〔医薬品〕	1,045,900	3,600.00 3,765,240,000	4,115.00 4,303,878,500	1.22
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ 〔銀行業〕	23,026,300	162.00 3,730,260,600	185.00 4,259,865,500	1.21
日本	株式	東京電力 〔電気・ガス業〕	1,672,000	2,330.00 3,895,760,000	2,492.00 4,166,624,000	1.18
日本	株式	パナソニック 〔電気機器〕	2,598,200	1,111.00 2,886,600,200	1,430.00 3,715,426,000	1.06
日本	株式	野村ホールディングス 〔証券、商品先物取引業〕	5,252,000	622.00 3,266,744,000	689.00 3,618,628,000	1.03
日本	株式	三井物産 〔卸売業〕	2,261,200	1,144.00 2,586,812,800	1,571.00 3,552,345,200	1.01

日本	株式	エヌ・ティ・ティ・ドコモ 〔情報・通信業〕	23,274	131,000.00 3,048,894,000	142,400.00 3,314,217,600	0.94
日本	株式	東日本旅客鉄道 〔陸運業〕	494,600	6,100.00 3,017,060,000	6,500.00 3,214,900,000	0.91
日本	株式	東芝 〔電気機器〕	5,989,000	458.00 2,742,962,000	483.00 2,892,687,000	0.82
日本	株式	新日本製鐵 〔鉄鋼〕	7,817,000	321.00 2,509,257,000	367.00 2,868,839,000	0.82
日本	株式	三菱地所 〔不動産業〕	1,842,000	1,345.02 2,477,526,840	1,530.00 2,818,260,000	0.80
日本	株式	東京海上ホールディングス 〔保険業〕	1,067,300	2,485.00 2,652,240,500	2,633.00 2,810,200,900	0.80
日本	株式	ファナック 〔電気機器〕	274,900	7,140.00 1,962,786,000	9,920.00 2,727,008,000	0.78
日本	株式	ソフトバンク 〔情報・通信業〕	1,147,500	2,070.00 2,375,325,000	2,303.00 2,642,692,500	0.75
日本	株式	日産自動車 〔輸送用機器〕	3,192,300	626.00 1,998,379,800	801.00 2,557,032,300	0.73
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス 〔小売業〕	1,120,800	1,933.00 2,166,506,400	2,259.00 2,531,887,200	0.72
日本	株式	信越化学工業 〔化学〕	457,400	4,690.00 2,145,206,000	5,430.00 2,483,682,000	0.71
日本	株式	小松製作所 〔機械〕	1,234,100	1,698.00 2,095,501,800	1,960.00 2,418,836,000	0.69
日本	株式	関西電力 〔電気・ガス業〕	1,085,900	2,150.00 2,334,685,000	2,142.00 2,325,997,800	0.66
日本	株式	日本たばこ産業 〔食料品〕	6,625	255,800.00 1,694,675,000	348,000.00 2,305,500,000	0.66
日本	株式	ジェイエフイーホールディングス 〔鉄鋼〕	596,500	2,840.00 1,694,060,000	3,765.00 2,245,822,500	0.64

## □ 種類別・業種別の投資比率

平成22年3月31日現在

種類	業種	投資比率 (%)	種類	業種	投資比率 (%)
株式（国内）	水産・農林業	0.09	株式（国内）	精密機器	1.56
	鉱業	0.38		その他製品	2.41
	建設業	1.94		電気・ガス業	4.86
	食料品	3.18		陸運業	3.69
	繊維製品	0.83		海運業	0.59
	パルプ・紙	0.36		空運業	0.29
	化学	5.82		倉庫・運輸関連業	0.23
	医薬品	3.93		情報・通信業	5.21
	石油・石炭製品	0.62		卸売業	5.14
	ゴム製品	0.56		小売業	3.47
	ガラス・土石製品	1.25		銀行業	9.57
	鉄鋼	2.65		証券、商品先物取引業	1.80
	非鉄金属	1.23		保険業	2.13
	金属製品	0.70		その他金融業	0.75
	機械	4.63		不動産業	2.21
	電気機器	14.99		サービス業	1.51
	輸送用機器	9.77		合計	98.35

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

平成22年3月31日現在

種類	取引所等および 資産の名称	買建 / 売建	数量 (枚)	簿価(円)	時価(円)	投資 比率 (%)
株価指数 先物取引	東京証券取引所 TOPIX先物	買建	571	5,470,802,300	5,581,525,000	1.59

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については以下のように評価しております。

- ・原則として基準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又は最終相場で評価しております。
- ・このような時価が発表されていない場合には、基準日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

## 〔国内債券パッシブ・マザーファンド〕

## (1) 投資状況

平成22年3月31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	376,250,677,080	73.25
地方債証券	日本	33,566,768,884	6.54
特殊債券	日本	57,460,460,579	11.19
	韓国	201,016,000	0.04
	小計	57,661,476,579	11.23
社債券	日本	39,694,218,700	7.73
	アメリカ	3,845,347,000	0.75
	イギリス	203,930,000	0.04
	オランダ	101,155,000	0.02
	韓国	202,394,000	0.04
	小計	44,047,044,700	8.58
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,107,345,909	0.41
合計(純資産総額)		513,633,313,152	100.00

## (2) 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成22年3月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	額面金額 (円)	帳簿価額 単価/金額 (円)	評価額 単価/金額 (円)	利率/ 償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第234回利付国債(10年)	14,601,000,000	102.29 14,935,561,160	101.82 14,867,906,280	1.4 2011/9/20	2.89
日本	国債証券	第236回利付国債(10年)	13,128,000,000	102.70 13,483,137,100	102.30 13,430,206,560	1.5 2011/12/20	2.61
日本	国債証券	第247回利付国債(10年)	12,235,000,000	101.06 12,365,268,000	101.58 12,428,802,400	0.8 2013/3/20	2.42
日本	国債証券	第244回利付国債(10年)	11,452,000,000	101.65 11,640,958,000	102.05 11,687,796,680	1 2012/12/20	2.28
日本	国債証券	第263回利付国債(10年)	10,782,000,000	104.41 11,257,582,650	104.89 11,309,239,800	1.6 2014/9/20	2.20
日本	国債証券	第265回利付国債(10年)	10,650,000,000	104.14 11,091,662,810	104.52 11,132,338,500	1.5 2014/12/20	2.17
日本	国債証券	第231回利付国債(10年)	10,745,000,000	101.91 10,950,400,000	101.40 10,895,967,250	1.3 2011/6/20	2.12
日本	国債証券	第268回利付国債(10年)	10,315,000,000	104.23 10,752,137,000	104.60 10,790,315,200	1.5 2015/3/20	2.10
日本	国債証券	第260回利付国債(10年)	9,815,000,000	104.08 10,215,861,700	104.74 10,281,114,350	1.6 2014/6/20	2.00
日本	国債証券	第256回利付国債(10年)	9,710,000,000	103.13 10,014,767,000	103.76 10,075,969,900	1.4 2013/12/20	1.96
日本	国債証券	第258回利付国債(10年)	9,513,000,000	102.57 9,757,550,000	103.46 9,842,530,320	1.3 2014/3/20	1.92

日本	国債証券	第253回利付国債（10年）	9,310,000,000	103.90 9,673,197,000	104.32 9,712,843,700	1.6 2013/9/20	1.89
日本	国債証券	第250回利付国債（10年）	9,565,000,000	99.51 9,518,131,500	100.63 9,625,737,750	0.5 2013/6/20	1.87
日本	国債証券	第239回利付国債（10年）	8,688,000,000	102.74 8,926,333,920	102.67 8,920,143,360	1.4 2012/6/20	1.74
日本	国債証券	第242回利付国債（10年）	6,980,000,000	102.40 7,147,520,000	102.43 7,149,963,000	1.2 2012/9/20	1.39
日本	国債証券	第277回利付国債（10年）	6,265,000,000	104.13 6,523,872,300	105.11 6,585,454,750	1.6 2016/3/20	1.28
日本	国債証券	第237回利付国債（10年）	6,370,000,000	102.89 6,554,624,800	102.60 6,535,811,100	1.5 2012/3/20	1.27
日本	国債証券	第303回利付国債（10年）	6,295,000,000	100.81 6,346,209,730	100.67 6,337,302,400	1.4 2019/9/20	1.23
日本	国債証券	第305回利付国債（10年）	6,160,000,000	99.95 6,156,975,100	99.44 6,125,627,200	1.3 2019/12/20	1.19
日本	国債証券	第301回利付国債（10年）	5,595,000,000	101.26 5,665,879,500	101.85 5,698,731,300	1.5 2019/6/20	1.11
日本	国債証券	第270回利付国債（10年）	5,487,000,000	102.37 5,617,172,200	103.61 5,685,245,310	1.3 2015/6/20	1.11
日本	国債証券	第272回利付国債（10年）	5,345,000,000	102.78 5,493,811,000	104.09 5,563,717,400	1.4 2015/9/20	1.08
日本	国債証券	第274回利付国債（10年）	5,245,000,000	103.49 5,428,150,000	104.62 5,487,371,450	1.5 2015/12/20	1.07
日本	国債証券	第286回利付国債（10年）	5,080,000,000	104.46 5,306,806,500	105.94 5,382,158,400	1.8 2017/6/20	1.05
日本	国債証券	第243回利付国債（10年）	5,250,000,000	101.87 5,348,328,500	102.19 5,364,975,000	1.1 2012/9/20	1.04
日本	国債証券	第284回利付国債（10年）	5,067,000,000	104.04 5,271,711,800	105.49 5,345,431,650	1.7 2016/12/20	1.04
日本	国債証券	第288回利付国債（10年）	5,005,000,000	103.60 5,185,532,000	105.07 5,259,153,900	1.7 2017/9/20	1.02
日本	国債証券	第285回利付国債（10年）	4,988,000,000	103.89 5,182,255,800	105.40 5,257,800,920	1.7 2017/3/20	1.02
日本	国債証券	第282回利付国債（10年）	4,950,000,000	104.43 5,169,404,600	105.59 5,226,853,500	1.7 2016/9/20	1.02
日本	国債証券	第290回利付国債（10年）	5,097,000,000	101.07 5,151,537,900	102.41 5,220,296,430	1.4 2018/3/20	1.02

## □ 種類別の投資比率

平成22年3月31日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	73.25
地方債証券	6.54
特殊債券	11.23
社債券	8.58
合計	99.59

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

**その他投資資産の主要なもの**

該当事項はありません。

## 〔外国株式インデックス・マザーファンド〕

## (1) 投資状況

平成22年3月31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	133,557,850,028	51.92
	カナダ	13,886,067,896	5.40
	ドイツ	10,008,181,052	3.89
	イタリア	4,092,872,589	1.59
	フランス	12,755,804,365	4.96
	オーストラリア	10,434,699,523	4.06
	イギリス	26,233,790,245	10.20
	スイス	11,344,323,359	4.41
	バミューダ	835,666,139	0.32
	香港	2,791,864,901	1.09
	シンガポール	1,834,729,236	0.71
	ニュージーランド	130,419,521	0.05
	オランダ	3,527,599,258	1.37
	スペイン	5,069,217,387	1.97
	ベルギー	1,244,575,239	0.48
	スウェーデン	3,494,693,954	1.36
	ノルウェー	944,469,268	0.37
	オーストリア	410,538,214	0.16
	ルクセンブルク	783,005,587	0.30
	フィンランド	1,590,959,169	0.62
	デンマーク	1,220,208,755	0.47
	アイルランド	1,332,211,304	0.52
	ギリシャ	530,103,175	0.21
	キプロス	48,067,966	0.02
	ポルトガル	348,978,793	0.14
	ケイマン諸島	283,092,772	0.11
	モーリシャス	33,796,098	0.01
	リベリア	58,694,984	0.02
	パナマ	80,653,868	0.03
	ジャージー	583,190,197	0.23
	ガーンジー	38,204,481	0.01
アンティル	957,734,705	0.37	
マン島	35,109,007	0.01	
小計	250,521,373,035	97.39	
投資証券	アメリカ	2,012,743,387	0.78
	カナダ	353,963,861	0.14
	フランス	356,443,291	0.14
	オーストラリア	883,496,486	0.34
	イギリス	319,954,390	0.12
	香港	67,439,373	0.03
	シンガポール	68,911,290	0.03
	オランダ	46,342,945	0.02
	小計	4,109,295,023	1.60
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,613,997,245	1.02
合計(純資産総額)		257,244,665,303	100.00

## (2) 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成22年3月31日現在

国/ 地域	種類	銘柄名/業種	数量 (株)	帳簿価額 単価/金額 (円)	評価額 単価/金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION 〔エネルギー〕	647,212	6,958.46 4,503,599,849	6,238.33 4,037,523,330	1.57
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP 〔ソフトウェア・サービス〕	1,089,402	2,717.69 2,960,666,072	2,769.80 3,017,426,531	1.17
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〕	122,657	18,661.96 2,289,020,420	21,941.62 2,691,293,676	1.05
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO 〔資本財〕	1,451,943	1,483.05 2,153,315,100	1,702.63 2,472,124,613	0.96
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO 〔家庭用品・パーソナル用品〕	397,770	5,813.13 2,312,292,379	5,922.92 2,355,962,434	0.92
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〕	376,076	5,851.28 2,200,528,083	6,038.29 2,270,858,206	0.88
イギリス	株式	BP PLC 〔エネルギー〕	2,558,318	817.12 2,090,473,270	876.09 2,241,332,166	0.87
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP 〔各種金融〕	1,356,079	1,454.21 1,972,030,694	1,652.39 2,240,771,921	0.87
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC 〔銀行〕	2,372,703	989.81 2,348,548,883	940.67 2,231,954,258	0.87
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED 〔食品・飲料・タバコ〕	472,800	4,216.97 1,993,788,096	4,713.66 2,228,618,448	0.87
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO 〔各種金融〕	537,263	3,847.20 2,066,960,362	4,147.72 2,228,418,209	0.87
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP 〔テクノロジー・ハードウェアおよび機器〕	178,946	11,695.12 2,092,796,375	11,980.76 2,143,909,222	0.83
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC 〔テクノロジー・ハードウェアおよび機器〕	783,731	2,175.27 1,704,830,607	2,479.51 1,943,273,554	0.76
アメリカ	株式	AT&T INC 〔電気通信サービス〕	804,051	2,509.28 2,017,596,168	2,414.38 1,941,291,085	0.75
アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION 〔エネルギー〕	273,607	7,268.28 1,988,653,599	7,005.91 1,916,866,564	0.75
アメリカ	株式	WELLS FARGO & COMPANY 〔銀行〕	662,132	2,517.66 1,667,024,840	2,869.35 1,899,890,837	0.74
アメリカ	株式	PFIZER INC 〔医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス〕	1,099,816	1,697.04 1,866,442,302	1,605.87 1,766,161,959	0.69
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A 〔ソフトウェア・サービス〕	33,151	53,907.37 1,787,083,421	52,725.76 1,747,911,934	0.68
オーストラリア	株式	BHP BILLITON LTD 〔素材〕	456,730	3,444.45 1,573,187,850	3,787.28 1,729,766,586	0.67
アメリカ	株式	WAL-MART STORES INC 〔食品・生活必需品小売り〕	315,440	5,081.84 1,603,017,123	5,201.86 1,640,876,737	0.64
アメリカ	株式	HEWLETT-PACKARD CO 〔テクノロジー・ハードウェアおよび機器〕	322,894	4,565.47 1,474,163,774	4,955.31 1,600,039,996	0.62

アメリカ	株式	INTEL CORP 〔半導体・半導体製造装置〕	751,922	1,777.99 1,336,913,105	2,079.44 1,563,579,691	0.61
フランス	株式	TOTAL SA 〔エネルギー〕	287,796	5,229.15 1,504,928,798	5,356.56 1,541,599,304	0.60
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC 〔電気通信サービス〕	7,167,038	192.34 1,378,565,425	213.68 1,531,515,748	0.60
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〕	415,711	3,377.35 1,404,002,377	3,503.88 1,456,604,119	0.57
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE 〔食品・飲料・タバコ〕	283,987	5,318.16 1,510,290,121	5,105.10 1,449,783,396	0.56
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〕	287,583	4,859.43 1,397,490,694	4,975.52 1,430,877,843	0.56
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN 〔医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス〕	95,710	14,552.98 1,392,866,558	14,917.86 1,427,788,476	0.56
スペイン	株式	BANCO SANTANDER SA 〔銀行〕	1,120,641	1,442.82 1,616,889,971	1,244.32 1,394,445,108	0.54
アメリカ	株式	PEPSICO INC 〔食品・飲料・タバコ〕	221,574	5,790.80 1,283,092,846	6,212.28 1,376,479,905	0.54

## □ 種類別・業種別の投資比率

平成22年3月31日現在

種類	業種	投資比率 (%)	種類	業種	投資比率 (%)
株式(外国)	エネルギー	11.24	株式(外国)	ヘルスケア機器・サービス	2.81
	素材	7.27		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.41
	資本財	7.39		銀行	9.08
	商業・専門サービス	0.69		各種金融	5.92
	運輸	1.66		保険	4.29
	自動車・自動車部品	0.97		不動産	0.65
	耐久消費財・アパレル	1.11		ソフトウェア・サービス	4.62
	消費者サービス	1.39		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.50
	メディア	2.42		電気通信サービス	4.13
	小売	2.57		公益事業	4.11
	食品・生活必需品小売り	2.63		半導体・半導体製造装置	1.59
	食品・飲料・タバコ	6.10		投資証券	1.60
	家庭用品・パーソナル用品	1.84		合計	98.98

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

平成22年3月31日現在

種類	取引所等および 資産の名称	買建/ 売建	数量 (枚)	簿価(円)	時価(円)	投資 比率 (%)
海外金融 先物取引	シカゴ商業取引所 S P 500 10 / 06	買建	58	1,570,808,881	1,577,614,152	0.61
海外金融 先物取引	ロンドン国際金融先物オプション取引所 F T S E 10 / 06	買建	39	308,417,803	308,166,768	0.12
海外金融 先物取引	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所 D J E U R 10 / 06	買建	179	640,681,951	641,975,122	0.25

(注) 時価の算定方法

海外金融先物取引の時価については以下のように評価しております。

- ・原則として基準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又は最終相場で評価しております。
- ・このような時価が発表されていない場合には、基準日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

平成22年3月31日現在

種類	取引所等および 資産の名称	買建/ 売建	数量 (枚)	簿価(円)	時価(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	市場外取引 米ドル	売建	5,822,610.71	542,019,843	541,677,474	0.21
為替予約取引	市場外取引 カナダドル	売建	610,883.36	55,871,392	55,804,194	0.02
為替予約取引	市場外取引 オーストラリアドル	売建	437,728.92	37,355,786	37,303,258	0.01
為替予約取引	市場外取引 英ポンド	売建	820,458.53	115,258,014	115,184,173	0.04
為替予約取引	市場外取引 スイスフラン	売建	509,627.66	44,490,494	44,485,398	0.02
為替予約取引	市場外取引 香港ドル	売建	953,359.57	11,434,308	11,421,247	0.00
為替予約取引	市場外取引 シンガポールドル	売建	168,891.84	11,238,063	11,229,618	0.00
為替予約取引	市場外取引 スウェーデンクローナ	売建	822,502.55	10,523,097	10,536,257	0.00
為替予約取引	市場外取引 ノルウェークローネ	売建	340,418.28	5,289,759	5,293,504	0.00
為替予約取引	市場外取引 デンマーククローネ	売建	320,483.07	5,375,783	5,374,501	0.00
為替予約取引	市場外取引 ユーロ	売建	1,321,976.47	165,194,179	165,128,080	0.06

(注)

1. 基準日に対顧客先物売買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おります。
  - (1) 基準日において為替予約の受渡日（以下「当該日」という）の対顧客先物売買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顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
  - (2) 基準日において当該日の対顧客先物売買相場が発表されていない場合は、以下の計算方法によっておりま

す。

基準日に当該日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後の二つの対顧客先物売買相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

基準日に当該日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

2. 基準日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、基準日の対顧客直物売買相場の仲値で評価しております。

## 〔外国債券バッシブ・マザーファンド〕

## (1) 投資状況

平成22年3月31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	93,047,223,581	35.43
	カナダ	7,456,665,603	2.84
	ドイツ	26,874,947,133	10.23
	イタリア	28,733,025,330	10.94
	フランス	25,319,423,308	9.64
	オーストラリア	2,111,944,862	0.80
	イギリス	18,573,907,516	7.07
	スイス	1,564,248,147	0.60
	シンガポール	969,467,861	0.37
	マレーシア	1,340,334,819	0.51
	オランダ	6,541,212,191	2.49
	スペイン	12,056,527,253	4.59
	ベルギー	7,726,124,360	2.94
	スウェーデン	1,876,014,276	0.71
	ノルウェー	917,697,680	0.35
	オーストリア	4,520,848,554	1.72
	フィンランド	1,375,357,957	0.52
	デンマーク	2,231,254,151	0.85
	アイルランド	2,501,492,019	0.95
	ギリシャ	6,033,557,298	2.30
ポーランド	2,448,654,937	0.93	
ポルトガル	2,914,702,146	1.11	
	小計	257,134,630,982	97.92
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,469,138,413	2.08
合計(純資産総額)		262,603,769,395	100.00

## (2) 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成22年3月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額 単価/金額 (円)	評価額 単価/金額 (円)	利率/ 償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US T 3.625% 19/08/15	16,000,000	9,321.53 1,491,445,737	9,164.44 1,466,310,400	3.625 2019/8/15	0.56
アメリカ	国債証券	US T 3.125% 19/05/15	16,000,000	8,973.99 1,435,839,800	8,834.43 1,413,510,200	3.125 2019/5/15	0.54
アメリカ	国債証券	US T 3.375% 19/11/15	15,000,000	9,041.25 1,356,188,837	8,950.73 1,342,610,812	3.375 2019/11/15	0.51
アメリカ	国債証券	US T 2.75% 19/02/15	15,000,000	8,729.76 1,309,465,312	8,610.56 1,291,584,187	2.75 2019/2/15	0.49
アメリカ	国債証券	US T 3.75% 18/11/15	13,000,000	9,475.54 1,231,820,525	9,349.06 1,215,378,612	3.75 2018/11/15	0.46

イタリア	国債証券	BTPS 6% 31/05/01	7,900,000	14,676.85 1,159,471,213	14,693.09 1,160,754,141	6 2031/5/1	0.44
イギリス	国債証券	UKT 5% 12/03/07	7,560,000	15,100.02 1,141,561,512	15,067.16 1,139,077,779	5 2012/3/7	0.43
アメリカ	国債証券	US T 0.875% 12/01/31	12,000,000	9,318.90 1,118,268,111	9,286.55 1,114,386,600	0.875 2012/1/31	0.42
アメリカ	国債証券	US T 0.75% 11/11/30	12,000,000	9,298.06 1,115,767,662	9,285.10 1,114,212,150	0.75 2011/11/30	0.42
イタリア	国債証券	BTPS 6.5% 27/11/01	6,960,000	15,447.60 1,075,153,461	15,431.36 1,074,023,184	6.5 2027/11/1	0.41
イタリア	国債証券	BTPS 5% 12/02/01	7,900,000	13,347.00 1,054,413,493	13,316.47 1,052,001,288	5 2012/2/1	0.40
アメリカ	国債証券	US T 1% 11/07/31	11,000,000	9,351.24 1,028,637,161	9,346.88 1,028,157,423	1 2011/7/31	0.39
アメリカ	国債証券	US T 1% 11/10/31	11,000,000	9,328.26 1,026,109,655	9,330.16 1,026,318,425	1 2011/10/31	0.39
ドイツ	国債証券	DBR 5% 12/07/04	7,220,000	13,582.55 980,660,225	13,573.80 980,028,879	5 2012/7/4	0.37
イギリス	国債証券	UKT 2.25% 14/03/07	7,000,000	13,872.92 971,104,680	13,991.56 979,409,340	2.25 2014/3/7	0.37
イタリア	国債証券	BTPS 4.25 13/08/01	7,310,000	13,326.46 974,164,635	13,397.67 979,369,677	4.25 2013/8/1	0.37
イタリア	国債証券	BTPS 5.25% 29/11/01	7,200,000	13,540.07 974,885,673	13,492.60 971,467,862	5.25 2029/11/1	0.37
アメリカ	国債証券	US T 2.125% 14/11/30	10,500,000	9,141.45 959,852,975	9,164.44 962,266,200	2.125 2014/11/30	0.37
イタリア	国債証券	BTPS 3.75% 15/08/01	7,200,000	13,041.64 938,998,656	13,126.59 945,114,739	3.75 2015/8/1	0.36
アメリカ	国債証券	US T 2.625% 14/07/31	10,000,000	9,474.08 947,408,875	9,414.48 941,448,500	2.625 2014/7/31	0.36
アメリカ	国債証券	US T 1.75% 12/08/15	10,000,000	9,439.19 943,919,875	9,408.67 940,867,000	1.75 2012/8/15	0.36
アメリカ	国債証券	US T 1.125% 11/06/30	10,000,000	9,373.78 937,378,000	9,367.96 936,796,500	1.125 2011/6/30	0.36
ドイツ	国債証券	DBR 5% 12/01/04	7,000,000	13,412.03 938,842,506	13,381.68 936,717,616	5 2012/1/4	0.36
アメリカ	国債証券	US T 0.875% 11/04/30	10,000,000	9,341.07 934,107,067	9,344.70 934,470,500	0.875 2011/4/30	0.36
アメリカ	国債証券	US T 0.875% 11/03/31	10,000,000	9,341.79 934,179,750	9,341.43 934,143,408	0.875 2011/3/31	0.36
アメリカ	国債証券	US T 0.875% 11/02/28	10,000,000	9,343.97 934,397,817	9,335.25 933,525,567	0.875 2011/2/28	0.36
アメリカ	国債証券	US T 1.00% 2011/12/31	10,000,000	9,339.90 933,990,762	9,315.63 931,563,000	1 2011/12/31	0.35
アメリカ	国債証券	US T 2.375% 14/09/30	10,000,000	9,354.15 935,415,442	9,291.64 929,164,317	2.375 2014/9/30	0.35
アメリカ	国債証券	US T 1.375% 12/11/15	10,000,000	9,318.24 931,824,675	9,288.73 928,873,567	1.375 2012/11/15	0.35

フランス	国債証券	FRTR 4.25% 19/04/25	6,900,000	13,377.68 923,060,113	13,442.64 927,542,242	4.25 2019/4/25	0.35
------	------	---------------------	-----------	--------------------------	--------------------------	-------------------	------

## □ 種類別の投資比率

平成22年3月31日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	97.92
合計	97.92

**投資不動産物件**

該当事項はありません。

**その他投資資産の主要なもの**

平成22年3月31日現在

種類	取引所等および 資産の名称	買建/ 売建	数量 (枚)	簿価(円)	時価(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	市場外取引 米ドル	買建	2,014,825.79	186,026,850	187,439,243	0.07
為替予約取引	市場外取引 ユーロ	買建	1,071,398.00	133,469,405	133,828,324	0.05

(注)

1. 基準日に対顧客先物売買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おります。
  - (1) 基準日において為替予約の受渡日（以下「当該日」という）の対顧客先物売買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顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
  - (2) 基準日において当該日の対顧客先物売買相場が発表されていない場合は、以下の計算方法によっております。
 

基準日に当該日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後の二つの対顧客先物売買相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

基準日に当該日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
2. 基準日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については、基準日の対顧客直物売買相場の仲値で評価しております。

## 6【手続等の概要】

### イ 申込（販売）手続等の概要

#### （イ）申込方法

いつでもお申し込みいただけます。取扱いの販売会社にお申し付けください。

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。

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

1円以上1円単位

### ロ 換金（解約）手続等の概要

#### （イ）換金方法

いつでもご換金のお申込みができます。お買付けの販売会社にお申し付けください。

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。

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、解約請求のお申込みの受け付けを中止させていただく場合、既に受け付けた解約請求のお申込みを取り消させていただく場合があります。

#### （ロ）換金価額

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。

#### （ハ）支払開始日

解約代金は、原則として解約請求受付日から起算して5営業日目以降にお支払いします。

### ハ 手続等に関するお問い合わせ先

ファンドの手続等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
三井住友アセットマネジメント株式会社	0120-88-2976

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。

## 7【管理及び運営の概要】

### イ 基準価額の算出方法・算出頻度

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

### ロ 決算と収益分配金

#### （イ）決算日

決算日は毎年2月18日（休業日の場合は翌営業日となります。）です。

#### （ロ）分配金

分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。

分配対象額が少額の場合等には委託会社の判断により分配を行わないことがあります。

#### （ハ）支払方法

分配金は、原則として、税金を差し引いた後、再投資いたします。

### ハ 償還および償還金

#### （イ）信託期間

信託期間は、無期限です。（設定日：平成17年9月30日）

ただし、当ファンドの信託約款に定める信託終了事由に該当する場合、委託会社はあらかじめ受益者に書面により通知する等の信託約款所定の手続きを経て、当ファンドを償還させることがあります。

#### （ロ）償還金

償還金は、原則として、償還日（償還日が休日の場合は翌営業日）から起算して5営業日目までにお支払いします。お買付けの販売会社でお受け取りください。

### ニ 運用報告書の交付および基準価額の照会

#### （イ）運用報告書

委託会社は毎決算後、期中の運用経過のほか、信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した「運用報告書」を作成します。運用報告書は、原則として、あらかじめお申し出いただいたご住所に販売会社よりお届けいたします。

#### （ロ）基準価額

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れば、いつでもお知らせします。また、基準価額は、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「DCマ30」、「DCマ50」、「DCマ70」として掲載されます。

### ホ 信託約款の変更、信託契約の解約等

#### （イ）信託約款の変更

委託会社は、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あります。変更内容が重大な信託約款の変更については、原則として、あらかじめ公告し、また、知られたる受益者に対しては、書面でお知らせします。この場合、所定の期間内（1ヵ月以上）に、当該信託約款の変更に異議を申し出た受益者の受益権の合計口数が総受益権の口数の2分の1を超えるときは、当該信託約款の変更は行われません。

#### （ロ）信託契約の解約

委託会社は、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あります。

信託契約の解約については、原則として、あらかじめ公告し、また、知られたる受益者に対しては、書面でお知らせします。この場合、所定の期間内（1ヵ月以上）に、当該信託契約の解約に異議を申し出た受益者の受益権の合計口数が総受益権の口数の2分の1を超えるときは、当該信託契約の解約は行われません。

ただし、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等には、異議申立ての受け付けを行わず、信託を終了させることがあります。

#### （ハ）反対者の買取請求

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。

#### （ニ）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。

へ ファンドについてのお問い合わせ

基準価額、その他ファンドについてご不明な点はお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。

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
三井住友アセットマネジメント株式会社	0120-88-2976

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。

## 第2【財務ハイライト情報】

以下の情報は、当ファンドの第4期ならびに第5期の財務諸表から抜粋して記載したものです。

当該財務諸表については、あずさ監査法人により監査証明を受けており、その証明にかかる監査報告書は有価証券届出書の「第三部 ファンドの詳細情報 第4 ファンドの経理状況」の財務諸表に添付されております。

## 【三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）】

## 1【貸借対照表】

(単位：円)

	第4期 (平成21年2月18日現在)	第5期 (平成22年2月18日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	45,986,459	64,998,290
親投資信託受益証券	881,200,284	1,366,386,300
未収入金	887,000	-
未収利息	25	89
流動資産合計	928,073,768	1,431,384,679
資産合計	928,073,768	1,431,384,679
負債の部		
流動負債		
未払解約金	886,095	847,423
未払受託者報酬	152,011	219,253
未払委託者報酬	1,013,332	1,388,529
その他未払費用	25,276	36,480
流動負債合計	2,076,714	2,491,685
負債合計	2,076,714	2,491,685
純資産の部		
元本等		
元本	1,054,314,569	1,473,303,036
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	128,317,515	44,410,042
元本等合計	925,997,054	1,428,892,994
純資産合計	925,997,054	1,428,892,994
負債純資産合計	928,073,768	1,431,384,679

## 2【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期	第5期
	自平成20年2月19日 至平成21年2月18日	自平成21年2月19日 至平成22年2月18日
営業収益		
受取利息	137,348	40,292
有価証券売買等損益	170,967,288	108,532,887
営業収益合計	170,829,940	108,573,179
営業費用		
受託者報酬	285,435	389,207
委託者報酬	1,902,797	2,489,089
その他費用	47,450	64,744
営業費用合計	2,235,682	2,943,040
営業利益又は営業損失（ ）	173,065,622	105,630,139
経常利益又は経常損失（ ）	173,065,622	105,630,139
当期純利益又は当期純損失（ ）	173,065,622	105,630,139
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（ ）	5,983,668	3,854,363
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	34,056,791	128,317,515
剰余金増加額又は欠損金減少額	8,867,876	8,622,681
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は 欠損金減少額	-	8,622,681
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は 欠損金減少額	8,867,876	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,160,228	26,490,984
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は 欠損金増加額	4,160,228	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は 欠損金増加額	-	26,490,984
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	128,317,515	44,410,042

## 3【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第4期	第5期
	自平成20年2月19日 至平成21年2月18日	自平成21年2月19日 至平成22年2月18日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券（売買目的有価証券） 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	親投資信託受益証券（売買目的有価証券） 同左

(貸借対照表に関する注記)

項目	第4期	第5期
	(平成21年2月18日現在)	(平成22年2月18日現在)
1. 受益権総数	当該計算期間の末日における受益権の総数 1,054,314,569口	当該計算期間の末日における受益権の総数 1,473,303,036口
2. 元本の欠損	「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額 128,317,515円	「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額 44,410,042円
3. 1単位当たり純資産額	0.8783円 (1万口 = 8,783円)	0.9699円 (1万口 = 9,699円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第4期	第5期
	自平成20年2月19日 至平成21年2月18日	自平成21年2月19日 至平成22年2月18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（16,039,008円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（92,169,362円）、および分配準備積立金（17,563,794円）より、分配対象収益は125,772,164円（1万口当たり1,192.92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（21,721,426円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（144,927,496円）、および分配準備積立金（31,572,989円）より、分配対象収益は198,221,911円（1万口当たり1,345.42円）であります。分配を行っておりません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第4期（自平成20年2月19日 至平成21年2月18日）

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	881,200,284円	166,884,034円
合計	881,200,284円	166,884,034円

第5期（自平成21年2月19日 至平成22年2月18日）

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,366,386,300円	92,588,645円
合計	1,366,386,300円	92,588,645円

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ．取引の状況に関する事項

項目	第4期 自平成20年2月19日 至平成21年2月18日	第5期 自平成21年2月19日 至平成22年2月18日
1．取引の内容	<p>当ファンドの行うことのできるデリバティブ取引は、次の通りです。</p> <p>a．わが国の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。</p> <p>b．わが国の取引所における通貨にかかる先物取引および通貨にかかるオプション取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引。</p> <p>c．わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。</p> <p>異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（「スワップ取引」）。</p> <p>金利先渡取引および為替先渡取引。</p> <p>外国為替の売買の予約取引。</p>	同左
2．取引に対する取組方針	デリバティブ取引につきましては信託約款等に従っており、その制限を遵守しております。	同左
3．取引の利用目的	信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため。	同左
4．取引に係るリスクの内容	デリバティブ取引に伴いファンドに影響を与える主なリスクとしてマーケットリスクがあげられます。マーケットリスクについては、ポジションや時価、予想損失額の把握が重要だと考えております。	同左
5．取引に係るリスクの管理体制	リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理ならびにコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。	同左
6．取引の時価等に関する事項についての補足説明	該当事項はありません。	同左

## . 取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

第4期（平成21年2月18日現在）

第4期末現在、デリバティブ取引は行っていません。

第5期（平成22年2月18日現在）

第5期末現在、デリバティブ取引は行っていません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第4期（自 平成20年2月19日 至 平成21年2月18日）

該当事項はありません。

第5期（自 平成21年2月19日 至 平成22年2月18日）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項目	第4期 （平成21年2月18日現在）	第5期 （平成22年2月18日現在）
期首元本額	675,882,922円	1,054,314,569円
期中追加設定元本額	469,037,816円	495,358,440円
期中一部解約元本額	90,606,169円	76,369,973円

## 【三井住友・DC年金バランス50（標準型）】

## 1【貸借対照表】

（単位：円）

	第4期 (平成21年2月18日現在)	第5期 (平成22年2月18日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	146,074,362	220,483,935
親投資信託受益証券	2,750,720,345	4,393,832,457
未収入金	1,552,000	-
未収利息	80	302
流動資産合計	2,898,346,787	4,614,316,694
資産合計	2,898,346,787	4,614,316,694
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,551,043	271,950
未払受託者報酬	494,201	708,456
未払委託者報酬	3,459,345	4,722,967
その他未払費用	82,309	118,014
流動負債合計	5,586,898	5,821,387
負債合計	5,586,898	5,821,387
純資産の部		
元本等		
元本	3,728,508,957	5,130,131,943
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	835,749,068	521,636,636
元本等合計	2,892,759,889	4,608,495,307
純資産合計	2,892,759,889	4,608,495,307
負債純資産合計	2,898,346,787	4,614,316,694

## 2【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期	第5期
	自平成20年2月19日 至平成21年2月18日	自平成21年2月19日 至平成22年2月18日
営業収益		
受取利息	520,368	131,094
有価証券売買等損益	948,282,610	502,524,241
営業収益合計	947,762,242	502,655,335
営業費用		
受託者報酬	964,772	1,253,062
委託者報酬	6,753,264	8,430,878
その他費用	160,674	208,722
営業費用合計	7,878,710	9,892,662
営業利益又は営業損失（ ）	955,640,952	492,762,673
経常利益又は経常損失（ ）	955,640,952	492,762,673
当期純利益又は当期純損失（ ）	955,640,952	492,762,673
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（ ）	25,416,181	11,673,293
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	118,325,844	835,749,068
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	32,409,154
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は 欠損金減少額	-	32,409,154
剰余金減少額又は欠損金増加額	23,850,141	199,386,102
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は 欠損金増加額	10,454,161	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は 欠損金増加額	13,395,980	199,386,102
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	835,749,068	521,636,636

## 3【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第4期	第5期
	自平成20年2月19日 至平成21年2月18日	自平成21年2月19日 至平成22年2月18日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券（売買目的有価証券） 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	親投資信託受益証券（売買目的有価証券） 同左

(貸借対照表に関する注記)

項目	第4期	第5期
	(平成21年2月18日現在)	(平成22年2月18日現在)
1. 受益権総数	当該計算期間の末日における受益権の総数 3,728,508,957口	当該計算期間の末日における受益権の総数 5,130,131,943口
2. 元本の欠損	「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額 835,749,068円	「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額 521,636,636円
3. 1単位当たり純資産額	0.7758円 (1万口 = 7,758円)	0.8983円 (1万口 = 8,983円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第4期	第5期
	自平成20年2月19日 至平成21年2月18日	自平成21年2月19日 至平成22年2月18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（57,637,944円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（477,375,730円）、および分配準備積立金（106,084,677円）より、分配対象収益は641,098,351円（1万口当たり1,719.44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（73,963,049円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（726,333,106円）、および分配準備積立金（158,071,104円）より、分配対象収益は958,367,259円（1万口当たり1,868.11円）であります。分配を行っておりません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第4期（自平成20年2月19日 至平成21年2月18日）

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	2,750,720,345円	928,967,785円
合計	2,750,720,345円	928,967,785円

第5期（自平成21年2月19日 至平成22年2月18日）

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	4,393,832,457円	447,068,450円
合計	4,393,832,457円	447,068,450円

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ・取引の状況に関する事項

項目	第4期 自平成20年2月19日 至平成21年2月18日	第5期 自平成21年2月19日 至平成22年2月18日
1. 取引の内容	<p>当ファンドの行うことのできるデリバティブ取引は、次の通りです。</p> <p>a. わが国の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。</p> <p>b. わが国の取引所における通貨にかかる先物取引および通貨にかかるオプション取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引。</p> <p>c. わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。</p> <p>異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（「スワップ取引」）。</p> <p>金利先渡取引および為替先渡取引。</p> <p>外国為替の売買の予約取引。</p>	同左
2. 取引に対する取組方針	デリバティブ取引につきましては信託約款等に従っており、その制限を遵守しております。	同左
3. 取引の利用目的	信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため。	同左
4. 取引に係るリスクの内容	デリバティブ取引に伴いファンドに影響を与える主なリスクとしてマーケットリスクがあげられます。マーケットリスクについては、ポジションや時価、予想損失額の把握が重要だと考えております。	同左
5. 取引に係るリスクの管理体制	リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理ならびにコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。	同左
6. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	該当事項はありません。	同左

## . 取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

第4期(平成21年2月18日現在)

第4期末現在、デリバティブ取引は行ってありません。

第5期(平成22年2月18日現在)

第5期末現在、デリバティブ取引は行ってありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第4期(自平成20年2月19日至平成21年2月18日)

該当事項はありません。

第5期(自平成21年2月19日至平成22年2月18日)

該当事項はありません。

(その他の注記)

項目	第4期 (平成21年2月18日現在)	第5期 (平成22年2月18日現在)
期首元本額	2,532,269,265円	3,728,508,957円
期中追加設定元本額	1,456,057,755円	1,554,846,560円
期中一部解約元本額	259,818,063円	153,223,574円

## 【三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）】

## 1【貸借対照表】

(単位：円)

	第4期 (平成21年2月18日現在)	第5期 (平成22年2月18日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	58,686,512	97,003,052
親投資信託受益証券	1,112,474,729	1,965,960,700
未収利息	32	132
流動資産合計	1,171,161,273	2,062,963,884
資産合計	1,171,161,273	2,062,963,884
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	42,894
未払受託者報酬	206,416	315,378
未払委託者報酬	1,513,619	2,207,569
その他未払費用	34,337	52,503
流動負債合計	1,754,372	2,618,344
負債合計	1,754,372	2,618,344
純資産の部		
元本等		
元本	1,727,001,844	2,507,724,029
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	557,594,943	447,378,489
元本等合計	1,169,406,901	2,060,345,540
純資産合計	1,169,406,901	2,060,345,540
負債純資産合計	1,171,161,273	2,062,963,884

## 2【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第4期	第5期
	自平成20年2月19日 至平成21年2月18日	自平成21年2月19日 至平成22年2月18日
営業収益		
受取利息	221,214	55,832
有価証券売買等損益	578,358,581	274,992,779
営業収益合計	578,137,367	275,048,611
営業費用		
受託者報酬	415,860	546,684
委託者報酬	3,049,432	3,858,707
その他費用	69,177	90,995
営業費用合計	3,534,469	4,496,386
営業利益又は営業損失（ ）	581,671,836	270,552,225
経常利益又は経常損失（ ）	581,671,836	270,552,225
当期純利益又は当期純損失（ ）	581,671,836	270,552,225
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（ ）	16,589,990	9,180,017
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	46,814,989	557,594,943
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	31,199,945
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は 欠損金減少額	-	31,199,945
剰余金減少額又は欠損金増加額	39,328,086	182,355,699
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は 欠損金増加額	4,570,592	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は 欠損金増加額	34,757,494	182,355,699
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	557,594,943	447,378,489

## 3【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第4期	第5期
	自平成20年2月19日 至平成21年2月18日	自平成21年2月19日 至平成22年2月18日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券（売買目的有価証券） 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	親投資信託受益証券（売買目的有価証券） 同左

(貸借対照表に関する注記)

項目	第4期	第5期
	(平成21年2月18日現在)	(平成22年2月18日現在)
1. 受益権総数	当該計算期間の末日における受益権の総数 1,727,001,844口	当該計算期間の末日における受益権の総数 2,507,724,029口
2. 元本の欠損	「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額 557,594,943円	「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額 447,378,489円
3. 1単位当たり純資産額	0.6771円 (1万口 = 6,771円)	0.8216円 (1万口 = 8,216円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第4期	第5期
	自平成20年2月19日 至平成21年2月18日	自平成21年2月19日 至平成22年2月18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（26,727,119円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（303,100,215円）、および分配準備積立金（58,583,700円）より、分配対象収益は388,411,034円（1万口当たり2,249.04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（33,616,328円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（484,022,460円）、および分配準備積立金（81,263,749円）より、分配対象収益は598,902,537円（1万口当たり2,388.23円）であります。分配を行っておりません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第4期（自平成20年2月19日 至平成21年2月18日）

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,112,474,729円	567,932,985円
合計	1,112,474,729円	567,932,985円

第5期（自平成21年2月19日 至平成22年2月18日）

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,965,960,700円	250,666,508円
合計	1,965,960,700円	250,666,508円

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ．取引の状況に関する事項

項 目	第 4 期 自 平成20年 2月19日 至 平成21年 2月18日	第 5 期 自 平成21年 2月19日 至 平成22年 2月18日
1．取引の内容	<p>当ファンドの行うことのできるデリバティブ取引は、次の通りです。</p> <p>a．わが国の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。</p> <p>b．わが国の取引所における通貨にかかる先物取引および通貨にかかるオプション取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引。</p> <p>c．わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。</p> <p>異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（「スワップ取引」）。</p> <p>金利先渡取引および為替先渡取引。</p> <p>外国為替の売買の予約取引。</p>	同 左
2．取引に対する取組方針	デリバティブ取引につきましては信託約款等に従っており、その制限を遵守しております。	同 左
3．取引の利用目的	信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため。	同 左
4．取引に係るリスクの内容	デリバティブ取引に伴いファンドに影響を与える主なリスクとしてマーケットリスクがあげられます。マーケットリスクについては、ポジションや時価、予想損失額の把握が重要だと考えております。	同 左
5．取引に係るリスクの管理体制	リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理ならびにコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。	同 左
6．取引の時価等に関する事項についての補足説明	該当事項はありません。	同 左

## . 取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

第4期（平成21年2月18日現在）

第4期末現在、デリバティブ取引は行ってありません。

第5期（平成22年2月18日現在）

第5期末現在、デリバティブ取引は行ってありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第4期（自平成20年2月19日 至 平成21年2月18日）

該当事項はありません。

第5期（自平成21年2月19日 至 平成22年2月18日）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項目	第4期 （平成21年2月18日現在）	第5期 （平成22年2月18日現在）
期首元本額	1,142,611,401円	1,727,001,844円
期中追加設定元本額	726,637,191円	884,174,334円
期中一部解約元本額	142,246,748円	103,452,149円

### 第3【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4【ファンドの詳細情報の項目】

当ファンドの有価証券届出書「第三部 ファンドの詳細情報」の記載項目は下記の通りです。

### 第1 ファンドの沿革

#### 第2 手続等

1 申込（販売）手続等

2 換金（解約）手続等

#### 第3 管理及び運営

1 資産管理等の概要

資産の評価、 保管、 信託期間、 計算期間、 その他

2 受益者の権利等

#### 第4 ファンドの経理状況

1 財務諸表

（1）貸借対照表、（2）損益及び剰余金計算書、（3）注記表、（4）附属明細表

2 ファンドの現況

純資産額計算書

#### 第5 設定及び解約の実績

## 第三部【ファンドの詳細情報】

### 第1【ファンドの沿革】

平成17年9月30日

信託契約締結、設定、運用開始。

### 第2【手続等】

#### 1【申込（販売）手続等】

##### イ 申込方法

- (イ) 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。
- (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

1円以上1円単位

##### ホ 照会先

手続き等のご不明な点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
三井住友アセットマネジメント株式会社	0120-88-2976

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5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。

### 第3【管理及び運営】

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

なお、外貨建資産の円換算については、原則としてわが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算するものとし、予約為替の評価は、原則としてわが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

###### 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「DCマ30」、「DCマ50」、「DCマ70」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
三井住友アセットマネジメント株式会社	0120-88-2976

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17年9月30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2月19日から翌年2月18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

間を開始するものとします。なお、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

## （５）【その他】

### イ 信託の終了

#### （イ）信託契約の解約

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

#### （ロ）信託契約に関する監督官庁の命令

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

#### （ハ）委託会社の登録取消等に伴う取扱い

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

#### （ニ）受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

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

### ロ 収益分配金、償還金の支払い

#### （イ）収益分配金

- a. 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。分配対象額が少額の場合等には委託会社の判断により分配を行わないことがあります。
- b. 当ファンドは、分配金自動再投資専用ですので、分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日の翌営業日に再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

#### （ロ）償還金

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

### ハ 信託約款の変更

- （イ）委託会社は、当ファンドの信託約款を変更することが受益者の利益のため必要と認めるとき、監督官庁より変更の命令を受けたとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンド

の信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨および内容を監督官庁に届け出ます。

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

## 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。

## ハ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

## ト 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

## チ 運用にかかる報告書の開示方法

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

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

## 2【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。

当ファンドは、分配金自動再投資専用であるため、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 償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

償還金は、信託終了後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日から起算して5営業日目まで）から、販売会社において、原則として、償還日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として）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 手続等 2 換金（解約）手続等」の記載をご参照ください。

## 二 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ときは、当該解約または信託約款変更は行われません。

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

## ホ 帳簿閲覧・謄写請求権

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

#### 第4【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4期（平成20年2月19日から平成21年2月18日まで）および第5期（平成21年2月19日から平成22年2月18日まで）の財務諸表について、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年金バランス30（債券重点型）】

## （1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第4期 (平成21年2月18日現在)	第5期 (平成22年2月18日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	45,986,459	64,998,290
親投資信託受益証券	881,200,284	1,366,386,300
未収入金	887,000	-
未収利息	25	89
流動資産合計	928,073,768	1,431,384,679
資産合計	928,073,768	1,431,384,679
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	886,095	847,423
未払受託者報酬	152,011	219,253
未払委託者報酬	1,013,332	1,388,529
その他未払費用	25,276	36,480
流動負債合計	2,076,714	2,491,685
負債合計	2,076,714	2,491,685
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,054,314,569	1,473,303,036
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	128,317,515	44,410,042
元本等合計	925,997,054	1,428,892,994
純資産合計	925,997,054	1,428,892,994
負債純資産合計	928,073,768	1,431,384,679

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第4期	第5期
	自平成20年2月19日 至平成21年2月18日	自平成21年2月19日 至平成22年2月18日
<b>営業収益</b>		
受取利息	137,348	40,292
有価証券売買等損益	170,967,288	108,532,887
営業収益合計	170,829,940	108,573,179
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	285,435	389,207
委託者報酬	1,902,797	2,489,089
その他費用	47,450	64,744
営業費用合計	2,235,682	2,943,040
営業利益又は営業損失( )	173,065,622	105,630,139
経常利益又は経常損失( )	173,065,622	105,630,139
当期純利益又は当期純損失( )	173,065,622	105,630,139
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( )	5,983,668	3,854,363
期首剰余金又は期首欠損金( )	34,056,791	128,317,515
剰余金増加額又は欠損金減少額	8,867,876	8,622,681
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	8,622,681
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	8,867,876	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,160,228	26,490,984
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,160,228	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	26,490,984
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金( )	128,317,515	44,410,042

## (3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第4期 自平成20年2月19日 至平成21年2月18日	第5期 自平成21年2月19日 至平成22年2月18日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券（売買目的有価証券） 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	親投資信託受益証券（売買目的有価証券） 同左

(貸借対照表に関する注記)

