

## 【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23年 5 月12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】	隠地 保夫
【電話番号】	03-5405-0735
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証 券に係るファンドの名称】	三井住友・DC年金バランス30（債券重点型） 三井住友・DC年金バランス50（標準型） 三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証 券の金額】	三井住友・DC年金バランス30（債券重点型） ：5,000億円を上限とします。 三井住友・DC年金バランス50（標準型） ：5,000億円を上限とします。 三井住友・DC年金バランス70（株式重点型） ：5,000億円を上限とします。 合計 1 兆5,000億円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

## 第一部【証券情報】

### （１）【ファンドの名称】

三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）  
三井住友・DC年金バランス50（標準型）  
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）  
上記3ファンドの愛称として「マイパッケージ」という名称を用いることがあります。

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

### （２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

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

当初元本は1口当たり1円です。委託会社の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

### （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	インターネット・ ホームページ・アドレス
三井住友アセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	http://www.smam-jp.com

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

### （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23年5月13日から平成24年5月17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。

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 大型株 中小型株	年 1 回	グローバル (日本を含む)			日経225
債券 一般 公社債 その他債券 クレジット属性 ( )	年 2 回 年 4 回 年 6 回(隔月) 年 12 回(毎月) 日 々 その他 ( )	日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東(中東) エマージング	ファミリーファンド	あり	
不動産投信			ファンド・オブ・ファンズ	なし	
その他資産 (投資信託証券(資産複合(株式、 債券)資産区分固定型))					その他 (合成指数)
資産複合 ( ) 資産区分固定型 資産区分変更型					

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

## (2) 【ファンドの沿革】

平成17年9月30日

信託契約締結、設定、運用開始。

### （３）【ファンドの仕組み】

イ 当ファンドの関係法人とその役割

（イ）委託会社「三井住友アセットマネジメント株式会社」

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

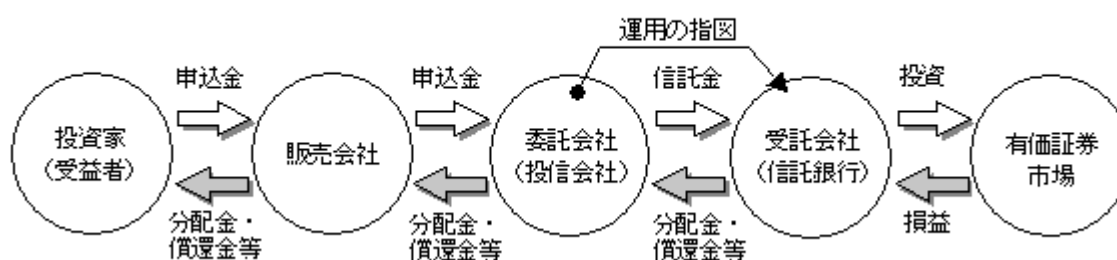
（ロ）受託会社「住友信託銀行株式会社」

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

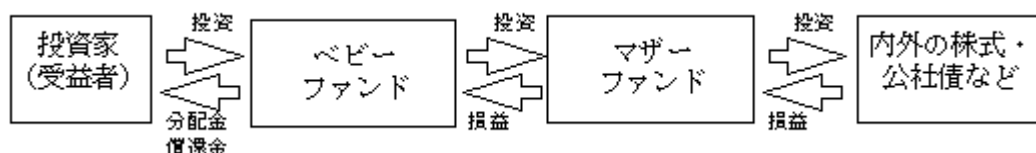
委託会社との間で締結される販売契約（名称の如何を問いません。）に基づき、当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書（目論見書）の提供、受益者からの一部解約実行請求の受付、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を行います。

#### 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23年3月31日現在）

（ロ）会社の沿革

昭和60年7月15日 三生投資顧問株式会社設立

昭和62年2月20日 証券投資顧問業の登録

昭和62年6月10日 投資一任契約にかかる業務の認可

平成11年1月1日 三井生命保険相互会社の特別勘定運用部門と統合

平成11年2月5日 三生投資顧問株式会社から三井生命グローバルアセットマネジメント株式会社へ商号変更

平成12年1月27日 証券投資信託委託業の認可取得

平成14年12月1日 住友ライフ・インベストメント株式会社、スミセイ グローバル投信株式会社、三井住友海上アセットマネジメント株式会社およびさくら投信投資顧問株式会社と合併し、三井住友アセットマネジメント株式会社に商号変更



## (八) 大株主の状況

(平成23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	東京都千代田区丸の内一丁目1番2号	4,851	27.5
三井生命保険株式会社	東京都千代田区大手町二丁目1番1号	882	5.0

## 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。

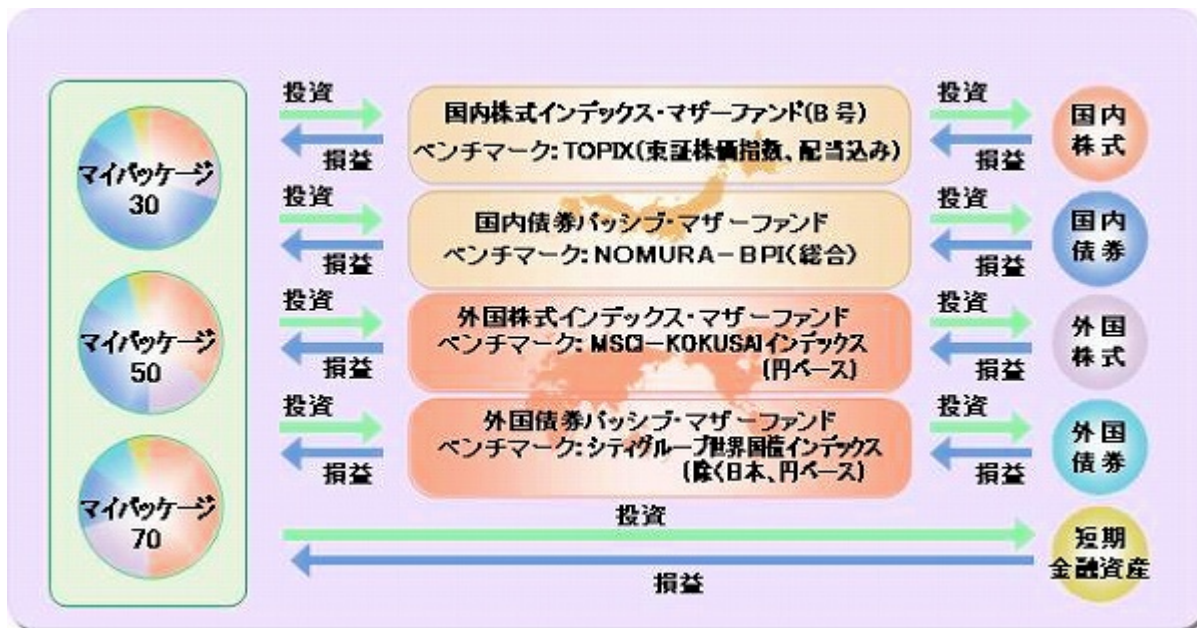
##### c. マイパッケージ70

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。

## 〈ファンドの特色〉

1. 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。



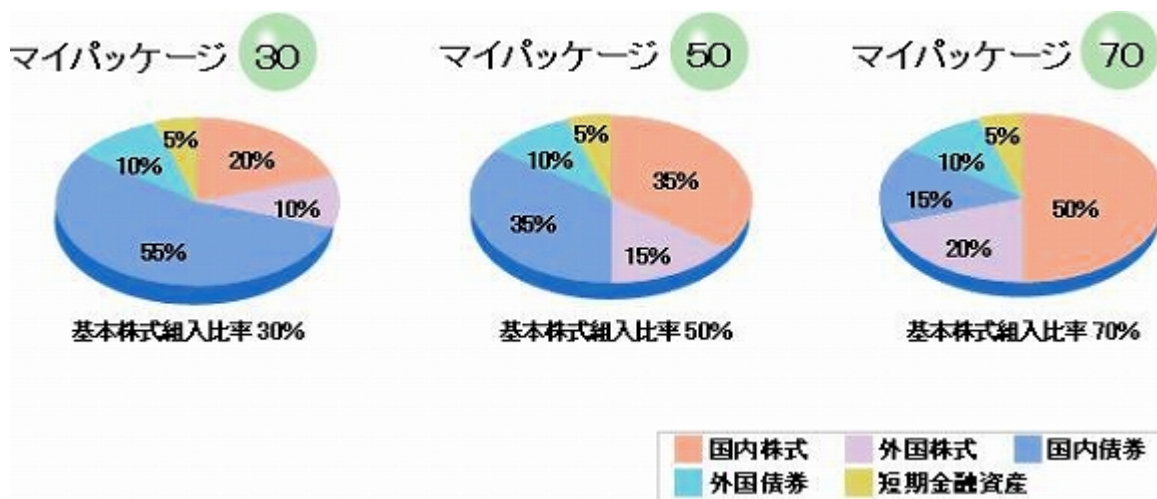
各マザーファンドは、ベンチマークに連動する投資成果を目指して運用を行います。

- ・ TOPIX（東証株価指数、配当込み）、NOMURA - BPI（総合）、MSCI - KOKUSAI インデックス、シティグループ世界国債インデックスは、それぞれ東京証券取引所、野村證券株式会社、MSCI インク、シティグループ・グローバル・マーケット・インクが公表している指数で各社の知的財産です。
- ・ 指数を公表する各社は当ファンドの運用と何ら関係ありません。

2. 各ファンドにつき、国内株式、国内債券、外国株式、外国債券および短期金融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。

### 〔各ファンドの基本資産配分イメージ〕



**3. 運用にあたっては、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%

**4. 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、**

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

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

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

**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委託会社独自のリスクモデルを併用して、通貨配分、国別配分、デュレーション、満期構成等を可能な限り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）に近づけたポートフォリオを構築します。シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）との連動性を随時チェックし、必要に応じてマルチファクターモデルおよび委託会社独自のリスクモデルを使用してポートフォリオのリバランスを行います。

