

【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三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）
券に係るファンドの名称】 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三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）
券の金額】 : 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225 |
| 債券 一般債 公社債 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 | |
| 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。

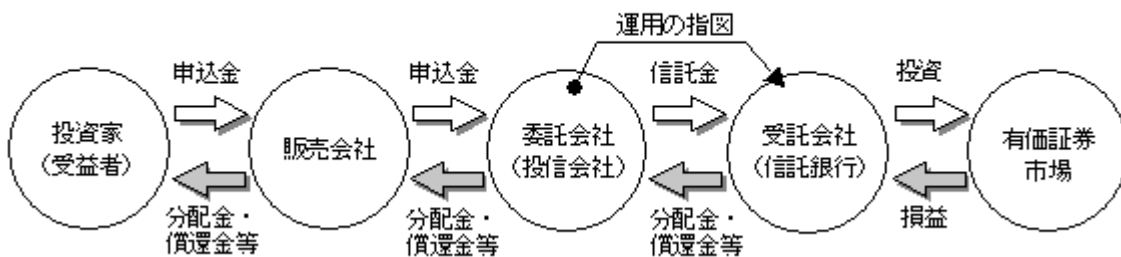
（ロ）受託会社 「住友信託銀行株式会社」

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

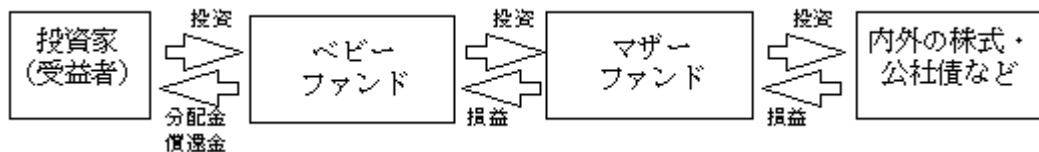
委託会社との間で締結される販売契約（名称の如何を問いません。）に基づき、当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書（目論見書）の提供、受益者からの一部解約実行請求の受付、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を行います。

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 | 国内債券パッシブ・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 | 外国債券パッシブ・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。

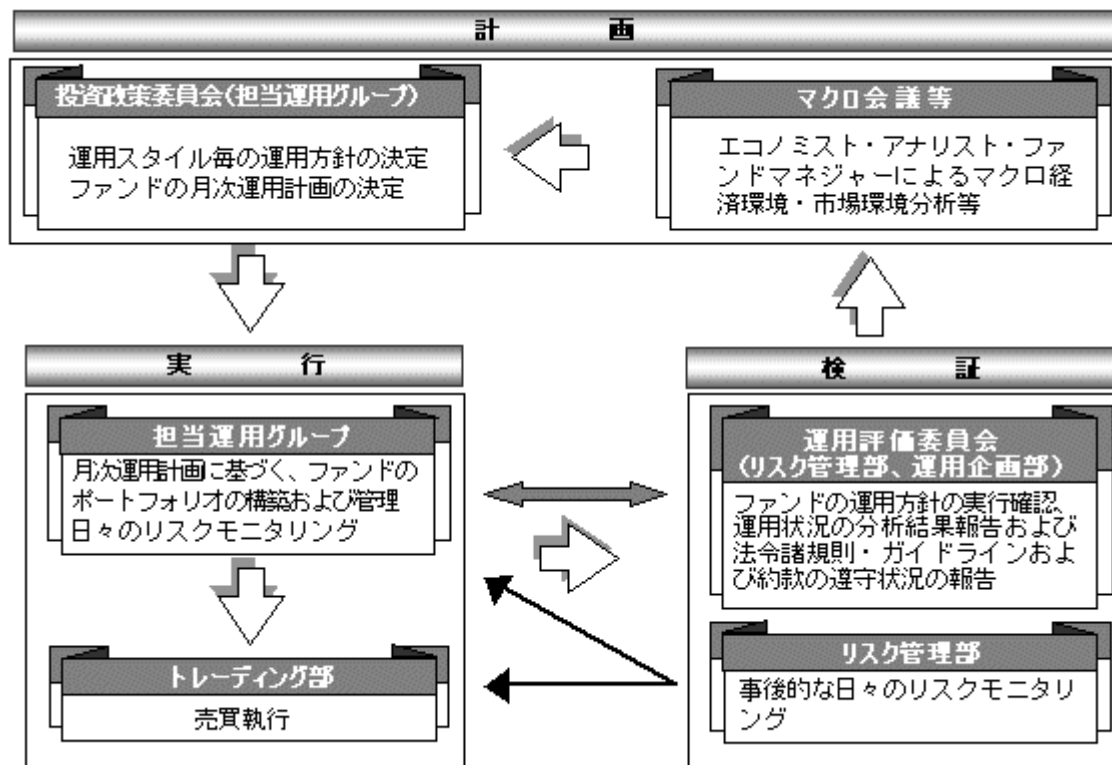
売買執行については、組織的に分離されたトレーディング部が、最良と思われる手法をもって売買を執行します。