項目	第4期 (平成21年2月18日現在)	第5期 (平成22年2月18日現在)
1. 受益権総数	当該計算期間の末日における受益権の総数 1,054,314,569口	当該計算期間の末日における受益権の総数 1,473,303,036口
2. 元本の欠損	「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額 128,317,515円	「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額 44,410,042円
3. 1単位当たり純資産額	0.8783円 (1万口 = 8,783円)	0.9699円 (1万口 = 9,699円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第4期 自平成20年2月19日 至平成21年2月18日	第5期 自平成21年2月19日 至平成22年2月18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（16,039,008円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（92,169,362円）、および分配準備積立金（17,563,794円）より、分配対象収益は125,772,164円（1万口当たり1,192.92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（21,721,426円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（144,927,496円）、および分配準備積立金（31,572,989円）より、分配対象収益は198,221,911円（1万口当たり1,345.42円）であります。分配を行っておりません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第4期（自平成20年2月19日 至平成21年2月18日）

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	881,200,284円	166,884,034円
合計	881,200,284円	166,884,034円

第5期（自平成21年2月19日 至平成22年2月18日）

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,366,386,300円	92,588,645円
合計	1,366,386,300円	92,588,645円

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ．取引の状況に関する事項

項目	第4期 自平成20年2月19日 至平成21年2月18日	第5期 自平成21年2月19日 至平成22年2月18日
1．取引の内容	<p>当ファンドの行うことのできるデリバティブ取引は、次の通りです。</p> <p>a．わが国の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。</p> <p>b．わが国の取引所における通貨にかかる先物取引および通貨にかかるオプション取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引。</p> <p>c．わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。</p> <p>異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（「スワップ取引」）。</p> <p>金利先渡取引および為替先渡取引。</p> <p>外国為替の売買の予約取引。</p>	同左
2．取引に対する取組方針	デリバティブ取引につきましては信託約款等に従っており、その制限を遵守しております。	同左
3．取引の利用目的	信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため。	同左
4．取引に係るリスクの内容	デリバティブ取引に伴いファンドに影響を与える主なリスクとしてマーケットリスクがあげられます。マーケットリスクについては、ポジションや時価、予想損失額の把握が重要だと考えております。	同左
5．取引に係るリスクの管理体制	リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理ならびにコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。	同左
6．取引の時価等に関する事項についての補足説明	該当事項はありません。	同左

## . 取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

第4期（平成21年2月18日現在）

第4期末現在、デリバティブ取引は行っておりません。

第5期（平成22年2月18日現在）

第5期末現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第4期（自平成20年2月19日至平成21年2月18日）

該当事項はありません。

第5期（自平成21年2月19日至平成22年2月18日）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項目	第4期	第5期
	（平成21年2月18日現在）	（平成22年2月18日現在）
期首元本額	675,882,922円	1,054,314,569円
期中追加設定元本額	469,037,816円	495,358,440円
期中一部解約元本額	90,606,169円	76,369,973円

## （4）【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

種別	銘柄名	元本額	評価額	
			単価	金額
親投資信託 受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド （B号）	245,170,796円	1.1642円	285,427,840円
親投資信託 受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	744,960,225円	1.0654円	793,680,623円
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	118,272,751円	1.2235円	144,706,710円
親投資信託 受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	120,486,037円	1.1833円	142,571,127円
合計		1,228,889,809円		1,366,386,300円

## 【三井住友・DC年金バランス50(標準型)】

## (1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第4期 (平成21年2月18日現在)	第5期 (平成22年2月18日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	146,074,362	220,483,935
親投資信託受益証券	2,750,720,345	4,393,832,457
未収入金	1,552,000	-
未収利息	80	302
流動資産合計	2,898,346,787	4,614,316,694
資産合計	2,898,346,787	4,614,316,694
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	1,551,043	271,950
未払受託者報酬	494,201	708,456
未払委託者報酬	3,459,345	4,722,967
その他未払費用	82,309	118,014
流動負債合計	5,586,898	5,821,387
負債合計	5,586,898	5,821,387
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	3,728,508,957	5,130,131,943
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	835,749,068	521,636,636
元本等合計	2,892,759,889	4,608,495,307
純資産合計	2,892,759,889	4,608,495,307
負債純資産合計	2,898,346,787	4,614,316,694

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第４期	第５期
	自 平成20年 2月19日 至 平成21年 2月18日	自 平成21年 2月19日 至 平成22年 2月18日
<b>営業収益</b>		
受取利息	520,368	131,094
有価証券売買等損益	948,282,610	502,524,241
営業収益合計	947,762,242	502,655,335
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	964,772	1,253,062
委託者報酬	6,753,264	8,430,878
その他費用	160,674	208,722
営業費用合計	7,878,710	9,892,662
営業利益又は営業損失（ ）	955,640,952	492,762,673
経常利益又は経常損失（ ）	955,640,952	492,762,673
当期純利益又は当期純損失（ ）	955,640,952	492,762,673
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（ ）	25,416,181	11,673,293
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	118,325,844	835,749,068
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	32,409,154
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	32,409,154
剰余金減少額又は欠損金増加額	23,850,141	199,386,102
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	10,454,161	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	13,395,980	199,386,102
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	835,749,068	521,636,636

## (3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第4期	第5期
	自平成20年2月19日 至平成21年2月18日	自平成21年2月19日 至平成22年2月18日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券（売買目的有価証券） 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	親投資信託受益証券（売買目的有価証券） 同左

(貸借対照表に関する注記)

項目	第4期	第5期
	(平成21年2月18日現在)	(平成22年2月18日現在)
1. 受益権総数	当該計算期間の末日における受益権の総数 3,728,508,957口	当該計算期間の末日における受益権の総数 5,130,131,943口
2. 元本の欠損	「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額 835,749,068円	「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額 521,636,636円
3. 1単位当たり純資産額	0.7758円 (1万口 = 7,758円)	0.8983円 (1万口 = 8,983円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第4期	第5期
	自平成20年2月19日 至平成21年2月18日	自平成21年2月19日 至平成22年2月18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（57,637,944円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（477,375,730円）、および分配準備積立金（106,084,677円）より、分配対象収益は641,098,351円（1万口当たり1,719.44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（73,963,049円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（726,333,106円）、および分配準備積立金（158,071,104円）より、分配対象収益は958,367,259円（1万口当たり1,868.11円）であります。分配を行っておりません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第4期（自平成20年2月19日 至平成21年2月18日）

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	2,750,720,345円	928,967,785円
合計	2,750,720,345円	928,967,785円

第5期（自平成21年2月19日 至平成22年2月18日）

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	4,393,832,457円	447,068,450円
合計	4,393,832,457円	447,068,450円

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ．取引の状況に関する事項

項目	第4期 自平成20年2月19日 至平成21年2月18日	第5期 自平成21年2月19日 至平成22年2月18日
1．取引の内容	<p>当ファンドの行うことのできるデリバティブ取引は、次の通りです。</p> <p>a．わが国の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。</p> <p>b．わが国の取引所における通貨にかかる先物取引および通貨にかかるオプション取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引。</p> <p>c．わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。</p> <p>異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（「スワップ取引」）。</p> <p>金利先渡取引および為替先渡取引。</p> <p>外国為替の売買の予約取引。</p>	同左
2．取引に対する取組方針	デリバティブ取引につきましては信託約款等に従っており、その制限を遵守しております。	同左
3．取引の利用目的	信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため。	同左
4．取引に係るリスクの内容	デリバティブ取引に伴いファンドに影響を与える主なリスクとしてマーケットリスクがあげられます。マーケットリスクについては、ポジションや時価、予想損失額の把握が重要だと考えております。	同左
5．取引に係るリスクの管理体制	リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理ならびにコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。	同左
6．取引の時価等に関する事項についての補足説明	該当事項はありません。	同左

## . 取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

第4期（平成21年2月18日現在）

第4期末現在、デリバティブ取引は行っておりません。

第5期（平成22年2月18日現在）

第5期末現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第4期（自平成20年2月19日 至 平成21年2月18日）

該当事項はありません。

第5期（自平成21年2月19日 至 平成22年2月18日）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項目	第4期 （平成21年2月18日現在）	第5期 （平成22年2月18日現在）
期首元本額	2,532,269,265円	3,728,508,957円
期中追加設定元本額	1,456,057,755円	1,554,846,560円
期中一部解約元本額	259,818,063円	153,223,574円

## （4）【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

種別	銘柄名	元本額	評価額	
			単価	金額
親投資信託 受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド (B号)	1,380,599,004円	1.1642円	1,607,293,360円
親投資信託 受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	1,529,941,750円	1.0654円	1,629,999,940円
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	570,347,386円	1.2235円	697,820,026円
親投資信託 受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	387,660,890円	1.1833円	458,719,131円
合計		3,868,549,030円		4,393,832,457円

【三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)】  
(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第4期 (平成21年2月18日現在)	第5期 (平成22年2月18日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	58,686,512	97,003,052
親投資信託受益証券	1,112,474,729	1,965,960,700
未収利息	32	132
流動資産合計	1,171,161,273	2,062,963,884
資産合計	1,171,161,273	2,062,963,884
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	-	42,894
未払受託者報酬	206,416	315,378
未払委託者報酬	1,513,619	2,207,569
その他未払費用	34,337	52,503
流動負債合計	1,754,372	2,618,344
負債合計	1,754,372	2,618,344
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,727,001,844	2,507,724,029
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	557,594,943	447,378,489
元本等合計	1,169,406,901	2,060,345,540
純資産合計	1,169,406,901	2,060,345,540
負債純資産合計	1,171,161,273	2,062,963,884

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第4期	第5期
	自平成20年2月19日 至平成21年2月18日	自平成21年2月19日 至平成22年2月18日
<b>営業収益</b>		
受取利息	221,214	55,832
有価証券売買等損益	578,358,581	274,992,779
営業収益合計	578,137,367	275,048,611
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	415,860	546,684
委託者報酬	3,049,432	3,858,707
その他費用	69,177	90,995
営業費用合計	3,534,469	4,496,386
営業利益又は営業損失( )	581,671,836	270,552,225
経常利益又は経常損失( )	581,671,836	270,552,225
当期純利益又は当期純損失( )	581,671,836	270,552,225
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( )	16,589,990	9,180,017
期首剰余金又は期首欠損金( )	46,814,989	557,594,943
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	31,199,945
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	31,199,945
剰余金減少額又は欠損金増加額	39,328,086	182,355,699
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,570,592	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	34,757,494	182,355,699
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金( )	557,594,943	447,378,489

## (3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第4期	第5期
	自平成20年2月19日 至平成21年2月18日	自平成21年2月19日 至平成22年2月18日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券（売買目的有価証券） 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	親投資信託受益証券（売買目的有価証券） 同左

(貸借対照表に関する注記)

項目	第4期	第5期
	(平成21年2月18日現在)	(平成22年2月18日現在)
1. 受益権総数	当該計算期間の末日における受益権の総数 1,727,001,844口	当該計算期間の末日における受益権の総数 2,507,724,029口
2. 元本の欠損	「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額 557,594,943円	「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の6第10号に規定する額 447,378,489円
3. 1単位当たり純資産額	0.6771円 (1万口=6,771円)	0.8216円 (1万口=8,216円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第4期	第5期
	自平成20年2月19日 至平成21年2月18日	自平成21年2月19日 至平成22年2月18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（26,727,119円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（303,100,215円）、および分配準備積立金（58,583,700円）より、分配対象収益は388,411,034円（1万口当たり2,249.04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（33,616,328円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（484,022,460円）、および分配準備積立金（81,263,749円）より、分配対象収益は598,902,537円（1万口当たり2,388.23円）であります。分配を行っておりません。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第4期（自平成20年2月19日 至平成21年2月18日）

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,112,474,729円	567,932,985円
合計	1,112,474,729円	567,932,985円

第5期（自平成21年2月19日 至平成22年2月18日）

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,965,960,700円	250,666,508円
合計	1,965,960,700円	250,666,508円

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ．取引の状況に関する事項

項目	第4期 自平成20年2月19日 至平成21年2月18日	第5期 自平成21年2月19日 至平成22年2月18日
1．取引の内容	<p>当ファンドの行うことのできるデリバティブ取引は、次の通りです。</p> <p>a．わが国の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。</p> <p>b．わが国の取引所における通貨にかかる先物取引および通貨にかかるオプション取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引。</p> <p>c．わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。</p> <p>異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（「スワップ取引」）。</p> <p>金利先渡取引および為替先渡取引。</p> <p>外国為替の売買の予約取引。</p>	同左
2．取引に対する取組方針	デリバティブ取引につきましては信託約款等に従っており、その制限を遵守しております。	同左
3．取引の利用目的	信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため。	同左
4．取引に係るリスクの内容	デリバティブ取引に伴いファンドに影響を与える主なリスクとしてマーケットリスクがあげられます。マーケットリスクについては、ポジションや時価、予想損失額の把握が重要だと考えております。	同左
5．取引に係るリスクの管理体制	リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理ならびにコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。	同左
6．取引の時価等に関する事項についての補足説明	該当事項はありません。	同左

## . 取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

第4期（平成21年2月18日現在）

第4期末現在、デリバティブ取引は行っておりません。

第5期（平成22年2月18日現在）

第5期末現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第4期（自平成20年2月19日 至 平成21年2月18日）

該当事項はありません。

第5期（自平成21年2月19日 至 平成22年2月18日）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項目	第4期	第5期
	（平成21年2月18日現在）	（平成22年2月18日現在）
期首元本額	1,142,611,401円	1,727,001,844円
期中追加設定元本額	726,637,191円	884,174,334円
期中一部解約元本額	142,246,748円	103,452,149円

## （4）【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

種別	銘柄名	元本額	評価額	
			単価	金額
親投資信託 受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド （B号）	883,900,097円	1.1642円	1,029,036,492円
親投資信託 受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	293,868,644円	1.0654円	313,087,653円
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	341,075,355円	1.2235円	417,305,696円
親投資信託 受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	174,538,037円	1.1833円	206,530,859円
合計		1,693,382,133円		1,965,960,700円

## （参考情報）

[「国内株式インデックス・マザーファンド（B号）」の状況](#)[「国内債券パッシブ・マザーファンド」の状況](#)[「外国株式インデックス・マザーファンド」の状況](#)[「外国債券パッシブ・マザーファンド」の状況](#)

## 2【ファンドの現況】

### 【純資産額計算書】

#### a. 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)

平成22年3月31日現在

資産総額	1,509,379,768 円
負債総額	620,576 円
純資産総額( - )	1,508,759,192 円
発行済口数	1,511,897,238 口
1口当たり純資産額( / )	0.9979 円
( 1万口当たり純資産額	9,979 円)

#### b. 三井住友・DC年金バランス50(標準型)

平成22年3月31日現在

資産総額	4,960,312,899 円
負債総額	3,358,203 円
純資産総額( - )	4,956,954,696 円
発行済口数	5,270,311,076 口
1口当たり純資産額( / )	0.9405 円
( 1万口当たり純資産額	9,405 円)

#### c. 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)

平成22年3月31日現在

資産総額	2,274,100,029 円
負債総額	1,937,908 円
純資産総額( - )	2,272,162,121 円
発行済口数	2,596,587,990 口
1口当たり純資産額( / )	0.8751 円
( 1万口当たり純資産額	8,751 円)

## 第5【設定及び解約の実績】

## a．三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）

計算期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	1,000,000	-
第2期	261,744,830	3,829,999
第3期	470,245,880	53,277,789
第4期	469,037,816	90,606,169
第5期	495,358,440	76,369,973

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。以下同じ。

## b．三井住友・DC年金バランス50（標準型）

計算期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	1,000,000	-
第2期	1,089,719,269	10,113,718
第3期	1,551,597,287	99,933,573
第4期	1,456,057,755	259,818,063
第5期	1,554,846,560	153,223,574

## c．三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）

計算期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	1,000,000	-
第2期	501,029,827	15,165,803
第3期	723,490,810	67,743,433
第4期	726,637,191	142,246,748
第5期	884,174,334	103,452,149

## 第四部【特別情報】

### 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22年3月31日現在

資本金の額	2,000百万円
会社が発行する株式の総数	60,000株
発行済株式総数	17,640株

##### ロ 最近5年間における資本金の額の増減 該当ありません。

##### ハ 会社の機構

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

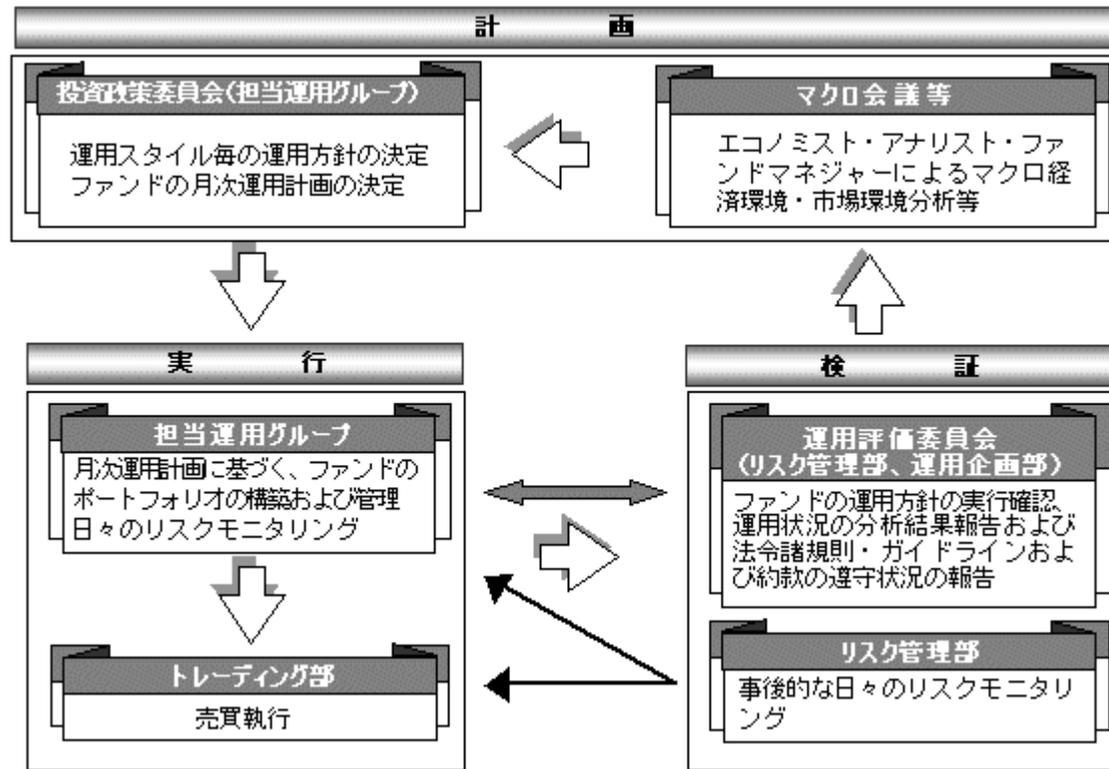
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役を若干名を選定します。

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

##### ニ 投資信託の運用の流れ



## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成22年3月31日現在、委託会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

（平成22年3月31日現在、単位：百万円）

		本数	純資産総額
株式投資信託	単位型	67 ( 1 )	187,311 ( 212 )
	追加型	242 ( 109 )	4,362,813 ( 2,526,206 )
	計	309 ( 110 )	4,550,125 ( 2,526,418 )
公社債投資信託	単位型	0 ( 0 )	0 ( 0 )
	追加型	0 ( 0 )	0 ( 0 )
	計	0 ( 0 )	0 ( 0 )
合計		309 ( 110 )	4,550,125 ( 2,526,418 )

( )内は、私募投資信託分であり、内書き表記しております。

### 3【委託会社等の経理状況】

1 当社の財務諸表は、第23期（平成19年4月1日から平成20年3月31日まで）については、改正前の「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しており、第24期（平成20年4月1日から平成21年3月31日まで）については、改正後の「財務諸表等規則」並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

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

2 当社は、第23期（平成19年4月1日から平成20年3月31日まで）及び第24期（平成20年4月1日から平成21年3月31日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、あずさ監査法人の監査を受けており、第25期中間会計期間（平成21年4月1日から平成21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、あずさ監査法人の中間監査を受けております。

## (1)【貸借対照表】

(単位：千円)

		第 2 3 期 (平成20年3月31日現在)	第 2 4 期 (平成21年3月31日現在)
(資産の部)			
流動資産			
現金及び預金	2	18,130,988	15,883,303
有価証券		5,994,478	2,998,947
前払費用		222,628	323,949
未収入金		-	3,593
未収委託者報酬		4,184,389	2,158,082
未収運用受託報酬		1,008,548	635,902
未収投資助言報酬	2	493,368	406,959
未収収益		8,180	8,062
未収還付法人税等		-	1,068,737
未収還付消費税等		-	182,000
繰延税金資産		439,833	68,795
その他の流動資産		24,816	2,641
流動資産計		30,507,231	23,740,977
固定資産			
有形固定資産			
有形固定資産	1		
建物		169,017	169,629
器具備品		225,583	200,701
有形固定資産合計		394,601	370,331
無形固定資産			
無形固定資産	1		
電話加入権		173	161
商標権		10,048	8,104
無形固定資産合計		10,222	8,266
投資その他の資産			
投資有価証券		1,598,911	2,542,125

関係会社株式	236,178	236,178
長期差入保証金	702,453	783,231
長期前払費用	18,200	14,643
会員権	17,113	20,113
繰延税金資産	15,024	34,393
投資その他の資産合計	2,587,882	3,630,686
固定資産計	2,992,706	4,009,284
資産合計	33,499,937	27,750,261

(単位：千円)

	第 2 3 期 (平成20年3月31日現在)	第 2 4 期 (平成21年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	40,052	44,497
未払金		
未払収益分配金	2,787	947
未払償還金	28,571	23,376
未払手数料	2 1,727,481	891,493
その他未払金	149,275	112,743
未払費用	760,613	612,126
未払消費税等	366,587	-
未払法人税等	3,334,415	-
前受収益	5,985	-
賞与引当金	375,721	291,836
その他の流動負債	254	-
流動負債計	6,791,746	1,977,020
固定負債		
退職給付引当金	749,327	972,202
固定負債計	749,327	972,202
負債合計	7,541,073	2,949,223
(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	13,483,283	12,356,655
利益剰余金合計	15,304,488	14,177,860
株主資本計	25,933,472	24,806,844
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	25,392	5,805
評価・換算差額等計	25,392	5,805
純資産合計	25,958,864	24,801,038
負債・純資産合計	33,499,937	27,750,261

## （２）【損益計算書】

（単位：千円）

	第 2 3 期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)	第 2 4 期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	32,260,683	20,072,582
運用受託報酬	4,320,395	3,506,635
投資助言報酬	2,276,198	2,048,748
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	75,471	60,260
その他	-	2,749
営業収益計	38,937,748	25,695,976
営業費用		
支払手数料	15,226,126	9,326,200
広告宣伝費	834,129	529,276
公告費	8,062	1,227
受益証券発行費	218	-
調査費		
調査費	541,419	538,515
委託調査費	2,298,023	1,310,113
営業雑経費		
通信費	27,577	30,202
印刷費	325,929	302,661
協会費	18,986	23,322
諸会費	15,281	14,373
情報機器関連費	1,936,376	2,036,426
販売促進費	36,029	55,223
その他	60,681	55,485
営業費用計	21,328,842	14,223,029

一般管理費		
給料		
役員報酬	166,266	174,486
給料・手当	3,698,904	4,004,575
賞与	1,119,415	1,051,279
賞与引当金繰入額	375,721	291,836
交際費	20,571	23,229
寄付金	-	4,000
事務委託費	250,163	356,543
旅費交通費	249,775	258,981
租税公課	116,931	81,166
不動産賃借料	624,843	762,812
退職給付費用	277,530	262,634
固定資産減価償却費	149,507	119,811
諸経費	398,374	281,968
一般管理費計	7,448,006	7,673,326
営業利益	10,160,899	3,799,620

営業外収益			
受取配当金		8,036	-
有価証券利息		7,450	22,216
受取利息	1	34,555	36,255
為替差益		634	11,209
時効成立分配金・償還金		5,827	7,832
原稿・講演料		4,424	3,910
雑収入		3,743	4,132
営業外収益計		64,671	85,555
営業外費用			
時効成立後支払分配金・償還金		1,826	693
雑損失		0	82
営業外費用計		1,826	775
経常利益		10,223,744	3,884,401
特別利益			
貸倒引当金戻入益		25,000	-
投資有価証券償還益		5,787	1,136
投資有価証券売却益		124,622	122
ゴルフ会員権売却益		5,555	-
特別利益計		160,966	1,259
特別損失			
固定資産除却損	2	12,288	688
投資有価証券償還損		503	84,238
投資有価証券評価損		17,700	65,553
投資有価証券売却損		56	464,272
投資有価証券清算損		256	-
ゴルフ会員権売却損		24,476	-
特別損失計		55,282	614,753
税引前当期純利益		10,329,428	3,270,907
法人税、住民税及び事業税		4,544,339	1,206,047
法人税等調整額		134,250	369,088
法人税等合計		4,410,088	1,575,135

当期純利益	5,919,339	1,695,771
-------	-----------	-----------

## (3)【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	第 2 3 期	第 2 4 期
	(自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)	(自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)
株主資本		
資本金		
前期末残高	2,000,000	2,000,000
当期末残高	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金		
前期末残高	8,628,984	8,628,984
当期末残高	8,628,984	8,628,984
資本剰余金合計		
前期末残高	8,628,984	8,628,984
当期末残高	8,628,984	8,628,984
利益剰余金		
利益準備金		
前期末残高	284,245	284,245
当期末残高	284,245	284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金		
前期末残高	60,000	60,000
当期末残高	60,000	60,000
特別償却準備金		
前期末残高	9,041	-
当期変動額		
特別償却準備金取崩	9,041	-
当期変動額合計	9,041	-
当期末残高	-	-
別途積立金		

前期末残高	1,476,959	1,476,959
当期末残高	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金		
前期末残高	8,613,302	13,483,283
当期変動額		
特別償却準備金取崩	9,041	-
剰余金の配当	1,058,400	2,822,400
当期純利益	5,919,339	1,695,771
当期変動額合計	4,869,980	1,126,628
当期末残高	13,483,283	12,356,655
利益剰余金合計		
前期末残高	10,443,548	15,304,488
当期変動額		
剰余金の配当	1,058,400	2,822,400
当期純利益	5,919,339	1,695,771
当期変動額合計	4,860,939	1,126,628
当期末残高	15,304,488	14,177,860

株主資本合計		
前期末残高	21,072,532	25,933,472
当期変動額		
剰余金の配当	1,058,400	2,822,400
当期純利益	5,919,339	1,695,771
当期変動額合計	4,860,939	1,126,628
当期末残高	25,933,472	24,806,844
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
前期末残高	433,303	25,392
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	407,911	31,197
当期変動額合計	407,911	31,197
当期末残高	25,392	5,805
評価・換算差額合計		
前期末残高	433,303	25,392
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	407,911	31,197
当期変動額合計	407,911	31,197
当期末残高	25,392	5,805
純資産合計		
前期末残高	21,505,836	25,958,864
当期変動額		
剰余金の配当	1,058,400	2,822,400
当期純利益	5,919,339	1,695,771
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	407,911	31,197
当期変動額合計	4,453,028	1,157,826
当期末残高	25,958,864	24,801,038

## 重要な会計方針

項目	第23期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)	第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)
1 有価証券の評価基準及び評価方法	満期保有目的の債券 償却原価法 子会社株式 移動平均法による原価法 その他有価証券 時価のあるもの 決算日の市場価格等に基づく時価法 （評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定） 時価のないもの 移動平均法による原価法	満期保有目的の債券 同左 子会社株式 同左 その他有価証券 時価のあるもの 同左 時価のないもの 同左
2 固定資産の減価償却の方法	有形固定資産 定率法によっております。但し、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、定額法によっております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。 建物 3～50年 器具備品 3～20年 無形固定資産 定額法によっております。	有形固定資産 同左 無形固定資産 同左
3 引当金の計上基準 (1) 賞与引当金  (2) 退職給付引当金	従業員賞与の支給に充てるため、将来の支給見込額のうち当期の負担額を計上しております。 従業員の退職金支給に備えるため、当事業年度末における退職給付債務に基づき計上しております。	同左 従業員の退職金支給に備えるため、当事業年度末における退職給付債務に基づき計上しております。 過去勤務債務については、その発生時において一時に費用処理しております。 数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

4 リース取引の処理方法	リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。	所有権移転外ファイナンス・リース取引のうち、リース取引開始日が平成20年4月1日前に開始する事業年度に属するものについては、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。
5 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理は税抜方式によっております。	同左

## 会計方針の変更

(会計処理の変更)

<p style="text-align: center;">第23期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)</p>	<p style="text-align: center;">第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)</p>
<p>有形固定資産の減価償却の方法</p> <p>法人税法の改正（（所得税法等の一部を改正する法律 平成19年3月30日法律第6号）及び（法人税法施行令の一部を改正する政令 平成19年3月30日政令第83号））に伴い、当事業年度から平成19年4月1日以降に取得したのものについては、改正後の法人税法に基づく方法に変更しております。</p> <p>なお、この変更による影響は軽微であります。</p>	<p style="text-align: center;">-</p>
<p style="text-align: center;">-</p>	<p>リース取引に関する会計基準</p> <p>所有権移転外ファイナンス・リース取引については、従来、賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっておりましたが、企業会計基準第13号「リース取引に関する会計基準」（平成19年3月30日 企業会計基準委員会）及び企業会計基準適用指針第16号「リース取引に関する会計基準の適用指針」（同前）が平成20年4月1日以後開始する事業年度から適用されることになったことに伴い、当事業年度から同会計基準及び適用指針を適用しております。</p> <p>当事業年度において、通常の売買取引に係る方法に準じた会計処理による取引はありません。</p>

(表示方法の変更)

<p style="text-align: center;">第23期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)</p>	<p style="text-align: center;">第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)</p>
<p>1.前事業年度において区分掲記しておりました「現金」（当事業年度877千円）及び「預金」（当事業年度18,130,111千円）は、金融商品取引法の施行により「現金及び預金」として表示しております。</p> <p>2.金融商品取引法の施行に伴い、区分表示をより明瞭にするため、以下の表示方法の変更を行っております。</p> <p>(貸借対照表)</p> <p>前事業年度において「未収投資顧問料」として表示しておりました投資一任契約の未収運用受託報酬及び投資顧問（助言）契約の未収投資助言報酬は、当事業年度においては「未収運用受託報酬」及び「未収投資助言報酬」として区分して表示しております。なお、前事業年度における「未収運用受託報酬」及び「未収投資助言報酬」は、それぞれ1,001,467千円、444,216千円であります。</p> <p>(損益計算書)</p> <p>前事業年度において「投資顧問料」として表示しておりました投資一任契約の運用受託報酬及び投資顧問（助言）契約の投資助言報酬は、当事業年度においては「運用受託報酬」及び「投資助言報酬」として区分して表示しております。なお、前事業年度における「運用受託報酬」及び「投資助言報酬」は、それぞれ3,970,091千円、2,451,535千円であります。</p> <p>3.前事業年度において区分掲記しておりました「時効成立分配金」（当事業年度53千円）及び「時効成立償還金」（当事業年度5,773千円）は、金額的重要性が乏しいため、「時効成立分配金・償還金」として表示しております。</p>	<p style="text-align: center;">-</p>

(追加情報)

第23期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)	第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)
<p>(有形固定資産の減価償却の方法) 当事業年度から、平成19年3月31日以前に取得したものについては、償却可能限度額まで償却が終了した翌年から5年間で均等償却する方法によっております。なお、この変更による影響は軽微であります。</p> <p>(退職給付会計) 退職給付債務の算定にあたり、従来、簡便法によっておりましたが、従業員の増加に伴い、当事業年度より原則法による算定方法に変更しております。この結果、従来と同一の方法を採用した場合と比べ、営業利益、経常利益、税引前当期純利益及び当期純利益は、それぞれ123,774千円減少しております。</p> <p>また、この変更は従業員の増加等に伴い、当下期に行ったため、当中間会計期間は、前事業年度と同一の方法によっております。従って当中間会計期間は、変更後の方法によった場合に比べ、営業利益、経常利益及び税引前中間純利益及び中間純利益は128,390千円多く計上されております。</p>	-

注 記 事 項

(貸借対照表関係)

第23期 (平成20年3月31日現在)	第24期 (平成21年3月31日現在)
<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建 物 126,027千円</p> <p>器具備品 859,261千円</p> <p>無形固定資産の減価償却累計額</p> <p>電話加入権 60千円</p> <p>ソフトウェア 111,411千円</p> <p>商標権 9,393千円</p>	<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建 物 150,704千円</p> <p>器具備品 941,423千円</p> <p>無形固定資産の減価償却累計額</p> <p>電話加入権 72千円</p> <p>商標権 11,337千円</p>
<p>2 関係会社に対する債権債務</p> <p>現金及び預金 12,481,426千円</p> <p>未収投資助言報酬 478,296千円</p> <p>未払手数料 509,702千円</p>	<p>2 関係会社に対する債権債務</p> <p>現金及び預金 10,311,398千円</p> <p>未収投資助言報酬 398,818千円</p> <p>未払手数料 331,400千円</p>
<p>3 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座貸越契約を締結しております。</p> <p>当事業年度末における当座貸越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。</p> <p>当座貸越極度額の総額 10,000,000千円</p> <p>借入実行残高 - 千円</p>	<p>3 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座貸越契約を締結しております。</p> <p>当事業年度末における当座貸越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。</p> <p>当座貸越極度額の総額 10,000,000千円</p> <p>借入実行残高 - 千円</p>

差引額	10,000,000千円	差引額	10,000,000千円
4 当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York)Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成27年6月までの賃借料総額149,005千円の支払保証を行っております。		4 当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York)Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成27年6月までの賃借料総額128,926千円の支払保証を行っております。	

## (損益計算書関係)

第23期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)	第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)
1 関係会社との取引に係るもの 受取利息 24,820千円	1 関係会社との取引に係るもの 受取利息 18,943千円
2 固定資産除却損は、器具備品12,082千円、電話加入権206千円であります。	2 固定資産除却損は、器具備品688千円であります。

## (株主資本等変動計算書関係)

第23期(自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)

## 1. 発行済株式数に関する事項

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

## 2. 剰余金の配当に関する事項

## (1) 配当金支払額等

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成19年6月25日 定時株主総会	普通株式	1,058,400	60,000	平成19年 3月31日	平成19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20年6月23日開催の第23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20年6月23日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	2,822,400	160,000	平成20年 3月31日	平成20年 6月24日

第24期(自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)

## 1. 発行済株式数に関する事項

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

## 2. 剰余金の配当に関する事項

## (1) 配当金支払額等

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成20年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,822,400	160,000	平成20年 3月31日	平成20年 6月24日

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

平成21年6月30日開催の第24回定時株主総会において次の通り付議いたします。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成21年6月30日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	846,720	48,000	平成21年 3月31日	平成21年 7月1日

## (リース取引関係)

第23期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)			第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)		
1.リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引 (借主側) リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額(単位：千円)			1.リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引 (借主側) リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額(単位：千円)		
	器具備品	合計		器具備品	合計
取得価額相当額	9,504	9,504	取得価額相当額	5,330	5,330
減価償却累計額相当額	7,603	7,603	減価償却累計額相当額	5,330	5,330
期末残高相当額	1,900	1,900	期末残高相当額	-	-
未経過リース料期末残高相当額(単位：千円)			未経過リース料期末残高相当額(単位：千円)		
1年以内	2,030		1年以内	-	
合計	2,030		合計	-	
支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額 (単位：千円)			支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額 (単位：千円)		
支払リース料	2,067		支払リース料	2,067	
減価償却費相当額	1,900		減価償却費相当額	1,900	
支払利息相当額	104		支払利息相当額	37	
減価償却費相当額及び利息相当額の算定方法 減価償却費相当額の算定方法 ・リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。			減価償却費相当額及び利息相当額の算定方法 減価償却費相当額の算定方法 ・同左		
利息相当額の算定方法 ・リース料総額とリース物件の取得価額相当額との差額を利息相当額とし、各期への配分方法については、利息法によっております。			利息相当額の算定方法 ・同左		
2.オペレーティング・リース取引			2.オペレーティング・リース取引		

(借主側)		(借主側)	
未経過リース料	(単位:千円)	未経過リース料(解約不能のもの)	(単位:千円)
1年以内	1,119	1年以内	710,121
1年超	1,959	1年超	962,627
合計	3,078	合計	1,672,748

(有価証券関係)

第23期(平成20年3月31日現在)

## 1. 満期保有目的の債券で時価のあるもの

(単位：千円)

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)貸借対照表日の時価が貸借対照表計上額を超えるもの	-	-	-
小計	-	-	-
(2)貸借対照表日の時価が貸借対照表計上額を超えないもの	5,994,478	5,993,700	778
小計	5,994,478	5,993,700	778
合計	5,994,478	5,993,700	778

## 2. その他有価証券で時価のあるもの

(単位：千円)

区分	取得原価	貸借対照表計上額	差額
(1)貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	800,100	877,780	77,680
小計	800,100	877,780	77,680
(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	655,700	620,832	34,867
小計	655,700	620,832	34,867
合計	1,455,800	1,498,613	42,813

## 3. 時価評価されていない有価証券の内容及び貸借対照表計上額

(単位：千円)

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

## 4. 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額

628,566	124,622	56
---------	---------	----

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

(単位：千円)

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
(1)満期保有目的の債券 国債・地方債等	6,000,000	-	-	-
小計	6,000,000	-	-	-
(2)その他有価証券	-	-	-	-
小計	-	-	-	-
合計	6,000,000	-	-	-

第24期(平成21年3月31日現在)

## 1. 満期保有目的の債券で時価のあるもの

(単位：千円)

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)貸借対照表日の時価が貸借対照表計上額を超えるもの	-	-	-
小計	-	-	-
(2)貸借対照表日の時価が貸借対照表計上額を超えないもの	2,998,947	2,998,800	147
小計	2,998,947	2,998,800	147
合計	2,998,947	2,998,800	147

## 2. その他有価証券で時価のあるもの

(単位：千円)

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

## 3. 時価評価されていない有価証券の内容及び貸借対照表計上額

(単位：千円)

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

## 4. 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
882,530	122	464,272

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

(単位：千円)

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
(1)満期保有目的の債券 国債・地方債等	3,000,000	-	-	-
小計	3,000,000	-	-	-
(2)その他有価証券	-	-	-	-
小計	-	-	-	-
合計	3,000,000	-	-	-

(デリバティブ取引関係)

第23期(自平成19年4月1日至平成20年3月31日)

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

第24期(自平成20年4月1日至平成21年3月31日)

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

(退職給付関係)

第23期 (自平成19年4月1日 至平成20年3月31日)	第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)																						
<p>1. 採用している退職給付制度の概要</p> <p>当社は、確定給付型の制度として、退職一時金制度を設けております</p>	<p>1. 採用している退職給付制度の概要</p> <p>当社は、確定給付型の制度として、退職一時金制度を設けております。</p>																						
<p>2. 退職給付債務の額</p> <p style="text-align: right;">(単位：千円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">退職給付債務</td> <td style="text-align: right; border-bottom: 1px solid black;">749,327</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td style="text-align: right; border-bottom: 3px double black;">749,327</td> </tr> </table>	退職給付債務	749,327	退職給付引当金	749,327	<p>2. 退職給付債務の額</p> <p style="text-align: right;">(単位：千円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">退職給付債務</td> <td style="text-align: right; border-bottom: 1px solid black;">972,202</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td style="text-align: right; border-bottom: 3px double black;">972,202</td> </tr> </table>	退職給付債務	972,202	退職給付引当金	972,202														
退職給付債務	749,327																						
退職給付引当金	749,327																						
退職給付債務	972,202																						
退職給付引当金	972,202																						
<p>3. 退職給付費用の額</p> <p style="text-align: right;">(単位：千円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">勤務費用</td> <td style="text-align: right;">126,881</td> </tr> <tr> <td>利息費用</td> <td style="text-align: right;">9,519</td> </tr> <tr> <td>簡便法から原則法への変更による差額</td> <td style="text-align: right;">125,138</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">15,991</td> </tr> <tr> <td>退職給付費用</td> <td style="text-align: right; border-bottom: 3px double black;">277,530</td> </tr> </table>	勤務費用	126,881	利息費用	9,519	簡便法から原則法への変更による差額	125,138	その他	15,991	退職給付費用	277,530	<p>3. 退職給付費用の額</p> <p style="text-align: right;">(単位：千円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">勤務費用</td> <td style="text-align: right;">145,258</td> </tr> <tr> <td>利息費用</td> <td style="text-align: right;">12,449</td> </tr> <tr> <td>過去勤務債務の費用処理額</td> <td style="text-align: right;">87,363</td> </tr> <tr> <td>数理計算上の差異の費用処理額</td> <td style="text-align: right;">6,153</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">11,409</td> </tr> <tr> <td>退職給付費用</td> <td style="text-align: right; border-bottom: 3px double black;">262,634</td> </tr> </table>	勤務費用	145,258	利息費用	12,449	過去勤務債務の費用処理額	87,363	数理計算上の差異の費用処理額	6,153	その他	11,409	退職給付費用	262,634
勤務費用	126,881																						
利息費用	9,519																						
簡便法から原則法への変更による差額	125,138																						
その他	15,991																						
退職給付費用	277,530																						
勤務費用	145,258																						
利息費用	12,449																						
過去勤務債務の費用処理額	87,363																						
数理計算上の差異の費用処理額	6,153																						
その他	11,409																						
退職給付費用	262,634																						
<p>4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項</p> <p>退職給付見込額の期間配分方法</p> <p style="padding-left: 20px;">勤務期間を基準とする方法</p> <p>割引率 <span style="float: right;">1.5%</span></p>	<p>4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項</p> <p>退職給付見込額の期間配分方法</p> <p style="padding-left: 20px;">勤務期間を基準とする方法</p> <p>割引率 <span style="float: right;">1.5%</span></p> <p>過去勤務債務の額の処理年数</p>																						

1年(発生時において費用処理する方法)

数理計算上の差異の処理年数

1年(発生時において費用処理する方法)

(税効果会計関係)

第23期 (平成20年3月31日現在)	第24期 (平成21年3月31日現在)
1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生主な原因別の内訳 (単位：千円)	1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生主な原因別の内訳 (単位：千円)
(1) 流動の部	(1) 流動の部
繰延税金資産	繰延税金資産
賞与引当金 152,880	賞与引当金 118,748
未払事業税 260,640	未払社会保険料 12,792
未払社会保険料 13,739	未払事業所税 6,134
未払事業所税 5,846	その他 5,436
その他 6,726	繰延税金資産計 143,111
繰延税金資産計 439,833	評価性引当額 -
評価性引当額 -	繰延税金資産合計 143,111
繰延税金資産合計 439,833	繰延税金負債
繰延税金資産の純額 439,833	未収還付事業税 74,316
	繰延税金負債合計 74,316
	繰延税金資産の純額 68,795
(2) 固定の部	(2) 固定の部
繰延税金資産	繰延税金資産
退職給付引当金 304,901	退職給付引当金 395,589
ソフトウェア償却 78,264	ソフトウェア償却 101,933
投資有価証券評価損 29,953	投資有価証券評価損 56,627
特定外国子会社留保金額 159,153	特定外国子会社留保金額 193,760
その他 13,042	その他有価証券評価差額金 2,362
繰延税金資産計 585,314	その他 14,742
評価性引当額 552,870	繰延税金資産計 765,014
繰延税金資産合計 32,444	評価性引当額 730,620
繰延税金負債	繰延税金資産合計 34,393
その他有価証券評価差額金 17,420	繰延税金資産の純額 34,393
繰延税金負債合計 17,420	

繰延税金資産の純額	15,024		
2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳		2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳	
	(%)		(%)
法定実効税率	40.7	法定実効税率	40.7
(調整)		(調整)	
評価性引当額の増減	2.4	評価性引当額の増減	5.4
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.1	交際費等永久に損金に算入されない項目	0.5
住民税均等割等	0.0	住民税均等割等	0.2
その他	0.5	その他	1.4
税効果会計適用後の法人税等の負担率	42.7	税効果会計適用後の法人税等の負担率	48.2

(関連当事者との取引)

第23期(自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)

(1) 親会社及び法人主要株主等

(単位：千円)

属性	会社等の名称	住所	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	関係内容		取引の内容	取引金額	科目	期末残高
						役員の兼任等	事業上の関係				
その他の関係会社	住友生命保険(相)	大阪市中央区	199,000,000	生命保険業	% (被所有)直接 35		当社の主要顧客 投信の販売委託	投資助言報酬 委託販売手数料	1,324,757 276,418	未収投資助言報酬 未払手数料	331,981 42,572
その他の関係会社	三井生命保険(株)	東京都千代田区	137,280,000	生命保険業	% (被所有)直接 30		当社の主要顧客 投信の販売委託	投資助言報酬 委託販売手数料	273,276 251,915	未収投資助言報酬 未払手数料	143,563 88,117
その他の関係会社	三井住友海上火災保険(株)	東京都中央区	139,595,523	損害保険業	% (被所有)直接 17.5		当社の主要顧客 投信の販売委託	投資助言報酬 委託販売手数料	579,567 441,750	未払手数料	53,804
その他の関係会社	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	664,986,500	銀行業	% (被所有)直接 17.5	1名	投信の販売委託	委託販売手数料	2,407,945	未払手数料	325,208

(注) 1. 上記金額のうち、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(1) 投資助言契約の受託については、当社規定の投資助言料率に基づき決定しております。

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

(2) 子会社等

(単位：千円)

属性	会社等の名称	住所	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	関係内容		取引の内容	取引金額	科目	期末残高
						役員の兼任等	事業上の関係				
子会社	Sumitomo Mitsui Asset Management (New York) Inc.	米国 ニューヨーク	65,334	投資顧問業	% 直接100	出向 2名	業務委託	調査費	199,897	未払金	2,360
子会社	Sumitomo Mitsui Asset Management (London) Limited	英国 ロンドン	106,622	投資顧問業	% 直接100	出向 2名	業務委託	調査費	139,844	-	-
子会社	Sumitomo Mitsui Asset Management (Hong Kong) Limited	香港	52,736	投資顧問業	% 直接100	出向 2名	業務委託	調査費	563,312	未払費用	227,521

## (注) 1. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## (3) 兄弟会社等

(単位：千円)

属性	会社等の名称	住所	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	関係内容		取引の内容	取引金額	科目	期末残高
						役員の兼任等	事業上の関係				
主要株主の子会社	住生コンピュータサービス(株)	大阪市淀川区	300,000	情報処理サービス業	% -	-	IT機器等購入 ITサポート	IT機器・消耗品購入 IT運用保守サポート等	542,560	前払費用 長期前払費用 未払費用 未払金	4,225 11,572 40,881 1,412
主要株主の子会社	エムエルアイ・システムズ(株)	千葉県柏市	100,000	情報システムの企画、設計、保守等	% -	-	ITサポート	IT運用保守サポート等	116,364	前払費用 未払費用	560 8,785

(注) 1. 上記金額のうち、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) その他営業取引については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

第24期(自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)

(1) 親会社及び主要株主(会社等の場合に限る。)等

(単位:千円)

種類	会社等の 名称又は 氏名	所在地	資本金、 出資金 又は基金	事業の内容 又は職業	議決権等 の所有(被所 有)割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の 関係会社	住友生命 保険(相)	大阪府 大阪市 中央区	199,000,000	生命保険業	% (被所有) 直接 40	当社の主要顧客 投信の販売委託	投資助言報酬 委託販売手数料	1,151,492 227,288	未収投資助言報酬 未払手数料	267,215 34,564
その他の 関係会社	(株)三井 住友銀行	東京都 千代田区	664,986,500	銀行業	% (被所有) 直接27.5	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	2,114,655	未払手数料	180,287

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(1) 投資助言契約の受託については、当社規定の投資助言料率に基づき決定しております。

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

(追加情報)

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

## (1株当たり情報)

第23期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)		第24期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	
1株当たり純資産額	1,471,590円96銭	1株当たり純資産額	1,405,954円57銭
1株当たり当期純利益	335,563円48銭	1株当たり当期純利益	96,132円19銭
なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。		なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	
(1株当たり純資産額の算定上の基礎)		(1株当たり純資産額の算定上の基礎)	
貸借対照表の純資産の部の合計額	25,958,864千円	貸借対照表の純資産の部の合計額	24,801,038千円
普通株式に係る純資産額	25,958,864千円	普通株式に係る純資産額	24,801,038千円
普通株式の発行済株式数	17,640株	普通株式の発行済株式数	17,640株
1株当たり純資産額の算定に用いられた普通株式の数	17,640株	1株当たり純資産額の算定に用いられた普通株式の数	17,640株
(1株当たり当期純利益の算定上の基礎)		(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	5,919,339千円	損益計算書上の当期純利益	1,695,771千円
普通株式に係る当期純利益	5,919,339千円	普通株式に係る当期純利益	1,695,771千円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳	該当事項はありません。	普通株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	普通株式の期中平均株式数	17,640株

## (重要な後発事象)

第23期(自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)

該当事項はありません。

第24期(自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)

該当事項はありません。

## 中間財務諸表

## (1)中間貸借対照表

(単位：千円)

第25期中間会計期間末 (平成21年9月30日現在)		
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		15,620,134
有価証券		2,999,230
前払費用		245,665
未収委託者報酬		2,895,496
未収運用受託報酬		658,499
未収投資助言報酬		443,157
未収収益		7,495
繰延税金資産		196,660
その他		16,660
流動資産合計		23,083,000
固定資産		
有形固定資産	1	330,844
無形固定資産		7,288
投資その他の資産		
投資有価証券		4,777,847
その他		938,827
投資その他の資産合計		5,716,674
固定資産合計		6,054,807
資産合計		29,137,807
負債の部		
流動負債		
預り金		45,983
未払金		1,225,025

未払費用		699,098
未払法人税等		865,628
前受収益		7,178
賞与引当金		257,569
その他	2	66,354
流動負債合計		<u>3,166,838</u>
固定負債		
退職給付引当金		1,055,906
固定負債合計		<u>1,055,906</u>
負債合計		<u>4,222,744</u>

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	12,441,640
利益剰余金合計	14,262,845
株主資本合計	24,891,829
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	23,234
評価・換算差額等合計	23,234
純資産合計	24,915,063
負債純資産合計	29,137,807

## (2)中間損益計算書

(単位：千円)

		第25期中間会計期間 (自 平成21年4月1日 至 平成21年9月30日)
営業収益		
委託者報酬		9,197,433
運用受託報酬		1,285,645
投資助言報酬		970,746
その他の営業収益		31,069
営業収益計		11,484,895
営業費用		
一般管理費	1	3,508,168
営業利益		1,612,529
営業外収益	2	57,646
営業外費用	3	11,441
経常利益		1,658,734
特別利益		11,351
特別損失		3,607
税引前中間純利益		1,666,478
法人税、住民税及び事業税		846,969
法人税等調整額		112,195
法人税等合計		734,773
中間純利益		931,705

## (3)中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

第25期中間会計期間 (自 平成21年 4月 1日 至 平成21年 9月30日)	
株主資本	
資本金	
前期末残高	2,000,000
当中間期末残高	2,000,000
資本剰余金	
資本準備金	
前期末残高	8,628,984
当中間期末残高	8,628,984
資本剰余金合計	
前期末残高	8,628,984
当中間期末残高	8,628,984
利益剰余金	
利益準備金	
前期末残高	284,245
当中間期末残高	284,245
その他利益剰余金	
配当準備積立金	
前期末残高	60,000
当中間期末残高	60,000
別途積立金	
前期末残高	1,476,959
当中間期末残高	1,476,959
繰越利益剰余金	
前期末残高	12,356,655
当中間期変動額	
剰余金の配当	846,720
中間純利益	931,705