**（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券
  - 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（新株引受権証券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、ファンドマネージャーが、マクロ経済環境、市場環境に関する分析・検討を行います。

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

##### （ロ）実行（Do）

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

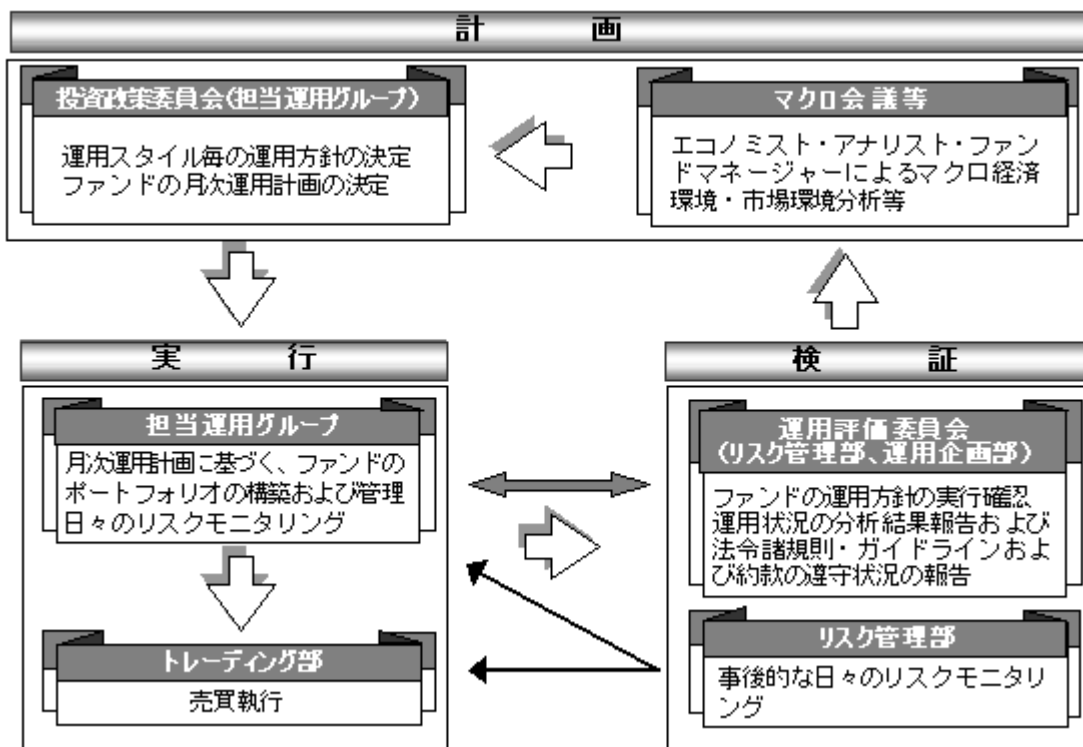
売買執行については、組織的に分離されたトレーディング部が、最良と思われる手法をもって売買を執行します。

##### （ハ）検証（Check）

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

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

#### 【ファンドの運用体制】



リスク管理部は10名程度、運用企画部は8名程度で構成されています。

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

#### 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有価証券の各号（第１号から第21号まで）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（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有価証券の各号（第1号から第21号まで）に掲げるものに投資します（ただし、投資法人債券を除きます。）。

## 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、上記合成指数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ベビーファンドに追加設定・一部解約により資金の流出入が生じた場合、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0.231% （年0.22%）	年0.2415% （年0.23%）	年0.252% （年0.24%）
配分	委託会社	年0.0945% （年0.09%）	年0.105% （年0.1%）	年0.1155% （年0.11%）
	販売会社	年0.105% （年0.1%）	年0.105% （年0.1%）	年0.105% （年0.1%）
	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。
- （ハ）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。）

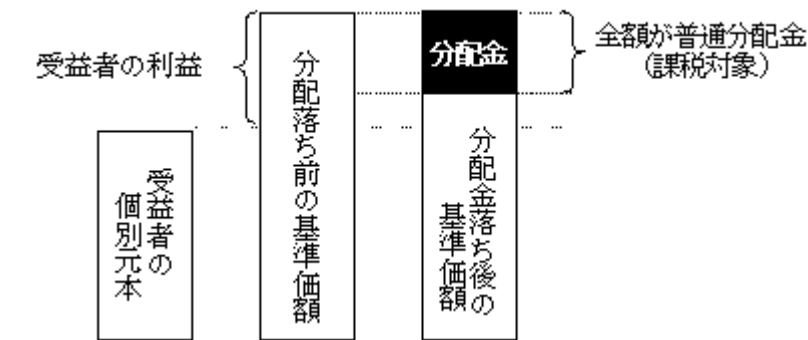
### ロ 一部解約時および償還時の課税について

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。

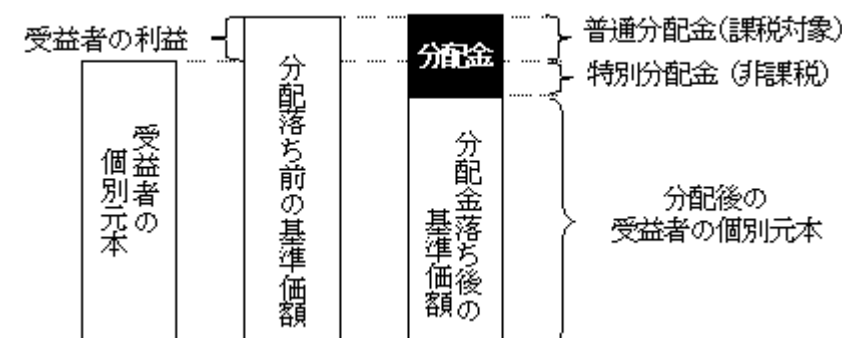
### ハ 収益分配金の課税について

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。

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

< 受取配当にかかる益金不算入制度、配当控除の適用の可否 >

#### a . マイパッケージ30

受取配当にかかる益金不算入制度、配当控除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、配当控除の適用が可能です。

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、配当控除の適用が可能です。

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23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23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	405,086,328	20.42
国内債券パッシブ・マザーファンド受益証券	日本	1,082,094,039	54.56
外国株式インデックス・マザーファンド受益証券	日本	206,080,442	10.39
外国債券パッシブ・マザーファンド受益証券	日本	205,044,529	10.34
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		85,010,039	4.29
合計(純資産総額)		1,983,315,377	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23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	2,127,718,689	35.36
国内債券パッシブ・マザーファンド受益証券	日本	2,076,584,284	34.51
外国株式インデックス・マザーファンド受益証券	日本	928,801,728	15.44
外国債券パッシブ・マザーファンド受益証券	日本	609,760,213	10.13
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		274,060,353	4.55
合計(純資産総額)		6,016,925,267	100.00

## c. 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)

平成23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	1,433,819,508	50.30
国内債券パッシブ・マザーファンド受益証券	日本	422,834,325	14.83
外国株式インデックス・マザーファンド受益証券	日本	582,710,893	20.44
外国債券パッシブ・マザーファンド受益証券	日本	289,699,925	10.16
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		121,489,621	4.26
合計(純資産総額)		2,850,554,272	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23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	997,873,515	1.0805 1,078,202,799	1.0844 1,082,094,039	54.56
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）	351,241,072	1.2600 442,577,835	1.1533 405,086,328	20.42
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	150,105,938	1.3802 207,183,926	1.3729 206,080,442	10.39
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	181,166,752	1.1113 201,330,612	1.1318 205,044,529	10.34

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

## b．三井住友・DC年金バランス50（標準型）

平成23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）	1,844,896,115	1.2637 2,331,548,973	1.1533 2,127,718,689	35.36
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	1,914,961,531	1.0805 2,069,250,273	1.0844 2,076,584,284	34.51
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	676,525,405	1.3808 934,146,280	1.3729 928,801,728	15.44
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	538,752,618	1.1113 598,729,927	1.1318 609,760,213	10.13

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

## c．三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）

平成23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）	1,243,232,037	1.2637 1,571,148,762	1.1533 1,433,819,508	50.30
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	424,437,973	1.3795 585,541,066	1.3729 582,710,893	20.44
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	389,924,682	1.0806 421,369,254	1.0844 422,834,325	14.83
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	255,963,885	1.1113 284,456,525	1.1318 289,699,925	10.16

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23年3月31日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	95.71
合計	95.71

## b．三井住友・DC年金バランス50（標準型）

平成23年3月31日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	95.45
合計	95.45

## c．三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）

平成23年3月31日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	95.74
合計	95.74

## 【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
第6期(平成23年2月18日)(分配落)	1,960,814,211	10,043
第6期(平成23年2月18日)(分配付)	1,960,814,211	10,043
平成22年3月末日	1,508,759,192	9,979
平成22年4月末日	1,542,896,622	10,072
平成22年5月末日	1,576,960,880	9,678
平成22年6月末日	1,610,082,270	9,566
平成22年7月末日	1,745,921,494	9,677
平成22年8月末日	1,772,002,589	9,529
平成22年9月末日	1,817,271,092	9,723
平成22年10月末日	1,807,771,344	9,629
平成22年11月末日	1,828,923,667	9,707
平成22年12月末日	1,942,671,128	9,821
平成23年1月末日	1,988,260,591	9,859
平成23年2月末日	1,948,210,495	9,969
平成23年3月末日	1,983,315,377	9,882

(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。以下同じ。

(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。以下同じ。



## 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
第6期(平成23年2月18日)(分配落)	6,082,088,735	9,470
第6期(平成23年2月18日)(分配付)	6,082,088,735	9,470
平成22年3月末日	4,956,954,696	9,405
平成22年4月末日	5,068,621,882	9,500
平成22年5月末日	4,917,403,388	8,907
平成22年6月末日	4,890,604,407	8,700
平成22年7月末日	5,397,708,956	8,833
平成22年8月末日	5,422,762,474	8,589
平成22年9月末日	5,625,391,542	8,851
平成22年10月末日	5,593,651,006	8,743
平成22年11月末日	5,742,940,075	8,924
平成22年12月末日	5,986,828,950	9,092
平成23年1月末日	6,062,268,814	9,165
平成23年2月末日	5,993,987,036	9,344
平成23年3月末日	6,016,925,267	9,171