（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たときは、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たときは、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。）

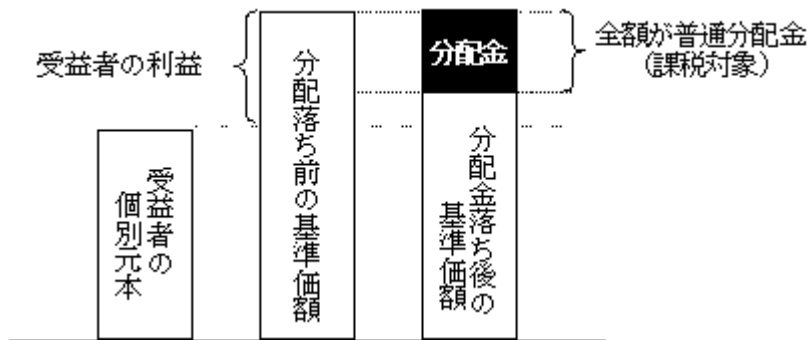
ロ 一部解約時および償還時の課税について

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。

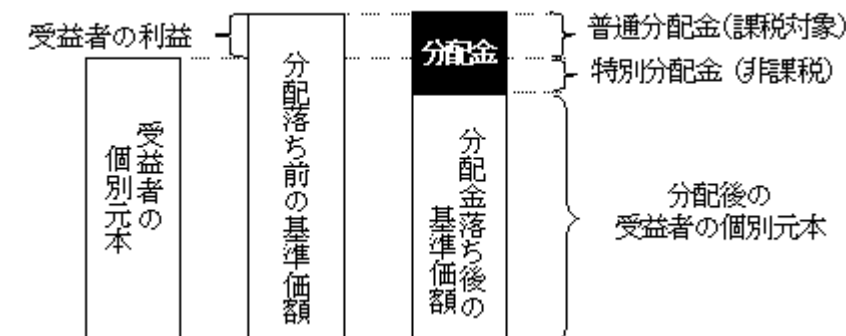
ハ 収益分配金の課税について

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 |

【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 | 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。

ヘ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

ト 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

チ 運用にかかる報告書の開示方法

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

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

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場合は、当該解約または信託約款変更は行われません。

当該解約または信託約款変更が行われる場合において、前述の異議を申し立てた受益者は、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) |
|-----------------|-----------------------|-----------------------|
| 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 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) |
|-----------------|-----------------------|-----------------------|
| 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 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 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 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（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 | 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 | 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) |
|-----------------|-----------------------|-----------------------|
| 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。