当中間期変動額合計	84,985
当中間期末残高	12,441,640
利益剰余金合計	
前期末残高	14,177,860
当中間期変動額	
剰余金の配当	846,720
中間純利益	931,705
当中間期変動額合計	84,985
当中間期末残高	14,262,845
株主資本合計	
前期末残高	24,806,844
当中間期変動額	
剰余金の配当	846,720
中間純利益	931,705
当中間期変動額合計	84,985
当中間期末残高	24,891,829

評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
前期末残高	5,805
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	29,039
当中間期変動額合計	29,039
当中間期末残高	23,234
評価・換算差額等合計	
前期末残高	5,805
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	29,039
当中間期変動額合計	29,039
当中間期末残高	23,234
純資産合計	
前期末残高	24,801,038
当中間期変動額	
剰余金の配当	846,720
中間純利益	931,705
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	29,039
当中間期変動額合計	114,025
当中間期末残高	24,915,063

## 中間財務諸表作成の基本となる重要な事項

## 第25期中間会計期間

(自 平成21年4月1日 至 平成21年9月30日)

## 1. 資産の評価基準及び評価方法

## (1) 有価証券

- ・満期保有目的の債券 償却原価法
- ・子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法
- ・その他有価証券
  - 時価のあるもの 中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は、全部純資産直入法により処理し売却原価は移動平均法により算定）
  - 時価のないもの 移動平均法による原価法

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 3～50年

器具備品 3～20年

## (2) 無形固定資産

定額法によっております。

## 3. 引当金の計上基準

## (1) 賞与引当金

従業員に対して支給する賞与の支出に充てるため、支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。

## (2) 退職給付引当金

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

過去勤務債務については、発生時において全額を費用処理しております。

数理計算上の差異については、発生時において全額を費用処理しております。

#### 4．その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

##### (1) 消費税等の会計処理

税抜方式によっております。

## 注 記 事 項

( 中間貸借対照表関係 )

第25期中間会計期間末 (平成21年9月30日現在)	
1.有形固定資産の減価償却累計額	1,032,523千円
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109,050千円の支払保証を行っております。	

## 注 記 事 項

( 中間損益計算書関係 )

第25期中間会計期間 (自平成21年4月1日 至 平成21年9月30日)	
1.減価償却実施額	
有形固定資産	48,154千円
無形固定資産	977千円
2.営業外収益のうち主要なもの	
受取利息	9,890千円
還付加算金	37,708千円
3.営業外費用のうち主要なもの	
為替差損	11,441千円

## 注 記 事 項

(中間株主資本等変動計算書関係)

第25期中間会計期間 (自 平成21年4月1日 至 平成21年9月30日)					
1. 発行済株式数に関する事項					
	前事業年度末 株式数	当中間会計期間 増加株式数	当中間会計期間 減少株式数	当中間会計期間末 株式数	
普通株式	17,640株	-	-	17,640株	
2. 配当に関する事項					
(決議)	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成21年6月30日 定時株主総会	普通株式	846,720	48,000	平成21年 3月31日	平成21年 7月1日

## 注 記 事 項

(リース取引関係)

第25期中間会計期間 (自 平成21年4月1日 至 平成21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	660,929千円
<u>1年超</u>	<u>631,258千円</u>
合 計	1,292,187千円

## 注 記 事 項

(有価証券関係)

## 1. 時価のある有価証券

(単位：千円)

第25期中間会計期間末 (平成21年9月30日現在)			
区分	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 満期保有目的の債券	2,999,230	2,999,100	130
合計	2,999,230	2,999,100	130
区分	取得原価	中間貸借対照表計上額	差額
(2) その他有価証券			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他	4,639,824	4,677,549	37,724
合計	4,639,824	4,677,549	37,724

## 2. 時価評価されていない主な有価証券

(単位：千円)

第25期中間会計期間末 (平成21年9月30日現在)	
内容	中間貸借対照表計上額
(1) 子会社株式及び関連会社株式	236,178
合計	236,178
(2) その他有価証券	
非上場株式	298
投資証券	100,000
合計	100,298

(デリバティブ取引関係)

第25期中間会計期間 (自平成21年4月1日至平成21年9月30日)
当社は、デリバティブ取引を行っておりませんので、該当事項はありません。

(持分法損益等)

第25期中間会計期間  
(自 平成21年4月1日 至 平成21年9月30日)

該当事項はありません。

## 注 記 事 項

## （ 1 株当たり情報 ）

第25期中間会計期間 ( 自 平成21年 4 月1日 至 平成21年 9 月30日 )	
1 株当たり純資産額	1,412,418円57銭
1 株当たり中間純利益	52,817円75銭
なお、潜在株式調整後 1 株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載していません。	
(注) 1 株当たり純資産額の算定上の基礎	
中間貸借対照表の純資産額の部の合計額	24,915,063千円
普通株式に係る純資産額	24,915,063千円
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	931,705千円
普通株式に係る中間純利益	931,705千円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳	
該当事項はありません。	
普通株式の期中平均株式数	17,640株

## （ 重要な後発事象 ）

第25期中間会計期間 ( 自 平成21年 4 月 1 日 至 平成21年 9 月30日 )	
該当事項はありません。	

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

#### 5【その他】

- イ 定款の変更、その他の重要事項  
平成21年6月30日に開催された定時株主総会において、株券不発行会社に移行するため株券を発行することを定める条項を削除する定款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 住友信託銀行株式会社

(ロ) 資本金の額 342,037百万円（平成21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21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
株式会社三井住友銀行	1,262,959百万円	銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。
株式会社みずほコーポレート銀行	1,404,065百万円	
住友生命保険相互会社	369,000百万円	保険業法に基づき、保険業を営んでいます。
三井生命保険株式会社	167,280百万円	

資本金の額は、平成21年9月末現在。

住友生命保険相互会社の資本金の額は、平成21年9月末現在の基金および基金償却積立金の合計額を記載しております。

### 2【関係業務の概要】

イ 受託会社

信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

ロ 販売会社

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

### 3【資本関係】

販売会社である住友生命保険相互会社は、委託会社株式を7,056株（持株比率40.0%）保有しています。

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

販売会社である三井生命保険株式会社は、委託会社株式を882株（持株比率5.0%）保有しています。

### 第3【その他】

1. 目論見書の表紙にロゴ・マーク、図案を使用し、ファンドの基本的性格および税区分を記載するほか、届出書本文第一部「証券情報」、第二部「ファンド情報」の主要内容を要約し、「ファンドの概要」として、目論見書の冒頭に記載することがあります。また、有価証券届出書の表紙記載情報を抜粋して、目論見書に記載することがあります。
2. 目論見書の冒頭または巻末に届出書記載内容に関連する用語集を掲載することがあります。
3. 交付目論見書（金融商品取引法第13条第2項第1号に定める事項に関する内容を記載した目論見書）に約款を添付します。
4. 目論見書は電子媒体として使用されるほか、インターネット等に掲載されることがあります。
5. 評価機関等から当ファンドに対する評価を取得し、使用することがあります。

## （参考情報）

「三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）」、「三井住友・DC年金バランス50（標準型）」、「三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）」は、「国内株式インデックス・マザーファンド（B号）」、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「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、監査の対象外となっております。

「国内株式インデックス・マザーファンド（B号）」の状況

## （1）貸借対照表

対象年月日	（平成21年2月18日現在）	（平成22年2月18日現在）
科目	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	6,187,707,958	4,655,692,047
株式	215,203,057,090	323,683,558,850
派生商品評価勘定	800,600	10,330,900
未収入金	-	103,950
未収配当金	259,098,050	275,665,370
未収利息	3,390	6,377
前払金	82,860,000	49,850,000
差入委託証拠金	-	2,565,000
流動資産合計	221,733,527,088	328,677,772,494
資産合計	221,733,527,088	328,677,772,494
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	84,207,650	60,320,550
未払金	3,016,372,702	-
未払解約金	-	27,988,680
流動負債合計	3,100,580,352	88,309,230
負債合計	3,100,580,352	88,309,230
純資産の部		
元本等		
1 元本		
元本	230,892,995,349	282,243,743,306
元本合計	230,892,995,349	282,243,743,306
2 剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	12,260,048,613	46,345,719,958
剰余金合計	12,260,048,613	46,345,719,958
元本等合計	218,632,946,736	328,589,463,264
純資産合計	218,632,946,736	328,589,463,264
負債・純資産合計	221,733,527,088	328,677,772,494

（注）「国内株式インデックス・マザーファンド（B号）」は、毎年11月30日（ただし、休業日の場合は翌営業日）に決算を行います。上記の貸借対照表は平成21年2月18日ならびに平成22年2月18日現在における同マザーファンドの状況です。

## (2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自平成20年2月19日 至平成21年2月18日	自平成21年2月19日 至平成22年2月18日
1. 有価証券の評価基準及び 評価方法	株式（売買目的有価証券） 移動平均法に基づき、原則として時価で 評価しております。時価評価にあたって は、取引所における最終相場（最終相場 のないものについては、それに準じる価 額）、ジャスダック証券取引所が発表す る基準値段または金融商品取引業者等か ら提示される気配相場に基づいて評価し ております。	株式（売買目的有価証券） 移動平均法に基づき、原則として時価で 評価しております。時価評価にあたって は、取引所における最終相場（最終相場 のないものについては、それに準じる価 額）または金融商品取引業者等から提示 される気配相場に基づいて評価しており ます。
2. デリバティブの評価基準 及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価 しております。時価評価にあたっては、原 則として、計算日に知りうる直近の日の 主たる取引所の発表する清算値段または 最終相場によっております。	先物取引 同左
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日 において、確定配当金額または予想配当 金額を計上しております。	受取配当金の計上基準 同左

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成21年2月18日現在)	(平成22年2月18日現在)								
1. 担保資産	代用として、担保に供している資産は次 の通りであります。 <table style="margin-left: auto; margin-right: auto;"> <tr> <td style="text-align: center;"><u>担保資産</u></td> <td style="text-align: center;"><u>金額</u></td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">株式</td> <td style="text-align: right;">6,120,000,000円</td> </tr> </table>	<u>担保資産</u>	<u>金額</u>	株式	6,120,000,000円	代用として、担保に供している資産は次 の通りであります。 <table style="margin-left: auto; margin-right: auto;"> <tr> <td style="text-align: center;"><u>担保資産</u></td> <td style="text-align: center;"><u>金額</u></td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">株式</td> <td style="text-align: right;">4,032,000,000円</td> </tr> </table>	<u>担保資産</u>	<u>金額</u>	株式	4,032,000,000円
<u>担保資産</u>	<u>金額</u>									
株式	6,120,000,000円									
<u>担保資産</u>	<u>金額</u>									
株式	4,032,000,000円									
2. 受益権総数	平成21年2月18日現在における受益権の 総数 230,892,995,349口	平成22年2月18日現在における受益権の 総数 282,243,743,306口								
3. 元本の欠損	「投資信託財産の計算に関する規則」第 55条の6第10号に規定する額 12,260,048,613円									
4. 1単位当たり純資産額	0.9469円 (1万口=9,469円)	1.1642円 (1万口=11,642円)								

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ．取引の状況に関する事項

項目	自平成20年2月19日 至平成21年2月18日	自平成21年2月19日 至平成22年2月18日
1．取引の内容	当ファンドの行うことのできるデリバティブ取引は、次の通りです。 わが国の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。	同左
2．取引に対する取組方針	デリバティブ取引につきましては信託約款等に従っており、その制限を遵守しております。	同左
3．取引の利用目的	信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、および価格変動リスクを回避するため。	同左
4．取引に係るリスクの内容	デリバティブ取引に伴いファンドに影響を与える主なリスクとして価格変動リスクがあります。	同左
5．取引に係るリスクの管理体制	リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理ならびにコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。	同左
6．取引の時価等に関する事項についての補足説明	該当事項はありません。	同左

## . 取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

## 株式関連

(平成21年2月18日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 (TOPIX先物) 買建	4,005,990,000	-	3,923,130,000	82,860,000
		(4,006,537,050)	(-)		(83,407,050)
	買建 合計	4,005,990,000	-	3,923,130,000	82,860,000
		(4,006,537,050)	(-)		(83,407,050)

(平成22年2月18日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 (TOPIX先物) 買建	4,945,900,000	-	4,896,050,000	49,850,000
		(4,946,039,650)	(-)		(49,989,650)
	買建 合計	4,945,900,000	-	4,896,050,000	49,850,000
		(4,946,039,650)	(-)		(49,989,650)

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については以下のように評価しております。

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

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

2. 株価指数先物取引の残高は契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

なお、( )内は手数料相当額を含んだ場合の金額を表わしています。

4. 株価指数先物取引の取引市場は、東京証券取引所です。

(関連当事者との取引に関する注記)

(自平成20年2月19日 至 平成21年2月18日)

該当事項はありません。

(自平成21年2月19日 至 平成22年2月18日)

該当事項はありません。

(その他の注記)

(平成21年2月18日現在)	
本有価証券報告書における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	157,542,858,839円
同期中における追加設定元本額	82,907,962,615円
同期中における一部解約元本額	9,557,826,105円
平成21年2月18日現在における元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	5,564,721,890円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	188,330,856円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,037,601,223円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	601,071,336円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	2,609,607円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	179,012円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	210,954円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	226,552円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	233,808円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	233,520円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	267,148円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	76,954,449,164円
バランスファンドVA(安定運用型)〈適格機関投資家限定〉	1,478,864,350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〉	55,536,595,657円
SMAM・バランスファンドVA25〈適格機関投資家専用〉	18,890,693,086円
SMAM・バランスファンドVA37.5〈適格機関投資家専用〉	8,488,551,888円
SMAM・バランスファンドVA50〈適格機関投資家専用〉	28,632,830,498円
SMAM・バランスファンドVL30〈適格機関投資家限定〉	190,414,114円
SMAM・バランスファンドVL50〈適格機関投資家限定〉	617,462,664円
世界6資産バランスファンドVA〈適格機関投資家限定〉	116,894,704円
SMAM・バランスファンドVA75〈適格機関投資家専用〉	2,179,498,653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〉	122,124,767円
SMAM・インデックス・バランスVA25〈適格機関投資家専用〉	862,827,429円
SMAM・インデックス・バランスVA50〈適格機関投資家専用〉	2,902,865,711円
SMAM・バランスファンドVA40〈適格機関投資家専用〉	5,220,646,724円
SMAM・バランスファンドVA35〈適格機関投資家専用〉	10,633,892,262円
SMAM・バランスVA株40T〈適格機関投資家限定〉	1,398,382,841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)	3,685,005,809円
SMAM・グローバルバランス40VA〈適格機関投資家限定〉	194,619,923円
SMAM・バランスファンドVA20〈適格機関投資家専用〉	1,197,619,055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)	4,193,070,144円
合計	230,892,995,349円

(平成22年2月18日現在)

本有価証券報告書における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	230,892,995,349円
同期中における追加設定元本額	88,825,634,235円
同期中における一部解約元本額	37,474,886,278円
平成22年2月18日現在における元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	6,545,731,880円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	245,170,796円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,380,599,004円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	883,900,097円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	10,277,571円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	2,460,970円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	332,014円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	2,871,606円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	414,770円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	241,579円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	777,885円
国内株式指数ファンド(TOPIX)	94,276,541円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	74,778,732,193円
バランスファンドVA(安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	1,175,265,719円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型 < 適格機関投資家限定 >	50,610,519,734円
SMAM・バランスファンドVA25 < 適格機関投資家専用 >	17,794,214,423円
SMAM・バランスファンドVA37.5 < 適格機関投資家専用 >	8,489,730,556円
SMAM・バランスファンドVA50 < 適格機関投資家専用 >	28,939,946,810円
SMAM・バランスファンドVL30 < 適格機関投資家限定 >	177,535,624円
SMAM・バランスファンドVL50 < 適格機関投資家限定 >	569,810,955円
世界6資産バランスファンドVA < 適格機関投資家限定 >	107,441,912円
SMAM・バランスファンドVA75 < 適格機関投資家専用 >	2,687,743,628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 >	124,104,806円
SMAM・インデックス・バランスVA25 < 適格機関投資家専用 >	847,260,762円
SMAM・インデックス・バランスVA50 < 適格機関投資家専用 >	3,148,556,794円
SMAM・バランスファンドVA40 < 適格機関投資家専用 >	4,951,902,326円
SMAM・バランスファンドVA35 < 適格機関投資家専用 >	12,860,980,706円
SMAM・バランスVA株40T < 適格機関投資家限定 >	1,366,607,879円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	10,793,382,997円
SMAM・グローバルバランス40VA < 適格機関投資家限定 >	234,823,808円
SMAM・バランスファンドVA20 < 適格機関投資家専用 >	3,060,110,309円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	45,977,950,722円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A < 適格機関投資家専用 >	312,310,069円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A < 適格機関投資家専用 >	157,658,314円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A < 適格機関投資家専用 >	61,437,106円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L < 適格機関投資家専用 >	933,511,181円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L < 適格機関投資家専用 >	1,601,110,031円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T < 適格機関投資家専用 >	564,041,884円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2 < 適格機関投資家専用 >	54,423,129円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2 < 適格機関投資家専用 >	26,504,260円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2 < 適格機関投資家専用 >	8,799,158円

S M A M ・ アセットバランスファンドVA30L2 <適格機関投資家専用>	11,139,186円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA25L2 <適格機関投資家専用>	649,131,612円
合 計	282,243,743,306円

## (3) 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

(単位：円)

銘柄	株数	評価額 単価	評価額 金額	備考
極洋	123,000	195	23,985,000	
日本水産	329,600	259	85,366,400	
マルハニチロホールディングス	643,000	124	79,732,000	
サカタのタネ	43,700	1,188	51,915,600	
ホクト	32,800	1,918	62,910,400	
住石ホールディングス	106,600	88	9,380,800	
日鉄鉱業	85,000	394	33,490,000	
三井松島産業	180,000	159	28,620,000	
国際石油開発帝石	1,472	688,000	1,012,736,000	
日本海洋掘削	5,100	5,240	26,724,000	
関東天然瓦斯開発	29,000	471	13,659,000	
石油資源開発	50,600	4,390	222,134,000	
ショーボンドホールディングス	28,300	1,649	46,666,700	
ダイセキ環境ソリューション	43	117,100	5,035,300	
間組	146,600	79	11,581,400	
東急建設	112,700	235	26,484,500	
コムシスホールディングス	131,200	867	113,750,400	
ミサワホーム	43,900	306	13,433,400	
高松コンストラクショングループ	24,600	1,109	27,281,400	
東建コーポレーション	11,690	2,028	23,707,320	
ヤマウラ	17,000	197	3,349,000	
大成建設	1,360,000	188	255,680,000	
大林組	845,000	344	290,680,000	
清水建設	850,000	350	297,500,000	
長谷工コーポレーション	1,772,000	80	141,760,000	
松井建設	36,000	343	12,348,000	
鹿島建設	1,335,000	216	288,360,000	
鉄建建設	209,000	74	15,466,000	
安藤建設	114,000	109	12,426,000	
太平工業	46,000	424	19,504,000	
西松建設	403,000	116	46,748,000	
三井住友建設	207,300	74	15,340,200	
大豊建設	98,000	70	6,860,000	
前田建設工業	221,000	269	59,449,000	
佐田建設	58,000	33	1,914,000	

ナカノフドー建設	28,500	173	4,930,500
奥村組	290,000	324	93,960,000
大和小田急建設	20,000	275	5,500,000
東鉄工業	37,000	504	18,648,000
イチケン	49,000	111	5,439,000
浅沼組	122,000	62	7,564,000
戸田建設	349,000	322	112,378,000
熊谷組	279,000	57	15,903,000
青木あすなる建設	24,000	469	11,256,000
北野建設	72,000	211	15,192,000
植木組	52,000	117	6,084,000
三井ホーム	34,000	472	16,048,000
矢作建設工業	41,000	524	21,484,000
ピーエス三菱	27,600	320	8,832,000
大東建託	129,500	4,450	576,275,000
新日本建設	50,500	148	7,474,000
N I P P O	63,000	703	44,289,000
東亜道路工業	71,000	167	11,857,000
前田道路	85,000	714	60,690,000
日本道路	92,000	186	17,112,000
東亜建設工業	276,000	97	26,772,000
東洋建設	448,000	44	19,712,000
五洋建設	351,000	101	35,451,000
大林道路	39,000	198	7,722,000
世紀東急工業	131,000	55	7,205,000
福田組	59,000	167	9,853,000
東北ミサワホーム	8,100	189	1,530,900
住友林業	223,900	705	157,849,500
日本基礎技術	39,600	184	7,286,400
日成ビルド工業	140,000	56	7,840,000
エス・バイ・エル	205,000	45	9,225,000
巴コーポレーション	51,200	218	11,161,600
パナホーム	104,000	616	64,064,000
大和ハウス工業	751,000	981	736,731,000
ライト工業	79,000	207	16,353,000
積水ハウス	909,000	870	790,830,000
日特建設	114,000	44	5,016,000
北陸電気工事	15,000	253	3,795,000
コミュニチュア	24,000	502	12,048,000
ユアテック	47,000	432	20,304,000
西部電気工業	23,000	351	8,073,000
四電工	25,000	451	11,275,000
中電工	37,500	1,142	42,825,000
関電工	128,000	572	73,216,000
大明	36,300	669	24,284,700
きんでん	189,000	794	150,066,000

東京エネシス	35,000	583	20,405,000
トーエネック	39,000	482	18,798,000
住友電設	21,000	457	9,597,000
日本電設工業	57,000	720	41,040,000
協和エクシオ	104,800	751	78,704,800
新日本空調	21,800	595	12,971,000
東電通	46,000	153	7,038,000
日本電話施設	46,000	280	12,880,000
九電工	54,000	528	28,512,000
三機工業	67,000	587	39,329,000
日揮	301,000	1,702	512,302,000
中外炉工業	102,000	240	24,480,000
ヤマト	30,000	313	9,390,000
太平電業	38,000	802	30,476,000
高砂熱学工業	83,600	696	58,185,600
日立プラントテクノロジー	12,000	604	7,248,000
三晃金属工業	45,000	219	9,855,000
NEC ネットエスアイ	22,300	1,039	23,169,700
朝日工業社	34,000	360	12,240,000
大気社	44,100	1,487	65,576,700
ダイダン	40,000	462	18,480,000
日比谷総合設備	42,200	780	32,916,000
東芝プラントシステム	43,000	1,080	46,440,000
東洋エンジニアリング	193,000	298	57,514,000
千代田化工建設	235,000	844	198,340,000
新興プランテック	54,300	921	50,010,300
日本製粉	183,000	458	83,814,000
日清製粉グループ本社	290,500	1,195	347,147,500
日東富士製粉	20,000	342	6,840,000
昭和産業	119,000	285	33,915,000
鳥越製粉	24,300	758	18,419,400
協同飼料	134,000	112	15,008,000
中部飼料	31,000	825	25,575,000
日本配合飼料	117,000	103	12,051,000
ユニ・チャーム ペットケア	18,900	2,897	54,753,300
東洋精糖	75,000	118	8,850,000
日本甜菜製糖	162,000	233	37,746,000
三井製糖	116,000	294	34,104,000
森永製菓	311,000	205	63,755,000
中村屋	74,000	457	33,818,000
江崎グリコ	114,000	1,006	114,684,000
名糖産業	14,600	1,250	18,250,000
不二家	210,000	202	42,420,000
山崎製パン	237,000	1,167	276,579,000
第一屋製パン	49,000	115	5,635,000
モロゾフ	42,000	294	12,348,000

森永乳業	279,000	372	103,788,000
ヤクルト本社	173,900	2,741	476,659,900
明治ホールディングス	95,600	3,530	337,468,000
雪印メグミルク	65,300	1,276	83,322,800
プリマハム	183,000	95	17,385,000
日本ハム	227,000	1,089	247,203,000
伊藤ハム	208,000	320	66,560,000
林兼産業	119,000	113	13,447,000
丸大食品	132,000	268	35,376,000
米久	27,000	789	21,303,000
S Foods	11,500	802	9,223,000
サッポロホールディングス	464,000	462	214,368,000
アサヒビール	561,700	1,736	975,111,200
キリンホールディングス	1,320,000	1,284	1,694,880,000
宝ホールディングス	257,000	492	126,444,000
オエノンホールディングス	99,000	171	16,929,000
メルシャン	104,000	177	18,408,000
養命酒製造	20,000	840	16,800,000
三国コカ・コーラボトリング	27,900	705	19,669,500
コカ・コーラウエスト	79,700	1,477	117,716,900
コカ・コーラ セントラル ジャパン	34,100	1,105	37,680,500
ダイトードリンコ	13,700	2,946	40,360,200
伊藤園	83,400	1,344	112,089,600
キーコーヒー	22,400	1,578	35,347,200
ジャパンフーズ	4,800	817	3,921,600
日清オイリオグループ	127,000	453	57,531,000
不二製油	79,800	1,378	109,964,400
J - オイルミルズ	126,000	279	35,154,000
キッコーマン	246,000	1,077	264,942,000
味の素	816,000	916	747,456,000
キューピー	164,100	994	163,115,400
ハウス食品	116,100	1,301	151,046,100
カゴメ	114,700	1,587	182,028,900
焼津水産化学工業	15,100	1,073	16,202,300
アリアケジャパン	26,600	1,365	36,309,000
ニチレイ	338,000	336	113,568,000
東洋水産	139,000	2,448	340,272,000
日清食品ホールディングス	114,400	3,120	356,928,000
永谷園	25,000	864	21,600,000
フジッコ	28,000	1,052	29,456,000
ロック・フィールド	13,500	1,209	16,321,500
日本たばこ産業	6,706	328,500	2,202,921,000
わらべや日洋	16,900	1,103	18,640,700
なとり	6,700	833	5,581,100
ミヨシ油脂	126,000	142	17,892,000
片倉工業	37,100	808	29,976,800

ゲンゼ	206,000	323	66,538,000
川島織物セルコン	139,000	67	9,313,000
東洋紡績	1,004,000	133	133,532,000
ユニチカ	668,000	67	44,756,000
富士紡ホールディングス	130,000	144	18,720,000
日清紡ホールディングス	198,000	932	184,536,000
倉敷紡績	295,000	141	41,595,000
シキボウ	198,000	128	25,344,000
日本毛織	100,000	612	61,200,000
トーア紡コーポレーション	151,000	62	9,362,000
ダイドーリミテッド	38,100	666	25,374,600
帝国繊維	31,000	446	13,826,000
帝人	1,062,000	267	283,554,000
東レ	1,878,000	494	927,732,000
三菱レイヨン	705,000	377	265,785,000
サカイオーベックス	107,000	79	8,453,000
住江織物	85,000	171	14,535,000
日本フェルト	12,200	392	4,782,400
イチカワ	28,000	153	4,284,000
日本バイリーン	39,000	400	15,600,000
日東製網	57,000	106	6,042,000
芦森工業	77,000	112	8,624,000
アツギ	271,000	111	30,081,000
ダイニック	66,000	150	9,900,000
セーレン	71,500	556	39,754,000
小松精練	41,000	340	13,940,000
ワコールホールディングス	162,000	1,045	169,290,000
ホギメディカル	13,100	4,355	57,050,500
サンエー・インターナショナル	16,100	1,130	18,193,000
レナウン	17,900	158	2,828,200
クラウディア	3,700	1,120	4,144,000
三陽商会	138,000	341	47,058,000
オンワードホールディングス	187,000	588	109,956,000
ルック	64,000	79	5,056,000
ゴールドウイン	76,000	179	13,604,000
東京スタイル	97,000	654	63,438,000
デサント	76,000	486	36,936,000
ヤマトインターナショナル	13,800	320	4,416,000
特種東海ホールディングス	194,000	219	42,486,000
王子製紙	1,239,000	382	473,298,000
三菱製紙	415,000	105	43,575,000
北越紀州製紙	189,000	447	84,483,000
中越パルプ工業	118,000	153	18,054,000
大王製紙	128,000	721	92,288,000
日本製紙グループ本社	125,200	2,322	290,714,400
レンゴー	226,000	569	128,594,000

トーモク	92,000	196	18,032,000	
ザ・バック	19,800	1,223	24,215,400	
クラレ	410,000	1,147	470,270,000	
旭化成	1,625,000	472	767,000,000	
共和レザー	12,800	310	3,968,000	
コープケミカル	57,000	133	7,581,000	
昭和電工	1,878,000	178	334,284,000	
住友化学	1,925,000	411	791,175,000	
日本化成	72,000	170	12,240,000	
住友精化	53,000	353	18,709,000	
日産化学工業	186,000	1,278	237,708,000	
ラサ工業	144,000	87	12,528,000	
クレハ	179,000	452	80,908,000	
テイカ	42,000	235	9,870,000	
石原産業	541,000	68	36,788,000	
片倉チッカリン	15,000	269	4,035,000	
日本曹達	181,000	359	64,979,000	
東ソー	706,000	219	154,614,000	
トクヤマ	472,000	472	222,784,000	
セントラル硝子	293,000	404	118,372,000	
東亜合成	329,000	337	110,873,000	
ダイソー	125,000	218	27,250,000	
関東電化工業	70,000	651	45,570,000	
電気化学工業	594,000	379	225,126,000	
信越化学工業	463,000	4,910	2,273,330,000	
日本カーバイド工業	89,000	153	13,617,000	
堺化学工業	106,000	406	43,036,000	
エア・ウォーター	225,000	1,088	244,800,000	
大陽日酸	397,000	864	343,008,000	
日本化学工業	120,000	203	24,360,000	
日本パーカライジング	65,000	1,194	77,610,000	
高圧ガス工業	35,000	527	18,445,000	
チタン工業	49,000	190	9,310,000	
四国化成工業	40,000	476	19,040,000	
戸田工業	50,000	637	31,850,000	
ステラ ケミファ	14,600	4,150	60,590,000	
保土谷化学工業	74,000	312	23,088,000	
日本触媒	166,000	796	132,136,000	
大日精化工業	109,000	326	35,534,000	
カネカ	375,000	527	197,625,000	
三菱瓦斯化学	476,000	475	226,100,000	
三井化学	1,099,000	244	268,156,000	
J S R	274,700	1,789	491,438,300	
東京応化工業	50,600	1,640	82,984,000	
三菱ケミカルホールディングス	1,610,000	389	626,290,000	
日本合成化学工業	71,000	605	42,955,000	

ダイセル化学工業	359,000	598	214,682,000
住友ベークライト	261,000	472	123,192,000
積水化学工業	578,000	603	348,534,000
日本ゼオン	265,000	472	125,080,000
アイカ工業	73,000	930	67,890,000
宇部興産	1,266,000	226	286,116,000
積水樹脂	36,000	750	27,000,000
タキロン	66,000	229	15,114,000
旭有機材工業	87,000	203	17,661,000
日立化成工業	130,100	1,914	249,011,400
ニチバン	27,000	288	7,776,000
リケンテクノス	52,000	253	13,156,000
大倉工業	77,000	263	20,251,000
積水化成品工業	79,000	438	34,602,000
群栄化学工業	79,000	197	15,563,000
タイガースポリマー	16,700	311	5,193,700
日本カーリット	23,800	390	9,282,000
日本化薬	209,000	761	159,049,000
日本精化	25,600	691	17,689,600
A D E K A	119,700	845	101,146,500
日油	249,000	362	90,138,000
ハリマ化成	26,000	462	12,012,000
花王	772,500	2,275	1,757,437,500
第一工業製薬	56,000	243	13,608,000
三洋化成工業	79,000	523	41,317,000
大日本塗料	197,000	88	17,336,000
日本ペイント	261,000	580	151,380,000
関西ペイント	339,000	756	256,284,000
中国塗料	81,000	571	46,251,000
日本特殊塗料	25,200	329	8,290,800
藤倉化成	35,100	438	15,373,800
太陽インキ製造	21,800	2,271	49,507,800
D I C	934,000	181	169,054,000
サカタインクス	58,000	430	24,940,000
東洋インキ製造	272,000	410	111,520,000
富士フイルムホールディングス	597,500	2,932	1,751,870,000
資生堂	512,800	1,925	987,140,000
ライオン	343,000	441	151,263,000
高砂香料工業	87,000	455	39,585,000
マンダム	28,100	2,536	71,261,600
ミルボン	13,600	2,063	28,056,800
ファンケル	57,400	1,772	101,712,800
コーセー	43,500	1,909	83,041,500
ドクターシーラボ	189	188,200	35,569,800
エステー	17,100	999	17,082,900
コニシ	22,100	926	20,464,600

長谷川香料	36,600	1,311	47,982,600
小林製薬	41,500	3,660	151,890,000
荒川化学工業	22,400	1,013	22,691,200
メック	24,000	504	12,096,000
日本高純度化学	81	300,500	24,340,500
荏原ユーザライト	5,100	1,567	7,991,700
アース製薬	20,900	2,659	55,573,100
イハラケミカル工業	54,000	247	13,338,000
北興化学工業	29,000	265	7,685,000
大成ラミック	5,200	2,142	11,138,400
クミアイ化学工業	67,000	279	18,693,000
日本農薬	64,000	498	31,872,000
アキレス	226,000	132	29,832,000
有沢製作所	44,900	664	29,813,600
日東電工	233,400	3,480	812,232,000
レック	9,100	1,630	14,833,000
アロン化成	15,000	373	5,595,000
きもと	26,600	745	19,817,000
藤森工業	21,100	1,349	28,463,900
前澤化成工業	19,200	813	15,609,600
J S P	20,800	1,136	23,628,800
エフピコ	13,300	4,290	57,057,000
天馬	21,400	1,014	21,699,600
信越ポリマー	53,100	624	33,134,400
東リ	65,000	165	10,725,000
ニフコ	62,900	1,988	125,045,200
日本バルカー工業	120,000	173	20,760,000
ユニ・チャーム	55,300	8,600	475,580,000
協和発酵キリン	360,000	938	337,680,000
武田薬品工業	1,058,600	3,960	4,192,056,000
アステラス製薬	595,400	3,340	1,988,636,000
大日本住友製薬	212,900	902	192,035,800
塩野義製薬	409,000	1,804	737,836,000
田辺三菱製薬	250,000	1,278	319,500,000
わかもと製薬	33,000	297	9,801,000
あすか製薬	33,000	642	21,186,000
日本新薬	70,000	1,024	71,680,000
中外製薬	300,600	1,764	530,258,400
科研製薬	126,000	785	98,910,000
エーザイ	344,800	3,465	1,194,732,000
ロート製薬	127,000	1,064	135,128,000
小野薬品工業	139,700	4,060	567,182,000
久光製薬	84,500	3,200	270,400,000
有機合成薬品工業	32,000	230	7,360,000
持田製薬	107,000	867	92,769,000
大正製薬	241,000	1,551	373,791,000

参天製薬	85,500	2,888	246,924,000
エスエス製薬	63,000	704	44,352,000
扶桑薬品工業	110,000	293	32,230,000
日本ケミファ	51,000	251	12,801,000
ツムラ	82,600	2,719	224,589,400
キッセイ薬品工業	57,000	1,865	106,305,000
生化学工業	50,500	969	48,934,500
栄研化学	20,900	810	16,929,000
日水製薬	5,700	666	3,796,200
鳥居薬品	16,700	1,724	28,790,800
東和薬品	13,900	4,635	64,426,500
沢井製薬	18,500	6,290	116,365,000
ゼリア新薬工業	44,000	933	41,052,000
第一三共	888,200	1,814	1,611,194,800
キョーリン	75,000	1,349	101,175,000
新日本石油	1,701,000	469	797,769,000
昭和シェル石油	270,300	693	187,317,900
コスモ石油	758,000	218	165,244,000
ニチレキ	35,000	346	12,110,000
東燃ゼネラル石油	397,000	752	298,544,000
ユシロ化学工業	16,800	1,139	19,135,200
ビーピー・カストロール	17,500	316	5,530,000
新日鉱ホールディングス	1,077,500	435	468,712,500
AOCホールディングス	71,600	523	37,446,800
出光興産	32,300	6,730	217,379,000
横浜ゴム	307,000	385	118,195,000
東洋ゴム工業	286,000	200	57,200,000
ブリヂストン	872,500	1,473	1,285,192,500
住友ゴム工業	213,100	722	153,858,200
藤倉ゴム工業	16,500	314	5,181,000
オカモト	107,000	358	38,306,000
フコク	12,900	649	8,372,100
ニッタ	27,500	1,269	34,897,500
東海ゴム工業	47,300	1,141	53,969,300
三ツ星ベルト	73,000	370	27,010,000
バンドー化学	107,000	266	28,462,000
日東紡績	247,000	179	44,213,000
旭硝子	1,379,000	955	1,316,945,000
日本板硝子	848,000	239	202,672,000
石塚硝子	38,000	184	6,992,000
日本山村硝子	115,000	290	33,350,000
日本電気硝子	490,000	1,201	588,490,000
オハラ	11,600	1,414	16,402,400
住友大阪セメント	504,000	140	70,560,000
太平洋セメント	1,123,000	111	124,653,000
デイ・シイ	28,800	194	5,587,200

日本コンクリート工業	49,000	123	6,027,000
東海カーボン	281,000	490	137,690,000
日本カーボン	152,000	275	41,800,000
東洋炭素	14,700	4,590	67,473,000
ノリタケカンパニーリミテド	152,000	241	36,632,000
TOTO	432,000	605	261,360,000
日本碍子	331,000	2,040	675,240,000
日本特殊陶業	247,000	1,089	268,983,000
MARUWA	8,300	2,022	16,782,600
品川リフラクトリーズ	78,000	211	16,458,000
黒崎播磨	70,000	217	15,190,000
東京窯業	27,000	192	5,184,000
ニッカトー	12,300	376	4,624,800
フジミインコーポレーテッド	27,100	1,521	41,219,100
エーアンドエーマテリアル	83,000	65	5,395,000
ニチアス	148,000	386	57,128,000
ニチハ	35,300	619	21,850,700
新日本製鐵	7,910,000	330	2,610,300,000
住友金属工業	5,145,000	251	1,291,395,000
神戸製鋼所	3,895,000	161	627,095,000
日新製鋼	1,084,000	154	166,936,000
中山製鋼所	162,000	129	20,898,000
合同製鐵	163,000	189	30,807,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	604,000	3,230	1,950,920,000
東京製鐵	139,700	942	131,597,400
共英製鋼	28,600	1,703	48,705,800
大和工業	70,000	2,777	194,390,000
東京製鋼	62,000	270	16,740,000
大阪製鐵	17,600	1,410	24,816,000
淀川製鋼所	211,000	378	79,758,000
東洋鋼鋳	64,000	472	30,208,000
住友鋼管	13,100	475	6,222,500
丸一鋼管	83,200	1,753	145,849,600
モリ工業	55,000	283	15,565,000
大同特殊鋼	468,000	353	165,204,000
日本高周波鋼業	146,000	84	12,264,000
日本金属工業	95,000	140	13,300,000
日本冶金工業	174,500	290	50,605,000
山陽特殊製鋼	150,000	379	56,850,000
愛知製鋼	161,000	359	57,799,000
日立金属	166,000	887	147,242,000
日本金属	89,000	150	13,350,000
大平洋金属	210,000	674	141,540,000
日本電工	132,000	552	72,864,000
栗本鐵工所	180,000	86	15,480,000
日本鑄鉄管	41,000	132	5,412,000

三菱製鋼	179,000	157	28,103,000	
日亜鋼業	41,000	214	8,774,000	
日本精線	29,000	245	7,105,000	
シンニッタン	29,400	223	6,556,200	
新家工業	76,000	119	9,044,000	
日本軽金属	710,000	90	63,900,000	
大紀アルミニウム工業所	58,000	187	10,846,000	
三井金属鉱業	831,000	245	203,595,000	
東邦亜鉛	152,000	414	62,928,000	
三菱マテリアル	1,619,000	229	370,751,000	
住友金属鉱山	729,000	1,298	946,242,000	
DOWAホールディングス	337,000	519	174,903,000	
古河機械金属	525,000	98	51,450,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	30,500	2,880	87,840,000	
東邦チタニウム	50,100	1,611	80,711,100	
古河スカイ	139,000	188	26,132,000	
古河電気工業	892,000	441	393,372,000	
住友電気工業	922,900	1,126	1,039,185,400	
フジクラ	423,000	482	203,886,000	
昭和電線ホールディングス	389,000	84	32,676,000	
東京特殊電線	14,000	87	1,218,000	
タツタ電線	61,000	215	13,115,000	
日立電線	243,000	235	57,105,000	
沖電線	60,000	110	6,600,000	
カナレ電気	4,400	1,089	4,791,600	
平河ヒューテック	8,700	647	5,628,900	
リョービ	178,000	269	47,882,000	
アサヒホールディングス	43,800	1,390	60,882,000	
稲葉製作所	15,000	871	13,065,000	
三協・立山ホールディングス	362,000	115	41,630,000	
トーカロ	17,100	1,733	29,634,300	
アルファC o	12,800	814	10,419,200	
SUMCO	162,900	1,632	265,852,800	
川田テクノロジーズ	7,600	1,585	12,046,000	
東洋製罐	212,300	1,448	307,410,400	
ホッカンホールディングス	62,000	222	13,764,000	
コロナ	14,300	1,159	16,573,700	
横河ブリッジホールディングス	59,000	726	42,834,000	
駒井鉄工	50,000	191	9,550,000	
三和ホールディングス	283,000	264	74,712,000	
文化シャッター	86,000	265	22,790,000	
東洋シャッター	9,000	504	4,536,000	
住生活グループ	364,600	1,752	638,779,200	
日本ファイルコン	25,500	426	10,863,000	
ノーリツ	47,200	1,294	61,076,800	
長府製作所	30,700	2,086	64,040,200	

リンナイ	48,100	4,660	224,146,000
ダイニチ工業	13,700	624	8,548,800
日東精工	40,000	255	10,200,000
三洋工業	55,000	119	6,545,000
岡部	53,700	303	16,271,100
中国工業	61,000	81	4,941,000
東プレ	58,700	712	41,794,400
高周波熱錬	43,900	538	23,618,200
東京製綱	195,000	220	42,900,000
パイオラックス	13,300	1,788	23,780,400
日本発條	199,000	776	154,424,000
中央発條	43,000	281	12,083,000
三益半導体工業	24,100	1,092	26,317,200
アタカ大機	15,000	206	3,090,000
日本製鋼所	431,000	1,057	455,567,000
日立ツール	15,700	857	13,454,900
三浦工業	40,300	2,401	96,760,300
タクマ	120,000	210	25,200,000
ツガミ	91,000	431	39,221,000
オークマ	198,000	571	113,058,000
東芝機械	153,000	382	58,446,000
アマダ	460,000	694	319,240,000
アイダエンジニアリング	70,000	298	20,860,000
牧野フライス製作所	145,000	451	65,395,000
オーエスジー	125,900	929	116,961,100
ダイジェット工業	53,000	115	6,095,000
旭ダイヤモンド工業	74,000	671	49,654,000
森精機製作所	139,600	985	137,506,000
ディスコ	27,900	5,170	144,243,000
日東工器	16,100	1,901	30,606,100
豊和工業	180,000	48	8,640,000
大阪機工	121,000	74	8,954,000
東洋機械金属	11,300	158	1,785,400
オーエム製作所	23,000	313	7,199,000
津田駒工業	82,000	126	10,332,000
島精機製作所	36,700	1,798	65,986,600
日本スピンドル製造	46,000	126	5,796,000
日阪製作所	33,000	824	27,192,000
やまびこ	12,700	824	10,464,800
ペガサスミシン製造	42,500	161	6,842,500
ナブテスコ	114,000	1,107	126,198,000
三井海洋開発	21,500	1,735	37,302,500
レオン自動機	32,000	221	7,072,000
S M C	89,800	11,160	1,002,168,000
新川	24,300	1,249	30,350,700
ホソカワミクロン	51,000	328	16,728,000

ユニオンツール	18,900	2,553	48,251,700
オイレス工業	33,100	1,379	45,644,900
サトー	34,000	1,098	37,332,000
日本エアーテック	14,600	426	6,219,600
日精樹脂工業	30,700	246	7,552,200
ワイエイシイ	16,100	611	9,837,100
小松製作所	1,249,200	1,840	2,298,528,000
住友重機械工業	596,000	484	288,464,000
日立建機	122,800	1,947	239,091,600
日工	41,000	219	8,979,000
巴工業	10,700	1,080	11,556,000
井関農機	294,000	274	80,556,000
丸山製作所	81,000	159	12,879,000
北川鉄工所	153,000	87	13,311,000
クボタ	1,149,000	811	931,839,000
荏原実業	7,800	1,164	9,079,200
三菱化工機	82,000	240	19,680,000
月島機械	47,000	542	25,474,000
帝国電機製作所	10,100	1,681	16,978,100
東京機械製作所	105,000	92	9,660,000
新東工業	56,100	668	37,474,800
澁谷工業	17,500	734	12,845,000
アイチ コーポレーション	48,300	342	16,518,600
小森コーポレーション	78,800	1,009	79,509,200
鶴見製作所	22,000	593	13,046,000
住友精密工業	49,000	249	12,201,000
酒井重工業	69,000	124	8,556,000
荏原製作所	575,000	434	249,550,000
石井鐵工所	52,000	159	8,268,000
西島製作所	26,800	2,020	54,136,000
ダイキン工業	314,700	3,620	1,139,214,000
オルガノ	53,000	558	29,574,000
トーヨーカネツ	153,000	183	27,999,000
栗田工業	153,700	2,574	395,623,800
椿本チエイン	156,000	399	62,244,000
大同工業	68,000	136	9,248,000
日本コンベヤ	120,000	75	9,000,000
木村化工機	27,800	859	23,880,200
アネスト岩田	49,000	310	15,190,000
ダイフク	112,500	603	67,837,500
加藤製作所	70,000	157	10,990,000
油研工業	64,000	121	7,744,000
タダノ	127,000	423	53,721,000
フジテック	77,000	493	37,961,000
シーケーディ	77,800	707	55,004,600
キトー	96	78,300	7,516,800

平和	52,900	928	49,091,200
理想科学工業	26,200	837	21,929,400
SANKYO	78,400	4,370	342,608,000
日本金銭機械	24,400	748	18,251,200
マースエンジニアリング	12,900	1,745	22,510,500
福島工業	8,000	763	6,104,000
キヤノンファインテック	20,900	1,404	29,343,600
オーイズミ	13,200	204	2,692,800
ダイコク電機	10,200	1,535	15,657,000
アマノ	78,200	777	60,761,400
サンデン	172,000	297	51,084,000
マックス	47,000	889	41,783,000
グローリー	80,800	2,064	166,771,200
大和冷機工業	31,000	418	12,958,000
セガサミーホールディングス	304,500	1,071	326,119,500
日本ピストンリング	133,000	87	11,571,000
リケン	117,000	297	34,749,000
帝国ピストンリング	40,500	370	14,985,000
ホシザキ電機	58,100	1,195	69,429,500
大豊工業	20,300	595	12,078,500
日本精工	544,000	650	353,600,000
NTN	623,000	380	236,740,000
ジェイテクト	260,100	1,029	267,642,900
不二越	296,000	266	78,736,000
日本トムソン	95,000	488	46,360,000
THK	180,100	1,799	323,999,900
ユーシン精機	13,000	1,543	20,059,000
前澤給装工業	8,700	1,289	11,214,300
イーグル工業	34,000	546	18,564,000
日本ピラー工業	36,000	477	17,172,000
キッツ	134,000	475	63,650,000
日立工機	75,600	962	72,727,200
マキタ	174,700	3,085	538,949,500
日立造船	1,224,500	128	156,736,000
三菱重工業	4,520,000	331	1,496,120,000
IHI	1,976,000	149	294,424,000
イビデン	188,900	3,110	587,479,000
コニカミノルタホールディングス	620,000	951	589,620,000
ブラザー工業	372,200	1,064	396,020,800
ミネベア	396,000	495	196,020,000
日立製作所	6,064,000	305	1,849,520,000
東芝	6,065,000	454	2,753,510,000
三菱電機	2,495,000	769	1,918,655,000
富士電機ホールディングス	749,000	217	162,533,000
東洋電機製造	48,000	624	29,952,000
安川電機	317,000	751	238,067,000

シンフォニアテクノロジー	172,000	191	32,852,000
明電舎	270,000	402	108,540,000
オリジン電気	44,000	320	14,080,000
デンヨー	25,000	726	18,150,000
東芝テック	178,000	358	63,724,000
芝浦メカトロニクス	49,000	315	15,435,000
マブチモーター	38,700	5,040	195,048,000
日本電産	129,800	8,820	1,144,836,000
高岳製作所	121,000	287	34,727,000
ダイヘン	148,000	391	57,868,000
JVC・ケンウッド・ホールディングス	1,129,700	39	44,058,300
日新電機	49,000	440	21,560,000
大崎電気工業	42,000	773	32,466,000
オムロン	321,800	1,891	608,523,800
日東工業	42,300	908	38,408,400
I D E C	39,300	642	25,230,600
エルピーダメモリ	271,500	1,664	451,776,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	521,000	584	304,264,000
サクサホールディングス	83,000	121	10,043,000
メルコホールディングス	14,000	2,326	32,564,000
テクノメディカ	19	271,100	5,150,900
日本電気	3,500,000	244	854,000,000
富士通	2,775,000	592	1,642,800,000
沖電気工業	951,000	72	68,472,000
岩崎通信機	156,000	70	10,920,000
電気興業	75,000	442	33,150,000
サンケン電気	154,000	267	41,118,000
ナカヨ通信機	31,000	154	4,774,000
アイホン	17,200	1,545	26,574,000
NECエレクトロニクス	66,800	845	56,446,000
セイコーエプソン	215,800	1,550	334,490,000
ワコム	542	143,200	77,614,400
アルバック	53,800	2,280	122,664,000
ナナオ	22,000	2,194	48,268,000
日本信号	67,300	808	54,378,400
京三製作所	61,000	411	25,071,000
能美防災	30,000	562	16,860,000
ホーチキ	22,000	500	11,000,000
マスプロ電工	16,600	807	13,396,200
日本無線	109,000	161	17,549,000
パナソニック	2,629,700	1,306	3,434,388,200
シャープ	1,292,000	1,077	1,391,484,000
アンリツ	145,000	357	51,765,000
富士通ゼネラル	74,000	381	28,194,000
日立国際電気	69,000	836	57,684,000
ソニー	1,436,800	3,130	4,497,184,000