## 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
第6期(平成23年2月18日)(分配落)	2,906,265,010	8,802
第6期(平成23年2月18日)(分配付)	2,906,265,010	8,802
平成22年3月末日	2,272,162,121	8,751
平成22年4月末日	2,340,925,133	8,845
平成22年5月末日	2,203,610,078	8,085
平成22年6月末日	2,175,406,112	7,803
平成22年7月末日	2,452,725,840	7,952
平成22年8月末日	2,425,085,071	7,634
平成22年9月末日	2,551,612,540	7,946
平成22年10月末日	2,537,389,308	7,828
平成22年11月末日	2,636,730,837	8,088
平成22年12月末日	2,771,975,588	8,297
平成23年1月末日	2,829,280,157	8,399
平成23年2月末日	2,850,898,984	8,635
平成23年3月末日	2,850,554,272	8,386

## 【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
第6期（平成22年2月19日～平成23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
第6期（平成22年2月19日～平成23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
第6期（平成22年2月19日～平成23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
第6期	3.5

（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。以下同じ。

（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。以下同じ。

## 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
第6期	5.4

## 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
第6期	7.1

## (4) 【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	0
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
第6期	638,803,489	159,741,067

（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	0
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
第6期	1,758,746,053	466,119,658

## 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	0
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6期	1,002,632,701	208,523,447

## 〔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23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	306,465,740,725	97.40
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		8,183,327,786	2.60
合計(純資産総額)		314,649,068,511	100.00

当ファンドは、平成23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8,149,060,000円（投資比率2.59%）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23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〕	3,372,800	3,222.22 10,867,910,800	3,350.00 11,298,880,000	3.59
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ 〔銀行業〕	19,613,700	394.83 7,744,235,600	384.00 7,531,660,800	2.39
日本	株式	本田技研工業 〔輸送用機器〕	2,214,000	3,012.89 6,670,545,100	3,125.00 6,918,750,000	2.20
日本	株式	キヤノン 〔電気機器〕	1,630,600	3,918.93 6,390,215,700	3,620.00 5,902,772,000	1.88
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ 〔銀行業〕	1,959,800	2,569.82 5,036,336,000	2,586.00 5,068,042,800	1.61
日本	株式	三菱商事 〔卸売業〕	2,074,900	2,119.61 4,397,982,900	2,309.00 4,790,944,100	1.52
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ 〔銀行業〕	31,866,300	133.46 4,252,952,772	138.00 4,397,549,400	1.40
日本	株式	武田薬品工業 〔医薬品〕	1,029,600	3,886.66 4,001,715,000	3,880.00 3,994,848,000	1.27
日本	株式	ソニー 〔電気機器〕	1,474,300	2,945.79 4,342,987,400	2,664.00 3,927,535,200	1.25
日本	株式	ソフトバンク 〔情報・通信業〕	1,148,000	2,907.96 3,338,349,200	3,320.00 3,811,360,000	1.21
日本	株式	小松製作所 〔機械〕	1,302,100	2,338.52 3,044,994,900	2,825.00 3,678,432,500	1.17
日本	株式	日本電信電話 〔情報・通信業〕	973,100	3,781.23 3,679,521,700	3,735.00 3,634,528,500	1.16
日本	株式	ファナック 〔電気機器〕	273,300	11,973.58 3,272,382,000	12,590.00 3,440,847,000	1.09
日本	株式	任天堂 〔その他製品〕	150,200	22,668.28 3,404,776,000	22,470.00 3,374,994,000	1.07
日本	株式	三井物産 〔卸売業〕	2,236,800	1,313.86 2,938,857,300	1,491.00 3,335,068,800	1.06

日本	株式	エヌ・ティ・ティ・ドコモ 〔情報・通信業〕	21,407	136,371.99 2,919,315,294	146,200.00 3,129,703,400	0.99
日本	株式	パナソニック 〔電気機器〕	2,613,300	1,188.99 3,107,192,500	1,058.00 2,764,871,400	0.88
日本	株式	三菱電機 〔電気機器〕	2,625,000	835.10 2,192,148,000	982.00 2,577,750,000	0.82
日本	株式	三菱地所 〔不動産業〕	1,815,000	1,415.53 2,569,187,000	1,407.00 2,553,705,000	0.81
日本	株式	日立製作所 〔電気機器〕	5,894,000	396.99 2,339,895,000	433.00 2,552,102,000	0.81
日本	株式	日産自動車 〔輸送用機器〕	3,315,700	780.77 2,588,811,800	738.00 2,446,986,600	0.78
日本	株式	野村ホールディングス 〔証券・商品先物取引業〕	5,467,100	478.87 2,618,052,942	435.00 2,378,188,500	0.76
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス 〔小売業〕	1,084,400	2,042.04 2,214,390,000	2,122.00 2,301,096,800	0.73
日本	株式	東京海上ホールディングス 〔保険業〕	986,800	2,356.04 2,324,947,200	2,224.00 2,194,643,200	0.70
日本	株式	東日本旅客鉄道 〔陸運業〕	457,000	4,973.77 2,273,016,200	4,625.00 2,113,625,000	0.67
日本	株式	東芝 〔電気機器〕	5,184,000	431.88 2,238,897,000	407.00 2,109,888,000	0.67
日本	株式	K D D I 〔情報・通信業〕	4,024	480,522.68 1,933,623,304	515,000.00 2,072,360,000	0.66
日本	株式	関西電力 〔電気・ガス業〕	1,071,000	2,010.66 2,153,418,500	1,811.00 1,939,581,000	0.62
日本	株式	新日本製鐵 〔鉄鋼〕	7,214,000	275.49 1,987,409,000	266.00 1,918,924,000	0.61
日本	株式	信越化学工業 〔化学〕	457,900	4,078.34 1,867,473,200	4,135.00 1,893,416,500	0.60

## □ 種類別・業種別の投資比率

平成23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	1.40
	鉱業	0.70		その他製品	2.07
	建設業	2.17		電気・ガス業	3.58
	食料品	2.84		陸運業	3.39
	繊維製品	0.94		海運業	0.54
	パルプ・紙	0.36		空運業	0.28
	化学	5.80		倉庫・運輸関連業	0.23
	医薬品	4.39		情報・通信業	5.66
	石油・石炭製品	0.93		卸売業	5.52
	ゴム製品	0.64		小売業	3.39
	ガラス・土石製品	1.35		銀行業	8.88
	鉄鋼	2.27		証券・商品先物取引業	1.39
	非鉄金属	1.37		保険業	2.40

金属製品	0.74	その他金融業	0.73
機械	5.31	不動産業	2.20
電気機器	14.36	サービス業	1.63
輸送用機器	9.84	合計	97.40

**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23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	941	8,338,602,650	8,149,060,000	2.59

(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23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	365,799,965,380	73.70
地方債証券	日本	33,484,519,973	6.75
特殊債券	日本	53,529,575,284	10.78
	韓国	201,986,000	0.04
	小計	53,731,561,284	10.83
社債券	日本	37,550,900,000	7.57
	アメリカ	2,820,155,000	0.57
	イギリス	702,486,000	0.14
	オランダ	100,017,000	0.02
	韓国	203,940,000	0.04
	小計	41,377,498,000	8.34
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,962,185,105	0.40
合計(純資産総額)		496,355,729,742	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23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247回利付国債(10年)	13,085,000,000	101.62 13,297,387,000	101.17 13,239,141,300	0.8 2013/3/20	2.67
日本	国債証券	第270回利付国債(10年)	11,387,000,000	104.44 11,893,133,950	103.66 11,803,764,200	1.3 2015/6/20	2.38
日本	国債証券	第258回利付国債(10年)	11,353,000,000	103.57 11,758,476,200	103.02 11,695,860,600	1.3 2014/3/20	2.36
日本	国債証券	第244回利付国債(10年)	11,392,000,000	102.06 11,627,047,700	101.41 11,553,082,880	1 2012/12/20	2.33
日本	国債証券	第265回利付国債(10年)	10,650,000,000	105.04 11,187,612,000	104.17 11,094,424,500	1.5 2014/12/20	2.24
日本	国債証券	第268回利付国債(10年)	10,415,000,000	105.16 10,952,603,000	104.34 10,867,427,600	1.5 2015/3/20	2.19
日本	国債証券	第263回利付国債(10年)	10,192,000,000	105.37 10,739,310,400	104.32 10,633,007,840	1.6 2014/9/20	2.14
日本	国債証券	第277回利付国債(10年)	10,025,000,000	105.59 10,585,732,000	105.42 10,568,455,250	1.6 2016/3/20	2.13
日本	国債証券	第274回利付国債(10年)	9,605,000,000	105.31 10,115,601,500	104.76 10,063,062,450	1.5 2015/12/20	2.03
日本	国債証券	第272回利付国債(10年)	9,645,000,000	105.14 10,141,075,500	104.19 10,049,993,550	1.4 2015/9/20	2.02
日本	国債証券	第260回利付国債(10年)	9,585,000,000	105.08 10,072,778,700	104.13 9,980,860,500	1.6 2014/6/20	2.01