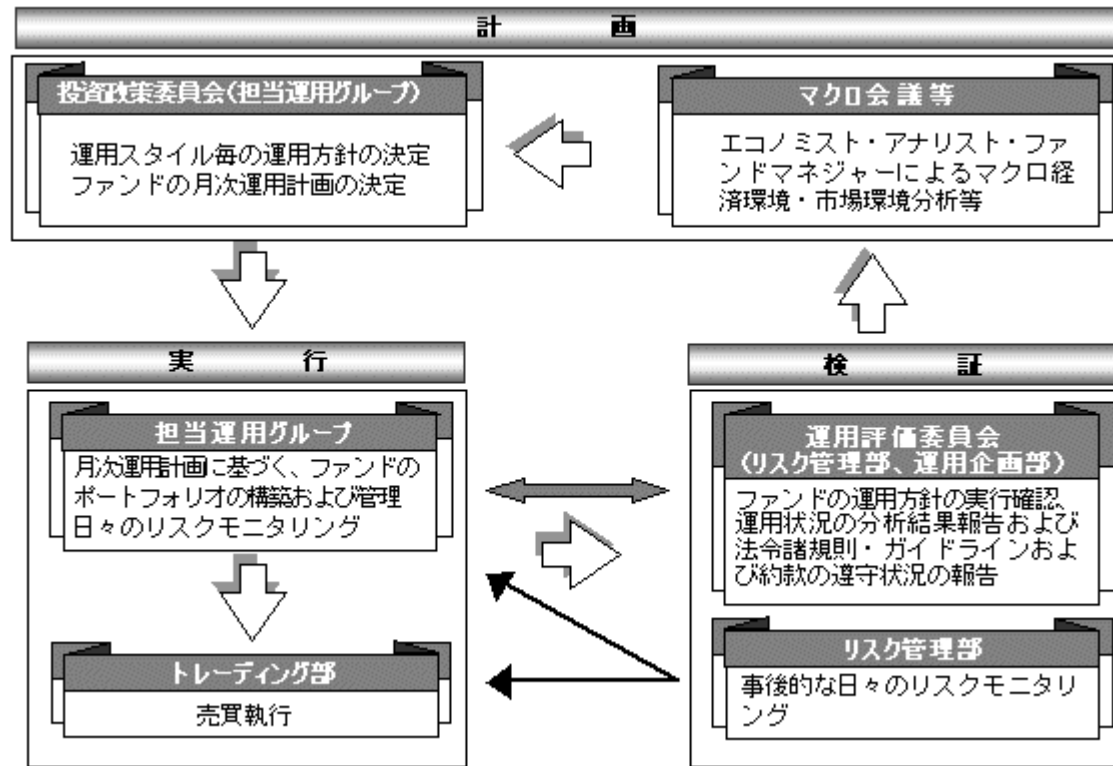
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

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;">749,327</td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;">退職給付引当金</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">749,327</td> </tr> <tr> <td></td> <td style="text-align: right; border-top: 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 | | 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;">972,202</td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;">退職給付引当金</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">972,202</td> </tr> <tr> <td></td> <td style="text-align: right; border-top: 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 | | 972,202 | | | | | | | | | | | | | | |
| 退職給付債務 | 749,327 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 退職給付引当金 | 749,327 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | 749,327 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 退職給付債務 | 972,202 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 退職給付引当金 | 972,202 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | 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 style="border-top: 1px solid black;">退職給付費用</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">277,530</td> </tr> <tr> <td></td> <td style="text-align: right; border-top: 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 | | 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 style="border-top: 1px solid black;">退職給付費用</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">262,634</td> </tr> <tr> <td></td> <td style="text-align: right; border-top: 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 | | 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 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | 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 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | 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</p> <p style="text-align: right;">1.5%</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</p> <p style="text-align: right;">1.5%</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の主な原因別の内訳 (単位：千円) | 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 (単位：千円) |
| (1) 流動の部 | (1) 流動の部 |
| 繰延税金資産 | 繰延税金資産 |
| 賞与引当金 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 | | 6,364,198 |
| 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 |
| D T S | 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 |
| T K C | 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 |
| J B C C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 |
| J A L U X | 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 |
| コロナイド | 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 |
| テンブホールディングス | 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 |
| カルチャア・コンピニエンス・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・地方債証券・特殊債券・社債証券（売買目的有価証券） 同左 |

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | (平成21年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 | 当ファンドの行うことのできるデリバティブ取引は、次の通りです。 a．わが国の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。 b．わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。 異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（「スワップ取引」）。 金利先渡取引。 | 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、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 | 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いません。

（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いません。

（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 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 | | | | |
| | SP500 | 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) |
| | DJ EUR | 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) |
| | FTSE | 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 | | | | |
| | SP500 | 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) |
| | DJ EUR | 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) |
| | FTSE | 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 | |
| FREEMONT-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 で評価してあります。 | 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 価で評価してあります。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 によってあります。 | 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 基づいて処理してあります。 | 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いません。

（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いません。

（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<適格機関投資家専用>

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 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。