T D K	139,300	5,510	767,543,000
帝国通信工業	68,000	198	13,464,000
三洋電機	2,756,000	144	396,864,000
宮越商事	10,100	535	5,403,500
ミツミ電機	86,200	1,672	144,126,400
タムラ製作所	83,000	266	22,078,000
アルプス電気	233,500	543	126,790,500
池上通信機	128,000	69	8,832,000
日本電波工業	19,900	1,996	39,720,400
日本トリム	3,700	1,781	6,589,700
ローランド ディー . ジー .	12,000	1,348	16,176,000
フォスター電機	24,100	2,390	57,599,000
クラリオン	20,000	145	2,900,000
S M K	88,000	440	38,720,000
ヨコオ	26,400	531	14,018,400
東光	145,000	122	17,690,000
ティアック	81,000	31	2,511,000
ホシデン	72,100	1,105	79,670,500
ヒロセ電機	46,400	9,580	444,512,000
日本航空電子工業	60,000	659	39,540,000
T O A	34,000	461	15,674,000
日立マクセル	9,000	1,711	15,399,000
ユニデン	97,000	221	21,437,000
アルパイン	58,300	1,136	66,228,800
スミダコーポレーション	20,800	754	15,683,200
アイコム	14,100	2,277	32,105,700
船井電機	23,200	3,695	85,724,000
横河電機	291,900	776	226,514,400
新電元工業	104,000	275	28,600,000
山武	72,700	2,040	148,308,000
日本光電工業	49,900	1,550	77,345,000
チノー	58,000	203	11,774,000
共和電業	32,000	250	8,000,000
日本電子材料	14,800	564	8,347,200
堀場製作所	46,200	2,225	102,795,000
アドバンテスト	198,100	2,236	442,951,600
小野測器	37,000	298	11,026,000
エスベック	31,100	500	15,550,000
サンクス	27,100	320	8,672,000
キーエンス	54,300	19,950	1,083,285,000
日置電機	13,500	1,531	20,668,500
シスメックス	50,500	5,260	265,630,000
メガチップス	23,100	1,193	27,558,300
O B A R A	22,700	963	21,860,100
日本電産コパル電子	29,100	649	18,885,900
ミヤチテクノス	18,400	640	11,776,000

東京電波	13,700	589	8,069,300
澤藤電機	29,000	133	3,857,000
コーセル	38,600	1,240	47,864,000
日立メディコ	18,000	742	13,356,000
新日本無線	29,000	194	5,626,000
オブテックス	19,800	913	18,077,400
千代田インテグレ	17,400	1,074	18,687,600
東光電気	21,000	599	12,579,000
スタンレー電気	179,300	1,675	300,327,500
岩崎電気	113,000	138	15,594,000
ウシオ電機	162,900	1,493	243,209,700
岡谷電機産業	19,000	275	5,225,000
ヘリオス テクノ ホールディング	30,300	274	8,302,200
日本セラミック	18,400	1,081	19,890,400
新神戸電機	24,000	842	20,208,000
日本デジタル研究所	22,400	990	22,176,000
古河電池	19,000	710	13,490,000
双信電機	18,600	343	6,379,800
山一電機	2,700	334	901,800
図研	20,400	674	13,749,600
日本電子	113,000	314	35,482,000
カシオ計算機	303,500	674	204,559,000
ファナック	278,000	8,900	2,474,200,000
日本シイエムケイ	59,400	668	39,679,200
エンプラス	16,600	1,527	25,348,200
ローム	134,100	6,180	828,738,000
浜松ホトニクス	105,000	2,192	230,160,000
三井ハイテック	40,800	668	27,254,400
新光電気工業	74,100	1,300	96,330,000
京セラ	222,100	8,210	1,823,441,000
太陽誘電	109,000	1,276	139,084,000
村田製作所	302,000	4,850	1,464,700,000
ユーシン	33,700	490	16,513,000
双葉電子工業	48,500	1,549	75,126,500
北陸電気工業	123,000	153	18,819,000
パナソニック電工	469,000	1,024	480,256,000
ニチコン	92,500	1,052	97,310,000
日本ケミコン	145,000	319	46,255,000
K O A	37,300	872	32,525,600
市光工業	83,000	141	11,703,000
小糸製作所	129,000	1,188	153,252,000
ミツバ	53,000	414	21,942,000
アロカ	15,500	658	10,199,000
スター精密	55,700	893	49,740,100
大日本スクリーン製造	299,000	460	137,540,000
キャノン電子	25,000	1,903	47,575,000

キヤノン	1,668,100	3,720	6,205,332,000
リコー	798,000	1,282	1,023,036,000
日本電産サンキョー	70,000	758	53,060,000
MUTOHホールディングス	42,000	139	5,838,000
東京エレクトロン	226,300	5,740	1,298,962,000
トヨタ紡織	84,900	1,608	136,519,200
鬼怒川ゴム工業	70,000	295	20,650,000
ユニプレス	40,900	1,295	52,965,500
豊田自動織機	232,000	2,333	541,256,000
モリタホールディングス	44,000	406	17,864,000
三櫻工業	34,200	557	19,049,400
デンソー	632,000	2,523	1,594,536,000
東海理化電機製作所	68,100	1,729	117,744,900
三井造船	1,119,000	219	245,061,000
佐世保重工業	193,000	191	36,863,000
川崎重工業	2,095,000	235	492,325,000
日本車輛製造	107,000	570	60,990,000
日本輸送機	39,000	176	6,864,000
近畿車輛	45,000	612	27,540,000
日産自動車	3,234,400	751	2,429,034,400
いすゞ自動車	1,835,000	215	394,525,000
トヨタ自動車	3,697,500	3,360	12,423,600,000
日野自動車	370,000	328	121,360,000
三菱自動車工業	5,960,000	124	739,040,000
エフテック	10,400	1,195	12,428,000
武蔵精密工業	29,000	1,896	54,984,000
トヨタ車体	50,700	1,452	73,616,400
日産車体	111,000	718	79,698,000
関東自動車工業	44,800	676	30,284,800
新明和工業	123,000	317	38,991,000
極東開発工業	55,500	304	16,872,000
日信工業	47,300	1,387	65,605,100
トピー工業	248,000	154	38,192,000
ティラド	99,000	202	19,998,000
曙ブレーキ工業	116,300	461	53,614,300
タチエス	39,400	853	33,608,200
N O K	141,400	1,303	184,244,200
カヤバ工業	188,000	300	56,400,000
シロキ工業	65,000	287	18,655,000
大同メタル工業	50,000	230	11,500,000
プレス工業	149,000	164	24,436,000
カルソニックカンセイ	207,000	247	51,129,000
太平洋工業	62,000	479	29,698,000
ケーヒン	53,600	1,572	84,259,200
河西工業	42,000	322	13,524,000
アイシン精機	237,200	2,378	564,061,600

マツダ	1,765,000	226	398,890,000
ダイハツ工業	266,000	841	223,706,000
愛知機械工業	68,000	356	24,208,000
今仙電機製作所	21,700	1,120	24,304,000
本田技研工業	2,295,300	3,130	7,184,289,000
スズキ	533,800	1,985	1,059,593,000
富士重工業	916,000	412	377,392,000
ヤマハ発動機	334,700	1,191	398,627,700
ショーワ	67,200	520	34,944,000
T B K	37,000	170	6,290,000
エクセディ	35,200	1,973	69,449,600
豊田合成	81,900	2,390	195,741,000
愛三工業	30,900	783	24,194,700
ヨロズ	16,800	1,213	20,378,400
エフ・シー・シー	38,400	1,759	67,545,600
シマノ	110,400	3,840	423,936,000
タカタ	45,400	2,085	94,659,000
テイ・エス テック	55,500	1,528	84,804,000
日本電産トーソク	10,200	1,345	13,719,000
テルモ	207,000	4,950	1,024,650,000
クリエートメディック	3,900	824	3,213,600
日機装	89,000	579	51,531,000
島津製作所	318,000	647	205,746,000
J M S	35,000	362	12,670,000
クボテック	126	21,450	2,702,700
モリテックス	16,200	241	3,904,200
長野計器	20,500	578	11,849,000
東京計器	113,000	121	13,673,000
愛知時計電機	27,000	256	6,912,000
東京精密	58,000	1,242	72,036,000
ニコン	502,000	2,027	1,017,554,000
トプコン	62,000	444	27,528,000
オリンパス	315,900	2,849	899,999,100
理研計器	18,300	567	10,376,100
タムロン	26,000	1,316	34,216,000
H O Y A	622,700	2,273	1,415,397,100
ノーリツ鋼機	22,700	590	13,393,000
エー・アンド・デイ	30,600	323	9,883,800
日本電産コパル	28,800	1,221	35,164,800
シチズンホールディングス	317,200	576	182,707,200
リズム時計工業	152,000	139	21,128,000
ニプロ	57,000	1,820	103,740,000
S R I スポーツ	174	85,000	14,790,000
バンダイナムコホールディングス	312,000	836	260,832,000
共立印刷	34,200	119	4,069,800
フランスベッドホールディングス	200,000	127	25,400,000

パイロットコーポレーション	253	102,800	26,008,400
トッパン・フォームズ	49,200	953	46,887,600
フジシールインターナショナル	26,800	1,916	51,348,800
タカラトミー	85,500	701	59,935,500
廣済堂	32,500	189	6,142,500
タカノ	13,500	483	6,520,500
プロネクサス	30,600	540	16,524,000
ホクシン	33,700	131	4,414,700
ウッドワン	56,000	240	13,440,000
大建工業	119,000	259	30,821,000
凸版印刷	813,000	786	639,018,000
大日本印刷	813,000	1,237	1,005,681,000
図書印刷	45,000	171	7,695,000
共同印刷	86,000	252	21,672,000
日本写真印刷	44,500	3,450	153,525,000
光村印刷	28,000	302	8,456,000
宝印刷	10,300	698	7,189,400
コンビ	16,500	621	10,246,500
アシックス	251,000	846	212,346,000
ツツミ	12,300	1,810	22,263,000
ローランド	20,900	880	18,392,000
小松ウオール工業	9,000	1,000	9,000,000
ヤマハ	194,500	1,092	212,394,000
河合楽器製作所	119,000	139	16,541,000
クリナップ	32,600	689	22,461,400
ビジョン	16,700	3,460	57,782,000
パラマウントベッド	28,700	1,807	51,860,900
兼松日産農林	47,000	105	4,935,000
キングジム	18,300	683	12,498,900
リンテック	61,700	1,740	107,358,000
イトーキ	64,300	193	12,409,900
任天堂	151,900	24,560	3,730,664,000
三菱鉛筆	24,200	1,224	29,620,800
タカラスタンダード	129,000	515	66,435,000
コクヨ	150,200	698	104,839,600
ナカバヤシ	61,000	184	11,224,000
グローブライド	156,000	105	16,380,000
サンウエーブ工業	41,000	327	13,407,000
岡村製作所	111,000	460	51,060,000
美津濃	142,000	408	57,936,000
アデランスホールディングス	33,200	1,011	33,565,200
東京電力	1,692,300	2,455	4,154,596,500
中部電力	904,500	2,301	2,081,254,500
関西電力	1,099,700	2,070	2,276,379,000
中国電力	397,100	1,778	706,043,800
北陸電力	275,100	1,945	535,069,500

東北電力	673,300	1,893	1,274,556,900
四国電力	297,400	2,516	748,258,400
九州電力	593,700	1,941	1,152,371,700
北海道電力	250,900	1,718	431,046,200
沖縄電力	19,000	4,875	92,625,000
電源開発	179,400	2,870	514,878,000
東京瓦斯	3,403,000	385	1,310,155,000
大阪瓦斯	2,891,000	320	925,120,000
東邦瓦斯	752,000	491	369,232,000
北海道瓦斯	46,000	240	11,040,000
西部瓦斯	322,000	248	79,856,000
静岡瓦斯	86,000	525	45,150,000
東武鉄道	1,149,000	489	561,861,000
相鉄ホールディングス	402,000	391	157,182,000
東京急行電鉄	1,472,000	371	546,112,000
京浜急行電鉄	741,000	707	523,887,000
小田急電鉄	856,000	749	641,144,000
京王電鉄	745,000	592	441,040,000
京成電鉄	400,000	513	205,200,000
富士急行	83,000	447	37,101,000
新京成電鉄	35,000	356	12,460,000
東日本旅客鉄道	500,600	5,990	2,998,594,000
西日本旅客鉄道	2,329	309,000	719,661,000
東海旅客鉄道	2,308	670,000	1,546,360,000
アートコーポレーション	7,500	1,391	10,432,500
西日本鉄道	364,000	356	129,584,000
ハマキョウレックス	9,300	2,302	21,408,600
サカイ引越センター	4,700	1,962	9,221,400
近畿日本鉄道	2,459,000	281	690,979,000
阪急阪神ホールディングス	1,817,000	416	755,872,000
南海電気鉄道	565,000	360	203,400,000
京阪電気鉄道	603,000	372	224,316,000
名糖運輸	6,800	773	5,256,400
名古屋鉄道	939,000	267	250,713,000
日本通運	1,143,000	375	428,625,000
ヤマトホールディングス	544,300	1,213	660,235,900
山九	322,000	426	137,172,000
丸運	10,800	220	2,376,000
丸全昭和運輸	83,000	284	23,572,000
センコー	92,000	319	29,348,000
トナミホールディングス	74,000	185	13,690,000
日本梱包運輸倉庫	80,000	946	75,680,000
日本石油輸送	21,000	190	3,990,000
福山通運	202,000	450	90,900,000
セイノーホールディングス	206,000	600	123,600,000
神奈川中央交通	30,000	502	15,060,000

日立物流	50,000	1,207	60,350,000
日本郵船	1,974,000	332	655,368,000
商船三井	1,291,000	577	744,907,000
川崎汽船	688,000	318	218,784,000
新和海運	101,000	272	27,472,000
乾汽船	29,000	672	19,488,000
明治海運	29,100	425	12,367,500
飯野海運	128,200	476	61,023,200
共栄タンカー	21,000	206	4,326,000
第一中央汽船	196,000	229	44,884,000
全日本空輸	3,834,000	271	1,039,014,000
バスコ	35,000	165	5,775,000
国際航業ホールディングス	18,000	188	3,384,000
日新	112,000	180	20,160,000
三菱倉庫	189,000	1,004	189,756,000
三井倉庫	103,000	331	34,093,000
住友倉庫	194,000	392	76,048,000
澁澤倉庫	76,000	274	20,824,000
東陽倉庫	39,000	181	7,059,000
日本トランスシティ	62,000	256	15,872,000
ケイヒン	68,000	99	6,732,000
安田倉庫	20,000	559	11,180,000
東洋埠頭	91,000	154	14,014,000
宇徳	20,000	235	4,700,000
上組	313,000	695	217,535,000
サンリツ	7,500	536	4,020,000
キムラユニティー	4,900	710	3,479,000
キューソー流通システム	4,900	852	4,174,800
郵船航空サービス	23,100	1,271	29,360,100
近鉄エクスプレス	23,000	2,375	54,625,000
東海運	23,400	208	4,867,200
バンテック	137	118,300	16,207,100
システムプロ	230	41,050	9,441,500
新日鉄ソリューションズ	25,200	1,387	34,952,400
コア	9,000	668	6,012,000
I Tホールディングス	87,000	1,003	87,261,000
コーエーテックモホールディングス	56,700	600	34,020,000
ドワンゴ	181	157,000	28,417,000
ベリサーブ	26	184,600	4,799,600
マクロミル	162	129,300	20,946,600
ティーガイア	244	135,300	33,013,200
GMOペイメントゲートウェイ	91	113,900	10,364,900
ザッパラス	136	134,100	18,237,600
インターネットイニシアティブ	186	170,200	31,657,200
ソネットエンタテインメント	149	222,100	33,092,900
S R Aホールディングス	12,300	798	9,815,400

J B I Sホールディングス	32,500	283	9,197,500
朝日ネット	19,000	280	5,320,000
パナソニック電気インフォメーションシステムズ	5,500	2,211	12,160,500
フェイス	1,192	8,910	10,620,720
野村総合研究所	161,400	1,975	318,765,000
サイバネットシステム	205	33,650	6,898,250
インテージ	9,100	1,560	14,196,000
シンプレクス・テクノロジー	430	42,150	18,124,500
クレスコ	8,400	413	3,469,200
フジ・メディア・ホールディングス	2,966	123,800	367,190,800
オービック	8,900	16,340	145,426,000
ティーディーシーソフトウェアエンジニアリング	6,200	707	4,383,400
ヤフー	15,663	31,750	497,300,250
トレンドマイクロ	113,900	3,360	382,704,000
日本オラクル	45,700	4,075	186,227,500
アルファシステムズ	8,000	1,502	12,016,000
フューチャーアーキテクト	319	31,400	10,016,600
シーエーシー	18,500	607	11,229,500
ソフトバンク・テクノロジー	8,000	716	5,728,000
トーセ	9,000	639	5,751,000
オービックビジネスコンサルタント	7,500	3,825	28,687,500
日立ビジネスソリューション	10,200	630	6,426,000
伊藤忠テクノソリューションズ	40,900	2,820	115,338,000
アイティフォー	34,300	299	10,255,700
東計電算	4,200	1,091	4,582,200
エクスネット	23	133,400	3,068,200
大塚商会	22,900	5,410	123,889,000
サイボウズ	440	35,650	15,686,000
アグレックス	4,100	744	3,050,400
電通国際情報サービス	18,800	493	9,268,400
ウェザーニューズ	9,000	1,016	9,144,000
C I J	25,100	277	6,952,700
ネットワンシステムズ	571	98,200	56,072,200
アルゴグラフィックス	10,900	954	10,398,600
エイベックス・グループ・ホールディングス	45,500	789	35,899,500
日本ユニシス	71,900	568	40,839,200
兼松エレクトロニクス	13,400	807	10,813,800
東京放送ホールディングス	154,100	1,291	198,943,100
日本テレビ放送網	24,970	12,280	306,631,600
テレビ朝日	720	141,800	102,096,000
テレビ東京	12,100	1,842	22,288,200
スカパー J S A Tホールディングス	2,198	38,550	84,732,900
アイ・ティー・シーネットワーク	61	196,800	12,004,800
イー・アクセス	1,150	69,100	79,465,000
N E Cモバイリング	9,300	2,216	20,608,800
日本電信電話	1,118,900	3,960	4,430,844,000

KDDI	4,409	493,000	2,173,637,000
光通信	38,700	1,508	58,359,600
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	23,569	140,000	3,299,660,000
GMOインターネット	35,400	361	12,779,400
学研ホールディングス	131,000	208	27,248,000
ゼンリン	39,400	1,024	40,345,600
昭文社	19,500	566	11,037,000
角川グループホールディングス	25,200	2,072	52,214,400
インプレスホールディングス	36,000	192	6,912,000
アイネット	13,400	455	6,097,000
松竹	159,000	830	131,970,000
東宝	202,700	1,466	297,158,200
東映	109,000	448	48,832,000
葵プロモーション	15,000	456	6,840,000
エヌ・ティ・ティ・データ	1,758	274,800	483,098,400
DTS	28,900	855	24,709,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	73,500	1,774	130,389,000
シーイーシー	18,400	456	8,390,400
カプコン	61,900	1,469	90,931,100
ジャステック	17,400	504	8,769,600
住商情報システム	30,000	1,279	38,370,000
日本システムウエア	16,600	279	4,631,400
アイネス	38,300	653	25,009,900
TKC	24,400	1,639	39,991,600
富士ソフト	36,800	1,470	54,096,000
ソラン	1,800	725	1,305,000
日本システムディベロップメント	59,900	1,003	60,079,700
コナミ	116,900	1,607	187,858,300
福井コンピュータ	12,900	300	3,870,000
JBCホールディングス	23,800	549	13,066,200
ソフトバンク	1,162,000	2,358	2,739,996,000
ハウスイ	43,000	104	4,472,000
インターニックス	17,400	321	5,585,400
高千穂交易	4,700	905	4,253,500
伊藤忠食品	5,900	2,973	17,540,700
エレマテック	15,800	1,026	16,210,800
JALUX	10,600	744	7,886,400
トーマンデバイス	3,800	1,700	6,460,000
双日	1,911,200	159	303,880,800
アルフレッサホールディングス	69,600	3,750	261,000,000
横浜冷凍	52,000	615	31,980,000
神栄	56,000	127	7,112,000
山下医科器械	3,400	1,108	3,767,200
ラサ商事	9,000	337	3,033,000
あいホールディングス	66,700	274	18,275,800
ダイワボウホールディングス	276,000	185	51,060,000

バイタルケーエスケー・ホールディングス	36,600	526	19,251,600
U K Cホールディングス	16,500	1,150	18,975,000
日本コークス工業	269,500	107	28,836,500
ミタチ産業	9,000	423	3,807,000
J F E 商事ホールディングス	188,000	307	57,716,000
シップヘルスケアホールディングス	371	49,900	18,512,900
富士興産	143,000	68	9,724,000
協栄産業	40,000	165	6,600,000
小野建	23,200	609	14,128,800
佐島電機	22,900	483	11,060,700
エコートレーディング	6,200	902	5,592,400
伯東	17,600	851	14,977,600
中山福	3,800	580	2,204,000
ナガイレーベン	15,900	1,994	31,704,600
菱食	27,800	2,265	62,967,000
松田産業	18,400	1,566	28,814,400
メディパルホールディングス	283,700	1,078	305,828,600
アドヴァン	19,900	590	11,741,000
S P K	4,900	1,241	6,080,900
アズワン	16,700	1,598	26,686,600
スズデン	6,000	466	2,796,000
尾家産業	8,500	777	6,604,500
シモジマ	16,500	1,265	20,872,500
ドウシシャ	13,500	2,224	30,024,000
高速	11,000	634	6,974,000
黒田電気	39,600	1,262	49,975,200
丸文	27,000	498	13,446,000
ハピネット	5,500	1,050	5,775,000
トーメンエレクトロニクス	9,400	977	9,183,800
エクセル	12,900	1,050	13,545,000
マルカキカイ	9,100	537	4,886,700
ガリバーインターナショナル	6,850	4,280	29,318,000
日本エム・ディ・エム	31,300	249	7,793,700
進和	15,000	1,057	15,855,000
エスケイジャパン	4,100	339	1,389,900
ダイトエレクトロン	16,200	417	6,755,400
シークス	20,200	1,040	21,008,000
田中商事	5,600	327	1,831,200
オーハシテクニカ	14,200	500	7,100,000
マクニカ	12,500	1,519	18,987,500
白銅	12,900	590	7,611,000
伊藤忠商事	1,841,000	723	1,331,043,000
丸紅	2,173,000	531	1,153,863,000
高島	63,000	132	8,316,000
F & A アクアホールディングス	20,200	952	19,230,400
長瀬産業	147,000	1,043	153,321,000

蝶理	215,000	100	21,500,000
豊田通商	252,800	1,312	331,673,600
三共生興	53,000	277	14,681,000
兼松	635,000	68	43,180,000
ツカモトコーポレーション	60,000	70	4,200,000
三井物産	2,289,100	1,396	3,195,583,600
日本紙パルプ商事	141,000	304	42,864,000
日立ハイテクノロジーズ	86,700	1,810	156,927,000
カメイ	33,000	431	14,223,000
東都水産	62,000	144	8,928,000
スターゼン	84,000	242	20,328,000
山善	113,100	299	33,816,900
椿本興業	23,000	177	4,071,000
住友商事	1,452,200	985	1,430,417,000
内田洋行	72,000	259	18,648,000
三菱商事	2,122,200	2,250	4,774,950,000
第一実業	61,000	222	13,542,000
キャノンマーケティングジャパン	94,600	1,190	112,574,000
西華産業	108,000	194	20,952,000
佐藤商事	25,300	447	11,309,100
菱洋エレクトロ	30,300	778	23,573,400
東京産業	17,000	245	4,165,000
ユアサ商事	322,000	73	23,506,000
神鋼商事	78,000	148	11,544,000
阪和興業	284,000	338	95,992,000
カナデン	29,000	447	12,963,000
菱電商事	38,000	439	16,682,000
フルサト工業	16,000	521	8,336,000
岩谷産業	287,000	251	72,037,000
すてきナイスグループ	133,000	186	24,738,000
昭光通商	119,000	104	12,376,000
二チモウ	56,000	141	7,896,000
極東貿易	48,000	122	5,856,000
イワキ	42,000	234	9,828,000
三愛石油	64,000	339	21,696,000
稲畑産業	71,300	337	24,028,100
G S Iクレオス	106,000	102	10,812,000
明和産業	29,400	173	5,086,200
東邦ホールディングス	74,700	1,210	90,387,000
サンゲツ	46,800	1,989	93,085,200
ミツウロコ	42,800	621	26,578,800
シナネン	61,000	389	23,729,000
伊藤忠エネクス	60,400	448	27,059,200
ザ・トーカイ	68,000	489	33,252,000
サンリオ	81,100	754	61,149,400
サンワテクノス	19,000	396	7,524,000

リョーサン	41,400	2,145	88,803,000
新光商事	26,800	768	20,582,400
トーホー	45,000	324	14,580,000
三信電気	29,000	685	19,865,000
東陽テクニカ	43,500	713	31,015,500
モスフードサービス	34,000	1,505	51,170,000
加賀電子	29,600	917	27,143,200
ソーダニッカ	24,000	334	8,016,000
立花エレテック	17,000	603	10,251,000
太平洋興発	126,000	64	8,064,000
ヤマタネ	142,000	123	17,466,000
丸紅建材リース	43,000	112	4,816,000
トラスコ中山	30,900	1,337	41,313,300
オートバックスセブン	33,800	2,675	90,415,000
加藤産業	40,400	1,487	60,074,800
イエローハット	30,100	669	20,136,900
富士エレクトロニクス	15,200	855	12,996,000
J Kホールディングス	23,500	332	7,802,000
ユニダックス	12,500	451	5,637,500
日伝	10,800	2,125	22,950,000
北沢産業	38,500	162	6,237,000
杉本商事	12,800	751	9,612,800
因幡電機産業	28,200	2,080	58,656,000
住金物産	127,000	190	24,130,000
ミスミグループ本社	95,800	1,543	147,819,400
江守商事	1,800	701	1,261,800
アルテック	18,400	295	5,428,000
タキヒヨー	46,000	454	20,884,000
スズケン	100,700	3,010	303,107,000
ジェコス	14,000	371	5,194,000
ローソン	80,100	3,945	315,994,500
サンエー	9,600	3,250	31,200,000
キリン堂	15,400	394	6,067,600
ダイユーエイト	6,300	600	3,780,000
カワチ薬品	18,300	1,803	32,994,900
エービーシー・マート	30,000	2,849	85,470,000
ハードオフコーポレーション	9,700	414	4,015,800
アスクル	22,200	1,644	36,496,800
ゲオ	493	94,200	46,440,600
ポイント	25,870	5,310	137,369,700
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	33,000	125	4,125,000
くらコーポレーション	81	261,400	21,173,400
キャンドウ	115	91,100	10,476,500
パル	8,000	1,863	14,904,000
エディオン	115,900	896	103,846,400
サーラコーポレーション	26,500	527	13,965,500

バルス	127	69,200	8,788,400	
あみやき亭	56	227,900	12,762,400	
ハニーズ	28,530	657	18,744,210	
アルペン	23,100	1,376	31,785,600	
ビックカメラ	725	30,750	22,293,750	
D C M J a p a nホールディングス	143,200	522	74,750,400	
M o n o t a R O	2,800	1,249	3,497,200	
ユニバース	3,200	1,221	3,907,200	
J . フロント リテイリング	673,000	495	333,135,000	
ドトール・日レスホールディングス	43,100	1,149	49,521,900	
マツモトキヨシホールディングス	48,600	1,975	95,985,000	
ココカラファイン ホールディングス	22,000	1,510	33,220,000	
三越伊勢丹ホールディングス	494,600	943	466,407,800	
クリエイトSDホールディングス	9,400	1,540	14,476,000	
C H Iグループ	14,700	368	5,409,600	
ブックオフコーポレーション	14,400	913	13,147,200	
あさひ	12,700	1,426	18,110,200	
サークルKサンクス	54,100	1,139	61,619,900	
日本調剤	4,670	2,281	10,652,270	
コスモス薬品	13,500	1,875	25,312,500	
セブン&アイ・ホールディングス	1,134,300	1,980	2,245,914,000	
ツルハホールディングス	21,300	3,310	70,503,000	
サンマルクホールディングス	8,200	2,934	24,058,800	
フェリシモ	7,700	1,210	9,317,000	
トリドール	78	167,800	13,088,400	
総合メディカル	6,100	2,035	12,413,500	
はるやま商事	14,900	369	5,498,100	
カッパ・クリエイト	20,200	1,913	38,642,600	
ライトオン	23,500	674	15,839,000	
ジーンズメイト	10,000	378	3,780,000	
良品計画	30,500	3,950	120,475,000	
三城ホールディングス	36,500	755	27,557,500	
コナカ	38,600	331	12,776,600	
ハウス オブ ローゼ	600	1,288	772,800	
G - 7ホールディングス	8,600	516	4,437,600	
イオン北海道	21,100	276	5,823,600	
コジマ	42,400	646	27,390,400	
コーナン商事	26,400	1,014	26,769,600	
エコス	11,100	623	6,915,300	
ワタミ	28,500	1,617	46,084,500	
マルシェ	4,100	704	2,886,400	
ドン・キホーテ	45,900	2,205	101,209,500	
メガネトップ	25,700	693	17,810,100	
西松屋チェーン	64,700	775	50,142,500	
ゼンショー	106,700	665	70,955,500	
幸楽苑	14,100	1,216	17,145,600	

ユニマットライフ	6,500	916	5,954,000
ハークスレイ	8,000	627	5,016,000
サイゼリヤ	43,400	1,622	70,394,800
ポプラ	9,700	530	5,141,000
ユナイテッドアローズ	33,200	954	31,672,800
ハイデイ日高	10,200	1,019	10,393,800
京都きもの友禅	17,800	809	14,400,200
コロワイド	63,500	611	38,798,500
壱番屋	6,600	2,148	14,176,800
トップカルチャー	13,000	342	4,446,000
スギホールディングス	40,100	2,122	85,092,200
スクロール	31,700	311	9,858,700
ファミリーマート	87,700	2,860	250,822,000
木曽路	29,000	1,895	54,955,000
千趣会	54,400	516	28,070,400
タカキュー	32,500	176	5,720,000
ケーヨー	52,700	458	24,136,600
上新電機	60,000	762	45,720,000
日本瓦斯	30,200	1,188	35,877,600
ベスト電器	98,500	230	22,655,000
マルエツ	58,000	385	22,330,000
ロイヤルホールディングス	42,200	901	38,022,200
東天紅	29,000	148	4,292,000
いなげや	27,000	949	25,623,000
島忠	64,200	1,886	121,081,200
チヨダ	38,000	1,187	45,106,000
鈴丹	3,300	221	729,300
ライフコーポレーション	17,400	1,514	26,343,600
カスミ	52,400	461	24,156,400
さが美	38,000	133	5,054,000
MrMax	29,000	397	11,513,000
テンアライド	20,500	305	6,252,500
AOKIホールディングス	25,600	1,028	26,316,800
オークワ	36,000	856	30,816,000
コメリ	34,600	2,391	82,728,600
青山商事	67,300	1,376	92,604,800
しまむら	29,700	7,910	234,927,000
CFSコーポレーション	24,500	447	10,951,500
高島屋	357,000	691	246,687,000
松屋	54,200	755	40,921,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	149,000	570	84,930,000
丸栄	51,000	118	6,018,000
ニッセンホールディングス	65,200	362	23,602,400
パルコ	73,500	707	51,964,500
丸井グループ	317,800	567	180,192,600
原信ナルスホールディングス	14,300	1,025	14,657,500

ダイエー	127,500	299	38,122,500
イズミヤ	94,000	415	39,010,000
イオン	931,400	920	856,888,000
ユニー	215,000	704	151,360,000
イズミ	77,500	1,139	88,272,500
東武ストア	24,000	279	6,696,000
平和堂	51,200	1,131	57,907,200
フジ	31,400	1,718	53,945,200
ヤオコー	11,900	2,671	31,784,900
ゼビオ	30,500	1,710	52,155,000
ケーズホールディングス	46,000	2,735	125,810,000
O l y m p i c	18,900	615	11,623,500
東日カーライフグループ	8,000	104	832,000
元気寿司	5,800	1,185	6,873,000
ヤマダ電機	129,770	6,150	798,085,500
アークランドサカモト	18,000	940	16,920,000
ニトリ	51,200	6,890	352,768,000
グルメ杵屋	19,000	511	9,709,000
愛眼	16,700	493	8,233,100
吉野家ホールディングス	765	100,400	76,806,000
松屋フーズ	10,900	1,356	14,780,400
サガミチェーン	30,000	570	17,100,000
ブレナス	31,300	1,284	40,189,200
ミニストップ	18,900	1,049	19,826,100
アークス	33,000	1,229	40,557,000
パロー	48,500	725	35,162,500
ベルク	10,300	826	8,507,800
大庄	15,200	1,231	18,711,200
ファーストリテイリング	57,000	15,130	862,410,000
サンドラッグ	54,400	2,147	116,796,800
ヤマザワ	5,400	1,287	6,949,800
やまや	2,700	679	1,833,300
ベルーナ	39,950	375	14,981,250
新生銀行	1,312,000	108	141,696,000
あおぞら銀行	908,000	119	108,052,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	20,236,900	456	9,228,026,400
りそなホールディングス	761,500	1,099	836,888,500
中央三井トラスト・ホールディングス	1,490,000	319	475,310,000
三井住友フィナンシャルグループ	1,941,500	2,866	5,564,339,000
第四銀行	364,000	305	111,020,000
北越銀行	305,000	147	44,835,000
西日本シティ銀行	930,000	243	225,990,000
札幌北洋ホールディングス	373,100	379	141,404,900
千葉銀行	1,044,000	560	584,640,000
横浜銀行	1,828,000	442	807,976,000
常陽銀行	1,029,000	358	368,382,000

群馬銀行	663,000	495	328,185,000
武蔵野銀行	43,900	2,495	109,530,500
千葉興業銀行	54,900	660	36,234,000
関東つくば銀行	95,500	281	26,835,500
東京都民銀行	52,300	1,136	59,412,800
七十七銀行	444,000	490	217,560,000
青森銀行	210,000	211	44,310,000
秋田銀行	190,000	360	68,400,000
山形銀行	159,000	404	64,236,000
岩手銀行	18,900	5,070	95,823,000
東邦銀行	240,000	288	69,120,000
東北銀行	152,000	137	20,824,000
みちのく銀行	153,000	172	26,316,000
ふくおかフィナンシャルグループ	1,081,000	327	353,487,000
静岡銀行	824,000	790	650,960,000
十六銀行	345,000	353	121,785,000
スルガ銀行	279,000	773	215,667,000
八十二銀行	534,000	512	273,408,000
山梨中央銀行	179,000	384	68,736,000
大垣共立銀行	386,000	309	119,274,000
福井銀行	241,000	295	71,095,000
北國銀行	301,000	321	96,621,000
清水銀行	9,500	3,565	33,867,500
滋賀銀行	263,000	545	143,335,000
南都銀行	268,000	490	131,320,000
百五銀行	256,000	416	106,496,000
京都銀行	474,000	774	366,876,000
三重銀行	120,000	241	28,920,000
ほくほくフィナンシャルグループ	1,867,000	191	356,597,000
広島銀行	778,000	368	286,304,000
山陰合同銀行	168,000	716	120,288,000
中国銀行	231,000	1,154	266,574,000
鳥取銀行	96,000	242	23,232,000
伊予銀行	320,000	790	252,800,000
百十四銀行	308,000	338	104,104,000
四国銀行	213,000	289	61,557,000
阿波銀行	232,000	497	115,304,000
鹿児島銀行	180,000	644	115,920,000
大分銀行	191,000	320	61,120,000
宮崎銀行	180,000	272	48,960,000
肥後銀行	224,000	491	109,984,000
佐賀銀行	161,000	252	40,572,000
十八銀行	188,000	262	49,256,000
沖縄銀行	21,300	3,415	72,739,500
琉球銀行	58,500	1,005	58,792,500
住友信託銀行	2,400,000	503	1,207,200,000

みずほ信託銀行	2,275,000	89	202,475,000
八千代銀行	15,300	2,023	30,951,900
みずほフィナンシャルグループ	23,317,400	176	4,103,862,400
紀陽ホールディングス	1,064,000	112	119,168,000
山口フィナンシャルグループ	264,000	974	257,136,000
長野銀行	108,000	177	19,116,000
名古屋銀行	259,000	350	90,650,000
愛知銀行	10,300	6,560	67,568,000
第三銀行	113,000	244	27,572,000
中京銀行	117,000	268	31,356,000
東日本銀行	152,000	182	27,664,000
愛媛銀行	176,000	249	43,824,000
トマト銀行	116,000	178	20,648,000
みなと銀行	303,000	113	34,239,000
京葉銀行	230,000	417	95,910,000
関西アーバン銀行	298,000	140	41,720,000
栃木銀行	142,000	378	53,676,000
北日本銀行	9,600	2,548	24,460,800
香川銀行	101,000	297	29,997,000
徳島銀行	85,000	300	25,500,000
福島銀行	408,000	49	19,992,000
大東銀行	218,000	66	14,388,000
フィデアホールディングス	139,100	142	19,752,200
池田泉州ホールディングス	919,700	209	192,217,300
SBIホールディングス	25,612	16,590	424,903,080
ジャフコ	39,800	2,045	81,391,000
大和証券グループ本社	2,502,000	443	1,108,386,000
野村ホールディングス	5,317,600	659	3,504,298,400
みずほ証券	728,000	276	200,928,000
みずほインベスターズ証券	665,000	92	61,180,000
岡三証券グループ	237,000	402	95,274,000
丸三証券	83,700	496	41,515,200
東洋証券	115,000	159	18,285,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	295,000	344	101,480,000
光世証券	82,000	95	7,790,000
水戸証券	79,000	206	16,274,000
いちよし証券	61,400	543	33,340,200
松井証券	170,600	609	103,895,400
だいこう証券ビジネス	15,500	375	5,812,500
マネックスグループ	2,170	39,100	84,847,000
カブドットコム証券	463	86,800	40,188,400
極東証券	36,900	794	29,298,600
岩井証券	24,600	530	13,038,000
三井住友海上グループホールディングス	604,300	2,240	1,353,632,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	917	256,600	235,302,200
日本興亜損害保険	960,000	541	519,360,000

損害保険ジャパン	1,246,000	620	772,520,000	
ニッセイ同和損害保険	323,000	426	137,598,000	
あいおい損害保険	679,000	427	289,933,000	
富士火災海上保険	174,000	96	16,704,000	
東京海上ホールディングス	1,080,400	2,495	2,695,598,000	
T & Dホールディングス	478,850	1,935	926,574,750	
クレディセゾン	204,500	1,158	236,811,000	
セディナ	260,300	164	42,689,200	
芙蓉総合リース	27,300	2,427	66,257,100	
興銀リース	43,300	1,635	70,795,500	
東京センチュリーリース	73,000	1,178	85,994,000	
日本証券金融	126,600	671	84,948,600	
大阪証券金融	72,500	185	13,412,500	
アイフル	122,100	144	17,582,400	
ポケットカード	53,800	253	13,611,400	
リコーリース	22,700	1,987	45,104,900	
イオンクレジットサービス	134,300	927	124,496,100	
アコム	75,240	1,327	99,843,480	
プロミス	102,300	686	70,177,800	
ジャックス	201,000	188	37,788,000	
日立キャピタル	72,900	1,200	87,480,000	
オリックス	138,840	7,070	981,598,800	
三菱UFJリース	74,020	3,035	224,650,700	
アサックス	125	79,400	9,925,000	
NECキャピタルソリューション	14,500	1,251	18,139,500	
日本駐車場開発	3,690	3,900	14,391,000	
昭栄	52,000	714	37,128,000	
東京建物不動産販売	23,600	277	6,537,200	
野村不動産ホールディングス	138,200	1,342	185,464,400	
ヒューリック	83,100	652	54,181,200	
エコナック	138,000	42	5,796,000	
パーク24	161,000	922	148,442,000	
三井不動産	1,182,000	1,527	1,804,914,000	
三菱地所	1,864,000	1,415	2,637,560,000	
平和不動産	207,500	274	56,855,000	
東京建物	551,000	328	180,728,000	
ダイビル	74,900	708	53,029,200	
サンケイビル	52,700	549	28,932,300	
東急不動産	530,000	345	182,850,000	
京阪神不動産	33,200	423	14,043,600	
住友不動産	639,000	1,614	1,031,346,000	
東宝不動産	29,300	480	14,064,000	
有楽土地	47,000	350	16,450,000	
大京	305,000	173	52,765,000	
テーオーシー	116,000	333	38,628,000	
東京楽天地	42,000	360	15,120,000	

レオパレス21	192,000	410	78,720,000
フジ住宅	39,400	314	12,371,600
空港施設	28,700	477	13,689,900
住友不動産販売	10,820	3,890	42,089,800
ゴールドクレスト	20,110	2,495	50,174,450
東栄住宅	20,100	704	14,150,400
日本エスリード	14,700	730	10,731,000
東急リパブル	29,100	654	19,031,400
飯田産業	12,600	1,549	19,517,400
アーネストワン	28,300	919	26,007,700
サンヨーハウジング名古屋	149	77,100	11,487,900
イオンモール	130,500	1,645	214,672,500
タクトホーム	154	67,000	10,318,000
リサ・パートナーズ	422	52,700	22,239,400
エヌ・ティ・ティ都市開発	1,805	70,300	126,891,500
ランドビジネス	322	15,960	5,139,120
日本空港ビルデング	69,200	1,239	85,738,800
日本工営	101,000	265	26,765,000
日本M&Aセンター	60	317,500	19,050,000
アコーディア・ゴルフ	787	94,000	73,978,000
パソナグループ	297	60,100	17,849,700
リンクアンドモチベーション	107	38,000	4,066,000
テンプホールディングス	41,800	730	30,514,000
学情	13,200	274	3,616,800
スタジオアリス	16,700	760	12,692,000
シミック	680	19,230	13,076,400
NECフィールディング	24,900	1,215	30,253,500
総合警備保障	101,300	1,029	104,237,700
カカクコム	185	349,000	64,565,000
ルネサンス	19,100	315	6,016,500
セキュアード・キャピタル・ジャパン	56	80,200	4,491,200
新日本科学	19,900	560	11,144,000
エムスリー	122	325,000	39,650,000
ディー・エヌ・エー	352	677,000	238,304,000
博報堂DYホールディングス	38,320	4,410	168,991,200
ぐるなび	177	189,500	33,541,500
一休	248	40,150	9,957,200
ジャパンベストレスキューシステム	93	69,000	6,417,000
ジェイコムホールディングス	52	89,500	4,654,000
パシフィックゴルフグループインターナショナル	683	65,700	44,873,100
イーピーエス	86	374,000	32,164,000
アミューズ	6,500	943	6,129,500
TAC	20,100	349	7,014,900
ケネディクス	1,487	27,300	40,595,100
電通	273,800	2,170	594,146,000
イオンファンタジー	10,700	1,017	10,881,900

みらかホールディングス	57,700	2,650	152,905,000
アルプス技研	14,000	591	8,274,000
ダイオーズ	1,000	470	470,000
日本空調サービス	1,500	714	1,071,000
オリエンタルランド	72,900	6,330	461,457,000
ダスキン	83,200	1,628	135,449,600
明光ネットワークジャパン	26,800	559	14,981,200
ファルコバイオシステムズ	17,300	858	14,843,400
秀英予備校	10,300	511	5,263,300
田谷	4,300	680	2,924,000
ラウンドワン	44,400	572	25,396,800
リゾートトラスト	43,500	1,222	53,157,000
ビー・エム・エル	15,500	2,334	36,177,000
ワタベウェディング	9,700	1,146	11,116,200
もしもしホットライン	18,700	1,799	33,641,300
東急コミュニティー	4,800	2,046	9,820,800
リソー教育	3,895	5,150	20,059,250
ウェアハウス	4,400	328	1,443,200
ユー・エス・エス	38,170	5,590	213,370,300
東京個別指導学院	33,200	152	5,046,400
カルチュア・コンビニエンス・クラブ	109,100	438	47,785,800
テー・オー・ダブリュー	7,800	489	3,814,200
セントラルスポーツ	8,500	865	7,352,500
リゾートソリューション	39,000	157	6,123,000
エイチ・アイ・エス	28,400	1,657	47,058,800
共立メンテナンス	12,100	1,279	15,475,900
イチネンホールディングス	31,200	356	11,107,200
建設技術研究所	13,900	472	6,560,800
燦ホールディングス	3,300	1,483	4,893,900
スパル興業	6,000	256	1,536,000
東京テアトル	119,000	140	16,660,000
ホリプロ	4,500	693	3,118,500
よみうりランド	63,000	293	18,459,000
東京都競馬	202,000	128	25,856,000
常磐興産	86,000	135	11,610,000
カナモト	38,000	408	15,504,000
東京ドーム	217,000	250	54,250,000
トランス・コスモス	37,800	752	28,425,600
乃村工藝社	61,000	203	12,383,000
藤田観光	81,000	351	28,431,000
日本管財	10,700	1,495	15,996,500
白洋舎	37,000	254	9,398,000
セコム	271,100	4,105	1,112,865,500
セントラル警備保障	9,800	899	8,810,200
丹青社	41,000	184	7,544,000
メイテック	42,600	1,634	69,608,400

アサツー ディ・ケイ	52,900	1,781	94,214,900	
応用地質	31,200	720	22,464,000	
船井総合研究所	26,100	509	13,284,900	
進学会	12,100	295	3,569,500	
ベネッセホールディングス	95,300	4,000	381,200,000	
イオンディライト	22,100	1,188	26,254,800	
ナック	4,800	829	3,979,200	
ニチイ学館	62,100	859	53,343,900	
ダイセキ	48,700	1,807	88,000,900	
合 計	402,832,931		323,683,558,850	

差入委託証拠金代用有価証券1,200,000株

(b) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

## 「国内債券パッシブ・マザーファンド」の状況

## (1) 貸借対照表

対象年月日	(平成21年2月18日現在)	(平成22年2月18日現在)
科目	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	4,684,281,479	1,043,826,652
国債証券	132,486,919,360	375,186,253,520
地方債証券	11,178,620,621	33,455,093,685
特殊債券	20,916,248,473	57,550,652,595
社債券	13,178,598,100	43,845,906,000
未収入金	285,718,000	576,492,000
未収利息	658,351,520	2,215,388,994
前払費用	130,812,704	89,616,727
流動資産合計	183,519,550,257	513,963,230,173
資産合計	183,519,550,257	513,963,230,173
負債の部		
流動負債		
未払金	4,412,422,400	-
未払解約金	1,843,999	716,664,000
流動負債合計	4,414,266,399	716,664,000
負債合計	4,414,266,399	716,664,000
純資産の部		
元本等		
1 元本		
元本	170,680,524,635	481,747,338,777
元本合計	170,680,524,635	481,747,338,777
2 剰余金		
剰余金	8,424,759,223	31,499,227,396
剰余金合計	8,424,759,223	31,499,227,396
元本等合計	179,105,283,858	513,246,566,173
純資産合計	179,105,283,858	513,246,566,173
負債・純資産合計	183,519,550,257	513,963,230,173

(注) 「国内債券パッシブ・マザーファンド」は、毎年5月25日（ただし、休業日の場合は翌営業日）に決算を行います。上記の貸借対照表は平成21年2月18日ならびに平成22年2月18日現在における同マザーファンドの状況です。

## (2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自平成20年2月19日 至平成21年2月18日	自平成21年2月19日 至平成22年2月18日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券・地方債証券・特殊債券・社債 券（売買目的有価証券） 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引 業者、銀行等の提示する価額（ただし、売 気配相場は使用しない）、価格情報会社 の提供する価額または業界団体が公表す る売買参考統計値等で評価しております。	国債証券・地方債証券・特殊債券・社債 券（売買目的有価証券） 同左

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成21年2月18日現在)	(平成22年2月18日現在)
1. 受益権総数	平成21年2月18日現在における受益権の 総数 170,680,524,635口	平成22年2月18日現在における受益権の 総数 481,747,338,777口
2. 1単位当たり純資産額	1.0494円 (1万円 = 10,494円)	1.0654円 (1万円 = 10,654円)

## (デリバティブ取引に関する注記)

## . 取引の状況に関する事項

項目	自平成20年2月19日 至平成21年2月18日	自平成21年2月19日 至平成22年2月18日
1. 取引の内容	<p>当ファンドの行うことのできるデリバティブ取引は、次の通りです。</p> <p>a. わが国の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。</p> <p>b. わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。</p> <p>異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（「スワップ取引」）。</p> <p>金利先渡取引。</p>	同左
2. 取引に対する取組方針	デリバティブ取引につきましては信託約款等に従っており、その制限を遵守しております。	同左
3. 取引の利用目的	信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため。	同左
4. 取引に係るリスクの内容	デリバティブ取引に伴いファンドに影響を与える主なリスクとしてマーケットリスクがあげられます。マーケットリスクについては、ポジションや時価、予想損失額の把握が重要だと考えております。	同左
5. 取引に係るリスクの管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理ならびにコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p>	同左
6. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	該当事項はありません。	同左

## . 取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

（平成21年2月18日現在）

平成21年2月18日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（平成22年2月18日現在）

平成22年2月18日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（関連当事者との取引に関する注記）

（自 平成20年2月19日 至 平成21年2月18日）

該当事項はありません。

（自 平成21年2月19日 至 平成22年2月18日）

該当事項はありません。

(その他の注記)

(平成21年2月18日現在)	
本有価証券報告書における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	126,637,732,124円
同期中における追加設定元本額	79,587,198,589円
同期中における一部解約元本額	35,544,406,078円
平成21年2月18日現在における元本の内訳	
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	491,135,139円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	988,273,559円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	173,746,752円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	7,514,728円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	369,072円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	256,070円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	185,219円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	160,477円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	139,073円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	157,174円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	48,102,688,064円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	12,123,226,494円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	27,730,639,128円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	540,139,193円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	767,786,251円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	193,022,245円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	288,285,480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>	111,890,542円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	2,161,427,075円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,813,631,862円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	7,512,130,123円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	17,333,001,775円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,379,772,383円
三井住友・国内債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	4,829,937,217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)	20,441,630,857円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	715,925,836円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	4,457,299,588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)	17,516,153,259円
合計	170,680,524,635円

(平成22年2月18日現在)

本有価証券報告書における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	170,680,524,635円
同期中における追加設定元本額	327,286,589,892円
同期中における一部解約元本額	16,219,775,750円
平成22年2月18日現在における元本の内訳	
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	744,960,225円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,529,941,750円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	293,868,644円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	28,391,536円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	6,984,443円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	544,572円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	2,709,835円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	348,542円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	166,405円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	522,649円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	51,779,889,393円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	13,957,489,385円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	31,513,366,216円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	586,029,547円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	828,908,881円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	207,311,452円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	411,167,856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>	138,564,317円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	2,462,089,949円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	3,444,396,781円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	8,194,308,690円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	24,445,866,476円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,475,988,511円
三井住友・国内債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	9,325,504,237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)	70,753,708,551円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	997,479,150円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	13,675,187,385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)	225,456,523,963円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	1,454,236,844円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	341,999,565円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	66,469,866円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	4,840,147,186円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	5,755,984,928円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	4,399,383,938円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	252,202,336円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	56,780,574円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	9,568,046円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	27,681,366円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	2,280,664,787円
合計	481,747,338,777円