日本	国債証券	第250回利付国債（10年）	9,565,000,000	100.85 9,646,371,000	100.63 9,625,929,050	0.5 2013/6/20	1.94
日本	国債証券	第253回利付国債（10年）	9,110,000,000	104.44 9,515,207,000	103.33 9,414,091,800	1.6 2013/9/20	1.90
日本	国債証券	第256回利付国債（10年）	8,110,000,000	104.02 8,436,612,000	103.10 8,362,058,800	1.4 2013/12/20	1.68
日本	国債証券	第242回利付国債（10年）	6,980,000,000	102.36 7,144,937,400	101.51 7,085,747,000	1.2 2012/9/20	1.43
日本	国債証券	第310回利付国債（10年）	6,700,000,000	99.41 6,661,012,500	98.34 6,588,914,000	1 2020/9/20	1.33
日本	国債証券	第303回利付国債（10年）	6,195,000,000	102.38 6,342,441,000	102.99 6,380,788,050	1.4 2019/9/20	1.29
日本	国債証券	第305回利付国債（10年）	6,090,000,000	101.02 6,152,118,000	101.91 6,206,501,700	1.3 2019/12/20	1.25
日本	国債証券	第306回利付国債（10年）	6,050,000,000	101.55 6,143,775,000	102.48 6,200,463,500	1.4 2020/3/20	1.25
日本	国債証券	第243回利付国債（10年）	6,050,000,000	102.06 6,174,630,000	101.36 6,132,824,500	1.1 2012/9/20	1.24
日本	国債証券	第312回利付国債（10年）	5,670,000,000	99.96 5,667,948,100	99.82 5,660,134,200	1.2 2020/12/20	1.14
日本	国債証券	第280回利付国債（10年）	5,017,000,000	107.93 5,414,848,100	107.10 5,373,508,020	1.9 2016/6/20	1.08
日本	国債証券	第301回利付国債（10年）	5,045,000,000	103.55 5,224,097,500	103.98 5,246,245,050	1.5 2019/6/20	1.06
日本	国債証券	第308回利付国債（10年）	5,150,000,000	102.37 5,272,454,500	101.33 5,218,649,500	1.3 2020/6/20	1.05
日本	国債証券	第297回利付国債（10年）	4,623,000,000	103.31 4,776,021,300	103.64 4,791,369,660	1.4 2018/12/20	0.97
日本	国債証券	第290回利付国債（10年）	4,597,000,000	104.04 4,782,718,800	104.19 4,789,752,210	1.4 2018/3/20	0.96
日本	国債証券	第288回利付国債（10年）	4,505,000,000	106.68 4,806,042,500	106.27 4,787,868,950	1.7 2017/9/20	0.96
日本	国債証券	第293回利付国債（10年）	4,460,000,000	107.04 4,774,321,500	106.88 4,767,204,800	1.8 2018/6/20	0.96
日本	国債証券	第296回利付国債（10年）	4,493,000,000	104.39 4,690,242,700	104.56 4,697,880,800	1.5 2018/9/20	0.95
日本	国債証券	第282回利付国債（10年）	4,400,000,000	106.82 4,700,080,000	106.15 4,670,688,000	1.7 2016/9/20	0.94

□ 種類別の投資比率

平成23年3月31日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	73.70
地方債証券	6.75
特殊債券	10.83
社債券	8.34
合計	99.60

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23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	124,017,227,354	51.21
	カナダ	14,738,529,694	6.09
	ドイツ	10,101,990,824	4.17
	イタリア	3,352,614,294	1.38
	フランス	11,274,852,512	4.66
	オーストラリア	9,590,673,797	3.96
	イギリス	24,369,493,147	10.06
	スイス	10,231,097,507	4.22
	バミューダ	748,227,477	0.31
	香港	2,947,221,767	1.22
	シンガポール	1,837,825,605	0.76
	ニュージーランド	118,760,490	0.05
	オランダ	3,401,056,036	1.40
	スペイン	4,322,672,994	1.78
	ベルギー	1,113,239,495	0.46
	スウェーデン	3,755,943,814	1.55
	ノルウェー	1,033,411,891	0.43
	オーストリア	406,964,996	0.17
	ルクセンブルク	670,432,202	0.28
	フィンランド	1,292,198,424	0.53
	デンマーク	1,301,917,523	0.54
	アイルランド	1,485,945,003	0.61
	ギリシャ	293,403,792	0.12
	キプロス	34,389,225	0.01
	イスラエル	880,284,723	0.36
	ポルトガル	309,638,328	0.13
	ケイマン諸島	159,548,626	0.07
	モーリシャス	40,841,922	0.02
	リベリア	61,319,043	0.03
ジャージー	704,294,824	0.29	
ガーンジー	71,866,176	0.03	
アンティル	1,327,169,131	0.55	
マン島	99,733,034	0.04	
小計	236,094,785,670	97.49	
投資証券	アメリカ	2,306,437,853	0.95
	カナダ	31,429,681	0.01
	フランス	333,012,056	0.14
	オーストラリア	787,987,175	0.33
	イギリス	306,791,803	0.13
	香港	70,395,618	0.03

	シンガポール	59,181,907	0.02
	オランダ	45,694,824	0.02
	小計	3,940,930,917	1.63
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,149,927,313	0.89
合計(純資産総額)		242,185,643,900	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23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〕	629,393	5,782.26 3,639,316,745	7,025.34 4,421,702,021	1.83
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〕	114,517	26,380.38 3,021,002,723	29,001.05 3,321,114,044	1.37
アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION 〔エネルギー〕	251,207	6,809.14 1,710,505,469	8,981.03 2,256,097,980	0.93
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO 〔資本財〕	1,330,243	1,330.15 1,769,426,033	1,672.14 2,224,361,176	0.92
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP 〔ソフトウェア・サービス〕	155,076	11,891.66 1,844,111,682	13,603.33 2,109,551,553	0.87
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED 〔食品・飲料・タバコ〕	432,600	5,047.02 2,183,342,124	4,813.79 2,082,447,933	0.86
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP 〔ソフトウェア・サービス〕	960,602	2,104.67 2,021,759,098	2,126.97 2,043,178,360	0.84
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC 〔銀行〕	2,208,303	871.81 1,925,222,706	878.31 1,939,593,157	0.80
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO 〔各種金融〕	487,863	3,156.28 1,539,835,214	3,862.31 1,884,281,802	0.78
アメリカ	株式	AT&T INC 〔電気通信サービス〕	737,651	2,303.88 1,699,459,645	2,553.53 1,883,618,752	0.78
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO 〔家庭用品・パーソナル用品〕	349,370	5,165.46 1,804,657,241	5,152.80 1,800,235,657	0.74
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〕	342,976	5,146.11 1,764,995,155	4,937.44 1,693,425,822	0.70
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〕	999,566	1,379.01 1,378,416,998	1,691.27 1,690,536,988	0.70
アメリカ	株式	WELLS FARGO & COMPANY 〔銀行〕	622,632	2,265.80 1,410,759,645	2,653.31 1,652,039,759	0.68
オーストラリア	株式	BHP BILLITON LTD 〔素材〕	419,230	3,722.97 1,560,784,162	3,926.10 1,645,942,592	0.68
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC 〔電気通信サービス〕	6,510,538	213.02 1,386,923,934	240.80 1,567,745,134	0.65
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A 〔ソフトウェア・サービス〕	31,011	48,423.07 1,501,647,904	48,379.99 1,500,312,055	0.62
イギリス	株式	BP PLC 〔エネルギー〕	2,345,584	573.54 1,345,301,317	613.81 1,439,763,332	0.59

アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE 〔食品・飲料・タバコ〕	260,737	5,272.13 1,374,640,073	5,491.22 1,431,765,793	0.59
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP 〔各種金融〕	1,258,679	942.89 1,186,796,772	1,118.36 1,407,665,686	0.58
アメリカ	株式	ORACLE CORPORATION 〔ソフトウェア・サービス〕	501,829	2,266.48 1,137,390,409	2,747.27 1,378,662,767	0.57
アメリカ	株式	CITIGROUP INC 〔各種金融〕	3,625,518	349.37 1,266,681,980	370.01 1,341,505,106	0.55
イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS 〔エネルギー〕	442,806	2,607.40 1,154,572,865	3,009.17 1,332,481,962	0.55
フランス	株式	TOTAL SA 〔エネルギー〕	263,796	4,366.97 1,151,991,654	5,046.10 1,331,142,156	0.55
アンティル	株式	SCHLUMBERGER LTD 〔エネルギー〕	170,434	6,407.38 1,092,036,005	7,786.99 1,327,169,131	0.55
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC. 〔食品・飲料・タバコ〕	226,652	4,811.75 1,090,594,417	5,462.95 1,238,189,676	0.51
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〕	263,283	4,893.44 1,288,360,372	4,537.55 1,194,661,619	0.49
アメリカ	株式	INTEL CORP 〔半導体・半導体製造装置〕	696,722	1,772.90 1,235,221,911	1,701.24 1,185,297,605	0.49
アメリカ	株式	CONOCOPHILLIPS 〔エネルギー〕	174,296	5,055.81 881,208,311	6,709.37 1,169,416,963	0.48
ドイツ	株式	SIEMENS AG-REG 〔資本財〕	102,851	9,945.62 1,022,917,967	11,323.16 1,164,599,018	0.48

## □ 種類別・業種別の投資比率

平成23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	12.82	株式（外国）	ヘルスケア機器・サービス	2.61
	素材	8.10		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6.74
	資本財	7.92		銀行	8.24
	商業・専門サービス	0.85		各種金融	5.57
	運輸	1.74		保険	4.22
	自動車・自動車部品	1.42		不動産	0.71
	耐久消費財・アパレル	1.15		ソフトウェア・サービス	5.21
	消費者サービス	1.46		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.40
	メディア	2.61		電気通信サービス	4.18
	小売	2.49		公益事業	3.78
	食品・生活必需品小売り	2.21		半導体・半導体製造装置	1.53
	食品・飲料・タバコ	5.99		投資証券	1.63
	家庭用品・パーソナル用品	1.56		合計	99.11

**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23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	シカゴ商業取引所 SP500 11/06	買建	47	1,266,859,556	1,293,466,849	0.53
海外金融 先物	ロンドン国際金融先物オプション取引所 FTSE 11/06	買建	32	248,132,178	252,912,854	0.10
海外金融 先物	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所 DJ EUR 11/06	買建	154	508,069,114	517,101,077	0.21