## (3) 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第1回利付国債(40年)	1,020,000,000	1,033,351,800	
	第2回利付国債(40年)	702,000,000	675,050,220	
	第227回利付国債(10年)	14,257,000,000	14,483,401,160	
	第231回利付国債(10年)	13,745,000,000	13,958,734,750	
	第234回利付国債(10年)	13,901,000,000	14,178,046,930	
	第236回利付国債(10年)	13,028,000,000	13,349,921,880	
	第237回利付国債(10年)	5,010,000,000	5,149,979,400	
	第238回利付国債(10年)	4,450,000,000	4,565,166,000	
	第239回利付国債(10年)	8,688,000,000	8,935,955,520	
	第242回利付国債(10年)	6,980,000,000	7,160,433,000	
	第243回利付国債(10年)	5,250,000,000	5,372,272,500	
	第244回利付国債(10年)	11,552,000,000	11,803,024,960	
	第247回利付国債(10年)	8,935,000,000	9,084,571,900	
	第250回利付国債(10年)	9,765,000,000	9,834,038,550	
	第253回利付国債(10年)	9,410,000,000	9,835,426,100	
	第256回利付国債(10年)	9,710,000,000	10,094,516,000	
	第258回利付国債(10年)	9,913,000,000	10,276,311,450	
	第260回利付国債(10年)	9,815,000,000	10,306,437,050	
	第263回利付国債(10年)	11,232,000,000	11,807,976,960	
	第265回利付国債(10年)	10,650,000,000	11,156,620,500	
	第268回利付国債(10年)	5,065,000,000	5,310,095,350	
	第270回利付国債(10年)	5,387,000,000	5,592,945,010	
	第272回利付国債(10年)	5,245,000,000	5,471,216,850	
	第274回利付国債(10年)	5,045,000,000	5,288,471,700	
	第277回利付国債(10年)	4,960,000,000	5,227,443,200	
	第280回利付国債(10年)	5,117,000,000	5,486,959,100	
	第282回利付国債(10年)	4,750,000,000	5,034,192,500	
	第284回利付国債(10年)	5,067,000,000	5,367,169,080	
	第285回利付国債(10年)	4,988,000,000	5,279,498,720	
	第286回利付国債(10年)	5,080,000,000	5,406,999,600	
	第288回利付国債(10年)	5,005,000,000	5,285,079,800	
	第289回利付国債(10年)	4,834,000,000	5,023,879,520	
	第290回利付国債(10年)	5,142,000,000	5,293,586,160	
	第293回利付国債(10年)	5,110,000,000	5,411,541,100	
	第296回利付国債(10年)	5,043,000,000	5,207,099,220	
	第297回利付国債(10年)	5,073,000,000	5,180,801,250	
	第299回利付国債(10年)	3,050,000,000	3,078,700,500	

第300回利付国債(10年)	1,400,000,000	1,437,282,000
第301回利付国債(10年)	5,645,000,000	5,777,262,350
第303回利付国債(10年)	6,395,000,000	6,468,670,400
第305回利付国債(10年)	4,260,000,000	4,254,419,400
第2回利付国債(30年)	570,000,000	592,406,700
第4回利付国債(30年)	300,000,000	336,129,000
第5回利付国債(30年)	290,000,000	290,629,300
第7回利付国債(30年)	549,000,000	557,608,320
第10回利付国債(30年)	985,000,000	784,385,050
第12回利付国債(30年)	500,000,000	486,570,000
第14回利付国債(30年)	1,000,000,000	1,026,620,000
第16回利付国債(30年)	765,000,000	798,415,200
第18回利付国債(30年)	870,000,000	873,471,300
第19回利付国債(30年)	875,000,000	877,808,750
第21回利付国債(30年)	605,000,000	606,470,150
第22回利付国債(30年)	685,000,000	712,550,700
第23回利付国債(30年)	679,000,000	705,888,400
第24回利付国債(30年)	680,000,000	707,091,200
第25回利付国債(30年)	810,000,000	809,327,700
第26回利付国債(30年)	1,073,000,000	1,093,633,790
第27回利付国債(30年)	1,060,000,000	1,101,340,000
第28回利付国債(30年)	1,646,000,000	1,710,901,780
第29回利付国債(30年)	1,402,000,000	1,428,623,980
第30回利付国債(30年)	1,520,000,000	1,516,032,800
第31回利付国債(30年)	1,080,000,000	1,054,490,400
第32回利付国債(20年)	70,000,000	82,493,600
第35回利付国債(20年)	170,000,000	198,432,500
第37回利付国債(20年)	302,000,000	348,976,100
第39回利付国債(20年)	458,000,000	512,135,600
第40回利付国債(20年)	390,000,000	427,163,100
第42回利付国債(20年)	480,000,000	536,712,000
第43回利付国債(20年)	1,370,000,000	1,569,293,900
第46回利付国債(20年)	1,205,000,000	1,300,761,350
第48回利付国債(20年)	1,285,000,000	1,421,878,200
第50回利付国債(20年)	1,018,000,000	1,062,211,740
第52回利付国債(20年)	990,000,000	1,050,657,300
第54回利付国債(20年)	1,265,000,000	1,353,904,200
第56回利付国債(20年)	1,598,000,000	1,669,798,140
第59回利付国債(20年)	1,595,000,000	1,604,282,900
第61回利付国債(20年)	1,575,000,000	1,444,747,500
第64回利付国債(20年)	1,525,000,000	1,556,918,250
第65回利付国債(20年)	1,530,000,000	1,558,136,700
第70回利付国債(20年)	1,970,000,000	2,121,473,300
第72回利付国債(20年)	1,853,000,000	1,921,598,060
第74回利付国債(20年)	2,384,000,000	2,466,224,160
第75回利付国債(20年)	1,800,000,000	1,857,402,000

	第78回利付国債(20年)	1,600,000,000	1,604,752,000	
	第82回利付国債(20年)	1,450,000,000	1,490,208,500	
	第84回利付国債(20年)	1,850,000,000	1,871,349,000	
	第85回利付国債(20年)	2,210,000,000	2,260,233,300	
	第88回利付国債(20年)	2,097,000,000	2,197,383,390	
	第90回利付国債(20年)	1,980,000,000	2,043,261,000	
	第92回利付国債(20年)	2,219,000,000	2,252,595,660	
	第93回利付国債(20年)	2,217,000,000	2,212,765,530	
	第95回利付国債(20年)	2,140,000,000	2,224,016,400	
	第97回利付国債(20年)	2,027,000,000	2,072,972,360	
	第99回利付国債(20年)	1,988,000,000	1,999,669,560	
	第100回利付国債(20年)	1,387,000,000	1,413,491,700	
	第101回利付国債(20年)	1,415,000,000	1,484,207,650	
	第102回利付国債(20年)	2,382,000,000	2,494,692,420	
	第105回利付国債(20年)	2,260,000,000	2,260,000,000	
	第107回利付国債(20年)	2,448,000,000	2,444,695,200	
	第109回利付国債(20年)	2,420,000,000	2,336,582,600	
	第111回利付国債(20年)	2,496,000,000	2,523,356,160	
	第113回利付国債(20年)	4,272,000,000	4,242,565,920	
	第114回利付国債(20年)	683,000,000	677,310,610	
	国債証券 小計	363,992,000,000	375,186,253,520	
地方債証券	第1回東京都公募公債(20年)	100,000,000	96,839,000	
	第1回東京都公募公債(30年)	100,000,000	96,793,000	
	第2回東京都公募公債(3年)	200,000,000	201,820,000	
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	100,760,000	
	第7回東京都公募公債(20年)	100,000,000	102,333,000	
	第8回東京都公募公債(20年)	100,000,000	104,572,000	
	第576回東京都公募公債	100,000,000	101,782,000	
	第577回東京都公募公債	100,000,000	101,865,000	
	第579回東京都公募公債	100,000,000	101,883,000	
	第582回東京都公募公債	100,000,000	102,535,000	
	第583回東京都公募公債	648,500,000	665,562,035	
	第584回東京都公募公債	100,000,000	102,505,000	
	第588回東京都公募公債	100,000,000	102,556,000	
	第596回東京都公募公債	100,000,000	101,085,000	
	第598回東京都公募公債	200,000,000	200,790,000	
	第602回東京都公募公債	200,000,000	207,106,000	
	第603回東京都公募公債	200,000,000	207,932,000	
	第604回東京都公募公債	100,000,000	103,992,000	
	第608回東京都公募公債	600,000,000	626,544,000	
	第610回東京都公募公債	100,000,000	105,577,000	
	第613回東京都公募公債	100,000,000	104,562,000	
	第628回東京都公募公債	100,000,000	104,780,000	
	第629回東京都公募公債	100,000,000	103,968,000	
	第634回東京都公募公債	106,000,000	112,739,480	

第642回東京都公募公債	200,000,000	212,310,000	
第643回東京都公募公債	100,000,000	105,144,000	
第646回東京都公募公債	100,000,000	107,094,000	
第652回東京都公募公債	200,000,000	209,116,000	
第653回東京都公募公債	200,000,000	206,870,000	
第660回東京都公募公債	700,000,000	723,996,000	
第662回東京都公募公債	100,000,000	103,853,000	
第668回東京都公募公債	200,000,000	204,482,000	
平成13年度第1回北海道公募公債	113,800,000	115,611,696	
平成16年度第3回北海道公募公債	100,000,000	104,073,000	
平成17年度第4回北海道公募公債	100,000,000	102,649,000	
平成17年度第9回北海道公募公債	100,000,000	103,559,000	
平成18年度第8回北海道公募公債(5年)	100,000,000	102,035,000	
平成19年度第2回北海道公募公債	100,000,000	105,164,000	
平成19年度第7回北海道公募公債	100,000,000	104,652,000	
平成20年度第4回北海道公募公債	100,000,000	105,330,000	
平成20年度第9回北海道公募公債(5年)	300,000,000	312,504,000	
平成20年度第12回北海道公募公債	100,000,000	102,923,000	
平成20年度第15回北海道公募公債(5年)	200,000,000	204,872,000	
第1回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	108,303,000	
第3回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	101,775,000	
第7回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	101,509,000	
第25回神奈川県公募公債(5年)	400,000,000	408,740,000	
第26回神奈川県公募公債(5年)	100,000,000	102,552,000	
第27回神奈川県公募公債(5年)	100,000,000	102,244,000	
第122回神奈川県公募公債	200,000,000	208,326,000	
第129回神奈川県公募公債	100,000,000	104,681,000	
第143回神奈川県公募公債	100,000,000	105,636,000	
第144回神奈川県公募公債	300,000,000	318,069,000	
第147回神奈川県公募公債	100,000,000	106,952,000	
第149回神奈川県公募公債	100,000,000	105,844,000	
第157回神奈川県公募公債	115,600,000	118,818,304	
第3回大阪府公募公債(7年)	200,000,000	208,244,000	
第26回大阪府公募公債(5年)	200,000,000	203,576,000	
第31回大阪府公募公債(5年)	100,000,000	102,857,000	
第52回大阪府公募公債(5年)	400,000,000	404,572,000	
第261回大阪府公募公債(10年)	105,000,000	108,801,000	
第262回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,262,000	
第267回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,198,000	
第277回大阪府公募公債(10年)	600,000,000	619,776,000	
第299回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	211,658,000	
第303回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	105,937,000	
第306回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	210,026,000	
第313回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,291,000	
平成14年度第2回京都府公募公債	300,000,000	305,583,000	
平成19年度第1回京都府公募公債	130,260,000	137,471,193	

平成14年度第5回兵庫県公募公債	100,000,000	101,150,000	
平成15年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	102,134,000	
平成16年度第12回兵庫県公募公債	100,000,000	103,488,000	
平成17年度第2回兵庫県公募公債	200,000,000	206,798,000	
平成17年度第6回兵庫県公募公債	101,000,000	103,873,450	
平成18年度第2回兵庫県公募公債(5年)	200,000,000	202,792,000	
平成19年度第8回兵庫県公募公債(5年)	100,000,000	102,272,000	
平成20年度第5回兵庫県公募公債	100,000,000	105,451,000	
平成21年度第3回兵庫県公募公債	200,000,000	203,768,000	
平成21年度第11回兵庫県公募公債	200,000,000	204,286,000	
平成21年度第23回兵庫県公募公債	200,000,000	198,222,000	
平成18年度第2回静岡県公募公債	100,000,000	107,157,000	
平成18年度第3回静岡県公募公債(5年)	100,000,000	101,953,000	
平成18年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	106,201,000	
平成19年度第7回静岡県公募公債	100,000,000	105,425,000	
平成20年度第1回静岡県公募公債	200,000,000	204,898,000	
平成20年度第7回静岡県公募公債	100,000,000	103,879,000	
平成21年度第5回静岡県公募公債	300,000,000	298,977,000	
平成14年度第2回愛知県公募公債(10年)	110,000,000	112,860,000	
平成17年度第2回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,258,000	
平成18年度第4回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	105,900,000	
平成19年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	106,204,000	
平成20年度第5回愛知県公募公債(5年)	500,000,000	511,225,000	
平成21年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,587,000	
平成21年度第7回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	203,120,000	
平成19年度第3回広島県公募公債	200,000,000	207,810,000	
平成20年度第1回広島県公募公債	100,000,000	104,969,000	
平成15年度第3回埼玉県公募公債	205,670,000	214,205,305	
平成16年度第3回埼玉県公募公債	100,000,000	105,954,000	
平成16年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	103,765,000	
平成17年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	104,793,000	
平成18年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	106,093,000	
平成19年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	106,591,000	
平成21年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	101,927,000	
平成21年度第4回埼玉県公募公債	200,000,000	201,924,000	
平成18年度第1回福岡県公募公債	100,000,000	107,819,000	
平成19年度第2回福岡県公募公債	100,000,000	107,158,000	
平成20年度第9回福岡県公募公債	200,000,000	202,944,000	
平成16年度第9回千葉県公募公債	100,000,000	104,269,000	
平成18年度第1回千葉県公募公債	200,000,000	214,314,000	
平成18年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	105,883,000	
平成19年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	105,499,000	
平成21年度第2回千葉県公募公債	345,000,000	352,400,250	
平成13年度第1回新潟県公募公債	155,000,000	157,777,600	
平成14年度第1回新潟県公募公債	240,000,000	244,939,200	
平成17年度第1回新潟県公募公債	200,000,000	206,182,000	

平成19年度第1回岐阜県公募公債(10年)	200,000,000	211,738,000	
第1回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,021,000	
第2回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,691,000	
第4回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,350,000	
第6回共同発行市場公募地方債	200,000,000	208,294,000	
第7回共同発行市場公募地方債	319,400,000	330,508,732	
第12回共同発行市場公募地方債	437,000,000	452,784,440	
第15回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,547,000	
第20回共同発行市場公募地方債	300,000,000	312,729,000	
第21回共同発行市場公募地方債	300,000,000	311,307,000	
第22回共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,560,000	
第23回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,284,000	
第27回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,226,000	
第29回共同発行市場公募地方債	300,000,000	311,232,000	
第30回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,352,000	
第31回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,243,000	
第32回共同発行市場公募地方債	300,000,000	314,379,000	
第33回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,763,000	
第35回共同発行市場公募地方債	400,000,000	418,976,000	
第36回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,741,000	
第38回共同発行市場公募地方債	200,000,000	214,314,000	
第40回共同発行市場公募地方債	300,000,000	323,337,000	
第46回共同発行市場公募地方債	200,000,000	211,568,000	
第55回共同発行市場公募地方債	200,000,000	211,600,000	
第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,772,000	
第57回共同発行市場公募地方債	300,000,000	312,600,000	
第62回共同発行市場公募地方債	200,000,000	209,120,000	
第65回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,398,000	
第73回共同発行市場公募地方債	300,000,000	307,260,000	
第75回共同発行市場公募地方債	900,000,000	923,940,000	
第77回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,118,000	
平成13年度第2回大阪市公募公債	100,000,000	101,200,000	
平成14年度第11回大阪市公募公債	100,000,000	101,033,000	
平成17年度第12回大阪市公募公債(5年)	100,000,000	100,836,000	
平成18年度第1回大阪市公募公債(5年)	500,000,000	506,795,000	
平成18年度第2回大阪市公募公債	200,000,000	212,874,000	
平成18年度第3回大阪市公募公債	100,000,000	107,065,000	
平成18年度第6回大阪市公募公債	300,000,000	319,329,000	
平成19年度第5回大阪市公募公債	100,000,000	106,173,000	
平成19年度第10回大阪市公募公債	100,000,000	104,015,000	
平成21年度第4回大阪市公募公債	300,000,000	303,627,000	
第1回名古屋市公募公債(20年)	200,000,000	203,430,000	
第3回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	100,713,000	
第11回名古屋市公募公債(5年)	300,000,000	305,973,000	
第12回ひ号名古屋市公募公債	100,000,000	103,213,000	
第455回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	106,535,000	

	第1回京都市公募公債(30年)	100,000,000	101,388,000	
	第7回京都市公募公債(20年)	100,000,000	102,301,000	
	平成18年度第3回京都市公募公債	200,000,000	212,634,000	
	平成15年度第1回神戸市公募公債	100,000,000	100,515,000	
	平成19年度第10回神戸市公募公債	100,000,000	103,673,000	
	第4回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	100,993,000	
	第9回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	103,995,000	
	第14回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	102,147,000	
	平成17年度第4回横浜市公募公債	200,000,000	208,614,000	
	平成17年度第3回横浜市公募公債	100,000,000	104,814,000	
	平成18年度第4回横浜市公募公債	300,000,000	318,921,000	
	平成18年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	106,645,000	
	平成18年度第3回横浜市公募公債	200,000,000	212,560,000	
	平成20年度第6回横浜市公募公債	200,000,000	203,872,000	
	第22回横浜市公募公債	100,000,000	103,003,000	
	平成13年度第2回札幌市公募公債	200,000,000	203,672,000	
	平成18年度第4回札幌市公募公債	200,000,000	211,816,000	
	第2回川崎市15年公募公債	100,000,000	101,393,000	
	第4回川崎市15年公募公債	100,000,000	104,812,000	
	第19回川崎市公募公債(5年)	100,000,000	103,338,000	
	平成15年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	103,852,000	
	平成19年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	103,827,000	
	平成18年度第4回福岡市公募公債	100,000,000	105,687,000	
	平成18年度第5回福岡市公募公債(5年)	100,000,000	101,820,000	
	平成20年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	102,620,000	
	平成21年度第7回福岡市公募公債	200,000,000	199,718,000	
	平成19年度第1回広島市公募公債	100,000,000	104,479,000	
	平成21年度第1回千葉市公募公債	200,000,000	204,506,000	
	地方債証券 小計	32,332,230,000	33,455,093,685	
特殊債券	第27回韓国産業銀行円貨債券(2007)	100,000,000	100,454,000	
	第1回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	103,450,000	
	第2回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	203,348,000	
	第3回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	206,996,000	
	第5回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	101,848,000	
	第5回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,274,000	
	第9回日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,006,000	
	第10回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,022,000	
	第15回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,135,000	
	第20回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,158,000	
	第20回日本政策投資銀行債券	100,000,000	100,999,000	
	第23回政府保証日本政策投資銀行債券	200,000,000	207,362,000	
	第24回日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,792,000	
	第27回日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,732,000	
	第30回日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,948,000	
	第36回日本政策投資銀行債券	100,000,000	100,058,000	

第46回日本政策投資銀行債券	200,000,000	207,832,000	
第51回日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,889,000	
第1回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	144,000,000	150,557,760	
第2回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,086,000	
第4回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	307,152,000	
第5回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	158,000,000	166,072,220	
第7回道路債券	100,000,000	110,137,000	
第8回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,106,000	
第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,523,000	
第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	103,759,000	
第9回道路債券	100,000,000	106,550,000	
第12回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,528,000	
第16回道路債券	200,000,000	203,532,000	
第17回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	102,000,000	109,720,380	
第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,853,000	
第21回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,256,000	
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	294,786,000	
第23回道路債券	200,000,000	208,288,000	
第23回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,906,000	
第25回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	318,648,000	
第26回道路債券	300,000,000	313,320,000	
第27回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	500,000,000	530,930,000	
第27回道路債券	100,000,000	105,836,000	
第29回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,256,000	
第30回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	210,964,000	
第30回道路債券	100,000,000	104,893,000	
第34回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,420,000	
第36回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	153,000,000	163,413,180	
第37回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	320,265,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,282,000	
第39回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,367,000	
第40回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	320,142,000	
第40回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,713,000	
第41回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	420,836,000	
第42回道路債券	100,000,000	102,432,000	
第44回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,228,000	
第45回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,430,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,196,000	
第48回日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	412,320,000	
第49回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,416,000	
第52回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	208,298,000	
第56回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,906,000	
第58回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	500,000,000	523,705,000	
第60回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,479,000	
第62回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,593,000	
第67回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	207,024,000	

第69回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,459,000	
第81回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	197,286,000	
第88回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	97,847,000	
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	295,272,000	
第313回政府保証道路債券	200,000,000	205,446,000	
第325回政府保証道路債券	100,000,000	103,455,000	
第327回政府保証道路債券	552,000,000	575,780,160	
第329回政府保証道路債券	300,000,000	314,460,000	
第330回政府保証道路債券	100,000,000	105,739,000	
第335回政府保証道路債券	100,000,000	104,061,000	
第336回政府保証道路債券	200,000,000	208,128,000	
第337回政府保証道路債券	100,000,000	103,591,000	
第338回政府保証道路債券	200,000,000	209,168,000	
第339回政府保証道路債券	100,000,000	104,078,000	
第340回政府保証道路債券	100,000,000	102,585,000	
第341回政府保証道路債券	100,000,000	103,578,000	
第346回政府保証道路債券	301,000,000	313,274,780	
第1回政府保証地方公営企業等金融機構債券	300,000,000	310,731,000	
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券	300,000,000	305,868,000	
第1回公営企業債券(5年)	500,000,000	511,155,000	
第2回公営企業債券	100,000,000	102,794,000	
第2回地方公営企業等金融機構債券(20年)	100,000,000	100,670,000	
第3回公営企業債券(20年)	100,000,000	90,792,000	
第5回公営企業債券(20年)	100,000,000	103,095,000	
第6回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	100,531,000	
第6回公営企業債券	100,000,000	100,809,000	
第7回政府保証地方公営企業等金融機構債券	500,000,000	506,575,000	
第7回公営企業債券	400,000,000	414,928,000	
第10回公営企業債券	100,000,000	105,231,000	
第11回公営企業債券(20年)	100,000,000	101,749,000	
第12回公営企業債券	100,000,000	104,277,000	
第15回公営企業債券	100,000,000	103,344,000	
第16回公営企業債券(20年)	100,000,000	100,839,000	
第17回公営企業債券	100,000,000	104,600,000	
第17回公営企業債券(20年)	100,000,000	104,559,000	
第18回公営企業債券(20年)	100,000,000	106,883,000	
第20回公営企業債券	100,000,000	107,406,000	
第22回公営企業債券(20年)	100,000,000	102,398,000	
第24回公営企業債券(20年)	200,000,000	202,740,000	
第30回公営企業債券	100,000,000	106,237,000	
第799回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,469,000	
第801回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,452,000	
第803回政府保証公営企業債券	500,000,000	507,545,000	
第804回政府保証公営企業債券	200,000,000	202,890,000	
第805回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,848,000	
第806回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,931,000	

第809回政府保証公営企業債券	202,000,000	206,496,520	
第810回政府保証公営企業債券	200,000,000	204,684,000	
第813回政府保証公営企業債券	201,000,000	206,453,130	
第815回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,685,000	
第818回政府保証公営企業債券	102,000,000	104,709,120	
第821回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,299,000	
第823回政府保証公営企業債券	200,000,000	203,006,000	
第824回政府保証公営企業債券	600,000,000	609,174,000	
第825回政府保証公営企業債券	500,000,000	507,675,000	
第826回政府保証公営企業債券	300,000,000	303,678,000	
第827回政府保証公営企業債券	200,000,000	201,776,000	
第829回政府保証公営企業債券	500,000,000	512,780,000	
第833回政府保証公営企業債券	200,000,000	208,256,000	
第834回政府保証公営企業債券	200,000,000	208,372,000	
第836回政府保証公営企業債券	300,000,000	310,377,000	
第838回政府保証公営企業債券	100,000,000	104,308,000	
第840回政府保証公営企業債券	200,000,000	209,598,000	
第841回政府保証公営企業債券	100,000,000	105,725,000	
第843回政府保証公営企業債券	100,000,000	104,483,000	
第844回政府保証公営企業債券	400,000,000	419,872,000	
第846回政府保証公営企業債券	100,000,000	104,081,000	
第847回政府保証公営企業債券	100,000,000	104,087,000	
第849回政府保証公営企業債券	100,000,000	104,593,000	
第851回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,571,000	
第852回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,553,000	
第858回政府保証公営企業債券	200,000,000	209,108,000	
第861回政府保証公営企業債券	300,000,000	315,363,000	
第863回政府保証公営企業債券	100,000,000	107,516,000	
第865回政府保証公営企業債券	300,000,000	322,644,000	
第866回政府保証公営企業債券	200,000,000	215,130,000	
第875回政府保証公営企業債券	200,000,000	210,824,000	
第883回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,530,000	
第884回政府保証公営企業債券	300,000,000	307,347,000	
第885回政府保証公営企業債券	200,000,000	209,452,000	
第886回政府保証公営企業債券	200,000,000	210,926,000	
第3回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	102,607,000	
第187回政府保証首都高速道路債券	193,000,000	201,013,360	
第195回政府保証首都高速道路債券	400,000,000	416,140,000	
第197回政府保証首都高速道路債券	300,000,000	313,644,000	
第199回政府保証首都高速道路債券	200,000,000	208,052,000	
第4回阪神高速道路債券	200,000,000	203,226,000	
第17回中小企業債券	100,000,000	101,457,000	
第23回中小企業債券	100,000,000	102,983,000	
第24回中小企業債券	200,000,000	203,482,000	
第150回政府保証中小企業債券	271,000,000	274,932,210	
第157回政府保証中小企業債券	200,000,000	202,904,000	

第165回政府保証中小企業債券	100,000,000	102,691,000	
第2回日本鉄道建設債券	100,000,000	103,186,000	
第2回国際協力銀行債券	500,000,000	509,405,000	
第6回国際協力銀行債券	100,000,000	102,217,000	
第10回国際協力銀行債券	300,000,000	311,184,000	
第15回国際協力銀行債券	200,000,000	210,118,000	
第21回国際協力銀行債券	100,000,000	104,530,000	
第27回国際協力銀行債券	100,000,000	105,329,000	
第7回政府保証都市再生債券	100,000,000	100,834,000	
第8回都市再生債券	200,000,000	208,358,000	
第9回政府保証都市再生債券	300,000,000	304,044,000	
第17回政府保証都市再生債券	500,000,000	503,260,000	
第18回政府保証都市再生債券	400,000,000	401,620,000	
第19回都市再生債券	100,000,000	106,345,000	
第27回都市再生債券	300,000,000	306,030,000	
第3回本州四国連絡橋債券	100,000,000	105,986,000	
第7回本州四国連絡橋債券	100,000,000	102,696,000	
第332回東京交通債券	100,000,000	111,030,000	
第338回東京交通債券	100,000,000	101,678,000	
第342回東京交通債券	100,000,000	107,519,000	
第35回政府保証電源開発債券	600,000,000	611,652,000	
第13回関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	100,106,000	
第16回関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	100,840,000	
第38回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	102,565,000	
第51回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	104,675,000	
第14回独立行政法人福祉医療機構債券	200,000,000	213,164,000	
第17回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	105,986,000	
第105回政府保証預金保険機構債券	100,000,000	101,231,000	
第127回政府保証預金保険機構債券	100,000,000	101,415,000	
第143回政府保証預金保険機構債券	100,000,000	101,656,000	
第153回政府保証預金保険機構債券	100,000,000	102,321,000	
第1回貸付債権担保住宅金融公庫債券	71,716,000	72,664,802	
第1回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	110,120,000	108,851,417	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	143,802,000	146,686,668	
第2回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	113,432,000	112,737,796	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	221,547,000	228,736,200	
第3回貸付債権担保住宅金融公庫債券	39,402,000	39,980,421	
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	56,651,000	57,044,724	
第4回貸付債権担保住宅金融公庫債券	43,403,000	43,819,234	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,043,000	87,112,250	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	232,914,000	236,540,470	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	60,139,000	60,213,572	
第6回貸付債権担保住宅金融公庫債券	94,474,000	95,989,362	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	65,203,000	67,217,772	
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	196,803,000	202,793,683	
第7回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	80,444,000	81,444,723	

第 8 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	48,345,000	48,234,773
第 8 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	201,102,000	206,024,976
第 8 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,594,000
第 9 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	135,040,000	138,717,139
第 9 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	84,752,000	87,124,208
第 1 0 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	50,311,000	49,315,848
第 1 0 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	207,141,000	212,325,739
第 1 0 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	87,634,000	89,151,820
第 1 1 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	88,818,000	90,541,069
第 1 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	56,323,000	56,040,258
第 1 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	92,582,000	93,914,254
第 1 4 回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	210,422,000
第 1 6 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	189,414,000	191,060,007
第 1 7 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	194,440,000	196,783,002
第 2 1 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,310,000
第 2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	190,964,000	198,522,355
第 2 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	206,104,000
第 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	289,632,000	296,458,626
第 2 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,760,000	98,382,665
第 2 8 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	69,542,000	69,389,007
第 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,874,000	98,961,380
第 2 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	73,672,000	73,715,466
第 2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,740,000	99,517,083
第 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,874,000	99,821,212
第 3 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	75,678,000	75,410,099
第 3 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	77,097,000	76,825,618
第 3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	199,648,000	199,154,869
第 3 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	76,784,000	76,043,034
第 3 4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	157,172,000	157,143,709
第 3 5 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	78,754,000	78,540,576
第 3 6 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	77,720,000	78,009,118
第 3 8 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	155,838,000	156,783,936
第 3 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	78,539,000	78,578,269
第 4 0 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	154,774,000	155,879,086
第 4 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	79,518,000	80,938,191
第 4 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	156,680,000	162,162,233
第 4 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	157,454,000	162,300,434
第 4 4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	78,792,000	81,334,617
第 5 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	82,476,000	84,513,157
第 5 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	83,731,000	85,085,767
第 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	168,050,000	172,503,325
第 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	167,794,000	172,750,634
第 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,945,000	76,481,372
第 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,465,000	87,546,927
第 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	157,690,000	159,300,014
第 1 5 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	186,628,000	188,785,419

第27回国民生活債券	300,000,000	307,017,000	
第36回国民生活債券	100,000,000	102,283,000	
第6回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	104,657,000	
第10回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	108,513,000	
第1回新東京国際空港債券	300,000,000	306,294,000	
第3回新東京国際空港債券	100,000,000	102,839,000	
第4回政府保証新東京国際空港債券	100,000,000	102,549,000	
第5回新東京国際空港債券	100,000,000	104,467,000	
第7回日本学生支援債券	300,000,000	306,303,000	
第3回沖縄振興開発金融公庫債券	200,000,000	208,674,000	
第5回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	103,416,000	
い第669号商工債券	100,000,000	100,863,000	
い第682号商工債	300,000,000	306,198,000	
い第687号商工債	200,000,000	206,270,000	
い第703号商工債	200,000,000	206,950,000	
い第711号商工債	100,000,000	101,693,000	
い第712号商工債	100,000,000	101,006,000	
い第670号農林債券	100,000,000	100,883,000	
い第671号農林債券	100,000,000	101,404,000	
い第675号農林債	100,000,000	101,880,000	
い第679号農林債	200,000,000	203,980,000	
い第681号農林債	100,000,000	102,036,000	
い第682号農林債	200,000,000	203,792,000	
い第684号農林債	100,000,000	102,130,000	
い第687号農林債	100,000,000	102,903,000	
い第690号農林債	400,000,000	409,136,000	
い第695号農林債	200,000,000	203,978,000	
い第696号農林債	500,000,000	514,055,000	
い第697号農林債	200,000,000	206,354,000	
い第698号農林債	100,000,000	103,217,000	
い第704号農林債	200,000,000	205,348,000	
い第708号農林債	300,000,000	306,291,000	
い第714号農林債	400,000,000	403,600,000	
第597回あおぞら債	100,000,000	101,247,000	
第195回しんきん中金債券	50,000,000	50,406,000	
第197回しんきん中金債券	100,000,000	101,488,000	
第201回信金中金債(5年)	200,000,000	203,944,000	
第203回信金中金債(5年)	100,000,000	101,923,000	
第209回信金中金債(5年)	100,000,000	102,180,000	
第215回信金中金債(5年)	200,000,000	205,814,000	
第216回信金中金債(5年)	200,000,000	204,820,000	
第218回信金中金債(5年)	300,000,000	306,648,000	
第221回信金中金債(5年)	100,000,000	102,149,000	
第225回信金中金債(5年)	200,000,000	205,462,000	
第227回信金中金債(5年)	100,000,000	103,179,000	
第228回信金中金債(5年)	400,000,000	413,608,000	

	第229回信金中金債(5年)	300,000,000	309,684,000	
	第230回信金中金債(5年)	100,000,000	102,679,000	
	第231回信金中金債(5年)	100,000,000	103,068,000	
	い第676号みずほコーポレート銀行債券	100,000,000	100,564,000	
	第99号商工債(3年)	500,000,000	504,310,000	
	第100号商工債(3年)	300,000,000	303,294,000	
	第101号商工債(3年)	200,000,000	202,464,000	
	第104号商工債(3年)	500,000,000	507,235,000	
	第108号商工債(3年)	500,000,000	507,685,000	
	第110号商工債(3年)	200,000,000	203,506,000	
	第113号商工債(3年)	300,000,000	303,642,000	
	第2回韓国中小企業銀行	100,000,000	99,388,000	
	第1回政府保証東日本高速道路債券	137,000,000	144,004,810	
	第3回政府保証東日本高速道路債券	100,000,000	107,503,000	
	第5回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	201,568,000	
	第1回政府保証中日本高速道路債券	250,000,000	262,782,500	
	第1回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	104,011,000	
	第3回政府保証中日本高速道路債券	163,000,000	171,270,620	
	第5回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	209,364,000	
	第6回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	103,364,000	
	第10回政府保証中日本高速道路債券	100,000,000	106,238,000	
	第12回政府保証中日本高速道路債券	103,000,000	109,344,800	
	第14回政府保証中日本高速道路債券	100,000,000	106,797,000	
	第19回政府保証中日本高速道路債券	124,000,000	128,224,680	
	第21回政府保証中日本高速道路債券	200,000,000	209,448,000	
	第25回政府保証中日本高速道路債券	200,000,000	203,828,000	
	第5回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,784,000	
	第8回政府保証西日本高速道路債券	233,000,000	245,595,980	
	第15回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	105,455,000	
	第19回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	101,274,000	
	第5回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	206,986,000	
	第18回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	205,214,000	
	第1回緑資源債券	100,000,000	102,004,000	
	第3回東京地下鉄株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	212,666,000	
	特殊債券 小計	55,916,280,000	57,550,652,595	
社債券	第9回株式会社ポスコ円貨社債(2006)	200,000,000	201,552,000	
	第1回メリルリンチ・アンド・カンパニー・インク	200,000,000	180,692,000	
	第13回メリルリンチ・アンド・カンパニー・インク	100,000,000	99,593,000	
	第14回メリルリンチ・アンド・カンパニー・インク	100,000,000	99,715,000	
	第7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	200,000,000	199,430,000	
	第11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	98,392,000	
	第13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	400,000,000	400,028,000	
	第1回ジェイ・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニー	100,000,000	98,671,000	
	第2回ジェイ・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニー	100,000,000	97,488,000	
	第3回ジェイ・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニー	200,000,000	193,348,000	

第4回ジェイ・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニー	100,000,000	100,913,000	
第5回ジェー・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニー	100,000,000	100,112,000	
第2回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク	200,000,000	201,102,000	
第8回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク	100,000,000	100,402,000	
第9回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク	100,000,000	101,304,000	
第10回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク	100,000,000	96,896,000	
第11回シティグループ・インク円貨社債(2003)	200,000,000	187,446,000	
第14回シティグループ・インク円貨債券	400,000,000	397,840,000	
第17回シティグループ・インク円貨債券	100,000,000	79,488,000	
第22回シティグループ・インク円貨債券	300,000,000	288,798,000	
第7回ザ・ベアー・スターズ・カンパニーズ・インク	200,000,000	201,862,000	
第1回バンク・オブ・アメリカ・コーポレーション	100,000,000	90,805,000	
第3回バンク・オブ・アメリカ・コーポレーション	200,000,000	199,116,000	
第5回バンク・オブ・アメリカ・コーポレーション	100,000,000	99,549,000	
第6回バンク・オブ・アメリカ・コーポレーション	100,000,000	98,925,000	
第1回テレフォニカ・エセ・アー保証テレフォニカ・ヨーロッパ・ビー・ヴィ	100,000,000	101,093,000	
H S B C 銀行 P L C 第1回円貨社債	200,000,000	202,892,000	
第1回キリンホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	305,784,000	
第2回サントリーホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,040,000	
第19回味の素株式会社無担保社債	100,000,000	103,201,000	
第4回日本たばこ産業株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	206,276,000	
第23回王子製紙株式会社無担保社債	100,000,000	101,411,000	
第6回株式会社日本製紙グループ本社無担保社債	100,000,000	100,911,000	
第24回住友化学工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,016,000	
第25回住友化学工業株式会社無担保社債	100,000,000	103,680,000	
第31回住友化学株式会社無担保社債	100,000,000	100,044,000	
第38回住友化学株式会社無担保社債	100,000,000	103,198,000	
第35回三菱化学株式会社無担保社債	100,000,000	105,335,000	
第22回三井化学株式会社無担保社債	200,000,000	202,600,000	
第35回三井化学株式会社無担保社債	100,000,000	104,168,000	
第26回新日本石油株式会社無担保社債	200,000,000	214,540,000	
第4回株式会社ブリヂストン無担保社債	200,000,000	202,308,000	
第16回住友ゴム工業株式会社無担保社債	100,000,000	105,686,000	
第12回旭硝子株式会社無担保社債	200,000,000	208,548,000	
第30回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	114,320,000	
第48回新日本製鐵株式会社無担保社債	200,000,000	204,092,000	
第49回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	100,888,000	
第55回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	103,066,000	
第47回住友金属工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,628,000	
第52回住友金属工業株式会社無担保社債	100,000,000	103,031,000	
第4回株式会社神戸製鋼所無担保社債	100,000,000	105,168,000	
第46回株式会社神戸製鋼所無担保社債	100,000,000	103,519,000	
第9回ジェイ エフ イー ホールディングス株式会社	100,000,000	102,337,000	
第11回ジェイ エフ イー ホールディングス株式会社	100,000,000	102,466,000	
第11回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	101,860,000	

第15回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	104,399,000	
第18回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	105,501,000	
第12回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	100,448,000	
第38回日本電気株式会社無担保社債	100,000,000	102,116,000	
第24回富士通株式会社無担保社債	200,000,000	204,868,000	
第6回パナソニック株式会社無担保社債	300,000,000	304,767,000	
第7回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	103,114,000	
第21回シャープ株式会社無担保社債	100,000,000	101,597,000	
第9回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	100,945,000	
第12回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	101,799,000	
第18回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	100,056,000	
第21回ソニー株式会社無担保社債	200,000,000	202,824,000	
第22回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	103,010,000	
第26回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	104,862,000	
第5回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	102,975,000	
第20回三菱重工工業株式会社無担保社債	100,000,000	102,728,000	
第22回三菱重工工業株式会社無担保社債	100,000,000	105,976,000	
第44回日産自動車株式会社無担保社債	300,000,000	300,279,000	
第7回トヨタ自動車株式会社無担保社債	400,000,000	411,560,000	
第9回トヨタ自動車株式会社無担保社債	300,000,000	305,283,000	
第5回アイシン精機株式会社無担保社債	100,000,000	102,728,000	
第3回凸版印刷株式会社無担保社債	100,000,000	103,074,000	
第43回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	105,887,000	
第57回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	101,085,000	
第63回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	101,794,000	
第61回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	104,504,000	
第63回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	100,244,000	
第23回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,446,000	
第25回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,358,000	
第30回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	104,303,000	
第67回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,926,000	
第69回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	105,214,000	
第72回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,690,000	
第32回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	97,472,000	
第6回株式会社三菱東京フィナンシャル・グループ	100,000,000	100,084,000	
第10回株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ	100,000,000	100,628,000	
第2回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	105,212,000	
第2回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	400,000,000	407,792,000	
第3回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	300,000,000	305,451,000	
第4回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	200,000,000	203,826,000	
第6回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	200,000,000	205,612,000	
第7回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	200,000,000	211,200,000	
第8回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	101,589,000	
第15回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	200,000,000	205,240,000	
第16回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	400,000,000	409,052,000	
第9回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	109,700,000	

第11回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	200,000,000	213,676,000	
株式会社三菱東京UFJ銀行第12回無担保社債	200,000,000	211,092,000	
第19回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	200,000,000	201,552,000	
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	200,000,000	202,628,000	
第56回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	102,523,000	
第72回株式会社東京三菱銀行無担保社債	100,000,000	103,651,000	
第84回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	300,000,000	305,403,000	
第85回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	101,979,000	
第89回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	200,000,000	200,904,000	
第90回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	102,956,000	
第92回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	400,000,000	411,740,000	
第95回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	102,189,000	
第100回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	200,000,000	206,064,000	
第103回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	200,000,000	202,998,000	
第104回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	103,230,000	
第105回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	100,644,000	
第110回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	99,621,000	
第4回株式会社りそな銀行無担保社債	200,000,000	211,360,000	
第2回株式会社ふくおかフィナンシャルグループ無担保社債	100,000,000	101,358,000	
第11回株式会社静岡銀行無担保社債	100,000,000	102,602,000	
第7回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	102,927,000	
第8回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	95,228,000	
中央三井信託銀行第3回無担保社債	100,000,000	104,576,000	
第4回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	102,042,000	
第5回株式会社三井住友銀行無担保社債	300,000,000	314,562,000	
第7回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	104,824,000	
第8回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	104,940,000	
第9回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	103,874,000	
第32回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	100,161,000	
第36回株式会社三井住友銀行無担保社債	200,000,000	203,622,000	
第37回株式会社三井住友銀行無担保社債	200,000,000	203,764,000	
第39回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	102,106,000	
第42回株式会社三井住友銀行無担保社債	200,000,000	203,974,000	
第43回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	102,293,000	
第45回株式会社三井住友銀行無担保社債	200,000,000	205,284,000	
第8回株式会社みずほ銀行無担保社債	200,000,000	207,560,000	
第9回株式会社みずほ銀行無担保社債	100,000,000	96,856,000	
第10回株式会社みずほ銀行無担保社債	100,000,000	103,414,000	
第30回エヌ・ティ・ティ・リース株式会社無担保社債	100,000,000	101,420,000	
第32回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	103,053,000	
第9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	100,517,000	
第8回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	101,485,000	
第11回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	101,417,000	
第17回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	101,567,000	
第21回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	106,437,000	
第26回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	102,137,000	

第34回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	203,096,000	
第43回アコム株式会社無担保社債	100,000,000	98,806,000	
第50回アコム株式会社無担保社債	100,000,000	90,075,000	
第18回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,472,000	
第36回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	101,271,000	
第111回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	98,464,000	
第113回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	88,830,000	
第115回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	98,113,000	
第6回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	101,524,000	
第6回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	101,536,000	
第2回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,028,000	
第3回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,554,000	
第5回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	202,674,000	
第7回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,120,000	
第13回野村ホールディングス株式会社無担保社債	500,000,000	511,285,000	
第15回野村ホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	313,161,000	
第28回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	103,368,000	
第58回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	104,641,000	
第65回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	89,817,000	
第66回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	100,886,000	
第87回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	104,104,000	
第53回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,692,000	
第58回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	101,364,000	
第63回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	106,471,000	
第42回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	105,779,000	
第2回東日本旅客鉄道株式会社社債	200,000,000	241,840,000	
第7回東日本旅客鉄道株式会社社債	200,000,000	232,234,000	
第9回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	114,766,000	
第15回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	111,051,000	
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	200,000,000	214,782,000	
第34回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,892,000	
第52回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	103,677,000	
第3回西日本旅客鉄道株式会社社債	200,000,000	233,070,000	
第5回西日本旅客鉄道株式会社社債	200,000,000	228,386,000	
第3回東海旅客鉄道株式会社普通社債	100,000,000	112,719,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	105,486,000	
第11回東海旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	92,932,000	
第19回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	204,896,000	
第21回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	105,247,000	
第28回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	106,276,000	
第41回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,084,000	
第42回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	202,336,000	
第43回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	101,498,000	
第48回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	104,622,000	
第51回日本電信電話株式会社電信電話債券	300,000,000	322,206,000	
第53回日本電信電話株式会社電信電話債券	300,000,000	309,633,000	

第56回日本電信電話株式会社電信電話債券	300,000,000	305,928,000	
第6回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	103,256,000	
第8回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	102,872,000	
第15回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	103,848,000	
第7回株式会社エヌ・ティ・ティ・ドコモ無担保社債	100,000,000	101,291,000	
第15回株式会社エヌ・ティ・ティ・ドコモ無担保社債	200,000,000	211,258,000	
第425回東京電力株式会社社債	100,000,000	119,445,000	
第483回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	101,512,000	
第485回東京電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	203,014,000	
第506回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	100,888,000	
第514回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	104,524,000	
第515回東京電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	207,870,000	
第516回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,863,000	
第522回東京電力株式会社社債(一般担保付)	300,000,000	322,422,000	
第524回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	105,662,000	
第526回東京電力株式会社社債(一般担保付)	300,000,000	316,413,000	
第527回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	104,099,000	
第528回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	104,980,000	
第532回東京電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	210,084,000	
第533回東京電力株式会社社債(一般担保付)	500,000,000	522,275,000	
第535回東京電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	210,160,000	
第537回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,277,000	
第538回東京電力株式会社社債(一般担保付)	400,000,000	402,508,000	
第541回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,228,000	
第544回東京電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	212,744,000	
第545回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	105,288,000	
第546回東京電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	208,334,000	
第547回東京電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	208,742,000	
第552回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,755,000	
第406回中部電力株式会社社債	200,000,000	231,800,000	
第408回中部電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	116,563,000	
第409回中部電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	237,296,000	
第455回中部電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	203,592,000	
第469回中部電力株式会社社債	100,000,000	103,883,000	
第471回中部電力株式会社社債	300,000,000	309,672,000	
第474回中部電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	105,203,000	
第475回中部電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	214,544,000	
第486回中部電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	207,896,000	
第432回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,628,000	
第433回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,292,000	
第440回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,808,000	
第449回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	108,173,000	
第451回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	106,154,000	
第453回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	106,098,000	
第459回関西電力株式会社社債(一般担保付)	300,000,000	307,620,000	
第465回関西電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	208,442,000	

第466回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,535,000	
第467回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,691,000	
第472回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	104,547,000	
第306回中国電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	234,654,000	
第310回中国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	115,549,000	
第340回中国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	100,742,000	
第349回中国電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	211,700,000	
第273回北陸電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,694,000	
第279回北陸電力株式会社社債(一般担保付)	30,000,000	31,344,000	
第284回北陸電力株式会社社債(一般担保付)	400,000,000	419,780,000	
第286回北陸電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	105,704,000	
第368回東北電力株式会社社債(一般担保付)	450,000,000	529,020,000	
第372回東北電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	241,702,000	
第376回東北電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	116,413,000	
第408回東北電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,630,000	
第431回東北電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	107,099,000	
第444回東北電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,792,000	
第445回東北電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	104,563,000	
第229回四国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	117,643,000	
第245回四国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	104,044,000	
第253回四国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	90,229,000	
第268回四国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,685,000	
第346回九州電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	106,326,000	
第372回九州電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	202,154,000	
第380回九州電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	105,246,000	
第384回九州電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,250,000	
第394回九州電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	105,850,000	
第400回九州電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,856,000	
第405回九州電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	104,563,000	
第408回九州電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,926,000	
第258回北海道電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	237,970,000	
第268回北海道電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,148,000	
第295回北海道電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	208,156,000	
第299回北海道電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	205,490,000	
第300回北海道電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,860,000	
第11回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,238,000	
第14回電源開発株式会社無担保社債	200,000,000	208,558,000	
第19回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	106,272,000	
第21回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	104,307,000	
第23回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	104,908,000	
第17回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	222,874,000	
第25回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	104,424,000	
第18回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	192,916,000	
第22回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	105,629,000	
第27回東邦瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	91,641,000	
第30回東邦瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	107,365,000	

	第20回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	500,000,000	510,250,000	
	社債券 小計	42,380,000,000	43,845,906,000	
	合計		510,037,905,800	

## 「外国株式インデックス・マザーファンド」の状況

## (1) 貸借対照表

対象年月日	(平成21年2月18日現在)	(平成22年2月18日現在)
科目	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	625,516,278	449,031,802
コール・ローン	2,678,593,226	1,192,585,849
株式	150,188,986,086	232,698,461,859
新株予約権証券	-	162,927
投資証券	1,861,627,300	3,725,678,832
派生商品評価勘定	-	38,611,709
未収入金	3,767	429,523,927
未収配当金	333,032,783	391,027,598
未収利息	1,467	1,633
差入委託証拠金	1,622,063,511	558,407,050
流動資産合計	157,309,824,418	239,483,493,186
資産合計	157,309,824,418	239,483,493,186
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	281,905,049	2,628,558
未払金	-	1,046,642,058
未払解約金	63,256,997	3,466,000
流動負債合計	345,162,046	1,052,736,616
負債合計	345,162,046	1,052,736,616
純資産の部		
元本等		
1 元本		
元本	187,764,946,274	194,883,523,384
元本合計	187,764,946,274	194,883,523,384
2 剰余金		
剰余金又は欠損金( )	30,800,283,902	43,547,233,186
剰余金合計	30,800,283,902	43,547,233,186
元本等合計	156,964,662,372	238,430,756,570
純資産合計	156,964,662,372	238,430,756,570
負債・純資産合計	157,309,824,418	239,483,493,186

(注) 「外国株式インデックス・マザーファンド」は、毎年11月30日（ただし、休業日の場合は翌営業日）に決算を行います。上記の貸借対照表は平成21年2月18日ならびに平成22年2月18日現在における同マザーファンドの状況です。

## (2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自平成20年2月19日 至平成21年2月18日	自平成21年2月19日 至平成22年2月18日
1. 有価証券の評価基準及び 評価方法	株式・投資証券（売買目的有価証券） 移動平均法に基づき、原則として時価で 評価しております。時価評価にあたって は、取引所または店頭市場における最終 相場（最終相場のないものについては、 それに準じる価額）、または金融商品取 引業者等から提示される気配相場に基づ いて評価しております。	株式・新株予約権証券・投資証券（売買 目的有価証券） 同左
2. デリバティブの評価基準 及び評価方法	(1)先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価 しております。時価評価にあたっては、原 則として、計算日に知りうる直近の日の 主たる取引所の発表する清算値段または 最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価 しております。時価評価にあたっては、原 則として、わが国における対顧客先物売 買相場の仲値によっております。	(1)先物取引 同左  (2)為替予約取引 同左
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日 において、その金額が確定しているもの については当該金額、未だ確定してい ない場合には入金日基準で計上して おります。	受取配当金の計上基準 同左
4. その他財務諸表作成のた めの基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」 第60条および第61条に基づいて処理 しております。	外貨建資産等の会計処理 同左

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成21年2月18日現在)	(平成22年2月18日現在)
1. 受益権総数	平成21年2月18日現在における受益権の 総数 187,764,946,274口	平成22年2月18日現在における受益権の 総数 194,883,523,384口
2. 元本の欠損	「投資信託財産の計算に関する規則」第 55条の6第10号に規定する額 30,800,283,902円	
3. 1単位当たり純資産額	0.8360円 (1万口 = 8,360円)	1.2235円 (1万口 = 12,235円)

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ．取引の状況に関する事項

項目	自平成20年2月19日 至平成21年2月18日	自平成21年2月19日 至平成22年2月18日
1．取引の内容	<p>当ファンドの行うことのできるデリバティブ取引は、次の通りです。</p> <p>a．わが国の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。</p> <p>b．わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引。</p> <p>c．わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。</p> <p>異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（「スワップ取引」）。</p> <p>金利先渡取引および為替先渡取引。</p> <p>外国為替の売買の予約取引。</p>	同左
2．取引に対する取組方針	デリバティブ取引につきましては信託約款等に従っており、その制限を遵守しております。	同左
3．取引の利用目的	信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため。	同左
4．取引に係るリスクの内容	デリバティブ取引に伴いファンドに影響を与える主なリスクとしてマーケットリスクがあげられます。マーケットリスクについては、ポジションや時価、予想損失額の把握が重要だと考えております。	同左
5．取引に係るリスクの管理体制	リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理ならびにコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。	同左
6．取引の時価等に関する事項についての補足説明	該当事項はありません。	同左

## . 取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

## 株式関連

(平成21年2月18日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	S P 5 0 0	3,268,494,051 (35,423,150米ドル)	( )	3,080,710,760 (33,388,000米ドル)	187,783,291 ( 203,150米ドル)
	D J E U R	1,278,878,608 (11,005,840ユーロ)	( )	1,206,895,032 (10,386,360ユーロ)	71,983,576 ( 619,480ユーロ)
	F T S E	590,675,108 (4,490,460英ポンド)	( )	568,536,926 (4,322,160英ポンド)	22,138,182 ( 168,300英ポンド)
買建 合計		5,138,047,767		4,856,142,718	281,905,049

(平成22年2月18日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	S P 5 0 0	1,151,346,704 (12,643,825米ドル)	( )	1,176,522,517 (12,920,300米ドル)	25,175,813 (276,475米ドル)
	D J E U R	463,861,237 (3,753,530ユーロ)	( )	470,520,963 (3,807,420ユーロ)	6,659,726 (53,890ユーロ)
	F T S E	226,927,223 (1,591,355英ポンド)	( )	232,169,912 (1,628,120英ポンド)	5,242,689 (36,765英ポンド)
買建 合計		1,842,135,164		1,879,213,392	37,078,228

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については以下のように評価しております。

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

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

## 通貨関連

(平成21年2月18日現在)

平成21年2月18日現在、通貨関連取引は行っておりません。

(平成22年2月18日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益	
			うち1年超			
市場外取引	為替予約取引					
	売 建					
	米ドル	318,747,800	-	318,675,000	72,800	
	ユーロ	105,087,795	-	105,034,500	53,295	
	英ポンド	89,827,920	-	89,831,700	3,780	
	オーストラリアドル	3,777,257	-	3,767,561	9,696	
	買 建					
	米ドル	567,326,554	-	566,890,724	435,830	
	カナダドル	59,861,380	-	59,771,983	89,397	
	ユーロ	168,817,712	-	168,544,920	272,792	
	英ポンド	114,130,472	-	113,938,696	191,776	
	スイスフラン	39,348,491	-	39,306,551	41,940	
	スウェーデンクローナ	22,399,866	-	22,366,139	33,727	
	デンマーククローネ	5,360,040	-	5,347,469	12,571	
	オーストラリアドル	48,603,131	-	48,478,370	124,761	
	香港ドル	11,662,151	-	11,647,343	14,808	
	シンガポールドル	10,240,004	-	10,230,518	9,486	
		売建 合計	517,440,772	-	517,308,761	132,011
		買建 合計	1,047,749,801	-	1,046,522,713	1,227,088

(注) 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法について

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

(関連当事者との取引に関する注記)

(自 平成20年2月19日 至 平成21年2月18日)

該当事項はありません。

(自 平成21年2月19日 至 平成22年2月18日)

該当事項はありません。

(その他の注記)

(平成21年2月18日現在)	
本有価証券報告書における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	112,264,969,226円
同期中における追加設定元本額	86,349,942,841円
同期中における一部解約元本額	10,849,965,793円
平成21年2月18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	934,786,714円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	109,343,491円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	512,763,563円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	281,563,991円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	1,359,395円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	104,021円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	157,474円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	192,589円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	202,987円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	220,498円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	290,962円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	52,846,847,994円
バランスファンドVA(安定運用型) <適格機関投資家限定>	843,561,877円
SMAM・外国株式インデックスファンド<適格機関投資家限定>	8,430,323,874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>	31,556,885,640円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	14,183,085,656円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	8,497,500,681円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	33,041,826,238円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	110,837,641円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	477,285,281円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	101,102,523円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	2,780,464,614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>	202,837,818円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	660,138,461円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	3,435,059,363円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	5,908,878,742円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	8,889,776,005円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,590,252,672円
三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,607,572,065円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	4,097,874,870円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	648,219,581円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	1,336,844,740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)	4,676,784,253円
合計	187,764,946,274円

(平成22年2月18日現在)

本有価証券報告書における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	187,764,946,274円
同期中における追加設定元本額	67,252,196,722円
同期中における一部解約元本額	60,133,619,612円
平成22年2月18日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	1,844,220,843円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	118,272,751円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	570,347,386円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	341,075,355円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	5,963,915円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	1,211,543円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	203,704円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	1,992,506円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	301,294円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	169,360円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	667,693円
外国株式指数ファンド	47,519,465円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	40,808,629,738円
バランスファンドVA(安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	566,869,543円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型 < 適格機関投資家限定 >	23,380,371,305円
SMAM・バランスファンドVA25 < 適格機関投資家専用 >	10,825,992,541円
SMAM・バランスファンドVA37.5 < 適格機関投資家専用 >	6,937,639,979円
SMAM・バランスファンドVA50 < 適格機関投資家専用 >	27,157,657,977円
SMAM・バランスファンドVL30 < 適格機関投資家限定 >	83,399,057円
SMAM・バランスファンドVL50 < 適格機関投資家限定 >	358,658,455円
世界6資産バランスファンドVA < 適格機関投資家限定 >	76,802,257円
SMAM・バランスファンドVA75 < 適格機関投資家専用 >	2,953,130,883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 >	171,896,892円
SMAM・インデックス・バランスVA25 < 適格機関投資家専用 >	516,547,017円
SMAM・インデックス・バランスVA50 < 適格機関投資家専用 >	2,976,707,530円
SMAM・バランスファンドVA40 < 適格機関投資家専用 >	4,685,643,303円
SMAM・バランスファンドVA35 < 適格機関投資家専用 >	9,008,829,272円
SMAM・バランスVA株40T < 適格機関投資家限定 >	1,260,322,794円
三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	2,314,783,710円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	9,860,892,684円
SMAM・グローバルバランス40VA < 適格機関投資家限定 >	665,564,822円
SMAM・バランスファンドVA20 < 適格機関投資家専用 >	2,893,192,905円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	42,787,473,943円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A < 適格機関投資家専用 >	97,451,371円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A < 適格機関投資家専用 >	58,721,176円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A < 適格機関投資家専用 >	24,153,726円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L < 適格機関投資家専用 >	288,763,640円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L < 適格機関投資家専用 >	661,182,172円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T < 適格機関投資家専用 >	530,298,877円
合計	194,883,523,384円

## (3) 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

銘柄	株数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル				
ALPHA NATURAL RESOURCES INC	16,100	46.48	748,328.00	
ANADARKO PETROLEUM CORP	67,414	68.81	4,638,757.34	
APACHE CORPORATION	45,807	103.57	4,744,230.99	
ARCH COAL INC	22,977	22.50	516,982.50	
BAKER HUGHES INC	42,513	48.05	2,042,749.65	
BJ SERVICES CO	41,317	21.81	901,123.77	
CABOT OIL & GAS CORPORATION	14,620	40.39	590,501.80	
CAMERON INTERNATIONAL CORP	33,612	41.16	1,383,469.92	
CHESAPEAKE ENERGY CORPORATION	83,215	26.36	2,193,547.40	
CHEVRON CORPORATION	276,407	72.84	20,133,485.88	
CIMAREX ENERGY CO	10,800	57.01	615,708.00	
CONOCOPHILLIPS	194,196	49.30	9,573,862.80	
CONSOL ENERGY INC	24,962	50.13	1,251,345.06	
DENBURY RESOURCES INC	36,254	15.10	547,435.40	
DEVON ENERGY CORPORATION	57,894	69.79	4,040,422.26	
DIAMOND OFFSHORE DRILLING, INC.	9,856	87.82	865,553.92	
EL PASO CORPORATION	99,320	10.47	1,039,880.40	
EOG RESOURCES INC	34,708	92.86	3,222,984.88	
EXXON MOBIL CORPORATION	662,112	65.76	43,540,485.12	
FMC TECHNOLOGIES INC	17,615	55.87	984,150.05	
HALLIBURTON CO	124,681	31.08	3,875,085.48	
HELMERICH & PAYNE INC	13,600	44.10	599,760.00	
HESS CORPORATION	40,897	60.76	2,484,901.72	
KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	10,681	56.90	607,748.90	
MARATHON OIL CORP	95,623	29.63	2,833,309.49	
MURPHY OIL CORPORATION	24,837	52.48	1,303,445.76	
NABORS INDUSTRIES LTD	38,984	23.08	899,750.72	
NATIONAL-OILWELL VARCO INC.	56,753	44.33	2,515,860.49	
NEWFIELD EXPLORATION CO	18,587	50.75	943,290.25	
NOBLE CORPORATION	36,318	41.80	1,518,092.40	
NOBLE ENERGY INC	24,111	76.44	1,843,044.84	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	111,742	80.94	9,044,397.48	
PATTERSON-UTI ENERGY INC	20,600	16.48	339,488.00	
PEABODY ENERGY CORP	37,133	46.27	1,718,143.91	
PETROHAWK ENERGY CORP	41,122	23.00	945,806.00	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	16,315	48.73	795,029.95	
PLAINS EXPLORATION & PRODUCTION COMPANY	19,600	33.51	656,796.00	
PRIDE INTERNATIONAL INC	24,900	30.73	765,177.00	
RANGE RESOURCES CORPORATION	21,671	53.29	1,154,847.59	

ROWAN COMPANIES INC	15,145	24.45	370,295.25	
SCHLUMBERGER LTD	165,064	65.43	10,800,137.52	
SMITH INTERNATIONAL INC	34,072	33.05	1,126,079.60	
SOUTHWESTERN ENERGY COMPANY	47,761	45.70	2,182,677.70	
SPECTRA ENERGY CORPORATION	87,063	21.38	1,861,406.94	
SUNOCO INC	14,194	26.75	379,689.50	
TRANSOCEAN LTD	44,456	84.13	3,740,083.28	
ULTRA PETROLEUM CORP	21,448	49.38	1,059,102.24	
VALERO ENERGY CORP	77,995	17.82	1,389,870.90	
WEATHERFORD INTL LTD	99,545	15.57	1,549,915.65	
WILLIAMS COS INC	80,253	22.39	1,796,864.67	
XTO ENERGY INC	75,643	46.06	3,484,116.58	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	29,105	70.18	2,042,588.90	
AIRGAS INC	10,000	62.94	629,400.00	
ALCOA INC	134,995	13.60	1,835,932.00	
ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	12,280	44.03	540,688.40	
BALL CORPORATION	12,403	52.15	646,816.45	
CELANESE CORPORATION	19,923	30.63	610,241.49	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	6,100	104.65	638,365.00	
CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	19,270	47.40	913,398.00	
CROWN HOLDINGS INC	20,500	26.32	539,560.00	
DOW CHEMICAL	158,284	28.74	4,549,082.16	
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	123,808	33.13	4,101,759.04	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	9,827	59.30	582,741.10	
ECOLAB INC	32,597	42.36	1,380,808.92	
FMC CORPORATION	9,200	56.98	524,216.00	
FREEPORT-MCMORAN COPPER-B	56,681	75.12	4,257,876.72	
INTERNATIONAL PAPER CO	57,375	23.71	1,360,361.25	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	11,392	42.10	479,603.20	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,943	79.67	473,478.81	
MEADWESTVACO CORP	22,715	23.41	531,758.15	
MONSANTO CO	75,017	78.10	5,858,827.70	
MOSAIC CO/THE	21,843	61.26	1,338,102.18	
NEWMONT MINING CORP	65,488	47.24	3,093,653.12	
NUCOR CORP	43,606	42.44	1,850,638.64	
OWENS-ILLINOIS INC	23,739	27.15	644,513.85	
PACTIV CORPORATION	19,083	22.98	438,527.34	
PPG INDUSTRIES INC	22,923	61.81	1,416,870.63	
PRAXAIR INC	42,570	78.04	3,322,162.80	
SEALED AIR CORP	21,138	19.86	419,800.68	
SIGMA-ALDRICH	16,256	48.50	788,416.00	
THE LUBRIZOL CORPORATION	9,500	76.99	731,405.00	
UNITED STATES STEEL CORPORATION	19,109	50.85	971,692.65	
VULCAN MATERIALS CO	17,053	44.35	756,300.55	
WEYERHAEUSER CO	29,680	40.32	1,196,697.60	
3M COMPANY	91,409	80.14	7,325,517.26	

AGCO CORP	13,500	34.84	470,340.00	
AMETEK INC	15,360	37.96	583,065.60	
BOEING CO	94,636	61.82	5,850,397.52	
CATERPILLAR INC	85,840	57.50	4,935,800.00	
COOPER INDUSTRIES PLC-CL-A	22,752	44.92	1,022,019.84	
CUMMINS INC	26,388	56.46	1,489,866.48	
DANAHER CORP	36,992	75.23	2,782,908.16	
DEERE & CO	57,424	56.48	3,243,307.52	
DOVER CORP	24,974	44.45	1,110,094.30	
EATON CORP	21,776	67.04	1,459,863.04	
EMERSON ELECTRIC CO	102,838	47.17	4,850,868.46	
FASTENAL COMPANY	18,434	43.12	794,874.08	
FIRST SOLAR,INC.	6,440	124.22	799,976.80	
FLOWERVE CORPORATION	7,919	97.34	770,835.46	
FLUOR CORP	25,236	45.58	1,150,256.88	
FOSTER WHEELER AG	17,596	27.56	484,945.76	
GENERAL DYNAMICS CORP	45,471	70.10	3,187,517.10	
GENERAL ELECTRIC CO	1,464,643	16.15	23,653,984.45	
GOODRICH CORPORATION	17,557	64.18	1,126,808.26	
HARSCO CORP	12,000	30.13	361,560.00	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	97,562	39.09	3,813,698.58	
ILLINOIS TOOL WORKS	57,560	45.45	2,616,102.00	
INGERSOLL-RAND PLC	44,163	32.53	1,436,622.39	
ITT CORPORATION	23,666	49.56	1,172,886.96	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	17,490	38.74	677,562.60	
JOY GLOBAL INC	13,959	49.86	695,995.74	
KBR,INC.	23,385	19.83	463,724.55	
L-3 COMMUNICATIONS HLDGS INC	16,010	88.11	1,410,641.10	
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	45,187	76.37	3,450,931.19	
MASCO CORP	50,766	13.95	708,185.70	
MCDERMOTT INTERNATIONAL,INC,	32,455	23.01	746,789.55	
NORTHROP GRUMMAN CORP	41,738	59.94	2,501,775.72	
PACCAR INC	47,676	36.06	1,719,196.56	
PALL CORPORATION	17,076	36.18	617,809.68	
PARKER HANNIFIN CORPORATION	22,459	58.19	1,306,889.21	
PENTAIR INC	12,150	31.75	385,762.50	
PRECISION CASTPARTS CORP	19,380	111.50	2,160,870.00	
QUANTA SERVICES INC	26,559	17.61	467,703.99	
RAYTHEON COMPANY	53,181	54.52	2,899,428.12	
ROCKWELL AUTOMATION INC	20,198	53.09	1,072,311.82	
ROCKWELL COLLINS INC.	22,064	54.29	1,197,854.56	
ROPER INDUSTRIES INC	12,200	53.91	657,702.00	
SPX CORP	6,868	59.20	406,585.60	
SUNPOWER CORPORATION-CLASS A	7,371	20.15	148,525.65	
TEXTRON INC	36,318	19.06	692,221.08	
TYCO INTERNATIONAL LTD	65,970	35.31	2,329,400.70	

UNITED TECHNOLOGIES CORP	123,253	67.35	8,301,089.55	
URS CORPORATION	10,900	46.85	510,665.00	
WW GRAINGER INC	8,760	102.64	899,126.40	
AVERY DENNISON CORP	14,862	32.10	477,070.20	
CINTAS CORP	19,413	23.85	463,000.05	
DUN & BRADSTREET CORP	7,601	71.09	540,355.09	
EQUIFAX INC	17,342	32.49	563,441.58	
IHS INC-CLASS A	7,000	51.90	363,300.00	
IRON MOUNTAIN INC	26,022	23.55	612,818.10	
MANPOWER INC	11,192	53.25	595,974.00	
PITNEY BOWES INC	28,973	22.59	654,500.07	
REPUBLIC SERVICES INC	52,994	27.42	1,453,095.48	
ROBERT HALF INTL INC	19,091	28.18	537,984.38	
RR DONNELLEY & SONS CO	29,298	20.17	590,940.66	
STERICYCLE,INC.	11,300	53.02	599,126.00	
WASTE MANAGEMENT INC	64,724	33.00	2,135,892.00	
C.H.ROBINSON WORLDWIDE,INC.	23,460	53.00	1,243,380.00	
CSX CORP	53,206	46.11	2,453,328.66	
DELTA AIR LINES INC	28,000	12.73	356,440.00	
EXPEDITORS INTL WASH INC	29,678	34.19	1,014,690.82	
FEDEX CORP	40,421	79.94	3,231,254.74	
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	12,900	32.66	421,314.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	50,177	49.26	2,471,719.02	
SOUTHWEST AIRLINES	24,000	12.29	294,960.00	
UNION PACIFIC CORP	69,060	64.98	4,487,518.80	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	95,986	57.51	5,520,154.86	
BORGWARNER INC	16,100	37.19	598,759.00	
FORD MOTOR COMPANY	393,089	11.49	4,516,592.61	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	32,434	13.90	450,832.60	
HARLEY-DAVIDSON INC	32,786	24.45	801,617.70	
JOHNSON CONTROLS INC	92,783	29.08	2,698,129.64	
BLACK & DECKER CORP	7,802	70.63	551,055.26	
COACH INC	43,645	36.05	1,573,402.25	
D.R.HORTON INC	39,548	13.12	518,869.76	
FORTUNE BRANDS INC	21,202	42.78	907,021.56	
GARMIN LTD	17,116	33.02	565,170.32	
HASBRO INC	17,474	35.43	619,103.82	
LEGGETT & PLATT INC	20,215	19.48	393,788.20	
MATTEL INC	48,282	21.56	1,040,959.92	
MOHAWK INDUSTRIES INC	8,183	46.14	377,563.62	
NEWELL RUBBERMAID INC	37,444	13.75	514,855.00	
NIKE INC -CL B	51,482	64.48	3,319,559.36	
POLO RALPH LAUREN CORPORATION	7,678	80.30	616,543.40	
PULTE HOMES INC	43,751	11.61	507,949.11	
STANLEY WORKS/THE	9,981	55.84	557,339.04	
TOLL BROTHERS INC	20,139	19.71	396,939.69	

VF CORP	11,805	76.55	903,672.75	
WHIRLPOOL CORP	10,204	83.06	847,544.24	
APOLLO GROUP INC-CL A	18,073	60.47	1,092,874.31	
CARNIVAL CORP	59,588	34.01	2,026,587.88	
DARDEN RESTAURANTS INC	18,640	40.59	756,597.60	
DEVRY INC	8,600	61.07	525,202.00	
H&R BLOCK INC	46,692	21.04	982,399.68	
INTL GAME TECHNOLOGY	40,760	18.17	740,609.20	
ITT EDUCATIONAL SERVICES INC	4,950	102.30	506,385.00	
LAS VEGAS SANDS CORP	46,000	17.46	803,160.00	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	42,137	27.09	1,141,491.33	
MCDONALD'S CORPORATION	149,958	64.26	9,636,301.08	
MGM MIRAGE	35,000	11.63	407,050.00	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	18,871	25.91	488,947.61	
STARBUCKS CORP	102,057	23.15	2,362,619.55	
STARWOOD HOTELS & RESORTS	26,064	37.56	978,963.84	
WYNN RESORTS LTD	10,121	64.41	651,893.61	
YUM! BRANDS INC	63,804	33.66	2,147,642.64	
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	34,320	22.62	776,318.40	
CBS CORP-CL B	77,893	13.52	1,053,113.36	
COMCAST CORP-CL A	268,629	15.66	4,206,730.14	
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	108,189	14.86	1,607,688.54	
DIRECTV-CLASS A	124,110	31.65	3,928,081.50	
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-A	18,130	31.38	568,919.40	
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-C	20,430	27.50	561,825.00	
DISH NETWORK CORP.	28,864	19.40	559,961.60	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	68,125	6.98	475,512.50	
LIBERTY GLOBAL INC-A	18,940	25.05	474,447.00	
LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	16,763	24.57	411,866.91	
MADISON SQUARE GARDEN INC-A W/I	8,580	19.87	170,484.60	
MCGRAW-HILL COMPANIES INC	43,651	34.75	1,516,872.25	
NEWS CORP-CL A	248,722	13.45	3,345,310.90	
NEWS CORPORATION-CLASS B	60,031	15.82	949,690.42	
OMNICOM GROUP	43,469	36.35	1,580,098.15	
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	13,000	39.43	512,590.00	
THE WALT DISNEY CO.	251,929	30.86	7,774,528.94	
TIME WARNER CABLE,INC.	47,800	46.14	2,205,492.00	
TIME WARNER INC	164,150	28.95	4,752,142.50	
VIACOM INC-CLASS B	76,488	29.76	2,276,282.88	
VIRGIN MEDIA INC	39,577	14.97	592,467.69	
WASHINGTON POST CO B	817	415.01	339,063.17	
ABERCROMBIE & FITCH CO -CL A	11,771	35.38	416,457.98	
ADVANCE AUTO PARTS	13,538	42.88	580,509.44	
AMAZON.COM INC	47,662	116.31	5,543,567.22	
AMERICAN EAGLE OUTFITTERS INC	27,500	16.20	445,500.00	
AUTONATION INC	17,000	18.46	313,820.00	

AUTOZONE INC	4,578	165.62	758,208.36	
BED BATH & BEYOND INC	36,549	41.17	1,504,722.33	
BEST BUY COMPANY INC	49,126	36.28	1,782,291.28	
CARMAX INC	31,522	21.19	667,951.18	
DOLLAR TREE INC	12,500	50.09	626,125.00	
EXPEDIA INC	28,183	21.88	616,644.04	
FAMILY DOLLAR STORES	18,636	32.42	604,179.12	
GAMESTOP CORP-CL A	21,647	19.28	417,354.16	
GAP INC/THE	64,971	19.90	1,292,922.90	
GENUINE PARTS CO	21,284	40.70	866,258.80	
HOME DEPOT INC	234,966	30.02	7,053,679.32	
J.C.PENNEY CO INC (HLDG CO)	29,797	25.88	771,146.36	
KOHL'S CORP	40,257	51.21	2,061,560.97	
LIBERTY MEDIA-INTERACTIVE A	80,507	11.13	896,042.91	
LIMITED BRANDS	37,393	21.05	787,122.65	
LOWE'S COMPANIES INC	201,625	23.05	4,647,456.25	
MACY'S INC	58,548	17.93	1,049,765.64	
NORDSTROM INC	22,735	35.12	798,453.20	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	19,000	40.79	775,010.00	
PETSMART INC	16,691	27.07	451,825.37	
PRICELINE.COM INC	5,492	212.87	1,169,082.04	
ROSS STORES INC	17,036	47.09	802,225.24	
SEARS HOLDINGS CORP	7,510	95.32	715,853.20	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	13,990	65.04	909,909.60	
STAPLES INC	98,976	25.05	2,479,348.80	
TARGET CORP	97,819	50.60	4,949,641.40	
TIFFANY & CO	17,007	43.05	732,151.35	
TJX COMPANIES INC	58,095	38.79	2,253,505.05	
URBAN OUTFITTERS,INC.	17,100	31.56	539,676.00	
COSTCO WHOLESALE CORP	60,504	61.05	3,693,769.20	
CVS CAREMARK CORPORATION	199,453	33.99	6,779,407.47	
KROGER CO	85,469	21.73	1,857,241.37	
SAFEWAY INC	57,449	23.20	1,332,816.80	
SUPERVALU INC	30,030	15.44	463,663.20	
SYSCO CORP	79,785	28.47	2,271,478.95	
WAL-MART STORES INC	322,140	54.06	17,414,888.40	
WALGREEN CO	136,406	34.19	4,663,721.14	
WHOLE FOODS MARKET INC	19,000	34.35	652,650.00	
ALTRIA GROUP INC	283,356	19.78	5,604,781.68	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	78,192	29.88	2,336,376.96	
BROWN-FORMAN CORPORATION	11,315	52.00	588,380.00	
BUNGE LIMITED	18,238	61.24	1,116,895.12	
CAMPBELL SOUP CO	29,379	33.62	987,721.98	
COCA-COLA CO/THE	287,487	55.33	15,906,655.71	
COCA-COLA ENTERPRISES INC	41,604	19.52	812,110.08	
CONAGRA FOODS INC	61,263	24.03	1,472,149.89	

CONSTELLATION BRANDS INC-A	27,523	15.68	431,560.64
DEAN FOODS CO	24,379	14.85	362,028.15
DR.PEPPER SNAPPLE GROUP,INC	36,037	28.59	1,030,297.83
GENERAL MILLS INC	44,007	70.97	3,123,176.79
HANSEN NATURAL CORPORATION	10,900	39.48	430,332.00
HJ HEINZ CO	43,619	45.02	1,963,727.38
HORMEL FOODS CORPORATION	10,000	40.59	405,900.00
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	16,600	60.34	1,001,644.00
KELLOGG CO	37,234	52.98	1,972,657.32
KRAFT FOODS INC-A	238,811	28.63	6,837,158.93
LORILLARD INC	22,620	75.60	1,710,072.00
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	16,630	37.12	617,305.60
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	28,500	46.43	1,323,255.00
MOLSON COORS BREWING COMPANY	21,025	40.47	850,881.75
PEPSI BOTTLING GROUP,INC.	20,300	38.23	776,069.00
PEPSIAMERICAS INC	8,000	29.84	238,720.00
PEPSICO INC	215,098	62.11	13,359,736.78
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	265,452	49.83	13,227,473.16
RALCORP HOLDINGS INC	8,300	66.13	548,879.00
REYNOLDS AMERICAN INC	24,112	51.91	1,251,653.92
SARA LEE CORP	92,511	13.69	1,266,475.59
THE HERSHEY COMPANY	21,810	38.39	837,285.90
TYSON FOODS INC-CL A	42,500	16.63	706,775.00
AVON PRODUCTS INC	59,313	30.53	1,810,825.89
CHURCH & DWIGHT CO INC	9,400	64.86	609,684.00
CLOROX COMPANY	19,061	60.38	1,150,903.18
COLGATE-PALMOLIVE CO	68,385	81.20	5,552,862.00
ENERGIZER HOLDINGS INC	9,117	55.96	510,187.32
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	15,682	58.86	923,042.52
KIMBERLY-CLARK CORP	56,690	59.35	3,364,551.50
PROCTER & GAMBLE CO	402,170	62.85	25,276,384.50
AETNA INC	60,602	29.61	1,794,425.22
AMERISOURCEBERGEN CORP	40,718	27.59	1,123,409.62
BARD(C.R.) INC	13,030	83.72	1,090,871.60
BAXTER INTERNATIONAL INC	83,266	57.65	4,800,284.90
BECKMAN COULTER INC	9,991	66.11	660,505.01
BECTON DICKINSON & CO	32,516	77.36	2,515,437.76
BOSTON SCIENTIFIC CORP	208,125	7.75	1,612,968.75
CARDINAL HEALTH INC	49,890	33.75	1,683,787.50
CAREFUSION CORPORATION	25,345	26.21	664,292.45
CERNER CORP	9,400	80.37	755,478.00
CIGNA CORP	36,511	33.19	1,211,800.09
COVENTRY HEALTH CARE INC	20,613	22.74	468,739.62
COVIDIEN PLC	68,775	50.87	3,498,584.25
DAVITA INC	14,748	60.35	890,041.80
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	18,609	33.12	616,330.08

EDWARDS LIFESCIENCES CORP	8,100	89.81	727,461.00	
EXPRESS SCRIPTS INC	35,762	88.80	3,175,665.60	
HENRY SCHEIN INC	12,050	57.05	687,452.50	
HOLOGIC INC	34,080	16.07	547,665.60	
HOSPIRA INC	21,733	51.69	1,123,378.77	
HUMANA INC.	23,643	46.64	1,102,709.52	
IMS HEALTH INC	24,048	21.90	526,651.20	
INTUITIVE SURGICAL INC	5,239	341.18	1,787,442.02	
LABORATORY CRP OF AMR HLDGS	14,856	73.15	1,086,716.40	
MCKESSON CORP	36,367	60.27	2,191,839.09	
MEDCO HEALTH SOLUTIONS INC	65,622	63.76	4,184,058.72	
MEDTRONIC INC	152,254	43.47	6,618,481.38	
OMNICARE INC	15,200	25.70	390,640.00	
PATTERSON COS INC	13,032	29.62	386,007.84	
QUEST DIAGNOSTICS	21,799	57.39	1,251,044.61	
ST JUDE MEDICAL INC	48,520	38.83	1,884,031.60	
STRYKER CORP	41,153	53.07	2,183,989.71	
UNITEDHEALTH GROUP INC	160,552	32.55	5,225,967.60	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	16,607	48.67	808,262.69	
WELLPOINT INC	65,860	59.70	3,931,842.00	
ZIMMER HOLDINGS INC	29,697	58.34	1,732,522.98	
ABBOTT LABORATORIES	212,294	54.75	11,623,096.50	
ALLERGAN INC	42,308	59.74	2,527,479.92	
AMGEN INC	139,593	57.20	7,984,719.60	
BIOGEN IDEC INC	39,897	56.23	2,243,408.31	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	236,439	24.51	5,795,119.89	
CELGENE CORP	62,772	59.08	3,708,569.76	
CEPHALON INC	10,463	67.28	703,950.64	
CHARLES RIVER LABORATORIES INC	9,360	37.28	348,940.80	
COVANCE INC	9,500	56.93	540,835.00	
ELI LILLY & CO	142,773	34.39	4,909,963.47	
FOREST LABORATORIES,INC.	41,830	29.66	1,240,677.80	
GENZYME CORP - GENL DIVISION	36,460	55.78	2,033,738.80	
GILEAD SCIENCES INC	124,714	48.65	6,067,336.10	
ILLUMINA INC	17,100	36.73	628,083.00	
JOHNSON & JOHNSON	379,876	63.98	24,304,466.48	
LIFE TECHNOLOGIES CORPORATION	24,615	49.50	1,218,442.50	
MERCK & CO. INC.	420,711	37.34	15,709,348.74	
MILLIPORE CORPORATION	7,786	70.04	545,331.44	
MYLAN INC	43,400	18.87	818,958.00	
MYRIAD GENETICS INC	12,500	21.62	270,250.00	
PERRIGO CO	11,500	48.12	553,380.00	
PFIZER INC	1,111,316	17.67	19,636,953.72	
PHARMACEUTICAL PRODUCT DEVELOPMENT INC	14,900	21.38	318,562.00	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	55,726	48.71	2,714,413.46	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	26,308	39.78	1,046,532.24	

WARNER CHILCOTT PLC	15,000	26.26	393,900.00	
WATERS CORP	13,441	58.92	791,943.72	
WATSON PHARMACEUTICALS INC	14,800	38.59	571,132.00	
BB & T CORPORATION	94,063	27.22	2,560,394.86	
COMERICA INC	19,950	35.21	702,439.50	
FIFTH THIRD BANCORP	101,738	12.05	1,225,942.90	
HUDSON CITY BANCORP INC	65,969	13.24	873,429.56	
KEYCORP	125,115	6.83	854,535.45	
M & T BANK CORP	10,268	74.49	764,863.32	
MARSHALL & ILSLEY CORPORATION	70,652	6.54	462,064.08	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	56,700	15.67	888,489.00	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	49,800	15.83	788,334.00	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	70,801	51.85	3,671,031.85	
REGIONS FINANCIAL CORPORATION	167,470	6.46	1,081,856.20	
SUNTRUST BANKS INC	67,303	22.60	1,521,047.80	
US BANCORP	263,790	23.73	6,259,736.70	
WELLS FARGO & COMPANY	669,232	27.33	18,290,110.56	
AMERICAN EXPRESS COMPANY	146,477	39.05	5,719,926.85	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	35,251	39.82	1,403,694.82	
BANK OF AMERICA CORP	1,192,179	15.66	18,669,523.14	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP(THE)	166,601	27.71	4,616,513.71	
BLACKROCK INC	3,250	213.09	692,542.50	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	63,386	36.85	2,335,774.10	
CITIGROUP INC	2,916,518	3.41	9,945,326.38	
CME GROUP INC.	8,110	293.08	2,376,878.80	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	74,281	13.53	1,005,021.93	
EATON VANCE CORP	15,000	29.96	449,400.00	
FRANKLIN RESOURCES INC	21,875	100.90	2,207,187.50	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	67,059	157.26	10,545,698.34	
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	8,268	102.81	850,033.08	
INVESCO LIMITED	56,639	19.16	1,085,203.24	
JEFFERIES GROUP INC (NEW)	13,400	26.16	350,544.00	
JPMORGAN CHASE & CO	541,763	40.04	21,692,190.52	
LEGG MASON INC	20,303	26.52	538,435.56	
LEUCADIA NATIONAL CORPORATION	27,056	22.91	619,852.96	
MOODY'S CORP	27,916	27.07	755,686.12	
MORGAN STANLEY	169,305	27.39	4,637,263.95	
NASDAQ STOCK MARKET INC	19,080	18.57	354,315.60	
NORTHERN TRUST CORP	30,305	51.84	1,571,011.20	
NYSE EURONEXT	36,829	25.51	939,507.79	
SCHWAB (CHARLES) CORP	137,712	17.74	2,443,010.88	
SEI INVESTMENTS COMPANY	17,324	17.44	302,130.56	
SLM CORPORATION	63,061	11.15	703,130.15	
STATE STREET CORP	68,367	44.84	3,065,576.28	
T ROWE PRICE GROUP INC	34,662	49.92	1,730,327.04	
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	36,894	17.40	641,955.60	

ACE LIMITED	47,608	49.75	2,368,498.00	
AFLAC INC	65,045	48.74	3,170,293.30	
ALLSTATE CORP	70,313	30.69	2,157,905.97	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	17,000	26.90	457,300.00	
AON CORPORATION	34,539	40.28	1,391,230.92	
ARCH CAPITAL GROUP LTD.	6,000	72.35	434,100.00	
ASSURANT INC	15,089	30.71	463,383.19	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	19,003	30.65	582,441.95	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	77,800	76.25	5,932,250.00	
CHUBB CORP	47,491	50.02	2,375,499.82	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	20,133	26.51	533,725.83	
EVEREST RE GROUP LTD	8,503	82.50	701,497.50	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL INC-CL A	29,561	14.10	416,810.10	
FIRST AMERICAN CORPORATION	13,000	33.06	429,780.00	
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	66,000	14.86	980,760.00	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	51,086	24.08	1,230,150.88	
LINCOLN NATIONAL CORP	42,427	25.15	1,067,039.05	
LOEWS CORPORATION	48,010	36.17	1,736,521.70	
MARSH & MCLENNAN COS	72,756	22.78	1,657,381.68	
METLIFE INC	113,563	34.87	3,959,941.81	
OLD REPUBLIC INTL CORP	32,961	10.90	359,274.90	
PARTNERRE LTD	9,268	77.36	716,972.48	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	44,800	22.84	1,023,232.00	
PROGRESSIVE CORP	89,783	16.92	1,519,128.36	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	63,964	50.57	3,234,659.48	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	9,163	53.88	493,702.44	
TORCHMARK CORPORATION	10,839	45.40	492,090.60	
TRANSATLANTIC HOLDINGS INC	8,000	49.68	397,440.00	
TRAVELERS COS INC(THE)	78,478	51.75	4,061,236.50	
UNUM GROUP	45,070	20.53	925,287.10	
VALIDUS HOLDINGS LTD	14,000	26.57	371,980.00	
W.R.BERKLEY CORPORATION	19,643	25.15	494,021.45	
WHITE MOUNTAINS INSURANCE GROUP LTD.	1,050	333.25	349,912.50	
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	24,198	28.25	683,593.50	
XL CAPITAL LTD -CLASS A	48,500	18.04	874,940.00	
ACCENTURE PLC-CL A	83,843	40.79	3,419,955.97	
ACTIVISION BLIZZARD INC	81,020	11.15	903,373.00	
ADOBE SYSTEMS INC	72,616	32.33	2,347,675.28	
AKAMAI TECHNOLOGIES	23,506	25.69	603,869.14	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	7,850	53.99	423,821.50	
AUTODESK INC	31,634	25.88	818,687.92	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	68,976	41.46	2,859,744.96	
BMC SOFTWARE INC	25,378	36.69	931,118.82	
CA INC	57,113	22.11	1,262,768.43	
CITRIX SYSTEMS INC	24,998	43.89	1,097,162.22	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATION	40,045	47.19	1,889,723.55	

COMPUTER SCIENCES CORP	20,862	52.05	1,085,867.10	
DST SYSTEMS INC	6,000	39.36	236,160.00	
EBAY INC	151,431	22.68	3,434,455.08	
ELECTRONIC ARTS INC	46,181	16.63	767,990.03	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	43,712	22.61	988,328.32	
FISERV INC	21,376	47.12	1,007,237.12	
GOOGLE INC-CL A	33,331	539.01	17,965,742.31	
INTUIT INC	40,222	29.91	1,203,040.02	
LENDER PROCESSING SERVICES,INC.	12,100	38.16	461,736.00	
MASTERCARD INC-CL A	13,544	224.83	3,045,097.52	
MCAFEE INC	22,212	40.36	896,476.32	
MICROSOFT CORP	1,105,202	28.59	31,597,725.18	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	26,000	14.92	387,920.00	
ORACLE CORPORATION	552,929	24.18	13,369,823.22	
PAYCHEX INC	45,944	30.08	1,381,995.52	
RED HAT INC	26,700	28.78	768,426.00	
SAIC INC	28,200	19.17	540,594.00	
SALESFORCE.COM,INC.	15,775	66.78	1,053,454.50	
SYMANTEC CORPORATION	113,313	16.94	1,919,522.22	
SYNOPSYS INC	21,384	22.10	472,586.40	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	21,919	14.36	314,756.84	
VERISIGN INC	26,118	24.11	629,704.98	
VISA INC	63,516	86.42	5,489,052.72	
VMWARE INC	7,500	47.40	355,500.00	
WESTERN UNION COMPANY	97,846	16.40	1,604,674.40	
YAHOO! INC	181,210	15.44	2,797,882.40	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	47,758	30.63	1,462,827.54	
AMPHENOL CORPORATION -CL A	23,444	41.69	977,380.36	
APPLE INC	123,457	202.55	25,006,215.35	
ARROW ELECTRONICS INC	15,390	28.44	437,691.60	
AVNET INC	20,900	27.81	581,229.00	
CISCO SYSTEMS INC	794,631	24.08	19,134,714.48	
CORNING INC	215,202	18.01	3,875,788.02	
DELL INC	239,052	14.11	3,373,023.72	
DOLBY LABORATORIES INC-CL A	7,300	53.08	387,484.00	
EMC CORP/MASS	278,603	17.40	4,847,692.20	
FLEXTRONICS INTL LTD	109,331	7.04	769,690.24	
FLIR SYSTEMS INC	21,940	26.93	590,844.20	
HARRIS CORP	18,350	46.02	844,467.00	
HEWLETT-PACKARD CO	328,794	50.12	16,479,155.28	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	180,626	126.33	22,818,482.58	
JUNIPER NETWORKS INC	72,423	25.62	1,855,477.26	
MOTOROLA INC	316,579	7.11	2,250,876.69	
NETAPP INC	46,144	32.09	1,480,760.96	
QUALCOMM INC	229,120	39.43	9,034,201.60	
SANDISK CORP	30,800	28.82	887,656.00	

SEAGATE TECHNOLOGY	69,568	20.00	1,391,360.00	
TERADATA CORP	23,177	29.58	685,575.66	
TYCO ELECTRONICS LTD	63,029	26.21	1,651,990.09	
WESTERN DIGITAL CORP	29,723	42.64	1,267,388.72	
XEROX CORP	179,580	8.92	1,601,853.60	
AMERICAN TOWER CORPORATION -CL A	55,309	43.71	2,417,556.39	
AT&T INC	812,851	25.40	20,646,415.40	
CENTURYTEL INC	39,312	35.10	1,379,851.20	
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	40,922	38.40	1,571,404.80	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	125,000	1.32	165,000.00	
METROPCS COMMUNICATIONS INC.	41,500	6.21	257,715.00	
NII HOLDINGS INC	24,479	37.16	909,639.64	
QWEST COMMUNICATIONS INTL	212,888	4.45	947,351.60	
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	15,000	34.33	514,950.00	
SPRINT NEXTEL CORP	397,323	3.24	1,287,326.52	
TELEPHONE AND DATA SYSTEMS	8,500	31.29	265,965.00	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	391,720	29.14	11,414,720.80	
WINDSTREAM CORPORATION	57,500	10.51	604,325.00	
AES CORPORATION	89,266	12.03	1,073,869.98	
ALLEGHENY ENERGY INC	23,612	22.59	533,395.08	
ALLIANT ENERGY CORP	16,148	31.60	510,276.80	
AMEREN CORPORATION	31,624	25.40	803,249.60	
AMERICAN ELECTRIC POWER	64,450	33.55	2,162,297.50	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	24,600	22.21	546,366.00	
CALPINE CORP	50,500	11.30	570,650.00	
CENTERPOINT ENERGY INC	52,609	14.06	739,682.54	
CONSOLIDATED EDISON INC	36,947	42.86	1,583,548.42	
CONSTELLATION ENERGY GROUP	24,223	33.69	816,072.87	
DOMINION RESOURCES INC/VA	82,825	38.38	3,178,823.50	
DTE ENERGY COMPANY	21,773	42.88	933,626.24	
DUKE ENERGY CORP	180,169	16.18	2,915,134.42	
EDISON INTERNATIONAL	43,253	33.31	1,440,757.43	
ENERGEN CORPORATION	8,700	45.37	394,719.00	
ENTERGY CORP	27,079	78.26	2,119,202.54	
EQT CORPORATION	16,780	44.23	742,179.40	
EXELON CORP	90,556	43.99	3,983,558.44	
FIRSTENERGY CORP	41,795	38.57	1,612,033.15	
FPL GROUP INC	54,460	45.77	2,492,634.20	
INTEGRYS ENERGY GROUP,INC.	9,700	43.82	425,054.00	
MDU RESOURCES GROUP INC	22,800	20.32	463,296.00	
MIRANT CORP	21,545	13.20	284,394.00	
NISOURCE INC	37,692	14.97	564,249.24	
NORTHEAST UTILITIES	24,100	25.85	622,985.00	
NRG ENERGY INC	37,625	22.59	849,948.75	
NSTAR	15,300	33.69	515,457.00	
ONEOK INC	13,800	42.72	589,536.00	

P G & E CORPORATION	50,874	41.87	2,130,094.38	
PEPCO HOLDINGS INC	32,034	16.62	532,405.08	
PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	14,844	36.65	544,032.60	
PPL CORPORATION	51,644	29.60	1,528,662.40	
PROGRESS ENERGY INC	38,076	37.81	1,439,653.56	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	68,548	30.74	2,107,165.52	
QUESTAR CORP	24,511	42.66	1,045,639.26	
SCANA CORP	16,463	35.03	576,698.89	
SEMPRA ENERGY	32,561	48.19	1,569,114.59	
SOUTHERN CO	108,918	31.64	3,446,165.52	
WISCONSIN ENERGY CORP	16,316	48.66	793,936.56	
XCEL ENERGY INC	62,912	20.55	1,292,841.60	
ADVANCED MICRO DEVICES	75,085	8.03	602,932.55	
ALTERA CORPORATION	40,370	23.43	945,869.10	
ANALOG DEVICES	41,005	28.38	1,163,721.90	
APPLIED MATERIALS INC	184,729	12.97	2,395,935.13	
BROADCOM CORP-CL A	59,822	31.44	1,880,803.68	
INTEL CORP	771,522	20.66	15,939,644.52	
KLA-TENCOR CORPORATION	24,324	30.43	740,179.32	
LAM RESEARCH CORP	17,964	35.27	633,590.28	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	30,958	27.68	856,917.44	
LSI CORPORATION	91,857	5.57	511,643.49	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	72,474	19.99	1,448,755.26	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	42,000	18.44	774,480.00	
MEMC ELECTRONIC MATERIALS	31,806	12.69	403,618.14	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	26,408	27.06	714,600.48	
MICRON TECHNOLOGY INC	111,541	8.73	973,752.93	
NATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	33,092	14.44	477,848.48	
NVIDIA CORP	75,794	17.84	1,352,164.96	
TEXAS INSTRUMENTS INC	172,641	24.71	4,265,959.11	
XILINX INC	37,753	25.10	947,600.30	
米ドル 小計	43,712,606		1,400,841,656.43	
( 邦貨換算額 )			(127,560,641,234)	( 単位 : 円 )
カナダドル				
CAMECO CORP	54,457	29.62	1,613,016.34	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	75,105	72.16	5,419,576.80	
CENOVUS ENERGY INC	102,148	26.81	2,738,587.88	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	24,900	39.09	973,341.00	
ENBRIDGE INC	49,529	47.19	2,337,273.51	
ENCANA CORP	102,348	34.55	3,536,123.40	
ENSIGN ENERGY SERVICES INC	20,400	15.42	314,568.00	
HUSKY ENERGY INC	36,342	27.59	1,002,675.78	
IMPERIAL OIL LTD	41,264	40.37	1,665,827.68	
NEXEN INC	65,708	23.11	1,518,511.88	
NIKO RESOURCES LTD	6,400	103.00	659,200.00	

PETROBAKKEN ENERGY LTD-A	11,000	27.85	306,350.00	
PETROBANK ENERGY & RESOURCES	11,600	53.65	622,340.00	
PROGRESS ENERGY RESOURCES CORP	21,000	13.07	274,470.00	
SUNCOR ENERGY INC	214,692	31.46	6,754,210.32	
TALISMAN ENERGY INC	141,232	18.67	2,636,801.44	
TRANSCANADA CORP	93,377	34.65	3,235,513.05	
TRICAN WELL SERVICE LTD	15,384	14.93	229,683.12	
AGNICO-EAGLE MINES	22,050	61.89	1,364,674.50	
AGRIUM INC	22,383	69.06	1,545,769.98	
BARRICK GOLD CORP	132,239	39.65	5,243,276.35	
ELDORADO GOLD CORPORATION	75,000	13.62	1,021,500.00	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	11,200	75.72	848,064.00	
FRANCO-NEVADA CORPORATION	15,500	27.72	429,660.00	
GOLDCORP INC	100,099	40.42	4,046,001.58	
IAMGOLD CORP	47,500	15.72	746,700.00	
INMET MINING CORPORATION	7,122	58.88	419,343.36	
IVANHOE MINES LTD	37,000	15.97	590,890.00	
KINROSS GOLD CORP	93,895	19.35	1,816,868.25	
PAN AMERICAN SILVER CORP	14,072	22.82	321,123.04	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	40,848	119.32	4,873,983.36	
SHERRITT INTERNATIONAL CORPORATION	44,500	7.08	315,060.00	
SILVER WHEATON CORPORATION	47,000	16.31	766,570.00	
SINO-FOREST CORPORATION-CL A	33,671	19.75	665,002.25	
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	68,517	39.15	2,682,440.55	
YAMANA GOLD INC	102,170	11.16	1,140,217.20	
BOMBARDIER INC 'B'	198,659	5.42	1,076,731.78	
CAE INC	37,214	9.00	334,926.00	
FINNING INTERNATIONAL INC	24,250	17.78	431,165.00	
SNC-LAVALIN GROUP INC	20,581	50.77	1,044,897.37	
RITCHIE BROS. AUCTIONEERS	12,400	21.00	260,400.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	64,314	54.84	3,526,979.76	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	22,986	51.45	1,182,629.70	
MAGNA INTERNATIONAL INC-CL A	14,356	60.07	862,364.92	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	15,500	25.57	396,335.00	
TIM HORTONS INC	25,000	31.50	787,500.00	
GROUPE AEROPLAN INC	28,000	11.35	317,800.00	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	49,306	19.82	977,244.92	
THOMSON REUTERS CORP	51,608	37.25	1,922,398.00	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	10,758	52.03	559,738.74	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B	16,600	19.77	328,182.00	
EMPIRE CO LTD A	3,200	49.71	159,072.00	
LOBLAW COMPANIES LTD	14,433	38.00	548,454.00	
METRO INC -A	15,800	39.75	628,050.00	
SHOPPERS DRUG MART CORP	28,320	43.87	1,242,398.40	
WESTON (GEORGE) LTD	7,380	71.19	525,382.20	
SAPUTO INC	20,840	30.50	635,620.00	

VITERRA INC	53,000	9.57	507,210.00	
BIOVAIL CORP	20,693	15.66	324,052.38	
BANK OF MONTREAL	75,079	55.60	4,174,392.40	
BANK OF NOVA SCOTIA	136,951	48.01	6,575,017.51	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	53,009	66.77	3,539,410.93	
GENWORTH MI CANADA INC	6,000	27.50	165,000.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	22,461	58.77	1,320,032.97	
ROYAL BANK OF CANADA	193,232	56.47	10,911,811.04	
TORONTO-DOMINION BANK	118,103	66.18	7,816,056.54	
CI FINANCIAL CORP	23,200	21.02	487,664.00	
IGM FINANCIAL INC	17,101	42.37	724,569.37	
ONEX CORPORATION	12,923	25.18	325,401.14	
TMX GROUP INC	9,421	30.00	282,630.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,700	367.70	992,790.00	
GREAT-WEST LIFECO INC	39,904	27.20	1,085,388.80	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANC	11,000	34.49	379,390.00	
INTACT FINANCIAL CORPORATION	16,500	40.39	666,435.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	240,845	19.50	4,696,477.50	
POWER CORP OF CANADA	48,260	29.65	1,430,909.00	
POWER FINANCIAL CORP	33,986	32.00	1,087,552.00	
SUN LIFE FINANCIAL INC	75,983	31.14	2,366,110.62	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	66,793	23.60	1,576,314.80	
BROOKFIELD PROPERTIES CORP	36,363	13.83	502,900.29	
CGI GROUP INC - CL A	39,587	14.25	564,114.75	
OPEN TEXT CORPORATION	7,500	47.13	353,475.00	
RESEARCH IN MOTION	70,371	73.56	5,176,490.76	
BCE INC	36,220	28.99	1,050,017.80	
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	65,000	32.94	2,141,100.00	
TELUS CORPORATION	4,400	33.53	147,532.00	
TELUS CORPORATION -NON VOTE	22,597	32.39	731,916.83	
CANADIAN UTILITIES LIMITED	12,100	42.28	511,588.00	
FORTIS INC	22,750	27.34	621,985.00	
TRANSALTA CORP	30,268	23.56	713,114.08	
カナダドル 小計	4,307,457		146,372,334.92	
( 邦貨換算額 )			(12,724,147,074)	( 単位 : 円 )
ユ-ロ				
COMPAGNIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE-VERITA	19,750	18.31	361,721.25	
ENI SPA	357,983	16.93	6,060,652.19	
FUGRO NV-CVA	9,145	43.30	395,978.50	
GALP ENERGIA SGPS S.A	21,800	11.65	253,970.00	
HELLENIC PETROLEUM SA	12,435	8.27	102,837.45	
NESTE OIL OYJ	16,385	10.72	175,647.20	
OMV AG	20,389	28.82	587,610.98	
REPSOL YPF SA	102,190	16.74	1,710,660.60	
SAIPEM	36,120	24.69	891,802.80	