**(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。

## 〔外国債券バッシブ・マザーファンド〕

## (1) 投資状況

平成23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	99,081,880,212	38.23
	カナダ	7,594,261,197	2.93
	ドイツ	24,560,504,202	9.48
	イタリア	26,236,886,982	10.12
	フランス	24,955,344,587	9.63
	オーストラリア	3,021,916,891	1.17
	イギリス	20,323,052,095	7.84
	スイス	1,431,882,717	0.55
	シンガポール	1,029,412,543	0.40
	マレーシア	1,300,361,372	0.50
	オランダ	6,176,617,544	2.38
	スペイン	11,304,555,244	4.36
	ベルギー	6,934,471,646	2.68
	スウェーデン	1,787,491,532	0.69
	ノルウェー	666,303,084	0.26
	オーストリア	4,766,546,453	1.84
	フィンランド	1,607,581,049	0.62
	デンマーク	2,173,501,763	0.84
	メキシコ	2,414,579,556	0.93
	アイルランド	1,912,241,954	0.74
ポーランド	2,410,050,990	0.93	
ポルトガル	2,385,318,945	0.92	
	小計	254,074,762,558	98.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,098,246,862	1.97
合計(純資産総額)		259,173,009,420	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23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 2.625% 20/11/15	18,000,000	7,772.23 1,399,002,221	7,757.63 1,396,374,328	2.625 2020/11/15	0.54
アメリカ	国債証券	US T 3.625% 20/02/15	15,000,000	8,502.08 1,275,313,125	8,539.76 1,280,964,726	3.625 2020/2/15	0.49
アメリカ	国債証券	US T 3.5% 20/05/15	15,000,000	8,389.05 1,258,358,320	8,425.43 1,263,815,039	3.5 2020/5/15	0.49
アメリカ	国債証券	US T 3.375% 19/11/15	15,000,000	8,368.26 1,255,240,195	8,404.64 1,260,696,914	3.375 2019/11/15	0.49
アメリカ	国債証券	US T 2.625% 20/8/15	15,000,000	7,760.23 1,164,035,039	7,796.61 1,169,491,757	2.625 2020/8/15	0.45



アメリカ	国債証券	US T 2.75% 19/02/15	13,000,000	8,091.32 1,051,872,445	8,122.71 1,055,953,031	2.75 2019/2/15	0.41
アメリカ	国債証券	US T 3.125% 19/05/15	12,000,000	8,278.41 993,409,680	8,309.80 997,176,375	3.125 2019/5/15	0.38
イタリア	国債証券	BTPS 6% 31/05/01	7,900,000	12,910.36 1,019,918,574	12,490.63 986,760,307	6 2031/5/1	0.38
アメリカ	国債証券	US T 3.75% 18/11/15	11,000,000	8,733.24 960,656,895	8,737.24 961,097,070	3.75 2018/11/15	0.37
イギリス	国債証券	UKT 4.5% 13/03/07	6,700,000	14,341.89 960,906,973	14,199.03 951,335,311	4.5 2013/3/7	0.37
イギリス	国債証券	UKT 2.25% 14/03/07	7,000,000	13,601.61 952,113,212	13,551.94 948,636,089	2.25 2014/3/7	0.37
フランス	国債証券	FRTR 3.0% 15/10/25	8,000,000	12,074.43 965,955,120	11,856.93 948,554,760	3 2015/10/25	0.37
アメリカ	国債証券	US T 3.625% 19/08/15	11,000,000	8,564.45 942,089,500	8,595.63 945,519,437	3.625 2019/8/15	0.36
アメリカ	国債証券	US T 2.375% 15/02/28	11,000,000	8,533.26 938,659,562	8,522.87 937,516,250	2.375 2015/2/28	0.36
アメリカ	国債証券	US T 1% 12/03/31	11,000,000	8,374.76 921,224,046	8,369.89 920,688,116	1 2012/3/31	0.36
フランス	国債証券	FRTR 3.75% 21/04/25	7,700,000	12,053.27 928,102,282	11,788.74 907,733,280	3.75 2021/4/25	0.35
アメリカ	国債証券	US T 4.375% 39/11/15	11,000,000	8,043.22 884,754,976	8,113.62 892,498,320	4.375 2039/11/15	0.34
アメリカ	国債証券	US T 4.375% 40/05/15	11,000,000	8,044.11 884,852,422	8,108.42 891,926,664	4.375 2040/5/15	0.34
アメリカ	国債証券	US T 2.125% 14/11/30	10,500,000	8,482.59 890,672,917	8,470.25 889,376,951	2.125 2014/11/30	0.34
ドイツ	国債証券	DBR 5% 12/07/04	7,220,000	12,489.10 901,713,625	12,266.66 885,653,281	5 2012/7/4	0.34
イギリス	国債証券	UKT 2.75% 15/01/22	6,500,000	13,657.57 887,742,381	13,624.51 885,593,313	2.75 2015/1/22	0.34
アメリカ	国債証券	US T 4.25% 40/11/15	11,000,000	7,968.19 876,501,558	7,933.02 872,633,265	4.25 2040/11/15	0.34
アメリカ	国債証券	US T 2.625% 14/07/31	10,000,000	8,669.68 866,968,671	8,642.40 864,240,312	2.625 2014/7/31	0.33
アメリカ	国債証券	US T 2.375% 14/09/30	10,000,000	8,584.58 858,458,793	8,561.20 856,120,199	2.375 2014/9/30	0.33
フランス	国債証券	FRTR 4.25% 19/04/25	6,900,000	12,645.82 872,562,214	12,389.52 854,877,335	4.25 2019/4/25	0.33
アメリカ	国債証券	US T 2.5% 15/04/30	10,000,000	8,562.50 856,250,121	8,545.61 854,561,136	2.5 2015/4/30	0.33
フランス	国債証券	FRTR 4.25% 23/10/25	7,000,000	12,481.83 873,728,274	12,201.41 854,099,022	4.25 2023/10/25	0.33
フランス	国債証券	BTNS 3.75% 13/01/12	7,000,000	12,295.05 860,653,549	12,148.39 850,387,337	3.75 2013/1/12	0.33
イタリア	国債証券	BTPS 3.75% 15/08/01	7,200,000	11,903.96 857,085,300	11,804.02 849,890,016	3.75 2015/8/1	0.33

アメリカ	国債証券	US T 2.25% 15/01/31	10,000,000	8,501.77 850,177,605	8,492.99 849,299,296	2.25 2015/1/31	0.33
------	------	---------------------	------------	-------------------------	-------------------------	-------------------	------

## □ 種類別の投資比率

平成23年3月31日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	98.03
合計	98.03

**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。

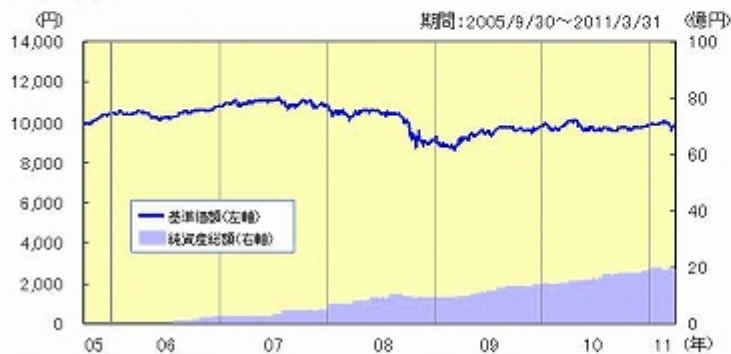
## 〔参考情報〕

基準日2011年3月31日

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

## 基準価額・純資産の推移

## &lt;マイパッケージ30&gt;



基準価額	9,882円
純資産総額	20億円

## 分配の推移

決算期	分配金
2011年2月	0円
2010年2月	0円
2009年2月	0円
2008年2月	0円
2007年2月	0円
設定未累計	0円

※ 分配金は1万円当たり、税引前です。  
 ※ 直近計算期間を記載しています。

## &lt;マイパッケージ50&gt;



基準価額	9,171円
純資産総額	60億円

## 分配の推移

決算期	分配金
2011年2月	0円
2010年2月	0円
2009年2月	0円
2008年2月	0円
2007年2月	0円
設定未累計	0円

※ 分配金は1万円当たり、税引前です。  
 ※ 直近計算期間を記載しています。

## &lt;マイパッケージ70&gt;



基準価額	8,388円
純資産総額	29億円

## 分配の推移

決算期	分配金
2011年2月	0円
2010年2月	0円
2009年2月	0円
2008年2月	0円
2007年2月	0円
設定未累計	0円

※ 分配金は1万円当たり、税引前です。  
 ※ 直近計算期間を記載しています。

※ 基準価額は、1万円当たり、信託報酬控除後です。

## 年間収益率の推移(暦年ベース)

## &lt;マイパッケージ30&gt;



## &lt;マイパッケージ50&gt;



## &lt;マイパッケージ70&gt;



2005年のファンドの収益率は、ファンドの設定日(2005年9月30日)から年末までの騰落率を表示しています。

2011年の収益率は、年初から2011年3月31日までの騰落率を表示しています。

ベンチマークの情報はあくまで参考情報として記載しており、ファンドの運用実績ではありません。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### イ 申込方法

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

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

#### ヘ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

#### ト 払込期日

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

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

### 2【換金（解約）手続等】

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

お買付けの販売会社にお申し出ください。

解約請求のお申込みに関しては、原則として午後3時まで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。

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

##### イ 基準価額の算出方法

基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券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	インターネット・ホームページ・アドレス
三井住友アセットマネジメント株式会社	0120-88-2976	<a href="http://www.smam-jp.com">http://www.smam-jp.com</a>

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

#### (2)【保管】

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

#### (3)【信託期間】

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

#### (5)【その他】

##### イ 信託の終了

##### (イ) 信託契約の解約

- 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。
- 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せん。

(ロ) 償還金

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

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

## ハ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

## ト 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

## チ 運用にかかる報告書の開示方法

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

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

## 4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利は次の通りです。

### イ 分配金請求権

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

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、）に支払われます。

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

### ハ 一部解約実行請求権

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

### ニ 信託約款変更等に対する異議申立権および受益権の買取請求権

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

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

### ホ 帳簿閲覧・謄写請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（以下「財務諸表等規則」といいます）（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」（以下「投資信託財産計算規則」といいます）（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

また、第5期（平成21年2月19日から平成22年2月18日まで）については、改正前の財務諸表等規則および投資信託財産計算規則に基づき、第6期（平成22年2月19日から平成23年2月18日まで）については、改正後の財務諸表等規則および投資信託財産計算規則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は、あずさ監査法人により監査を受け、第6期（平成22年2月19日から平成23年2月18日まで）の財務諸表については、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

なお、あずさ監査法人は、監査法人の種類の変更により平成22年7月1日をもって有限責任 あずさ監査法人となっております。

## 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5期 (平成22年2月18日現在)	第6期 (平成23年2月18日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	64,998,290	87,742,332
親投資信託受益証券	1,366,386,300	1,875,287,873
未収入金	-	125,000
未収利息	89	120
流動資産合計	1,431,384,679	1,963,155,325
資産合計	1,431,384,679	1,963,155,325
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	847,423	124,753
未払受託者報酬	219,253	295,527
未払委託者報酬	1,388,529	1,871,637
その他未払費用	36,480	49,197
流動負債合計	2,491,685	2,341,114
負債合計	2,491,685	2,341,114
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,473,303,036	1,952,365,458
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	44,410,042	8,448,753
元本等合計	1,428,892,994	1,960,814,211
純資産合計	1,428,892,994	1,960,814,211
負債純資産合計	1,431,384,679	1,963,155,325

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第5期	第6期
	自平成21年2月19日 至平成22年2月18日	自平成22年2月19日 至平成23年2月18日
営業収益		
受取利息	40,292	37,654
有価証券売買等損益	108,532,887	70,892,573
営業収益合計	108,573,179	70,930,227
営業費用		
受託者報酬	389,207	538,985
委託者報酬	2,489,089	3,413,471
その他費用	64,744	89,717
営業費用合計	2,943,040	4,042,173
営業利益	105,630,139	66,888,054
経常利益	105,630,139	66,888,054
当期純利益	105,630,139	66,888,054
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	3,854,363	1,926,945
期首剰余金又は期首欠損金( )	128,317,515	44,410,042
剰余金増加額又は欠損金減少額	8,622,681	4,693,226
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	4,693,226
剰余金減少額又は欠損金増加額	26,490,984	16,795,540
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	16,795,540
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金( )	44,410,042	8,448,753

## (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5期 自平成21年2月19日 至平成22年2月18日	第6期 自平成22年2月19日 至平成23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5期 (平成22年2月18日現在)	第6期 (平成23年2月18日現在)
1. 受益権総数	当計算期間の末日における受益権の総数 1,473,303,036口	当計算期間の末日における受益権の総数 1,952,365,458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 44,410,042円	
3. 1単位当たり純資産額	0.9699円 (1万口 = 9,699円)	1.0043円 (1万口 = 10,043円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第5期 自平成21年2月19日 至平成22年2月18日	第6期 自平成22年2月19日 至平成23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（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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（30,844,389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（214,678,764円）、および分配準備積立金（48,879,040円）より、分配対象収益は294,402,193円（1万口当たり1,507.92円）であります。分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）および「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

・金融商品の状況に関する事項

項目	第6期 自平成22年2月19日 至平成23年2月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいておりません。当ファンドにおけるデリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。リスクを管理する部署では、各種リスクごとに定められた頻度で、測定項目が上下限值（リミットあるいは注意レベル）内に収まっているかどうかのモニタリングを行っています。上下限値を越えていることが発見された場合は、原則として速やかに修正を行うよう、リスク管理を行う部署から関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われます。また、是正勧告あるいは報告を受けた関連運用グループでは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、リスク管理を行う部署は、上下限値に抵触した事実ならびにその後の対処結果あるいは関連運用グループの対処方針の決定に関し、必要に応じて、リスク管理を行う部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告する体制となっております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

## ・金融商品の時価等に関する事項

項目	第6期	
	自平成22年2月19日 至平成23年2月18日	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。	

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

## 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

## 第6期(自平成22年2月19日 至平成23年2月18日)

種類	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	65,755,600円
合計	65,755,600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>
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。
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。
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。
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。
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。

## . 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。

第6期（平成23年2月18日現在）

第6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。

第6期（自平成22年2月19日 至 平成23年2月18日）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項目	第5期 （平成22年2月18日現在）	第6期 （平成23年2月18日現在）
期首元本額	1,054,314,569円	1,473,303,036円
期中追加設定元本額	495,358,440円	638,803,489円
期中一部解約元本額	76,369,973円	159,741,067円

#### （4）【附属明細表】

有価証券明細表

（a）株式

該当事項はありません。

（b）株式以外の有価証券

種類	銘柄名	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）	315,275,270円	1.2778円	402,858,740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	991,008,625円	1.0804円	1,070,685,718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	145,975,261円	1.3816円	201,679,420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	179,994,598円	1.1115円	200,063,995円
合計		1,632,253,754円		1,875,287,873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5期 (平成22年2月18日現在)	第6期 (平成23年2月18日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	220,483,935	282,133,975
親投資信託受益証券	4,393,832,457	5,807,319,038
未収入金	-	12,000
未収利息	302	386
流動資産合計	4,614,316,694	6,089,465,399
資産合計	4,614,316,694	6,089,465,399
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	271,950	209,389
未払受託者報酬	708,456	914,984
未払委託者報酬	4,722,967	6,099,851
その他未払費用	118,014	152,440
流動負債合計	5,821,387	7,376,664
負債合計	5,821,387	7,376,664
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	5,130,131,943	6,422,758,338
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	521,636,636	340,669,603
元本等合計	4,608,495,307	6,082,088,735
純資産合計	4,608,495,307	6,082,088,735
負債純資産合計	4,614,316,694	6,089,465,399

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第5期	第6期
	自平成21年2月19日 至平成22年2月18日	自平成22年2月19日 至平成23年2月18日
営業収益		
受取利息	131,094	123,057
有価証券売買等損益	502,524,241	339,164,581
営業収益合計	502,655,335	339,287,638
営業費用		
受託者報酬	1,253,062	1,686,878
委託者報酬	8,430,878	11,245,716
その他費用	208,722	281,021
営業費用合計	9,892,662	13,213,615
営業利益	492,762,673	326,074,023
経常利益	492,762,673	326,074,023
当期純利益	492,762,673	326,074,023
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	11,673,293	7,272,562
期首剰余金又は期首欠損金( )	835,749,068	521,636,636
剰余金増加額又は欠損金減少額	32,409,154	47,684,278
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	47,684,278
剰余金減少額又は欠損金増加額	199,386,102	185,518,706
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	199,386,102	185,518,706
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金( )	521,636,636	340,669,603

## (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5期	第6期
	自平成21年2月19日 至平成22年2月18日	自平成22年2月19日 至平成23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5期	第6期
	(平成22年2月18日現在)	(平成23年2月18日現在)
1. 受益権総数	当計算期間の末日における受益権の総数 5,130,131,943口	当計算期間の末日における受益権の総数 6,422,758,338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 521,636,636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 340,669,603円
3. 1単位当たり純資産額	0.8983円 (1万口=8,983円)	0.9470円 (1万口=9,470円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第5期	第6期
	自平成21年2月19日 至平成22年2月18日	自平成22年2月19日 至平成23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（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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（102,664,537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（987,148,909円）、および分配準備積立金（215,069,298円）より、分配対象収益は1,304,882,744円（1万口当たり2,031.65円）であります。分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）および「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

・金融商品の状況に関する事項

項目	第6期 自平成22年2月19日 至平成23年2月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいておりません。当ファンドにおけるデリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。リスクを管理する部署では、各種リスクごとに定められた頻度で、測定項目が上下限值（リミットあるいは注意レベル）内に収まっているかどうかのモニタリングを行っています。上下限値を越えていることが発見された場合は、原則として速やかに修正を行うよう、リスク管理を行う部署から関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われます。また、是正勧告あるいは報告を受けた関連運用グループでは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、リスク管理を行う部署は、上下限値に抵触した事実ならびにその後の対処結果あるいは関連運用グループの対処方針の決定に関し、必要に応じて、リスク管理を行う部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告する体制となっております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

## ・金融商品の時価等に関する事項

項目	第6期	
	自平成22年2月19日 至平成23年2月18日	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。	

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

## 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

## 第6期(自平成22年2月19日 至平成23年2月18日)

種類	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	320,327,069円
合計	320,327,069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>
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。
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。
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。
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。
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。

## ．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。

第6期（平成23年2月18日現在）

第6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。

第6期（自平成22年2月19日 至 平成23年2月18日）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項目	第5期 （平成22年2月18日現在）	第6期 （平成23年2月18日現在）
期首元本額	3,728,508,957円	5,130,131,943円
期中追加設定元本額	1,554,846,560円	1,758,746,053円
期中一部解約元本額	153,223,574円	466,119,658円

#### （4）【附属明細表】

有価証券明細表

（a）株式

該当事項はありません。

（b）株式以外の有価証券

種類	銘柄名	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）	1,694,896,178円	1.2778円	2,165,738,336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	1,944,320,646円	1.0804円	2,100,644,025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	671,128,573円	1.3816円	927,231,236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	552,141,648円	1.1115円	613,705,441円
合計		4,862,487,045円		5,807,319,038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5期 (平成22年2月18日現在)	第6期 (平成23年2月18日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	97,003,052	126,099,698
親投資信託受益証券	1,965,960,700	2,783,864,641
未収利息	132	172
流動資産合計	2,062,963,884	2,909,964,511
資産合計	2,062,963,884	2,909,964,511
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	42,894	264,691
未払受託者報酬	315,378	420,603
未払委託者報酬	2,207,569	2,944,171
その他未払費用	52,503	70,036
流動負債合計	2,618,344	3,699,501
負債合計	2,618,344	3,699,501
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	2,507,724,029	3,301,833,283
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	447,378,489	395,568,273
元本等合計	2,060,345,540	2,906,265,010
純資産合計	2,060,345,540	2,906,265,010
負債純資産合計	2,062,963,884	2,909,964,511