SBM OFFSHORE NV	21,887	13.65	298,866.98
TECHNIP S.A.	14,609	54.17	791,369.53
TENARIS S.A.	65,569	16.77	1,099,592.13
TOTAL SA	290,996	42.63	12,405,159.48
ACERINOX SA	17,836	12.60	224,733.60
AIR LIQUIDE	34,180	84.04	2,872,487.20
AKZO NOBEL	31,816	42.66	1,357,429.64
ARCELOR MITTAL	118,748	28.18	3,346,318.64
BASF SE	126,563	41.55	5,258,692.65
CIMPOR-CIMENTOS DE PORTUGAL	29,700	5.80	172,260.00
CRH PLC	99,280	17.52	1,740,279.12
ERAMET	750	229.90	172,425.00
HEIDELBERGCEMENT AG	19,800	40.48	801,603.00
IMERYS SA	4,465	39.35	175,720.07
ITALCEMENTI SPA	9,800	8.40	82,369.00
K+S AG	23,220	44.29	1,028,413.80
KONINKLIJKE DSM NV	21,381	32.94	704,397.04
LAFARGE SA	27,732	50.69	1,405,735.08
LINDE AG	20,991	83.60	1,754,847.60
OUTOKUMPU OYJ	17,429	12.94	225,531.26
RAUTARUUKKI OYJ	12,273	14.26	175,012.98
SALZGITTER AG	5,090	64.99	330,799.10
SOLVAY SA	8,305	73.33	609,005.65
STORA ENSO OYJ-R SHS	78,312	4.45	348,645.02
THYSSENKRUPP AG	46,558	23.63	1,100,398.33
TITAN CEMENT CO. S.A.	9,091	17.80	161,819.80
UMICORE	15,650	22.76	356,272.25
UPM-KYMMENE OYJ	70,976	7.78	552,548.16
VOESTALPINE AG	16,653	27.00	449,631.00
WACKER CHEMIE AG	2,150	96.16	206,744.00
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	19,635	33.20	651,882.00
ALSTOM RGPT	28,113	47.19	1,326,793.03
BOSKALIS WESTMINSTER NV	8,400	24.25	203,700.00
BOUYGUES	31,031	35.00	1,086,085.00
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	52,223	33.44	1,746,337.12
EIFFAGE SA	5,600	37.50	210,000.00
EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	56,680	14.48	820,726.40
FINMECCANICA SPA	53,589	9.70	520,081.24
FOMENTO DE CONSTRUC Y CONTRA	5,502	24.63	135,541.77
GAMESA CORP TECNOLOGICA SA	24,421	10.34	252,635.24
GEA GROUP AG	19,900	14.15	281,585.00
HOCHTIEF AG	6,287	54.51	342,704.37
KONE OYJ-B	21,800	29.41	641,138.00
LEGRAND SA	15,500	21.78	337,667.50
MAN SE	14,693	52.30	768,443.90
METSO OYJ	18,271	23.58	430,830.18

PHILIPS ELECTRONICS NV	132,645	21.88	2,902,272.60	
PRYSMIAN SPA	14,400	12.59	181,296.00	
SACYR VALLEHERMOSO SA	12,700	6.66	84,594.70	
SAFRAN SA	25,677	14.64	376,039.66	
SCHNEIDER ELECTRIC SA	32,627	76.70	2,502,490.90	
SIEMENS AG-REG	113,091	64.30	7,271,751.30	
SOLARWORLD AG	12,784	11.41	145,929.36	
THALES SA	12,475	33.71	420,594.62	
VALLOUREC	7,610	134.25	1,021,642.50	
VINCI S.A.	59,763	38.63	2,308,644.69	
WARTSILA OYJ-B SHARES	11,871	33.16	393,642.36	
ZARDOYA OTIS SA	19,900	13.38	266,262.00	
BIC	3,400	52.40	178,160.00	
BUREAU VERITAS SA	7,300	35.27	257,471.00	
RANDSTAD HOLDING NV	14,398	33.00	475,134.00	
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	38,910	13.60	529,176.00	
AEROPORTS DE PARIS (ADP)	3,800	55.35	210,330.00	
AIR FRANCE-KLM	19,327	10.18	196,845.49	
ATLANTIA SPA	36,044	17.29	623,200.76	
BRISA	26,718	5.97	159,506.46	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	31,179	11.10	346,086.90	
DEUTSCHE POST AG-REG	117,848	12.17	1,434,210.16	
FERROVIAL SA	59,168	6.79	402,046.56	
FRAPORT AG	5,000	37.09	185,475.00	
IBERIA LINEAS AER DE ESPANA	63,493	2.21	140,573.50	
RYANAIR HOLDINGS PLC	1,656	3.38	5,610.52	
SOCIETE DES AUTOROUTES PARIS-RHIN-RHONE	3,000	54.00	162,000.00	
TNT NV	51,993	19.67	1,022,962.27	
VOPAK	4,500	53.30	239,850.00	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	46,066	29.61	1,364,244.59	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE(BMW)AG-PFD	7,041	22.65	159,513.85	
DAIMLER AG	124,423	33.04	4,110,935.92	
FIAT SPA	105,516	8.24	869,979.42	
MICHELIN (CGDE)-B	20,345	52.86	1,075,436.70	
NOKIAN RENKAAT OYJ	13,697	18.03	246,956.91	
PEUGEOT SA	21,555	20.30	437,674.27	
PIRELLI & C.	366,874	0.38	142,163.67	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PREF	12,565	37.42	470,182.30	
RENAULT SA	25,725	31.69	815,353.87	
VOLKSWAGEN AG	5,944	64.58	383,863.52	
VOLKSWAGEN AG PFD	14,405	59.10	851,335.50	
ADIDAS AG	26,824	36.45	977,868.92	
CHRISTIAN DIOR SA	8,720	71.28	621,561.60	
HERMES INTERNATIONAL	7,363	98.04	721,868.52	
LUXOTTICA GROUP SPA	15,130	18.45	279,148.50	
LVMH MOET HENNESSY LOUI V SA	33,438	78.69	2,631,236.22	

PUMA AG	626	214.85	134,496.10
ACCOR SA	19,367	36.58	708,444.86
AUTOGRILL SPA	17,000	8.96	152,405.00
OPAP SA	31,406	15.20	477,371.20
SODEXO	13,086	41.20	539,143.20
TUI AG	20,000	7.21	144,320.00
EUTELSAT COMMUNICATIONS	13,600	24.97	339,592.00
GESTEVISION TELECINCO SA	9,000	10.01	90,090.00
JC DECAUX S.A.	10,000	18.25	182,550.00
LAGARDERE S.C.A.	16,371	26.89	440,216.19
M6-METROPOLE TELEVISION	8,300	18.84	156,372.00
MEDIASET SPA	98,634	5.70	562,706.97
PAGESJAUNES SA	19,000	7.69	146,262.00
PUBLICIS GROUPE	15,800	28.19	445,402.00
REED ELSEVIER NV	100,396	8.63	866,517.87
SANOMA OYJ	10,500	14.43	151,515.00
SES	38,796	16.56	642,461.76
TELEVISION FRANCAISE (T.F.1)	16,976	12.31	209,059.44
VIVENDI SA	167,977	18.35	3,083,217.83
WOLTERS KLUWER-CVA	38,342	15.07	577,813.94
INDITEX	30,833	43.05	1,327,514.81
PPR	10,486	84.72	888,373.92
CARREFOUR SA	86,516	35.37	3,060,503.50
CASINO GUICHARD PERRACHON	7,640	58.23	444,877.20
COLRUYT NV	2,089	175.80	367,246.20
DELHAIZE GROUP	13,978	56.77	793,531.06
JERONIMO MARTINS SGPS S.A.	32,500	6.99	227,467.50
KESKO OYJ-B SHS	9,834	25.33	249,095.22
KONINKLIJKE AHOLD NV	165,197	9.00	1,486,773.00
METRO AG	15,829	38.34	606,963.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	98,894	37.27	3,685,779.38
COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	25,429	16.11	409,661.19
DANONE	76,560	42.45	3,249,972.00
HEINEKEN HOLDING NV	15,339	29.40	450,966.60
HEINEKEN NV	33,700	34.76	1,171,580.50
KERRY GROUP PLC-A	20,598	21.76	448,212.48
PARMALAT SPA	236,000	1.79	422,912.00
PERNOD-RICARD SA	27,117	57.29	1,553,532.93
SUEDZUCKER AG	8,500	17.22	146,370.00
UNILEVER NV-CVA	223,920	22.20	4,971,024.00
BEIERSDORF AG	11,140	42.95	478,463.00
HENKEL AG & CO KGAA	18,400	31.15	573,160.00
HENKEL AG & CO KGAA	24,378	35.99	877,486.11
L'OREAL	32,960	74.25	2,447,280.00
BIOMERIEUX	1,800	81.30	146,340.00
CELESIO AG	11,604	20.86	242,059.44

ESSILOR INTERNATIONAL	28,403	43.98	1,249,305.95
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	26,540	36.72	974,681.50
FRESENIUS SE	3,200	45.01	144,032.00
FRESENIUS SE-PFD	11,020	48.80	537,831.10
BAYER AG	113,323	50.42	5,713,745.66
ELAN CORPORATION PLC	75,566	5.32	402,011.12
GRIFOLS S.A.	15,200	11.00	167,276.00
IPSEN	3,300	37.63	124,179.00
MERCK KGAA	9,321	63.78	594,493.38
ORION OYJ	11,298	15.80	178,508.40
QIAGEN N.V.	33,000	15.71	518,595.00
SANOFI-AVENTIS	144,536	53.88	7,787,599.68
UCB SA	13,497	32.98	445,131.06
ALPHA BANK A.E.	65,321	6.37	416,094.77
ANGLO IRISH BANK CORPORATION PLC	96,000	0.00	96.00
BANCA CARIGE S.P.A	84,000	1.91	160,776.00
BANCA CARIGE S.P.A-RTS NEW	84,000	0.01	865.20
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	312,414	1.11	349,278.85
BANCA POPOLARE DI MILANO	59,060	4.47	264,293.50
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	489,284	10.15	4,966,232.60
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	313,402	0.75	235,051.50
BANCO DE SABADELL SA	130,244	3.54	461,975.46
BANCO DE VALENCIA SA	29,200	4.97	145,124.00
BANCO ESPIRITO SANTO,S.A(BES)	72,900	3.81	277,967.70
BANCO POPOLARE SPA	92,182	4.70	433,485.85
BANCO POPULAR ESPANOL	121,427	4.98	604,949.31
BANCO SANTANDER SA	1,123,641	9.91	11,135,282.31
BANK OF CYPRUS PUBLIC CO LTD	80,500	3.91	314,755.00
BANKINTER,S.A.	37,500	6.06	227,587.50
BNP PARIBAS	130,383	51.15	6,669,090.45
COMMERZBANK AG	99,543	5.72	570,082.76
CREDIT AGRICOLE SA	129,290	10.78	1,393,746.20
DEUTSCHE POSTBANK AG	12,150	22.61	274,711.50
DEXIA	72,498	3.99	289,919.50
EFG EUROBANK ERGASIAS	44,991	5.29	238,002.39
ERSTE GROUP BANK AG	26,513	27.90	739,712.70
INTESA SANPAOLO	1,067,990	2.70	2,883,573.00
INTESA SANPAOLO-RNC	134,503	2.08	280,775.01
KBC GROUPE SA	22,051	32.14	708,829.39
NATIONAL BANK OF GREECE S,A.	81,539	13.42	1,094,253.38
NATIXIS	118,000	3.45	407,100.00
PIRAEUS BANK S.A.	42,995	5.70	245,071.50
RAIFFEISEN INTERNATIONAL BANK-HOLDING AG	7,250	39.20	284,200.00
SOCIETE GENERALE	86,979	42.00	3,653,118.00
UNICREDIT SPA	2,258,241	2.00	4,522,127.60
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	82,394	9.20	758,436.77

CNP-CIE NATL A PORTEFEUILLE	5,000	36.51	182,575.00	
CRITERIA CAIXACORP SA	117,507	3.17	372,497.19	
DEUTSCHE BANK AG -REG	80,926	46.73	3,782,076.61	
DEUTSCHE BOERSE AG	26,347	49.10	1,293,637.70	
EURAZEO	4,000	49.70	198,820.00	
EXOR SPA	10,997	11.47	126,135.59	
FORTIS	305,000	2.57	785,375.00	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	11,295	65.18	736,208.10	
ING GROEP NV-CVA	501,142	6.81	3,413,779.30	
MARFIN INVESTMENT GROUP S.A	78,000	1.74	135,720.00	
MARFIN INVESTMENT GROUP SA-RTS NEW	78,000	-	-	
MEDIOBANCA SPA	65,868	7.61	501,584.82	
POHJOLA BANK PLC	17,903	7.90	141,433.70	
AEGON NV	214,788	4.48	962,250.24	
ALLIANZ SE-REG	62,599	81.98	5,131,866.02	
ASSICURAZIONI GENERALI	159,531	16.85	2,688,097.35	
AXA SA	233,394	15.55	3,630,443.67	
CNP ASSURANCES	5,471	65.44	358,022.24	
FONDIARIA SAI S.P.A.	8,700	11.60	100,920.00	
HANNOVER RUECKVERSICHERUNGS AG	8,600	32.24	277,307.00	
MAPFRE SA	95,649	2.67	255,956.72	
MEDIOLANUM SPA	29,000	4.02	116,725.00	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	27,274	109.75	2,993,321.50	
SAMPO OYJ-A SHS	58,454	17.78	1,039,312.12	
SCOR SE	23,458	17.65	414,033.70	
VIENNA INSURANCE GROUP	4,600	36.62	168,452.00	
IMMOEAST AG	60,000	3.62	217,200.00	
ATOS ORIGIN	5,731	34.68	198,751.08	
CAP GEMINI SA	19,604	31.68	621,152.74	
DASSAULT SYSTEMES SA	9,253	40.81	377,614.93	
INDRA SISTEMAS SA	14,528	14.70	213,561.60	
SAP AG	118,620	32.37	3,839,729.40	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	15,000	11.71	175,650.00	
ALCATEL-LUCENT	319,916	2.06	659,026.96	
NEOPOST SA	4,418	57.51	254,079.18	
NOKIA OYJ	515,767	9.78	5,044,201.26	
BELGACOM SA	21,031	26.13	549,540.03	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	390,942	9.55	3,733,496.10	
ELISA OYJ	17,422	15.25	265,685.50	
FRANCE TELECOM SA	255,520	16.84	4,304,234.40	
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	32,849	8.90	292,356.10	
ILIAD SA	2,000	78.80	157,600.00	
KONINKLIJKE KPN NV	230,975	11.59	2,677,000.25	
MOBISTAR SA	4,264	41.96	178,938.76	
PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	82,652	7.44	615,178.83	
TELECOM ITALIA SPA	1,408,901	1.11	1,576,560.21	

TELECOM ITALIA-RNC	820,811	0.85	701,382.99	
TELEFONICA S.A.	583,572	17.16	10,014,095.52	
TELEKOM AUSTRIA AG	43,226	9.82	424,479.32	
A2A S.P.A.	165,000	1.27	209,715.00	
ACCIONA S.A.	3,430	81.15	278,344.50	
E.ON AG	262,182	26.69	6,997,637.58	
EDP RENOVAVEIS SA	27,000	5.76	155,547.00	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	249,624	2.75	686,715.62	
ELECTRICITE DE FRANCE(EDF)	33,399	39.02	1,303,395.97	
ENAGAS	24,000	15.32	367,800.00	
ENEL SPA	905,547	3.91	3,547,480.37	
FORTUM OYJ	61,181	18.51	1,132,460.31	
GAS NATURAL SDG SA	32,246	13.25	427,420.73	
GDF SUEZ	170,505	27.03	4,608,750.15	
IBERDROLA RENOVABLES	117,000	3.14	367,380.00	
IBERDROLA SA	502,445	5.96	2,996,581.98	
OEST ELEKTRIZATSWIRTSCHAFTS AG-CL A	9,670	30.16	291,647.20	
PUBLIC POWER CORP	16,106	11.98	192,949.88	
RED ELECTRICA CORPORATION S.A.	15,600	35.74	557,544.00	
RWE AG	57,300	64.56	3,699,288.00	
RWE AG-NON VTG PFD	5,793	59.00	341,787.00	
SNAM RETE GAS	189,283	3.43	650,660.31	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	37,000	16.23	600,695.00	
TERNA SPA	179,846	2.95	531,894.54	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	54,730	23.92	1,309,415.25	
ASML HOLDING NV	58,682	23.30	1,367,584.01	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	150,000	4.08	613,350.00	
STMICROELECTRONICS NV	99,405	6.17	613,328.85	
ユーロ 小計	24,679,046		306,477,759.35	
( 邦貨換算額 )			(37,874,521,500)	( 単位 : 円 )
英ポンド				
AMEC PLC	47,335	7.91	374,419.85	
BG GROUP PLC	463,495	11.59	5,371,907.05	
BP PLC	2,582,318	5.72	14,786,352.86	
CAIRN ENERGY PLC	189,000	3.47	657,342.00	
PETROFAC LIMITED	28,000	10.26	287,280.00	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	489,006	17.57	8,591,835.42	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	370,430	16.94	6,275,084.20	
TULLOW OIL PLC	121,500	11.99	1,456,785.00	
ANGLO AMERICAN PLC	180,991	24.43	4,422,515.08	
ANTOFAGASTA PLC	53,270	8.82	469,841.40	
BHP BILLITON PLC	304,097	19.78	6,015,038.66	
EURASIAN NATURAL RESOURCES CORPORATION	36,500	10.06	367,190.00	
FRESNILLO PLC	25,000	7.70	192,500.00	
JOHNSON MATTHEY PLC	29,301	15.94	467,057.94	

KAZAKHMYS PLC	31,000	13.11	406,410.00
LONMIN PLC	20,936	18.71	391,712.56
RANDGOLD RESOURCES LTD	12,702	46.63	592,294.26
REXAM PLC	110,549	2.77	306,220.73
RIO TINTO PLC	188,893	34.00	6,422,362.00
VEDANTA RESOURCES PLC	18,600	25.00	465,000.00
XSTRATA PLC	261,717	10.62	2,780,743.12
BAE SYSTEMS PLC	490,735	3.49	1,712,665.15
BALFOUR BEATTY PLC	99,839	2.69	269,365.62
BUNZL PLC	46,008	6.35	292,380.84
COBHAM PLC	161,074	2.33	376,268.86
INVENSYS PLC	113,258	3.11	352,572.15
ROLLS-ROYCE GROUP PLC	257,993	5.16	1,331,243.88
SMITHS GROUP PLC	54,766	10.40	569,566.40
TOMKINS PLC	117,922	1.85	218,155.70
WOLSELEY PLC	37,232	14.45	538,002.40
CAPITA GROUP PLC	87,199	7.24	631,756.75
EXPERIAN PLC	141,394	6.05	856,140.67
G4S PLC	176,927	2.61	462,487.17
SERCO GROUP PLC	62,528	5.13	320,768.64
BRITISH AIRWAYS PLC	78,550	2.06	162,441.40
FIRSTGROUP PLC	63,315	3.57	226,097.86
BURBERRY GROUP PLC	61,437	6.36	391,046.50
CARNIVAL PLC	22,867	23.20	530,514.40
COMPASS GROUP PLC	258,178	4.67	1,206,982.15
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	33,789	9.01	304,607.83
THOMAS COOK GROUP PLC	116,000	2.34	271,788.00
TUI TRAVEL PLC	80,000	2.67	213,840.00
WHITBREAD PLC	25,356	14.09	357,266.04
BRITISH SKY BROADCASTING PLC	157,055	5.37	844,170.62
PEARSON PLC	112,953	8.86	1,000,763.58
REED ELSEVIER PLC	171,148	4.93	844,615.38
WPP PLC	173,667	6.03	1,048,080.34
HOME RETAIL GROUP	126,094	2.66	335,536.13
KINGFISHER PLC	333,840	2.13	711,746.88
MARKS & SPENCER GROUP PLC	220,199	3.42	753,300.77
NEXT PLC	26,544	19.37	514,157.28
SAINSBURY (J) PLC	160,638	3.32	533,960.71
TESCO PLC	1,096,082	4.27	4,686,298.59
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	290,792	2.98	868,595.70
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	50,400	9.19	463,428.00
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	274,226	21.43	5,878,034.31
DIAGEO PLC	343,310	10.50	3,604,755.00
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	140,970	20.00	2,819,400.00
SABMILLER PLC	128,710	17.22	2,216,386.20
UNILEVER PLC	176,197	18.80	3,312,503.60

RECKITT BENCKISER GROUP PLC	84,263	33.62	2,832,922.06	
SMITH & NEPHEW PLC	122,783	6.54	803,000.82	
ASTRAZENECA PLC	199,621	27.94	5,578,408.84	
GLAXOSMITHKLINE PLC	715,243	12.45	8,904,775.35	
SHIRE PLC	77,500	12.89	998,975.00	
BARCLAYS PLC	1,574,827	3.02	4,760,702.02	
HSBC HOLDINGS PLC	2,388,703	6.81	16,267,067.43	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,289,754	0.50	2,675,028.59	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	2,312,954	0.33	784,091.40	
STANDARD CHARTERED PLC	275,843	14.90	4,110,060.70	
3I GROUP PLC	132,000	2.62	346,104.00	
ICAP PLC	70,916	3.35	237,639.51	
INVESTEC PLC	61,000	4.52	275,842.00	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	18,902	6.56	123,997.12	
MAN GROUP PLC	238,945	2.39	572,512.22	
SCHRODERS PLC	17,000	11.80	200,600.00	
ADMIRAL GROUP PLC	25,000	12.00	300,000.00	
AVIVA PLC	378,434	3.76	1,425,939.31	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	817,491	0.76	624,154.37	
OLD MUTUAL PLC	743,324	1.08	804,276.56	
PRUDENTIAL PLC	344,753	6.03	2,080,584.35	
RESOLUTION LTD	332,046	0.75	250,694.73	
RSA INSURANCE GROUP PLC	461,885	1.31	609,226.31	
STANDARD LIFE PLC	308,048	1.97	607,470.65	
AUTONOMY CORP PLC	30,000	14.97	449,100.00	
SAGE GROUP PLC (THE)	179,063	2.29	411,128.64	
BT GROUP PLC	1,047,669	1.17	1,227,868.06	
CABLE & WIRELESS PLC	351,018	1.37	484,053.82	
INMARSAT PLC	60,000	7.29	437,700.00	
VODAFONE GROUP PLC	7,247,038	1.39	10,134,982.64	
CENTRICA PLC	696,335	2.74	1,913,528.58	
DRAX GROUP PLC	54,200	4.18	226,881.20	
INTERNATIONAL POWER PLC	206,253	3.29	679,191.12	
NATIONAL GRID PLC	337,617	6.38	2,153,996.46	
SCOTTISH & SOUTHERN ENERGY	127,808	11.49	1,468,513.92	
SEVERN TRENT PLC	33,494	11.46	383,841.24	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	95,391	5.43	517,973.13	
英bond 小計	39,590,953		179,794,415.78	
(邦貨換算額)			(25,638,683,690)	(単位：円)
スイスフラン				
GIVAUDAN-REG	1,028	865.50	889,734.00	
HOLCIM LTD-REG	34,097	72.90	2,485,671.30	
SYNGENTA AG	12,841	282.40	3,626,298.40	
ABB LTD	304,403	19.77	6,018,047.31	
GEBERIT AG-REG	5,370	184.10	988,617.00	

SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,000	81.50	81,500.00	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	8,970	81.90	734,643.00	
ADECCO SA-REG	17,834	54.70	975,519.80	
SGS SA	741	1,379.00	1,021,839.00	
KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	7,335	96.65	708,927.75	
CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-BR A	71,777	36.07	2,588,996.39	
THE SWATCH GROUP AG-B	4,219	295.50	1,246,714.50	
THE SWATCH GROUP AG-REG	6,100	56.10	342,210.00	
ARYATA AG	11,300	40.20	454,260.00	
LINDT & SPRUENGLI AG	116	2,240.00	259,840.00	
LINDT & SPRUENGLI AG-REG	14	25,120.00	351,680.00	
NESTLE SA-REGISTERED	477,600	51.10	24,405,360.00	
NOBEL BIOCARE HOLDING AG	15,645	27.82	435,243.90	
SONOVA HOLDING AG	6,442	128.30	826,508.60	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	970	259.25	251,472.50	
SYNTHES INC	8,150	125.30	1,021,195.00	
ACTELION LTD	14,216	53.20	756,291.20	
LONZA GROUP AG-REG	6,552	77.10	505,159.20	
NOVARTIS AG-REG SHS	290,883	58.55	17,031,199.65	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	96,790	181.20	17,538,348.00	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	155,060	47.92	7,430,475.20	
GAM HOLDING LTD	30,473	11.75	358,057.75	
JULIUS BAER GROUP LTD	27,073	33.70	912,360.10	
PARGESA HOLDING SA-BR	4,000	85.30	341,200.00	
UBS AG-REGISTERED	490,631	14.56	7,143,587.36	
BALOISE HOLDING AG	7,000	90.15	631,050.00	
SWISS LIFE HOLDING AG	4,070	135.80	552,706.00	
SWISS RE-REG	48,000	46.76	2,244,480.00	
ZURICH FINANCIAL SERVICES AG	20,148	248.50	5,006,778.00	
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	23,582	17.18	405,138.76	
SWISSCOM AG-REG	3,257	390.90	1,273,161.30	
BKW FMB ENERGIE AG	1,820	81.15	147,693.00	
スイスフラン 小計	2,219,507		111,991,963.97	
(邦貨換算額)			(9,446,522,160)	(単位：円)
スウェーデンクローナ				
LUNDIN PETROLEUM AB	27,602	55.20	1,523,630.40	
HOLMEN AB-B SHARES	7,833	176.50	1,382,524.50	
SSAB AB-A SHARES	33,942	118.60	4,025,521.20	
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	79,262	103.50	8,203,617.00	
ALFA LAVAL AB	47,952	102.70	4,924,670.40	
ASSA ABLOY AB-B	42,466	132.00	5,605,512.00	
ATLAS COPCO AB-A SHS	94,532	100.20	9,472,106.40	
ATLAS COPCO AB-B SHS	53,196	91.50	4,867,434.00	
SANDVIK AB	135,054	79.40	10,723,287.60	
SCANIA AB-B SHS	46,532	96.90	4,508,950.80	

SKANSKA AB-B SHS	52,290	119.60	6,253,884.00	
SKF AB-B SHARES	54,348	113.40	6,163,063.20	
VOLVO AB-A SHS	60,266	61.40	3,700,332.40	
VOLVO AB-B SHS	153,700	61.55	9,460,235.00	
SECURITAS AB-B SHS	42,457	73.70	3,129,080.90	
ELECTROLUX AB-SER B	32,783	152.20	4,989,572.60	
HUSQVARNA AB-B SHS	57,983	48.70	2,823,772.10	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	70,672	435.50	30,777,656.00	
SWEDISH MATCH AB	34,571	159.00	5,496,789.00	
GETINGE AB-B SHS	28,138	158.00	4,445,804.00	
NORDEA BANK AB	444,129	67.75	30,089,739.75	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A	209,923	42.67	8,957,414.41	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	67,508	191.50	12,927,782.00	
SWEDBANK AB - A SHARES	83,060	65.00	5,398,900.00	
INVESTOR AB-B SHS	64,149	124.50	7,986,550.50	
ERICSSON LM-B SHS	413,523	73.15	30,249,207.45	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	10,800	577.00	6,231,600.00	
TELE2 AB -B SHS	41,473	108.30	4,491,525.90	
TELIASONERA AB	301,271	49.60	14,943,041.60	
スウェーデンクローナ 小計	2,791,415		253,753,205.11	
(邦貨換算額)			(3,197,290,384)	(単位：円)
ノルウェークローネ				
SEADRILL LID	39,895	126.80	5,058,686.00	
STATOIL ASA	153,364	131.50	20,167,366.00	
NORSK HYDRO ASA	96,797	39.70	3,842,840.90	
YARA INTERNATIONAL ASA	25,705	245.70	6,315,718.50	
ORKLA ASA	107,350	47.45	5,093,757.50	
RENEWABLE ENERGY CORP AS	45,670	22.98	1,049,496.60	
DNB NOR ASA	119,019	64.75	7,706,480.25	
TELENOR ASA	114,792	75.45	8,661,056.40	
ノルウェークローネ 小計	702,592		57,895,402.15	
(邦貨換算額)			(894,483,963)	(単位：円)
デンマーククローネ				
NOVOZYMES A/S-B SHARES	6,223	557.00	3,466,211.00	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	27,562	284.10	7,830,364.20	
A P MOLLER - MAERSK A/S	182	43,090.00	7,842,380.00	
A P MOLLER-MAERSK A/S-A	79	41,170.00	3,252,430.00	
DSV A/S	29,480	88.95	2,622,246.00	
CARLSBERG AS-B	15,086	378.70	5,713,068.20	
COLOPLAST-B	3,472	607.00	2,107,504.00	
WILLIAM DEMANT HOLDING	2,900	394.60	1,144,340.00	
H LUNDBECK A/S	7,500	98.00	735,000.00	
NOVO NORDISK A/S-B	60,103	393.00	23,620,479.00	
DANSKE BANK A/S	63,398	126.10	7,994,487.80	

TOPDANMARK AS	1,934	648.00	1,253,232.00	
TRYGVESTA AS	3,368	319.80	1,077,086.40	
デンマーククローネ 小計	221,287		68,658,828.60	
( 邦貨換算額 )			(1,139,736,554)	( 単位 : 円 )
オーストラリアドル				
ARROW ENERGY LTD	75,000	3.64	273,000.00	
CALTEX AUSTRALIA LIMITED	18,000	9.92	178,560.00	
ENERGY RESOURCES OF AUSTRALIA LTD	9,500	19.06	181,070.00	
ORIGIN ENERGY LIMITED	120,981	16.54	2,001,025.74	
PALADIN ENERGY LIMITED	95,000	3.67	348,650.00	
SANTOS LTD	110,811	13.61	1,508,137.71	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	75,056	44.00	3,302,464.00	
WORLEY PARSONS LIMITED	22,100	24.00	530,400.00	
ALUMINA LTD	350,977	1.66	582,621.82	
AMCOR LIMITED	174,727	5.95	1,039,625.65	
BHP BILLITON LTD	462,330	41.39	19,135,838.70	
BLUESCOPE STEEL LTD	258,327	2.50	645,817.50	
BORAL LIMITED	83,596	5.52	461,449.92	
FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	168,000	5.16	866,880.00	
INCITEC PIVOT LTD	217,000	3.59	779,030.00	
JAMES HARDIE INDUSTRIES NV	64,003	7.66	490,262.98	
NEWCREST MINING LIMITED	66,278	33.67	2,231,580.26	
NUFARM LTD	24,275	9.92	240,808.00	
ONESTEEL LIMITED	174,695	3.43	599,203.85	
ORICA LIMITED	48,923	24.80	1,213,290.40	
OZ MINERALS LIMITED	431,524	1.03	446,627.34	
RIO TINTO LIMITED	59,681	72.92	4,351,938.52	
SIMS METAL MANAGEMENT LTD	22,195	21.50	477,192.50	
CSR LIMITED	207,940	1.68	349,339.20	
LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	20,905	37.95	793,344.75	
BRAMBLES LIMITED	194,532	7.04	1,369,505.28	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	130,138	2.97	386,509.86	
TOLL HOLDINGS LIMITED	91,620	8.74	800,758.80	
BILLABONG INTERNATIONAL LTD	24,611	10.76	264,814.36	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	48,007	4.66	223,712.62	
CROWN LTD	63,965	7.80	498,927.00	
TABCORP HOLDINGS LIMITED	83,545	6.82	569,776.90	
TATTS GROUP LTD	172,000	2.37	407,640.00	
FAIRFAX MEDIA LTD	301,729	1.74	525,008.46	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	79,432	3.79	301,047.28	
METCASH LTD	104,000	4.08	424,320.00	
WESFARMERS LIMITED	139,584	29.65	4,138,665.60	
WESFARMERS LIMITED-PPP	21,654	29.70	643,123.80	
WOOLWORTHS LIMITED	168,398	26.12	4,398,555.76	
COCA-COLA AMATIL LIMITED	76,917	10.57	813,012.69	

FOSTER'S GROUP LTD	270,619	5.55	1,501,935.45	
GOODMAN FIELDER LIMITED	158,000	1.58	249,640.00	
COCHLEAR LIMITED	7,803	62.78	489,872.34	
SONIC HEALTHCARE LTD	49,926	14.19	708,449.94	
CSL LIMITED	81,314	33.90	2,756,544.60	
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	345,592	22.07	7,627,215.44	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	46,000	10.00	460,000.00	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	209,368	53.18	11,134,190.24	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	287,711	25.91	7,454,592.01	
WESTPAC BANKING CORPORATION	403,377	25.43	10,257,877.11	
ASX LTD	23,410	35.85	839,248.50	
MACQUARIE GROUP LTD	45,932	47.30	2,172,583.60	
AMP LIMITED	280,161	6.27	1,756,609.47	
AXA ASIA PACIFIC HOLDINGS LTD	141,340	6.32	893,268.80	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	284,006	3.96	1,124,663.76	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	137,173	23.20	3,182,413.60	
SUNCORP-METWAY LIMITED	176,481	9.24	1,630,684.44	
COMPUTERSHARE LIMITED	61,429	12.05	740,219.45	
TELSTRA CORPORATION LIMITED	615,187	3.10	1,907,079.70	
AGL ENERGY LIMITED	75,469	13.75	1,037,698.75	
オーストラリアドル 小計	8,762,254		116,718,324.45	
(邦貨換算額)			(9,528,884,008)	(単位：円)
ニュージーランドドル				
FLETCHER BUILDING LTD	81,957	7.96	652,377.72	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	130,557	1.84	240,224.88	
SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP	82,890	3.19	264,419.10	
TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	256,909	2.34	601,167.06	
CONTACT ENERGY LIMITED	35,256	5.64	198,843.84	
ニュージーランドドル 小計	587,569		1,957,032.60	
(邦貨換算額)			(124,878,250)	(単位：円)
香港ドル				
MONGOLIA ENERGY CORPORATION LTD.	450,000	3.58	1,611,000.00	
HUTCHISON WHAMPOA LTD	294,000	55.80	16,405,200.00	
NWS HOLDINGS LTD	135,000	13.96	1,884,600.00	
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	195,000	14.24	2,776,800.00	
MTR CORPORATION	200,500	26.75	5,363,375.00	
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	31,000	53.60	1,661,600.00	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	96,000	23.90	2,294,400.00	
SANDS CHINA LTD	280,000	11.24	3,147,200.00	
SHANGRI-LA ASIA LTD.	188,000	13.22	2,485,360.00	
TELEVISION BROADCASTS LTD	40,000	36.30	1,452,000.00	
ESPRIT HOLDINGS LTD	154,927	57.05	8,838,585.35	
LI & FUNG LTD	311,600	36.20	11,279,920.00	
LIFESTYLE INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED	68,000	13.50	918,000.00	

BANK OF EAST ASIA	211,620	27.65	5,851,293.00	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	510,500	17.06	8,709,130.00	
HANG SENG BANK LTD	106,300	110.20	11,714,260.00	
WING HANG BANK LIMITED	22,000	65.15	1,433,300.00	
HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	141,700	131.00	18,562,700.00	
CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	193,000	95.70	18,470,100.00	
HANG LUNG GROUP LTD	116,000	37.50	4,350,000.00	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	287,000	28.70	8,236,900.00	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	149,000	51.45	7,666,050.00	
HOPEWELL HOLDINGS LTD	72,000	23.20	1,670,400.00	
HYSAN DEVELOPMENT CO	91,000	20.30	1,847,300.00	
KERRY PROPERTIES LTD	103,500	37.65	3,896,775.00	
NEW WORLD DEVELOPMENT	356,000	13.98	4,976,880.00	
SINO LAND CO	222,000	13.70	3,041,400.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	197,000	102.90	20,271,300.00	
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	106,500	87.55	9,324,075.00	
WHARF HOLDINGS LTD	196,000	40.80	7,996,800.00	
WHEELOCK&COMPANY LTD	130,000	22.00	2,860,000.00	
FOXCONN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	298,000	8.42	2,509,160.00	
PCCW LIMITED	510,000	2.20	1,122,000.00	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	63,000	29.75	1,874,250.00	
CLP HOLDINGS LTD	285,100	53.25	15,181,575.00	
HONG KONG & CHINA GAS	527,969	17.14	9,049,388.66	
HONGKONG ELECTRIC HOLDINGS	191,500	43.40	8,311,100.00	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	25,500	69.60	1,774,800.00	
香港ドル 小計	7,556,216		240,818,977.01	
(邦貨換算額)			(2,822,398,410)	(単位：円)
シンガポールドル				
FRASER & NEAVE LTD	128,000	4.15	531,200.00	
KEPPEL CORP LTD	178,000	8.42	1,498,760.00	
NOBLE GROUP LTD	221,200	3.06	676,872.00	
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	140,820	3.62	509,768.40	
SEMBCORP MARINE LTD	125,400	3.47	435,138.00	
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG	201,000	3.26	655,260.00	
YANGZIJANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	220,000	1.07	235,400.00	
COMFORTDELGRO CORP LTD	258,000	1.56	402,480.00	
NEPTUNE ORIENT LINES LTD	140,000	1.69	236,600.00	
SINGAPORE AIRLINES LTD	76,266	14.80	1,128,736.80	
GENTING SINGAPORE PLC	677,000	1.02	690,540.00	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	210,250	3.75	788,437.50	
CYCLE & CARRIAGE LTD	18,000	23.90	430,200.00	
OLAM INTERNATIONAL LTD	168,000	2.60	436,800.00	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	891,600	0.56	499,296.00	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	179,000	6.40	1,145,600.00	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	239,000	14.26	3,408,140.00	

OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	358,000	8.60	3,078,800.00	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	167,000	18.66	3,116,220.00	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	126,000	7.85	989,100.00	
CAPITALAND LTD	356,000	4.00	1,424,000.00	
CAPITAMALLS ASIA LTD	190,000	2.24	425,600.00	
CITY DEVELOPMENTS LTD	70,000	10.98	768,600.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,100,015	3.00	3,300,045.00	
STARHUB LIMITED	80,000	2.13	170,400.00	
シンガポールドル 小計	6,518,551		26,981,993.70	
(邦貨換算額)			(1,746,274,632)	(単位：円)
合計	141,649,453		232,698,461,859	単位：円
(外貨建有価証券邦貨換算額合計)			(232,698,461,859)	(単位：円)

(注)

- 合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券にかかるもので、内書きであります。
- 米ドル表示の株式については、576銘柄、信託財産純資産総額に対する比率53.5%、合計に対する比率54.8%です。  
カナダドル表示の株式については、90銘柄、信託財産純資産総額に対する比率5.3%、合計に対する比率5.5%です。  
ユーロ表示の株式については、267銘柄、信託財産純資産総額に対する比率15.9%、合計に対する比率16.3%です。  
英ポンド表示の株式については、97銘柄、信託財産純資産総額に対する比率10.8%、合計に対する比率11.0%です。  
スイスフラン表示の株式については、37銘柄、信託財産純資産総額に対する比率4.0%、合計に対する比率4.1%です。  
スウェーデンクローナ表示の株式については、29銘柄、信託財産純資産総額に対する比率1.3%、合計に対する比率1.4%です。  
ノルウェークローネ表示の株式については、8銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.4%、合計に対する比率0.4%です。  
デンマーククローネ表示の株式については、13銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.5%、合計に対する比率0.5%です。  
オーストラリアドル表示の株式については、60銘柄、信託財産純資産総額に対する比率4.0%、合計に対する比率4.1%です。  
ニュージーランドドル表示の株式については、5銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.1%、合計に対する比率0.1%です。  
香港ドル表示の株式については、38銘柄、信託財産純資産総額に対する比率1.2%、合計に対する比率1.2%です。  
シンガポールドル表示の株式については、25銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.7%、合計に対する比率0.8%です。

(b) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	口数	評価額	備考
新株予約権証券	ユーロ			
	FONCIERE DES REGIONS-WRT	3,200.00	1,318.40	
	ユーロ 小計	3,200.00	1,318.40	
	(邦貨換算額)		(162,927)	(単位：円)
	合計		162,927	単位：円
	(外貨建有価証券邦貨換算額合計)		(162,927)	(単位：円)

(注)

1. 合計金額欄の（ ）内は、外貨建有価証券にかかるもので、内書きであります。
2. ユーロ表示の新株予約権証券については、1銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.0%、合計に対する比率100.0%です。

種類	銘柄	口数	評価額	備考
投資証券	米ドル			
	AMB PROPERTY CORP	19,450	456,297.00	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	75,000	1,312,500.00	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,257	878,496.28	
	BOSTON PROPERTIES INC	18,859	1,233,190.01	
	DUKE REALTY CORP	30,373	331,976.89	
	EQUITY RESIDENTIAL	37,706	1,304,627.60	
	FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	7,904	530,595.52	
	HCP,INC.	39,557	1,159,020.10	
	HEALTH CARE REIT INC	16,200	680,724.00	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	84,951	1,003,271.31	
	KIMCO REALTY CORPORATION	52,532	704,979.44	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	15,247	460,916.81	
	PLUM CREEK TIMBER COMPANY	22,407	820,768.41	
	PROLOGIS	58,852	722,114.04	
	PUBLIC STORAGE	17,529	1,380,408.75	
	RAYONIER INC	10,900	454,857.00	
	REGENCY CENTERS CORP	11,100	373,848.00	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	39,442	2,991,675.70	
	VENTAS INC	22,179	979,646.43	
	VORNADO REALTY TRUST	22,091	1,410,289.44	
	米ドル 小計	613,536	19,190,202.73	
	( 邦貨換算額 )		(1,747,459,860)	( 単位 : 円 )
	カナダドル			
	ARC ENERGY TRUST UNITS	18,000	394,560.00	
	CANADIAN OIL SANDS TRUST	33,059	973,256.96	
	ENERPLUS RESOURCES FUND	23,490	546,377.40	
	PENN WEST ENERGY TRUST	59,667	1,181,406.60	
	PROVIDENT ENERGY TRUST-UNITS	34,000	289,680.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	14,500	267,090.00	
	YELLOW PAGES INCOME FUND	31,500	182,070.00	
	カナダドル 小計	214,216	3,834,440.96	
	( 邦貨換算額 )		(333,327,952)	( 単位 : 円 )
	ユーロ			
	CORIO NV	7,578	332,105.85	
	FONCIERE DES REGIONS	3,200	220,384.00	
	GECINA SA	2,430	186,599.70	
	ICADE	2,670	189,436.50	
	KLEPIERRE	12,132	328,291.92	

	UNIBAIL-RODAMCO SE	12,111	1,774,867.05	
	ユーロ 小計	40,121	3,031,685.02	
	(邦貨換算額)		(374,655,634)	(単位：円)
	英ポンド			
	BRITISH LAND CO PLC	117,505	532,297.65	
	HAMMERSON PLC	95,497	374,252.74	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	106,627	683,479.07	
	LIBERTY INTERNATIONAL PLC	65,855	309,452.64	
	SEGRO PLC	98,434	315,579.40	
	英ポンド 小計	483,918	2,215,061.50	
	(邦貨換算額)		(315,867,769)	(単位：円)
	オーストラリアドル			
	ASCIANO GROUP	362,000	640,740.00	
	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	236,612	444,830.56	
	DEXUS PROPERTY GROUP	694,804	569,739.28	
	GOODMAN GROUP	850,000	497,250.00	
	GPT GROUP	1,227,473	724,209.07	
	INTOLL GROUP	316,311	357,431.43	
	LEND LEASE GROUP	58,172	528,783.48	
	MAP GROUP	107,000	327,420.00	
	MIRVAC GROUP	380,710	552,029.50	
	STOCKLAND	323,614	1,262,094.60	
	TRANSURBAN GROUP	162,123	826,827.30	
	WESTFIELD GROUP	286,593	3,367,467.75	
	オーストラリアドル 小計	5,005,412	10,098,822.97	
	(邦貨換算額)		(824,467,907)	(単位：円)
	香港ドル			
	LINK REIT	293,500	5,511,930.00	
	香港ドル 小計	293,500	5,511,930.00	
	(邦貨換算額)		(64,599,819)	(単位：円)
	シンガポールドル			
	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	218,000	418,560.00	
	CAPITAMALL TRUST	328,000	590,400.00	
	シンガポールドル 小計	546,000	1,008,960.00	
	(邦貨換算額)		(65,299,891)	(単位：円)
	合計		3,725,678,832	単位：円
	(外貨建有価証券邦貨換算額合計)		(3,725,678,832)	(単位：円)

(注)

1. 合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券にかかるもので、内書きであります。
2. 米ドル表示の投資証券については、20銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.7%、合計に対する比率46.9%です。

カナダドル表示の投資証券については、7銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.1%、  
合計に対する比率8.9%です。

ユーロ表示の投資証券については、6銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.2%、  
合計に対する比率10.1%です。

英ポンド表示の投資証券については、5銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.1%、  
合計に対する比率8.5%です。

オーストラリアドル表示の投資証券については、12銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.3%、  
合計に対する比率22.1%です。

香港ドル表示の投資証券については、1銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.0%、  
合計に対する比率1.7%です。

シンガポールドル表示の投資証券については、2銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.0%、  
合計に対する比率1.8%です。

#### デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

## 「外国債券パッシブ・マザーファンド」の状況

## (1) 貸借対照表

対象年月日	(平成21年2月18日現在)	(平成22年2月18日現在)
科目	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	1,196,263,054	1,385,373,567
コール・ローン	1,969,867,932	945,750,933
国債証券	153,286,128,233	249,345,450,647
未収利息	1,804,453,888	2,941,603,143
前払費用	223,345,034	218,285,393
流動資産合計	158,480,058,141	254,836,463,683
資産合計	158,480,058,141	254,836,463,683
負債の部		
流動負債		
未払金	356,691,271	-
未払解約金	1,007,780,675	40,125,360
流動負債合計	1,364,471,946	40,125,360
負債合計	1,364,471,946	40,125,360
純資産の部		
元本等		
1 元本		
元本	143,056,349,148	215,320,683,575
元本合計	143,056,349,148	215,320,683,575
2 剰余金		
剰余金	14,059,237,047	39,475,654,748
剰余金合計	14,059,237,047	39,475,654,748
元本等合計	157,115,586,195	254,796,338,323
純資産合計	157,115,586,195	254,796,338,323
負債・純資産合計	158,480,058,141	254,836,463,683

(注) 「外国債券パッシブ・マザーファンド」は、毎年12月17日（ただし、休業日の場合は翌営業日）に決算を行います。上記の貸借対照表は平成21年2月18日ならびに平成22年2月18日現在における同マザーファンドの状況です。

## (2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自平成20年2月19日 至平成21年2月18日	自平成21年2月19日 至平成22年2月18日
1. 有価証券の評価基準及び 評価方法	国債証券（売買目的有価証券） 個別法に基づき、時価で評価して おります。時価評価にあたっては、 金融商品取引業者、銀行等の提 示する価額（ただし、売気配相場 は使用しない）、価格情報会社の 提供する価額または業界団体が公 表する売買参考統計値等で評価し ております。	国債証券（売買目的有価証券） 同左
2. デリバティブの評価基準 及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価 で評価しております。時価評価にあ たっては、原則として、わが国にお ける計算期間末日の対顧客先物 売買相場の仲値によっております。	為替予約取引 同左
3. その他財務諸表作成のため の基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規 則」第60条および第61条に基づ いて処理しております。	外貨建資産等の会計処理 同左

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成21年2月18日現在)	(平成22年2月18日現在)
1. 受益権総数	平成21年2月18日現在における 受益権の総数 143,056,349,148口	平成22年2月18日現在における 受益権の総数 215,320,683,575口
2. 1単位当たり純資産額	1.0983円 (1万口 = 10,983円)	1.1833円 (1万口 = 11,833円)

## (デリバティブ取引に関する注記)

## . 取引の状況に関する事項

項目	自平成20年2月19日 至平成21年2月18日	自平成21年2月19日 至平成22年2月18日
1. 取引の内容	<p>当ファンドの行うことのできるデリバティブ取引は、次の通りです。</p> <p>a. わが国の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。</p> <p>b. わが国の取引所における通貨にかかる先物取引および通貨にかかるオプション取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引。</p> <p>c. わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。</p> <p>異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（「スワップ取引」）。</p> <p>金利先渡取引および為替先渡取引。</p> <p>外国為替の売買の予約取引。</p>	同左
2. 取引に対する取組方針	デリバティブ取引につきましては信託約款等に従っており、その制限を遵守しております。	同左
3. 取引の利用目的	信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため。	同左
4. 取引に係るリスクの内容	デリバティブ取引に伴いファンドに影響を与える主なリスクとしてマーケットリスクがあげられます。マーケットリスクについては、ポジションや時価、予想損失額の把握が重要だと考えております。	同左
5. 取引に係るリスクの管理体制	リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理ならびにコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。	同左
6. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	該当事項はありません。	同左

## ・取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

（平成21年2月18日現在）

平成21年2月18日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（平成22年2月18日現在）

平成22年2月18日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（関連当事者との取引に関する注記）

（自 平成20年2月19日 至 平成21年2月18日）

該当事項はありません。

（自 平成21年2月19日 至 平成22年2月18日）

該当事項はありません。

(その他の注記)

(平成21年2月18日現在)

本有価証券報告書における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	108,309,366,173円
同期中における追加設定元本額	40,234,258,426円
同期中における一部解約元本額	5,487,275,451円
平成21年2月18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	805,883,711円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	87,463,740円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	275,381,169円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	114,361,235円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	2,036,472円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	156,265円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	145,843円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	137,841円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	136,091円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	129,625円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	111,237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>	6,010,775,435円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	12,589,986,808円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	40,507,140,245円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	12,674,530,018円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	26,446,659,058円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	86,414,564円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	188,200,610円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	54,290,318円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	1,106,784,375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>	162,100,253円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,837,815,805円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,749,569,417円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	7,209,433,682円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	14,428,884,302円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,274,387,597円
三井住友・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	1,995,919,031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)	857,457,974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)	3,256,020,507円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	343,583,893円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	4,266,144,037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)	3,724,307,990円
合計	143,056,349,148円

(平成22年2月18日現在)

本有価証券報告書における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	143,056,349,148円
同期中における追加設定元本額	81,883,058,087円
同期中における一部解約元本額	9,618,723,660円
平成22年2月18日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	1,437,046,810円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	120,486,037円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	387,660,890円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	174,538,037円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	6,080,796円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	2,287,400円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	260,423円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	1,845,496円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	261,961円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	141,319円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	357,822円
SMAM・年金外国債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>	5,253,769,385円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	11,648,080,707円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	40,356,560,721円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	13,525,756,703円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	28,394,771,792円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	83,750,647円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	184,534,055円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	52,430,229円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	1,492,762,291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>	181,727,474円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,882,168,303円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	3,037,270,194円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	7,314,529,946円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	18,868,991,392円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,289,878,560円
三井住友・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	7,712,405,655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)	1,540,448,823円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	10,399,713,387円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	448,270,586円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	11,857,402,694円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	44,140,833,782円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	297,019,628円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	89,446,385円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	24,483,112円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	438,898,912円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	1,571,506,491円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	399,449,669円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	52,889,159円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	15,468,506円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	3,703,780円

SMAM・アセットバランスファンドVA25L2&lt;適格機関投資家専用&gt;

630,793,616円

合計

215,320,683,575円

## (3) 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル			
	US T 0.75% 11/11/30	7,000,000.00	6,997,265.66	
	US T 0.875% 10/12/31	10,000,000.00	10,046,875.00	
	US T 0.875% 11/01/31	10,500,000.00	10,549,628.88	
	US T 0.875% 11/02/28	10,000,000.00	10,047,656.30	
	US T 0.875% 11/03/31	10,000,000.00	10,049,218.80	
	US T 0.875% 11/04/30	10,000,000.00	10,048,437.50	
	US T 0.875% 11/05/31	9,000,000.00	9,044,296.92	
	US T 1% 11/07/31	11,000,000.00	11,067,031.25	
	US T 1% 11/08/31	8,000,000.00	8,044,375.04	
	US T 1% 11/09/30	9,000,000.00	9,047,109.42	
	US T 1% 11/10/31	9,000,000.00	9,042,890.67	
	US T 1.00% 2011/12/31	8,000,000.00	8,026,250.00	
	US T 1.125% 11/06/30	10,000,000.00	10,082,812.50	
	US T 1.125% 11/12/15	7,000,000.00	7,041,015.66	
	US T 1.125% 12/01/15	7,000,000.00	7,036,640.66	
	US T 1.125% 12/12/15	9,000,000.00	8,945,156.25	
	US T 1.375% 12/03/15	7,000,000.00	7,065,078.16	
	US T 1.375% 12/04/15	8,000,000.00	8,070,000.00	
	US T 1.375% 12/05/15	8,500,000.00	8,564,414.10	
	US T 1.375% 12/09/15	7,000,000.00	7,027,890.66	
	US T 1.375% 12/10/15	8,000,000.00	8,025,000.00	
	US T 1.375% 12/11/15	8,000,000.00	8,014,375.04	
	US T 1.375% 12/2/15	8,000,000.00	8,077,500.00	
	US T 1.375% 2013/01/15	10,000,000.00	9,995,312.50	
	US T 1.5% 12/07/15	9,000,000.00	9,087,890.67	
	US T 1.5% 13/12/31	7,000,000.00	6,895,000.00	
	US T 1.75% 11/11/15	6,000,000.00	6,103,593.78	
	US T 1.75% 12/08/15	10,000,000.00	10,142,968.80	
	US T 1.75% 14/01/31	6,500,000.00	6,452,265.62	
	US T 1.75% 14/03/31	8,000,000.00	7,912,500.00	
	US T 1.875% 12/06/15	8,000,000.00	8,148,125.04	
	US T 1.875% 14/02/28	6,000,000.00	5,975,625.00	
	US T 1.875% 14/04/30	8,000,000.00	7,940,625.04	
	US T 11.25% 15/02/15	2,000,000.00	2,840,625.00	
	US T 2% 13/11/30	7,000,000.00	7,036,093.75	
	US T 2.125% 14/11/30	10,500,000.00	10,408,945.36	
	US T 2.25% 14/05/31	9,000,000.00	9,060,468.75	
	US T 2.375% 14/08/31	8,000,000.00	8,059,375.04	

US T 2.375% 14/09/30	10,000,000.00	10,057,812.50	
US T 2.375% 14/10/31	8,000,000.00	8,031,875.04	
US T 2.375% 16/03/31	5,500,000.00	5,339,296.87	
US T 2.5% 13/03/31	4,500,000.00	4,640,625.00	
US T 2.625% 14/06/30	9,000,000.00	9,187,031.25	
US T 2.625% 14/07/31	10,000,000.00	10,192,187.50	
US T 2.625% 16/02/29	5,000,000.00	4,940,625.00	
US T 2.625% 16/04/30	5,000,000.00	4,919,531.25	
US T 2.625% 2014/12/31	6,000,000.00	6,074,531.28	
US T 2.75% 13/02/28	3,700,000.00	3,845,109.37	
US T 2.75% 13/10/31	5,500,000.00	5,687,343.75	
US T 2.75% 16/11/30	7,000,000.00	6,841,406.25	
US T 2.75% 19/02/15	15,000,000.00	13,968,750.00	
US T 2.875% 13/01/31	4,000,000.00	4,174,687.52	
US T 3% 16/08/31	7,000,000.00	6,989,062.50	
US T 3% 16/09/30	7,000,000.00	6,973,750.00	
US T 3.125% 13/04/30	4,500,000.00	4,723,593.75	
US T 3.125% 13/08/31	5,500,000.00	5,762,109.37	
US T 3.125% 13/09/30	6,500,000.00	6,806,718.75	
US T 3.125% 16/10/31	6,000,000.00	6,015,000.00	
US T 3.125% 19/05/15	16,000,000.00	15,310,000.00	
US T 3.25% 16/05/31	4,000,000.00	4,072,500.00	
US T 3.25% 16/06/30	6,000,000.00	6,101,250.00	
US T 3.25% 16/07/31	5,000,000.00	5,078,125.00	
US T 3.25% 2016/12/31	8,000,000.00	8,051,250.00	
US T 3.375% 12/11/30	3,000,000.00	3,171,328.14	
US T 3.375% 13/06/30	5,000,000.00	5,283,593.75	
US T 3.375% 13/07/31	5,500,000.00	5,817,109.37	
US T 3.375% 19/11/15	15,000,000.00	14,557,031.25	
US T 3.5% 13/05/31	5,000,000.00	5,306,640.65	
US T 3.5% 18/02/15	8,500,000.00	8,547,812.50	
US T 3.5% 39/02/15	6,000,000.00	4,855,312.50	
US T 3.625 12/12/31	3,500,000.00	3,726,406.25	
US T 3.625% 13/05/15	3,650,000.00	3,890,671.87	
US T 3.625% 19/08/15	16,000,000.00	15,887,500.00	
US T 3.75% 18/11/15	13,000,000.00	13,150,312.50	
US T 3.875% 12/10/31	3,000,000.00	3,209,531.25	
US T 3.875% 13/02/15	3,800,000.00	4,077,875.00	
US T 3.875% 18/05/15	6,000,000.00	6,167,812.50	
US T 4% 12/11/15	5,000,000.00	5,374,218.75	
US T 4% 14/02/15	6,500,000.00	7,025,078.12	
US T 4% 18/08/15	8,000,000.00	8,272,500.00	
US T 4% 2015/02/15	7,700,000.00	8,291,937.50	
US T 4.125 15/05/15	7,200,000.00	7,787,250.00	
US T 4.125% 12/08/31	2,500,000.00	2,685,546.87	
US T 4.25% 11/01/15	4,000,000.00	4,142,187.52	

US T 4.25% 12/09/30	3,000,000.00	3,234,843.75
US T 4.25% 13/08/15	7,000,000.00	7,617,968.75
US T 4.25% 13/11/15	6,900,000.00	7,521,000.00
US T 4.25% 14/08/15	5,400,000.00	5,896,125.00
US T 4.25% 14/11/15	6,100,000.00	6,647,093.75
US T 4.25% 15/08/15	7,600,000.00	8,249,562.50
US T 4.25% 17/11/15	5,000,000.00	5,308,593.75
US T 4.25% 39/05/15	9,000,000.00	8,332,031.25
US T 4.375% 12/08/15	3,700,000.00	4,000,046.87
US T 4.375% 38/02/15	4,200,000.00	3,992,625.00
US T 4.375% 39/11/15	9,000,000.00	8,510,625.00
US T 4.5 11/09/30	4,000,000.00	4,246,250.00
US T 4.5 15/11/15	5,800,000.00	6,371,843.75
US T 4.5% 11/02/28	3,800,000.00	3,960,015.64
US T 4.5% 11/11/30	3,800,000.00	4,053,828.14
US T 4.5% 12/03/31	3,500,000.00	3,759,492.20
US T 4.5% 12/04/30	3,000,000.00	3,229,218.75
US T 4.5% 160215	5,400,000.00	5,912,156.25
US T 4.5% 17/05/15	5,000,000.00	5,420,312.50
US T 4.5% 36/02/15	5,500,000.00	5,362,500.00
US T 4.5% 38/05/15	4,500,000.00	4,369,921.87
US T 4.5% 39/08/15	9,000,000.00	8,693,437.50
US T 4.625% 11/08/31	3,600,000.00	3,819,937.50
US T 4.625% 11/10/31	2,800,000.00	2,987,468.76
US T 4.625% 11/12/31	3,500,000.00	3,747,187.50
US T 4.625% 12/02/29	2,500,000.00	2,687,890.62
US T 4.625% 12/07/31	3,000,000.00	3,254,296.89
US T 4.625% 16/11/15	5,200,000.00	5,701,312.50
US T 4.625% 17/02/15	5,000,000.00	5,475,781.25
US T 4.75% 11/03/31	4,000,000.00	4,190,312.52
US T 4.75% 12/01/31	3,000,000.00	3,227,109.39
US T 4.75% 12/05/31	3,500,000.00	3,794,765.62
US T 4.75% 14/05/15	6,400,000.00	7,110,000.00
US T 4.75% 17/08/15	5,000,000.00	5,492,968.75
US T 4.75% 37/02/15	4,000,000.00	4,051,875.00
US T 4.875% 11/04/30	4,000,000.00	4,210,312.52
US T 4.875% 11/05/31	4,000,000.00	4,223,125.00
US T 4.875% 11/07/31	4,000,000.00	4,249,687.52
US T 4.875% 12/02/15	5,820,000.00	6,280,143.75
US T 4.875% 12/06/30	3,500,000.00	3,810,078.12
US T 4.875% 16/08/15	4,900,000.00	5,458,906.25
US T 5% 11/02/15	5,800,000.00	6,067,343.75
US T 5% 11/08/15	5,900,000.00	6,289,953.12
US T 5% 37/05/15	4,000,000.00	4,208,125.00
US T 5.125% 11/06/30	4,300,000.00	4,568,078.12
US T 5.125% 16/05/15	5,700,000.00	6,431,203.12

US T 5.25% 28/11/15	3,000,000.00	3,257,343.75	
US T 5.25% 29/02/15	2,000,000.00	2,171,875.00	
US T 5.375% 31/02/15	4,020,000.00	4,435,190.62	
US T 5.5% 28/08/15	2,000,000.00	2,235,000.00	
US T 6% 26/02/15	3,000,000.00	3,532,500.00	
US T 6.125% 27/11/15	4,000,000.00	4,783,125.00	
US T 6.125% 29/08/15	2,420,000.00	2,908,537.50	
US T 6.25% 23/08/15	4,500,000.00	5,412,656.25	
US T 6.25% 30/05/15	4,000,000.00	4,885,625.00	
US T 6.375% 27/08/15	2,000,000.00	2,450,937.50	
US T 6.5% 26/11/15	2,000,000.00	2,478,125.00	
US T 6.625% 27/02/15	2,000,000.00	2,509,062.50	
US T 6.75% 26/08/15	2,000,000.00	2,537,187.50	
US T 6.875% 25/08/15	2,000,000.00	2,552,187.50	
US T 7.125% 23/02/15	3,400,000.00	4,392,906.25	
US T 7.25% 16/05/15	4,000,000.00	4,993,125.00	
US T 7.25% 22/08/15	2,500,000.00	3,264,843.75	
US T 7.5% 16/11/15	3,400,000.00	4,316,406.25	
US T 7.5% 24/11/15	2,000,000.00	2,686,250.00	
US T 7.625% 22/11/15	1,000,000.00	1,344,218.75	
US T 7.625% 25/02/15	2,000,000.00	2,717,812.50	
US T 7.875% 21/02/15	2,000,000.00	2,709,062.50	
US T 8% 21/11/15	5,800,000.00	7,948,718.75	
US T 8.125% 19/08/15	3,300,000.00	4,474,078.12	
US T 8.125% 21/05/15	2,000,000.00	2,757,187.50	
US T 8.125% 21/08/15	2,000,000.00	2,761,562.50	
US T 8.75% 17/05/15	3,000,000.00	4,077,656.25	
US T 8.75% 20/08/15	3,000,000.00	4,273,593.75	
US T 8.75% 20/05/15	1,000,000.00	1,420,781.25	
US T 8.875% 17/08/15	2,000,000.00	2,743,437.50	
US T 8.875% 19/02/15	2,100,000.00	2,952,468.75	
US T 9.0% 18/11/15	1,000,000.00	1,411,875.00	
US T 9.125% 18/05/15	1,000,000.00	1,411,406.25	
US T-BOND 8.5% 20/02/15	2,000,000.00	2,789,687.50	
米ドル 小計	936,610,000.00	978,655,947.09	
(邦貨換算額)		(89,116,410,542)	(単位：円)
カナダドル			
CAN 1% 11/09/01	3,500,000.00	3,498,250.00	
CAN 1.25% 11/06/01	3,000,000.00	3,015,540.00	
CAN 2% 12/09/01	3,000,000.00	3,025,440.00	
CAN 2% 14/12/01	4,000,000.00	3,902,800.00	
CAN 2.75% 10/12/01	3,000,000.00	3,053,430.00	
CAN 3% 14/06/01	4,500,000.00	4,607,505.00	
CAN 3.5% 13/06/01	4,500,000.00	4,706,325.00	
CAN 3.5% 20/06/01	1,000,000.00	988,220.00	

	CAN 3.75% 11/09/01	2,000,000.00	2,082,420.00	
	CAN 3.75% 12/06/01	2,000,000.00	2,100,640.00	
	CAN 3.75% 19/06/01	5,000,000.00	5,106,500.00	
	CAN 4% 16/06/01	3,000,000.00	3,184,590.00	
	CAN 4% 17/06/01	3,000,000.00	3,167,850.00	
	CAN 4% 41/06/01	3,000,000.00	2,956,320.00	
	CAN 4.25% 18/06/01	2,500,000.00	2,668,500.00	
	CAN 4.5% 15/06/01	3,000,000.00	3,268,890.00	
	CAN 5% 14/06/01	2,500,000.00	2,763,400.00	
	CAN 5% 37/06/01	4,000,000.00	4,590,000.00	
	CAN 5.25% 12/06/01	2,620,000.00	2,840,132.40	
	CAN 5.25% 13/06/01	2,000,000.00	2,202,760.00	
	CAN 5.75% 29/06/01	2,800,000.00	3,402,952.00	
	CAN 5.75% 33/06/01	3,000,000.00	3,707,850.00	
	CAN 6% 11/06/01	1,600,000.00	1,705,264.00	
	CAN 8% 23/06/01	980,000.00	1,393,814.80	
	CAN 8% 27/06/01	2,000,000.00	2,962,440.00	
	CAN 9% 25/06/01	1,480,000.00	2,313,891.20	
	CANADA-GOV'T 1.25 111201	1,000,000.00	1,001,000.00	
	カナダドル 小計	73,980,000.00	80,216,724.40	
	( 邦貨換算額 )		(6,973,239,852)	( 単位 : 円 )
	ユーロ			
	BGB 2% 12/3/28	1,500,000.00	1,517,250.00	
	BGB 3.25% 16/09/28	3,500,000.00	3,554,250.00	
	BGB 3.5% 11/03/28	3,500,000.00	3,603,600.00	
	BGB 3.5% 15/03/28	1,500,000.00	1,566,450.00	
	BGB 3.75% 15/09/28	3,300,000.00	3,476,220.00	
	BGB 3.75% 20/09/28	1,000,000.00	1,001,400.00	
	BGB 4% 13/03/28	2,800,000.00	2,986,480.00	
	BGB 4% 14/03/28	3,200,000.00	3,427,840.00	
	BGB 4% 17/03/28	2,500,000.00	2,640,000.00	
	BGB 4% 18/03/28	2,500,000.00	2,619,500.00	
	BGB 4% 19/03/28	3,000,000.00	3,110,700.00	
	BGB 4% 2022/03/28	2,000,000.00	2,034,000.00	
	BGB 4.25% 13/09/28	3,000,000.00	3,235,500.00	
	BGB 4.25% 14/09/28	3,500,000.00	3,783,500.00	
	BGB 5% 11/09/28	3,200,000.00	3,401,920.00	
	BGB 5% 12/09/28	3,700,000.00	4,028,190.00	
	BGB 5% 35/03/28	4,000,000.00	4,398,000.00	
	BGB 5.5% 17/09/28	2,740,000.00	3,161,686.00	
	BGB 5.5% 28/03/28	3,000,000.00	3,482,400.00	
	BGB 8% 12/12/24	1,600,000.00	1,881,600.00	
	BGB 8% 15/03/28	2,000,000.00	2,515,800.00	
	BTNS 1.5% 11/09/12	5,000,000.00	5,047,000.00	
	BTNS 2.5% 14/01/12	5,500,000.00	5,587,175.00	

	BTNS 3% 14/07/12	3,500,000.00	3,619,350.00	
	BTNS 3.5% 11/07/12	6,200,000.00	6,431,880.00	
	BTNS 3.75% 12/01/12	5,000,000.00	5,251,000.00	
	BTNS 3.75% 13/01/12	5,000,000.00	5,301,250.00	
	BTNS 4.5% 12/07/12	4,500,000.00	4,821,750.00	
	BTNS 4.5% 13/07/12	3,500,000.00	3,813,250.00	
	BTPS 2.5% 12/07/01	4,000,000.00	4,073,200.00	
	BTPS 3% 12/03/01	4,500,000.00	4,631,850.00	
	BTPS 3% 15/04/15	1,000,000.00	1,007,900.00	
	BTPS 3.5% 11/03/15	5,000,000.00	5,131,250.00	
	BTPS 3.5% 14/06/01	4,000,000.00	4,148,800.00	
	BTPS 3.75% 11/02/01	3,000,000.00	3,079,500.00	
	BTPS 3.75% 11/09/15	4,500,000.00	4,670,865.00	
	BTPS 3.75% 13/12/15	5,000,000.00	5,245,000.00	
	BTPS 3.75% 15/08/01	7,200,000.00	7,519,680.00	
	BTPS 3.75% 16/08/01	7,000,000.00	7,261,800.00	
	BTPS 3.75% 21/08/01	6,300,000.00	6,137,460.00	
	BTPS 4% 12/04/15	4,500,000.00	4,726,350.00	
	BTPS 4% 17/02/01	6,000,000.00	6,273,000.00	
	BTPS 4% 37/02/01	6,500,000.00	5,786,300.00	
	BTPS 4.25 12/10/15	5,500,000.00	5,837,150.00	
	BTPS 4.25 13/08/01	7,310,000.00	7,810,004.00	
	BTPS 4.25 19/02/01	6,400,000.00	6,661,760.00	
	BTPS 4.25% 11/09/01	4,500,000.00	4,699,305.00	
	BTPS 4.25% 13/04/15	4,500,000.00	4,787,550.00	
	BTPS 4.25% 14/08/01	6,900,000.00	7,385,070.00	
	BTPS 4.25% 15/02/01	6,000,000.00	6,412,200.00	
	BTPS 4.25% 19/09/01	6,000,000.00	6,186,000.00	
	BTPS 4.25% 20/03/01	4,000,000.00	4,083,600.00	
	BTPS 4.5% 18/02/01	6,000,000.00	6,413,400.00	
	BTPS 4.5% 18/08/01	5,000,000.00	5,313,500.00	
	BTPS 4.5% 19/03/01	6,500,000.00	6,869,850.00	
	BTPS 4.5% 20/02/01	5,500,000.00	5,750,250.00	
	BTPS 4.75% 13/02/01	5,300,000.00	5,718,170.00	
	BTPS 4.75% 23/08/01	4,500,000.00	4,686,300.00	
	BTPS 5% 12/02/01	7,900,000.00	8,430,090.00	
	BTPS 5% 25/03/01	2,000,000.00	2,112,000.00	
	BTPS 5% 34/08/01	4,970,000.00	5,136,992.00	
	BTPS 5% 39/08/01	5,000,000.00	5,170,000.00	
	BTPS 5% 40/09/01	2,000,000.00	2,055,400.00	
	BTPS 5.25 17/08/01	5,000,000.00	5,612,500.00	
	BTPS 5.25% 11/08/01	5,500,000.00	5,814,600.00	
	BTPS 5.25% 29/11/01	7,200,000.00	7,716,960.00	
	BTPS 5.75% 33/02/01	4,700,000.00	5,322,750.00	
	BTPS 6% 31/05/01	7,900,000.00	9,216,140.00	
	BTPS 6.5% 27/11/01	6,960,000.00	8,507,208.00	

	BTPS 7.25% 26/11/01	2,000,000.00	2,616,000.00	
	BTPS 9.00% 23/11/01	3,000,000.00	4,426,500.00	
	BUNDESSCHATZ 1.25 111216	3,000,000.00	3,013,500.00	
	BUNDESSCHATZ 1.25%110311	4,500,000.00	4,529,700.00	
	BUNDESSCHATZ 1.25%110916	4,000,000.00	4,022,320.00	
	BUNDESSCHATZ 1.5%110610	4,000,000.00	4,039,400.00	
	DBR 3.25% 15/07/04	5,500,000.00	5,752,725.00	
	DBR 3.25% 20/01/04	2,000,000.00	2,010,000.00	
	DBR 3.5% 160104	6,700,000.00	7,078,550.00	
	DBR 3.5% 19/07/04	7,000,000.00	7,196,000.00	
	DBR 3.75% 13/07/04	5,800,000.00	6,199,910.00	
	DBR 3.75% 15/01/04	6,000,000.00	6,420,900.00	
	DBR 3.75% 17/01/04	6,000,000.00	6,389,100.00	
	DBR 3.75% 19/01/04	6,000,000.00	6,300,000.00	
	DBR 4% 18/01/04	5,000,000.00	5,367,500.00	
	DBR 4% 37/01/04	6,200,000.00	6,209,300.00	
	DBR 4.00% 16/07/04	5,900,000.00	6,382,325.00	
	DBR 4.25% 14/01/04	6,700,000.00	7,292,950.00	
	DBR 4.25% 14/07/04	6,500,000.00	7,094,100.00	
	DBR 4.25% 17/07/04	5,000,000.00	5,465,000.00	
	DBR 4.25% 18/07/04	6,200,000.00	6,764,200.00	
	DBR 4.25% 39/07/04	3,500,000.00	3,673,250.00	
	DBR 4.5% 13/01/04	6,700,000.00	7,269,165.00	
	DBR 4.75% 28/07/04	3,000,000.00	3,326,100.00	
	DBR 4.75% 34/07/04	6,100,000.00	6,790,520.00	
	DBR 4.75% 40/07/04	2,000,000.00	2,272,000.00	
	DBR 5% 11/07/04	5,900,000.00	6,236,005.00	
	DBR 5% 12/01/04	7,000,000.00	7,513,450.00	
	DBR 5% 12/07/04	7,220,000.00	7,851,750.00	
	DBR 5.5% 31/01/04	4,300,000.00	5,204,720.00	
	DBR 5.625% 28/01/04	3,980,000.00	4,833,312.00	
	DBR 6% 16/06/20	890,000.00	1,060,524.00	
	DBR 6.25% 24/01/04	2,700,000.00	3,461,940.00	
	DBR 6.25% 300104	2,200,000.00	2,883,100.00	
	DBR 6.5% 27/07/04	3,000,000.00	3,977,100.00	
	FINNISH GO 3.875% 170915	2,000,000.00	2,100,000.00	
	FRANCE 3.75% 17/04/25	5,000,000.00	5,252,500.00	
	FRANCE 3.75% 19/10/25	5,000,000.00	5,132,000.00	
	FRANCE O.A.T.3.5% 150425	5,600,000.00	5,880,000.00	
	FRANCE O.A.T.5% 12/04/25	6,200,000.00	6,702,820.00	
	FRANCE OAT4% 141025	5,000,000.00	5,379,000.00	
	FRTR 3.0% 15/10/25	7,000,000.00	7,154,000.00	
	FRTR 3.25% 16/04/25	5,700,000.00	5,873,280.00	
	FRTR 3.75% 21/04/25	5,200,000.00	5,272,280.00	
	FRTR 4% 13/04/25	5,700,000.00	6,107,550.00	
	FRTR 4% 13/10/25	5,060,000.00	5,432,922.00	

	FRTR 4% 14/04/25	5,300,000.00	5,704,920.00	
	FRTR 4% 18/04/25	6,000,000.00	6,360,600.00	
	FRTR 4% 38/10/25	6,500,000.00	6,381,700.00	
	FRTR 4% 55/04/25	4,170,000.00	4,029,888.00	
	FRTR 4.25% 17/10/25	4,500,000.00	4,866,750.00	
	FRTR 4.25% 18/10/25	5,000,000.00	5,370,000.00	
	FRTR 4.25% 19/04/25	6,900,000.00	7,391,970.00	
	FRTR 4.25% 23/10/25	5,000,000.00	5,238,000.00	
	FRTR 4.5% 41/04/25	2,000,000.00	2,120,200.00	
	FRTR 4.75% 12/10/25	4,800,000.00	5,216,160.00	
	FRTR 4.75% 35/04/25	4,600,000.00	5,046,200.00	
	FRTR 5% 11/10/25	4,000,000.00	4,266,000.00	
	FRTR 5% 16/10/25	6,200,000.00	7,010,340.00	
	FRTR 5.5% 29/04/25	5,000,000.00	5,955,500.00	
	FRTR 5.75% 32/10/25	4,700,000.00	5,838,810.00	
	FRTR 6.00% 25/10/25	3,500,000.00	4,357,850.00	
	FRTR 6.5% 11/04/25	5,000,000.00	5,335,000.00	
	FRTR 8.5% 12/12/26	1,000,000.00	1,195,000.00	
	FRTR 8.5% 19/10/25	2,550,000.00	3,629,415.00	
	FRTR 8.5% 23/04/25	3,200,000.00	4,761,920.00	
	GGB 3.6% 16/07/20	2,000,000.00	1,759,600.00	
	GGB 3.7% 15/07/20	3,000,000.00	2,742,150.00	
	GGB 4% 13/08/20	2,000,000.00	1,900,000.00	
	GGB 4.3% 12/03/20	3,000,000.00	2,947,500.00	
	GGB 4.3% 17/07/20	3,000,000.00	2,628,600.00	
	GGB 4.5% 14/05/20	2,000,000.00	1,930,000.00	
	GGB 4.5% 37/09/20	2,050,000.00	1,522,945.00	
	GGB 4.6% 13/05/20	2,000,000.00	1,951,000.00	
	GGB 4.7% 24/03/20	2,200,000.00	1,901,020.00	
	GGB 5.25% 12/05/18	2,800,000.00	2,783,200.00	
	GGB 5.3% 26/03/20	1,000,000.00	897,500.00	
	GGB 5.5% 14/08/20	3,500,000.00	3,447,500.00	
	GGB 5.9% 22/10/22	2,730,000.00	2,627,352.00	
	GGB 6.5% 14/01/11	1,300,000.00	1,337,310.00	
	GGB 6.5% 19/10/22	2,540,000.00	2,518,156.00	
	HELLENIC REP 3.8% 110320	2,000,000.00	1,976,000.00	
	HELLENIC REP 3.9% 110820	1,500,000.00	1,483,500.00	
	HELLENIC REP 4.1% 120820	2,500,000.00	2,428,250.00	
	HELLENIC REP 4.6% 180720	2,000,000.00	1,774,200.00	
	HELLENIC REP 4.6% 400920	2,000,000.00	1,520,000.00	
	HELLENIC REP 5.35% 110518	1,600,000.00	1,595,680.00	
	HELLENIC REP 6% 190719	4,500,000.00	4,410,000.00	
	IRISH 3.9% 12/03/05	1,000,000.00	1,023,900.00	
	IRISH 4% 11/11/11	1,000,000.00	1,036,500.00	
	IRISH 4% 14/01/15	2,500,000.00	2,578,500.00	
	IRISH 4.4% 19/06/18	1,500,000.00	1,470,750.00	

IRISH 4.5% 18/10/18	2,000,000.00	2,020,000.00	
IRISH 4.5% 20/04/18	2,490,000.00	2,421,276.00	
IRISH 4.6% 16/04/18	1,800,000.00	1,884,960.00	
IRISH 5% 13/04/18	2,000,000.00	2,137,200.00	
IRISH 5% 2020/10/18	1,000,000.00	1,006,200.00	
IRISH 5.4% 25/03/13	2,000,000.00	2,015,200.00	
IRISH 5.9% 19/10/18	2,000,000.00	2,181,000.00	
ITALY 5.75% 16/07/25	1,000,000.00	1,131,800.00	
NETHERLANDS 2.5% 120115	3,000,000.00	3,081,600.00	
NETHERLANDS 2.75 150115	2,000,000.00	2,037,000.00	
NETHERLANDS 3.25% 150715	3,100,000.00	3,221,520.00	
NETHERLANDS 3.75% 140715	3,400,000.00	3,632,900.00	
NETHERLANDS 3.75% 230115	2,000,000.00	2,012,000.00	
NETHERLANDS 4% 16/07/15	3,300,000.00	3,535,950.00	
NETHERLANDS 4% 18/07/15	3,500,000.00	3,702,650.00	
NETHERLANDS 4% 19/07/15	2,500,000.00	2,625,000.00	
NETHERLANDS 4.25% 130715	4,400,000.00	4,761,680.00	
NETHERLANDS 4.5% 170715	3,600,000.00	3,954,240.00	
NETHERLANDS 5% 12/07/15	4,000,000.00	4,348,000.00	
NETHERLANDS 5.5% 280115	3,000,000.00	3,578,400.00	
NETHERLANDS 7.5% 230115	1,000,000.00	1,392,600.00	
NETHERLANDS G1.75% 130115	1,000,000.00	1,006,700.00	
NETHERLANDS GOVT4% 370115	3,000,000.00	2,970,000.00	
NETHERLANDS GOVT5% 110715	4,000,000.00	4,232,800.00	
OBL 2.25% 14/04/11	5,000,000.00	5,080,500.00	
OBL 2.5% 14/10/10	4,000,000.00	4,073,800.00	
OBL 3.5% 11/04/08	5,500,000.00	5,675,450.00	
OBL 3.5% 11/10/14	4,500,000.00	4,690,575.00	
OBL 3.5% 13/04/12	4,500,000.00	4,776,525.00	
OBL 4% 12/04/13	4,000,000.00	4,245,600.00	
OBL 4% 13/10/11	4,000,000.00	4,323,600.00	
OBL 4.25% 12/10/12	4,000,000.00	4,308,800.00	
PGB 3.2% 11/04/15	2,000,000.00	2,031,640.00	
PGB 3.35% 15/10/15	2,000,000.00	1,968,200.00	
PGB 3.6% 14/10/15	1,000,000.00	1,014,900.00	
PGB 3.85% 21/04/15	2,000,000.00	1,868,800.00	
PGB 4.10% 37/04/15	2,000,000.00	1,749,400.00	
PGB 4.2% 16/10/15	1,000,000.00	1,020,000.00	
PGB 4.35% 17/10/16	1,400,000.00	1,409,100.00	
PGB 4.375% 14/06/16	2,000,000.00	2,080,200.00	
PGB 4.45% 18/06/15	2,000,000.00	2,020,800.00	
PGB 4.75% 19/06/14	2,000,000.00	2,037,000.00	
PGB 4.95% 23/10/25	1,000,000.00	1,013,700.00	
PGB 5% 12/06/15	1,500,000.00	1,587,300.00	
PGB 5.15% 11/06/15	1,000,000.00	1,040,000.00	
PGB 5.45% 13/09/23	2,000,000.00	2,164,200.00	

	RAGB 3.4% 14/10/20	3,000,000.00	3,136,800.00	
	RAGB 3.5% 15/07/15	2,200,000.00	2,293,500.00	
	RAGB 3.5% 21/09/15	3,000,000.00	2,911,500.00	
	RAGB 3.8% 13/10/20	3,000,000.00	3,181,500.00	
	RAGB 3.9% 20/07/15	2,500,000.00	2,560,000.00	
	RAGB 4% 16/09/15	3,000,000.00	3,187,500.00	
	RAGB 4.15% 37/03/15	2,000,000.00	1,952,000.00	
	RAGB 4.3% 14/07/15	2,400,000.00	2,595,600.00	
	RAGB 4.3% 17/09/15	1,500,000.00	1,608,000.00	
	RAGB 4.35% 19/03/15	2,200,000.00	2,341,900.00	
	RAGB 4.65% 18/01/15	3,000,000.00	3,279,000.00	
	RAGB 4.85% 26/03/15	1,000,000.00	1,079,000.00	
	RAGB 5% 12/07/15	3,000,000.00	3,243,000.00	
	RAGB 6.25% 27/07/15	2,000,000.00	2,498,400.00	
	RFGB 3.125% 14/09/15	1,500,000.00	1,561,500.00	
	RFGB 4% 25/07/04	1,000,000.00	1,009,300.00	
	RFGB 4.25% 12/09/15	2,000,000.00	2,139,000.00	
	RFGB 4.25% 15/07/04	1,300,000.00	1,413,620.00	
	RFGB 4.375% 19/07/04	1,000,000.00	1,076,000.00	
	RFGB 5.375% 13/07/04	1,500,000.00	1,675,650.00	
	SPGB 2.3% 2013/04/30	2,500,000.00	2,495,000.00	
	SPGB 2.75% 12/04/30	3,500,000.00	3,578,050.00	
	SPGB 3.15% 16/01/31	3,800,000.00	3,784,420.00	
	SPGB 3.3% 14/10/31	3,000,000.00	3,062,100.00	
	SPGB 3.8% 17/01/31	4,000,000.00	4,066,000.00	
	SPGB 3.9% 12/10/31	4,500,000.00	4,704,750.00	
	SPGB 4% 20/04/30	1,000,000.00	999,300.00	
	SPGB 4.1% 11/04/30	3,500,000.00	3,618,895.00	
	SPGB 4.1% 18/07/30	4,000,000.00	4,067,600.00	
	SPGB 4.2% 13/07/30	3,500,000.00	3,701,250.00	
	SPGB 4.2% 37/01/31	3,250,000.00	2,937,025.00	
	SPGB 4.25% 14/01/31	3,500,000.00	3,724,700.00	
	SPGB 4.3% 19/10/31	3,000,000.00	3,082,800.00	
	SPGB 4.4% 15/01/31	3,800,000.00	4,028,000.00	
	SPGB 4.6% 19/07/30	3,500,000.00	3,676,750.00	
	SPGB 4.7% 41/07/30	1,000,000.00	970,800.00	
	SPGB 4.75% 14/07/30	3,500,000.00	3,798,550.00	
	SPGB 4.8% 24/01/31	3,300,000.00	3,394,050.00	
	SPGB 4.9% 40/07/30	4,000,000.00	4,053,600.00	
	SPGB 5% 12/07/30	3,100,000.00	3,327,540.00	
	SPGB 5.35% 11/10/31	3,600,000.00	3,835,800.00	
	SPGB 5.4% 11/07/30	4,500,000.00	4,762,350.00	
	SPGB 5.5% 17/07/30	4,280,000.00	4,816,284.00	
	SPGB 5.75% 32/07/30	3,700,000.00	4,130,680.00	
	SPGB 6% 29/01/31	4,900,000.00	5,668,810.00	
	SPGB 6.15% 13/01/31	3,600,000.00	4,017,240.00	

	ユーロ 小計	928,290,000.00	984,293,129.00	
	(邦貨換算額)		(121,638,944,881)	(単位：円)
	英債券			
	UKT 2.25% 14/03/07	7,000,000.00	6,921,390.00	
	UKT 2.75% 15/01/22	2,000,000.00	1,981,560.00	
	UKT 3.25% 11/12/07	4,400,000.00	4,563,240.00	
	UKT 3.75% 19/09/07	3,000,000.00	2,915,400.00	
	UKT 4% 16/09/07	4,800,000.00	4,960,848.00	
	UKT 4% 22/03/07	2,000,000.00	1,934,000.00	
	UKT 4% 60/01/22	1,000,000.00	906,300.00	
	UKT 4.25 110307	5,200,000.00	5,392,244.00	
	UKT 4.25% 27/12/07	2,800,000.00	2,698,696.00	
	UKT 4.25% 32/06/07	3,800,000.00	3,635,460.00	
	UKT 4.25% 36/03/07	4,800,000.00	4,542,912.00	
	UKT 4.25% 39/09/07	2,000,000.00	1,899,400.00	
	UKT 4.25% 46/12/07	3,900,000.00	3,717,480.00	
	UKT 4.25% 49/12/07	3,500,000.00	3,335,850.00	
	UKT 4.25% 55/12/07	5,000,000.00	4,796,150.00	
	UKT 4.5% 13/03/07	5,700,000.00	6,110,172.00	
	UKT 4.5% 19/03/07	5,200,000.00	5,381,272.00	
	UKT 4.5% 34/09/07	2,000,000.00	1,964,680.00	
	UKT 4.5% 42/12/07	5,000,000.00	4,955,500.00	
	UKT 4.75% 15/09/07	3,400,000.00	3,692,400.00	
	UKT 4.75% 20/03/07	2,200,000.00	2,307,756.00	
	UKT 4.75% 30/12/07	3,800,000.00	3,871,668.00	
	UKT 4.75% 38/12/07	4,500,000.00	4,631,400.00	
	UKT 5% 12/03/07	7,560,000.00	8,112,636.00	
	UKT 5% 14/09/07	3,500,000.00	3,840,340.00	
	UKT 5% 18/03/07	3,500,000.00	3,790,255.00	
	UKT 5% 25/03/07	4,400,000.00	4,625,104.00	
	UKT 5.25% 12/06/07	5,500,000.00	5,944,950.00	
	UKT 6.0% 281207	3,000,000.00	3,567,000.00	
	UKT 8% 13/09/27	2,500,000.00	3,001,250.00	
	UKT 8% 15/12/07	1,900,000.00	2,386,780.00	
	UKT 8% 21/06/07	2,620,000.00	3,513,996.40	
	UKT 8.75% 17/08/25	2,300,000.00	3,066,590.00	
	UKT 9% 11/07/12	1,600,000.00	1,779,312.00	
	英債券 小計	125,380,000.00	130,743,991.40	
	(邦貨換算額)		(18,644,093,173)	(単位：円)
	スイスフラン			
	SWITZERLAND 2.5% 160312	2,000,000.00	2,145,600.00	
	SWITZERLAND 2.75%120610	2,500,000.00	2,640,000.00	
	SWITZERLAND 3% 180108	1,000,000.00	1,099,500.00	
	SWITZERLAND 3% 19/05/12	2,000,000.00	2,198,400.00	

	SWITZERLAND 4% 11/06/10	2,000,000.00	2,099,200.00	
	SWITZERLAND 4% 13/02/11	2,000,000.00	2,202,600.00	
	SWITZERLAND 4% 280408	900,000.00	1,141,200.00	
	SWITZERLAND 4%230211	1,000,000.00	1,210,800.00	
	SWITZERLAND 4.25% 140106	800,000.00	904,960.00	
	SWITZERLAND 4.25% 170605	2,000,000.00	2,368,600.00	
	スイスフラン 小計	16,200,000.00	18,010,860.00	
	(邦貨換算額)		(1,519,216,041)	(単位：円)
	スウェーデンクローナ			
	SGB 3% 16/07/12	17,000,000.00	17,124,100.00	
	SGB 3.5% 39/03/30	10,000,000.00	9,408,000.00	
	SGB 3.75% 17/08/12	13,200,000.00	13,820,400.00	
	SGB 4.25% 19/03/12	20,000,000.00	21,550,000.00	
	SGB 4.5% 15/08/12	13,000,000.00	14,198,600.00	
	SGB 5% 20/12/01	15,000,000.00	17,256,000.00	
	SGB 5.25% 110315	11,640,000.00	12,222,000.00	
	SGB 5.5% 12/10/08	16,000,000.00	17,560,000.00	
	SGB 6.75% 14/05/05	19,100,000.00	22,434,860.00	
	スウェーデンクローナ 小計	134,940,000.00	145,573,960.00	
	(邦貨換算額)		(1,834,231,896)	(単位：円)
	ノルウェークローネ			
	NORWAY GOV 4.25% 170519	10,000,000.00	10,439,000.00	
	NORWAY GOV 4.5% 19/05/22	6,000,000.00	6,311,400.00	
	NORWAY GOV 5% 150515	10,000,000.00	10,830,000.00	
	NORWAY GOV 6% 110516	13,000,000.00	13,608,400.00	
	NORWAY GOV 6.5% 130515	16,000,000.00	17,779,200.00	
	ノルウェークローネ 小計	55,000,000.00	58,968,000.00	
	(邦貨換算額)		(911,055,600)	(単位：円)
	デンマーククローネ			
	DGB 4% 12/11/15	10,000,000.00	10,574,000.00	
	DGB 4% 15/11/15	16,000,000.00	16,992,000.00	
	DGB 4% 17/11/15	15,000,000.00	15,777,000.00	
	DGB 4% 19/11/15	15,000,000.00	15,615,000.00	
	DGB 4.5% 39/11/15	22,000,000.00	23,478,400.00	
	DGB 5% 13/11/15	20,820,000.00	22,932,813.60	
	DGB 6% 11/11/15	18,000,000.00	19,423,800.00	
	DGB 7% 24/11/10	5,080,000.00	6,863,588.00	
	デンマーククローネ 小計	121,900,000.00	131,656,601.60	
	(邦貨換算額)		(2,185,499,586)	(単位：円)
	ポーランドズロチ			
	POLGB 0% 11/07/25	5,000,000.00	4,703,500.00	
	POLGB 0% 12/01/25	5,000,000.00	4,582,500.00	

	POLGB 4.25% 11/05/24	8,000,000.00	8,004,000.00	
	POLGB 4.75% 12/04/25	7,000,000.00	7,000,000.00	
	POLGB 5.00% 13/10/24	6,500,000.00	6,500,000.00	
	POLGB 5.25% 13/04/25	5,000,000.00	5,010,000.00	
	POLGB 5.25% 17/10/25	8,000,000.00	7,720,000.00	
	POLGB 5.5% 19/10/25	6,000,000.00	5,751,600.00	
	POLGB 5.5% 2015/04/25	5,000,000.00	5,002,500.00	
	POLGB 5.75% 14/04/25	8,000,000.00	8,096,000.00	
	POLGB 5.75% 22/09/23	5,200,000.00	5,013,840.00	
	POLGB 6.25% 15/10/24	7,500,000.00	7,743,750.00	
	ポーランドズロチ 小計	76,200,000.00	75,127,690.00	
	(邦貨換算額)		(2,340,227,543)	(単位：円)
	オーストラリアドル			
	ACGB 4.5% 20/04/15	1,000,000.00	917,057.00	
	ACGB 5.25% 10/08/15	1,800,000.00	1,810,578.60	
	ACGB 5.25% 19/03/15	2,000,000.00	1,963,876.00	
	ACGB 5.75% 11/06/15	2,000,000.00	2,038,476.00	
	ACGB 5.75% 12/04/15	3,000,000.00	3,052,500.00	
	ACGB 5.75% 21/05/15	2,000,000.00	2,008,000.00	
	ACGB 6% 17/02/15	3,300,000.00	3,416,018.10	
	ACGB 6.25% 14/06/15	3,000,000.00	3,131,499.00	
	ACGB 6.25% 15/04/15	2,000,000.00	2,093,298.00	
	ACGB 6.5% 13/05/15	3,540,000.00	3,709,615.56	
	オーストラリアドル 小計	23,640,000.00	24,140,918.26	
	(邦貨換算額)		(1,970,864,566)	(単位：円)
	シンガポールドル			
	SIGB 2.25% 13/07/01	1,000,000.00	1,047,803.00	
	SIGB 3.125% 11/02/01	1,000,000.00	1,026,185.00	
	SIGB 3.125% 22/09/01	1,000,000.00	1,000,578.00	
	SIGB 3.25% 20/09/01	1,000,000.00	1,029,405.00	
	SIGB 3.5% 12/07/01	1,000,000.00	1,069,664.00	
	SIGB 3.5% 27/03/01	1,000,000.00	1,019,541.00	
	SIGB 3.625 140701	2,500,000.00	2,766,082.50	
	SIGB 3.625% 11/07/01	2,000,000.00	2,087,984.00	
	SIGB 3.75% 160901	1,000,000.00	1,106,685.00	
	SIGB 4% 18/09/01	1,200,000.00	1,337,763.60	
	SIGB 4.625 100701	1,170,000.00	1,188,255.51	
	シンガポールドル 小計	13,870,000.00	14,679,946.61	
	(邦貨換算額)		(950,086,144)	(単位：円)
	マレーシアリングット			
	MALAYSIAN 2.509 12/08/27	6,000,000.00	5,918,442.00	
	MALAYSIAN 3.502 27/05/31	4,000,000.00	3,469,532.00	
	MALAYSIAN 3.702 13/02/25	8,000,000.00	8,092,432.00	

	MALAYSIAN 3.718 12/06/15	8,000,000.00	8,130,936.00	
	MALAYSIAN 3.756 11/04/28	5,000,000.00	5,076,890.00	
	MALAYSIAN 3.814% 17/02/15	2,000,000.00	1,968,226.00	
	MALAYSIAN 4.24 18/02/07	5,000,000.00	5,030,220.00	
	MALAYSIAN 4.262 16/09/15	3,000,000.00	3,040,749.00	
	MALAYSIAN 5.094 14/04/30	6,000,000.00	6,328,926.00	
	マレーシアリングット 小計	47,000,000.00	47,056,353.00	
	(邦貨換算額)		(1,261,580,823)	(単位：円)
	合計		249,345,450,647	単位：円
	(外貨建有価証券邦貨換算額合計)		(249,345,450,647)	(単位：円)

(注)

- 合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券にかかるもので、内書きであります。
- 米ドル表示の債券については、164銘柄、信託財産純資産総額に対する比率35.0%、合計に対する比率35.7%です。  
カナダドル表示の債券については、27銘柄、信託財産純資産総額に対する比率2.7%、合計に対する比率2.8%です。  
ユーロ表示の債券については、253銘柄、信託財産純資産総額に対する比率47.7%、合計に対する比率48.8%です。  
英ポンド表示の債券については、34銘柄、信託財産純資産総額に対する比率7.3%、合計に対する比率7.5%です。  
スイスフラン表示の債券については、10銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.6%、合計に対する比率0.6%です。  
スウェーデンクローナ表示の債券については、9銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.7%、合計に対する比率0.7%です。  
ノルウェークローネ表示の債券については、5銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.4%、合計に対する比率0.4%です。  
デンマーククローネ表示の債券については、8銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.9%、合計に対する比率0.9%です。  
ポーランドズロチ表示の債券については、12銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.9%、合計に対する比率0.9%です。  
オーストラリアドル表示の債券については、10銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.8%、合計に対する比率0.8%です。  
シンガポールドル表示の債券については、11銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.4%、合計に対する比率0.4%です。  
マレーシアリングット表示の債券については、9銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.5%、合計に対する比率0.5%です。

## 独立監査人の監査報告書

平成22年4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

あずさ監査法人

指 定 社 員            公認会計士 鈴木 敏夫 印  
業 務 執 行 社 員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）の平成21年2月19日から平成22年2月18日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）の平成22年2月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

- 
- （注）1．上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
- 2．財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。
-

## 独立監査人の監査報告書

平成22年4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

あずさ監査法人

指 定 社 員            公認会計士 鈴木 敏夫 印  
業 務 執 行 社 員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DC年金バランス50（標準型）の平成21年2月19日から平成22年2月18日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・DC年金バランス50（標準型）の平成22年2月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

---

（注）1．上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2．財務諸表の範囲にはXBR Lデータ自体は含まれていません。

---

## 独立監査人の監査報告書

平成22年4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

あずさ監査法人

指 定 社 員            公認会計士 鈴木 敏夫 印  
業 務 執 行 社 員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）の平成21年2月19日から平成22年2月18日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）の平成22年2月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

- 
- (注) 1. 上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. 財務諸表の範囲にはXBR Lデータ自体は含まれていません。

[委託会社の監査報告書\(当期\)へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成21年4月15日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

あずさ監査法人

指 定 社 員            公認会計士 鈴木 敏夫 印  
業 務 執 行 社 員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）の平成20年2月19日から平成21年2月18日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）の平成21年2月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

- 
- （注）1．上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
- 2．前期の財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。
-

## 独立監査人の監査報告書

平成21年4月15日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

あずさ監査法人

指 定 社 員  
業務執行社員 公認会計士 鈴木 敏夫 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DC年金バランス50（標準型）の平成20年2月19日から平成21年2月18日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・DC年金バランス50（標準型）の平成21年2月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

---

（注）1．上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2．前期の財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

---

## 独立監査人の監査報告書

平成21年4月15日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

あずさ監査法人

指 定 社 員            公認会計士 鈴木 敏夫 印  
業 務 執 行 社 員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）の平成20年2月19日から平成21年2月18日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）の平成21年2月18日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

---

（注）1．上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2．前期の財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

[委託会社の監査報告書（前期）へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成21年 6 月26日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

あずさ監査法人

指 定 社 員 公認会計士 鈴木 敏夫 印  
業務執行社員指 定 社 員 公認会計士 辰巳 幸久 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友アセットマネジメント株式会社の平成20年4月1日から平成21年3月31日までの第24期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友アセットマネジメント株式会社の平成21年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

---

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

[委託会社の中間監査報告書へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成20年 6 月23日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

あずさ監査法人

指 定 社 員      公認会計士      三 浦 孝 昭 印  
業 務 執 行 社 員指 定 社 員      公認会計士      橋 本 克 己 印  
業 務 執 行 社 員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友アセットマネジメント株式会社の平成19年4月1日から平成20年3月31日までの第23期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することを含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友アセットマネジメント株式会社の平成20年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

---

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

## 独立監査人の中間監査報告書

平成21年12月16日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

あずさ監査法人

指 定 社 員      公認会計士      鈴木 敏夫 印  
業務執行社員指 定 社 員      公認会計士      辰巳 幸久 印  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友アセットマネジメント株式会社の平成21年4月1日から平成22年3月31日までの第25期事業年度の中間会計期間（平成21年4月1日から平成21年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書及び中間株主資本等変動計算書について中間監査を行った。この中間財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。

当監査法人は、我が国における中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。中間監査は分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続を適用して行われている。当監査法人は、中間監査の結果として中間財務諸表に対する意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友アセットマネジメント株式会社の平成21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21年4月1日から平成21年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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

以 上

---

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