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第 5 期	第 6 期
	自 平成21年 2月19日 至 平成22年 2月18日	自 平成22年 2月19日 至 平成23年 2月18日
営業収益		
受取利息	55,832	56,705
有価証券売買等損益	274,992,779	210,677,941
営業収益合計	275,048,611	210,734,646
営業費用		
受託者報酬	546,684	769,699
委託者報酬	3,858,707	5,387,803
その他費用	90,995	128,155
営業費用合計	4,496,386	6,285,657
営業利益	270,552,225	204,448,989
経常利益	270,552,225	204,448,989
当期純利益	270,552,225	204,448,989
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	9,180,017	2,723,125
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	557,594,943	447,378,489
剰余金増加額又は欠損金減少額	31,199,945	37,532,219
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	37,532,219
剰余金減少額又は欠損金増加額	182,355,699	187,447,867
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	182,355,699	187,447,867
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	447,378,489	395,568,273

## (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5期	第6期
	自平成21年2月19日 至平成22年2月18日	自平成22年2月19日 至平成23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5期	第6期
	(平成22年2月18日現在)	(平成23年2月18日現在)
1. 受益権総数	当計算期間の末日における受益権の総数 2,507,724,029口	当計算期間の末日における受益権の総数 3,301,833,283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 447,378,489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 395,568,273円
3. 1単位当たり純資産額	0.8216円 (1万口 = 8,216円)	0.8802円 (1万口 = 8,802円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第5期	第6期
	自平成21年2月19日 至平成22年2月18日	自平成22年2月19日 至平成23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（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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（49,164,613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（682,504,592円）、および分配準備積立金（107,357,783円）より、分配対象収益は839,026,988円（1万口当たり2,541.09円）であります。分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）および「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

・金融商品の状況に関する事項

項目	第6期 自平成22年2月19日 至平成23年2月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。当ファンドにおけるデリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。リスクを管理する部署では、各種リスクごとに定められた頻度で、測定項目が上下限值（リミットあるいは注意レベル）内に収まっているかどうかのモニタリングを行っています。上下限値を越えていることが発見された場合は、原則として速やかに修正を行うよう、リスク管理を行う部署から関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われます。また、是正勧告あるいは報告を受けた関連運用グループでは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、リスク管理を行う部署は、上下限値に抵触した事実ならびにその後の対処結果あるいは関連運用グループの対処方針の決定に関し、必要に応じて、リスク管理を行う部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告する体制となっております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

## ・金融商品の時価等に関する事項

項目	第6期
	自平成22年2月19日 至平成23年2月18日
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(親投資信託受益証券) 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

## 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

## 第6期(自平成22年2月19日 至平成23年2月18日)

種類	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	206,172,848円
合計	206,172,848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>
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。
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。
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。
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。
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。

## . 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。

第6期（平成23年2月18日現在）

第6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。

第6期（自平成22年2月19日 至 平成23年2月18日）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項目	第5期 （平成22年2月18日現在）	第6期 （平成23年2月18日現在）
期首元本額	1,727,001,844円	2,507,724,029円
期中追加設定元本額	884,174,334円	1,002,632,701円
期中一部解約元本額	103,452,149円	208,523,447円

#### （４）【附属明細表】

有価証券明細表

（a）株式

該当事項はありません。

（b）株式以外の有価証券

種類	銘柄名	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）	1,150,141,434円	1.2778円	1,469,650,724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	399,513,162円	1.0804円	431,634,020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	427,007,035円	1.3816円	589,952,919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	263,272,135円	1.1115円	292,626,978円
合計		2,239,933,766円		2,783,864,641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23年3月31日現在

資産総額	1,985,811,750 円
負債総額	2,496,373 円
純資産総額( - )	1,983,315,377 円
発行済口数	2,006,915,021 口
1口当たり純資産額( / )	0.9882 円
( 1万口当たり純資産額	9,882 円)

#### b. 三井住友・DC年金バランス50(標準型)

平成23年3月31日現在

資産総額	6,021,416,576 円
負債総額	4,491,309 円
純資産総額( - )	6,016,925,267 円
発行済口数	6,560,591,748 口
1口当たり純資産額( / )	0.9171 円
( 1万口当たり純資産額	9,171 円)

#### c. 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)

平成23年3月31日現在

資産総額	2,851,546,194 円
負債総額	991,922 円
純資産総額( - )	2,850,554,272 円
発行済口数	3,399,228,633 口
1口当たり純資産額( / )	0.8386 円
( 1万口当たり純資産額	8,386 円)



## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

### イ 名義書換

該当事項はありません。

### ロ 受益者名簿

作成しません。

### ハ 受益者に対する特典

ありません。

### ニ 受益権の譲渡および譲渡制限等

#### (イ) 受益権の譲渡

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

#### (ロ) 受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件

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

### ホ 受益権の再分割

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

### ヘ 償還金

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

### ト 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### イ 資本金の額および株式数

平成23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。

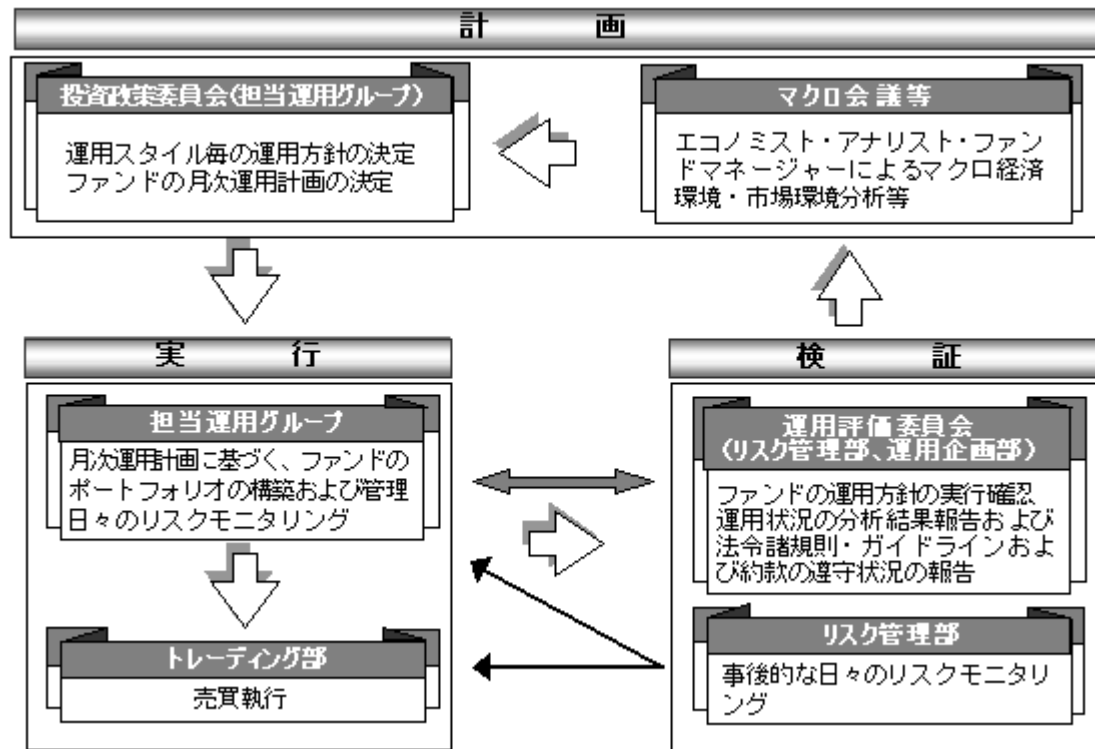
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

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23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23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	61 ( 1 )	115,301 ( 209 )
	追加型	264 ( 128 )	4,960,570 ( 3,198,656 )
	計	325 ( 129 )	5,075,871 ( 3,198,865 )
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		325 ( 129 )	5,075,871 ( 3,198,865 )

( )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25期（平成21年4月1日から平成22年3月31日まで）については、改正後の「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24期（平成20年4月1日から平成21年3月31日まで）及び第25期（平成21年4月1日から平成22年3月31日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、あずさ監査法人の監査を受けており、第26期中間会計期間（平成22年4月1日から平成22年9月30日まで）の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の中間監査を受けております。

なお、あずさ監査法人は、監査法人の種類の変更により平成22年7月1日付をもって、名称を有限責任 あずさ監査法人に変更しております。

## (1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第 24 期 (平成21年 3月31日現在)	第 25 期 (平成22年 3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金及び預金	2 15,883,303	15,484,883
有価証券	2,998,947	2,999,185
前払費用	323,949	248,594
未収入金	3,593	6,524
未収委託者報酬	2,158,082	3,405,895
未収運用受託報酬	635,902	456,672
未収投資助言報酬	2 406,959	426,716
未収収益	8,062	7,020
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	68,795	244,770
その他の流動資産	2,641	1,392
流動資産計	23,740,977	23,281,654
固定資産		
有形固定資産		
有形固定資産	1	
建物	169,629	173,574
器具備品	200,701	150,631
有形固定資産合計	370,331	324,206
無形固定資産		
無形固定資産	1	
電話加入権	161	150
商標権	8,104	6,160
無形固定資産合計	8,266	6,310
投資その他の資産		
投資有価証券	2,542,125	6,923,150
関係会社株式	236,178	236,178

長期差入保証金	783,231	681,764
長期前払費用	14,643	7,822
会員権	20,113	20,113
繰延税金資産	34,393	524,820
投資その他の資産合計	3,630,686	8,393,850
固定資産計	4,009,284	8,724,367
資産合計	27,750,261	32,006,022

(単位：千円)

	第 24 期 (平成21年3月31日現在)	第 25 期 (平成22年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	44,497	46,362
未払金		
未払収益分配金	947	943
未払償還金	23,376	18,453
未払手数料	2 891,493	1,523,402
その他未払金	112,743	71,728
未払費用	612,126	869,497
未払消費税等	-	74,053
未払法人税等	-	1,264,485
賞与引当金	291,836	293,651
流動負債計	1,977,020	4,162,578
固定負債		
退職給付引当金	972,202	1,137,766
固定負債計	972,202	1,137,766
負債合計	2,949,223	5,300,344
(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	12,356,655	14,172,932
利益剰余金合計	14,177,860	15,994,137
株主資本計	24,806,844	26,623,121
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	5,805	82,556
評価・換算差額等計	5,805	82,556
純資産合計	24,801,038	26,705,677
負債・純資産合計	27,750,261	32,006,022

## （２）【損益計算書】

（単位：千円）

	第 24 期 (自 平成20年 4月 1日 至 平成21年 3月31日)	第 25 期 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)
営業収益		
委託者報酬	20,072,582	21,113,167
運用受託報酬	3,506,635	2,492,177
投資助言報酬	2,048,748	1,893,038
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	60,260	43,853
その他	2,749	12,348
営業収益計	25,695,976	25,559,586
営業費用		
支払手数料	9,326,200	9,706,627
広告宣伝費	529,276	420,508
公告費	1,227	2,339
調査費		
調査費	538,515	579,477
委託調査費	1,310,113	1,556,961
営業雑経費		
通信費	30,202	31,515
印刷費	302,661	278,539
協会費	23,322	19,271
諸会費	14,373	12,955
情報機器関連費	2,036,426	2,005,507
販売促進費	55,223	13,183
その他	55,485	66,833
営業費用計	14,223,029	14,693,722
一般管理費		

給料		
役員報酬	174,486	155,835
給料・手当	4,004,575	4,192,414
賞与	1,051,279	719,290
賞与引当金繰入額	291,836	293,651
交際費	23,229	19,087
寄付金	4,000	23
事務委託費	356,543	195,150
旅費交通費	258,981	197,842
租税公課	81,166	86,095
不動産賃借料	762,812	714,209
退職給付費用	262,634	197,352
固定資産減価償却費	119,811	97,916
諸経費	281,968	280,916
一般管理費計	7,673,326	7,149,786
営業利益	3,799,620	3,716,077

営業外収益			
受取配当金		-	1,710
有価証券利息		22,216	4,645
受取利息	1	36,255	16,592
為替差益		11,209	-
時効成立分配金・償還金		7,832	3,492
原稿・講演料		3,910	3,255
還付加算金		-	37,708
雑収入		4,132	6,291
営業外収益計		85,555	73,696
営業外費用			
為替差損		-	5,113
時効成立後支払分配金・償還金		693	-
雑損失		82	-
営業外費用計		775	5,113
経常利益		3,884,401	3,784,660
特別利益			
投資有価証券償還益		1,136	2,459
投資有価証券売却益		122	31,117
特別利益計		1,259	33,577
特別損失			
固定資産除却損	2	688	5,302
投資有価証券償還損		84,238	-
投資有価証券評価損		65,553	51,557
投資有価証券売却損		464,272	2,724
特別損失計		614,753	59,583
税引前当期純利益		3,270,907	3,758,653
法人税、住民税及び事業税		1,206,047	1,817,726
法人税等調整額		369,088	722,069
法人税等合計		1,575,135	1,095,656
当期純利益		1,695,771	2,662,997

## （３）【株主資本等変動計算書】

（単位：千円）

	第 24 期 (自 平成20年 4月 1日 至 平成21年 3月31日)	第 25 期 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)
株主資本		
資本金		
前期末残高	2,000,000	2,000,000
当期末残高	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金		
前期末残高	8,628,984	8,628,984
当期末残高	8,628,984	8,628,984
資本剰余金合計		
前期末残高	8,628,984	8,628,984
当期末残高	8,628,984	8,628,984
利益剰余金		
利益準備金		
前期末残高	284,245	284,245
当期末残高	284,245	284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金		
前期末残高	60,000	60,000
当期末残高	60,000	60,000
別途積立金		
前期末残高	1,476,959	1,476,959
当期末残高	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金		
前期末残高	13,483,283	12,356,655
当期変動額		

剰余金の配当	2,822,400	846,720
当期純利益	1,695,771	2,662,997
当期変動額合計	1,126,628	1,816,277
当期末残高	12,356,655	14,172,932
利益剰余金合計		
前期末残高	15,304,488	14,177,860
当期変動額		
剰余金の配当	2,822,400	846,720
当期純利益	1,695,771	2,662,997
当期変動額合計	1,126,628	1,816,277
当期末残高	14,177,860	15,994,137
株主資本合計		
前期末残高	25,933,472	24,806,844
当期変動額		
剰余金の配当	2,822,400	846,720
当期純利益	1,695,771	2,662,997
当期変動額合計	1,126,628	1,816,277
当期末残高	24,806,844	26,623,121

評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
前期末残高	25,392	5,805
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	31,197	88,361
当期変動額合計	31,197	88,361
当期末残高	5,805	82,556
評価・換算差額合計		
前期末残高	25,392	5,805
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	31,197	88,361
当期変動額合計	31,197	88,361
当期末残高	5,805	82,556
純資産合計		
前期末残高	25,958,864	24,801,038
当期変動額		
剰余金の配当	2,822,400	846,720
当期純利益	1,695,771	2,662,997
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	31,197	88,361
当期変動額合計	1,157,826	1,904,639
当期末残高	24,801,038	26,705,677

## 重要な会計方針

項目	第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)
1 有価証券の評価基準及び 評価方法	満期保有目的の債券 償却原価法 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法 その他有価証券 時価のあるもの 決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により 処理し、売却原価は移動平均法に より算定) 時価のないもの 移動平均法による原価法	満期保有目的の債券 同左 子会社株式及び関連会社株式 同左 その他有価証券 時価のあるもの 同左 時価のないもの 同左
2 固定資産の減価償却の方 法	有形固定資産 定率法によっております。但し、建物（建 物附属設備を除く）については、定額法 によっております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであ ります。  建物 3～50年 器具備品 3～20年  無形固定資産 定額法によっております。	有形固定資産 同左     無形固定資産 同左
3 引当金の計上基準 (1) 賞与引当金	従業員賞与の支給に充てるため、将来の 支給見込額のうち当期の負担額を計上し ております。	同左



(2) 退職給付引当金	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>（会計方針の変更）</p> <p>当事業年度より、「退職給付に係る会計基準」の一部改正（その3）（企業会計基準第19号 平成20年7月31日）を適用しております。この変更が当事業年度の損益に与える影響はありません。また、本会計基準の適用に伴い発生する退職給付債務の差額はありませぬ。</p>
4 リース取引の処理方法	<p>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。</p>	-
5 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>消費税等の会計処理は税抜方式によっております。</p>	同左

## 会計方針の変更

(会計処理の変更)

第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)
<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>	-

## 注記事項

(貸借対照表関係)

第24期 (平成21年3月31日現在)	第25期 (平成22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          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>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>  建物          172,855千円</p> <p>  器具備品      863,358千円</p> <p>無形固定資産の減価償却累計額</p> <p>  電話加入権      83千円</p> <p>  商標権         13,282千円</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>2 関係会社に対する債権債務</p> <p>  現金及び預金  10,591,647千円</p> <p>  未収投資助言報酬  295,911千円</p> <p>  未払手数料     441,536千円</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>差引額 10,000,000千円</p>	<p>3 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座貸越契約を締結しております。</p> <p>当事業年度末における当座貸越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。</p> <p>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>差引額 10,000,000千円</p>
<p>4 当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York)Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成27年6月までの賃借料総額128,926千円の支払保証を行っております。</p>	<p>4 当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York)Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成27年6月までの賃借料総額102,815千円の支払保証を行っております。</p>

## （損益計算書関係）

第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)
1 関係会社との取引に係るもの 受取利息 18,943千円	1 関係会社との取引に係るもの 受取利息 5,916千円
2 固定資産除却損は、器具備品688千円であります。	2 固定資産除却損は、器具備品5,302千円であります。

## （株主資本等変動計算書関係）

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、配当の効力発生在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

第25期(自平成21年4月1日至平成22年3月31日)

## 1.発行済株式数に関する事項

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

## 2.剰余金の配当に関する事項

## (1) 配当金支払額等

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

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

平成22年6月24日開催の第25回定時株主総会において次の通り付議いたします。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成22年6月24日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	1,323,000	75,000	平成22年 3月31日	平成22年 6月25日

## (リース取引関係)

第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)																						
<p>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)</p> <p>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)</p> <table style="margin-left: 40px;"> <thead> <tr> <th style="text-align: left;">器具備品</th> <th colspan="2" style="text-align: center;">合計</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>取得価額相当額</td> <td style="text-align: right;">5,330</td> <td style="text-align: right;">5,330</td> </tr> <tr> <td>減価償却累計額相当額</td> <td style="text-align: right;">5,330</td> <td style="text-align: right;">5,330</td> </tr> <tr> <td>期末残高相当額</td> <td style="text-align: right;">-</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> </tbody> </table> <p>未経過リース料期末残高相当額(単位：千円)</p> <table style="margin-left: 40px;"> <tbody> <tr> <td>1年以内</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> <tr> <td>合計</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> </tbody> </table> <p>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)</p> <table style="margin-left: 40px;"> <tbody> <tr> <td>支払リース料</td> <td style="text-align: right;">2,067</td> </tr> <tr> <td>減価償却費相当額</td> <td style="text-align: right;">1,900</td> </tr> <tr> <td>支払利息相当額</td> <td style="text-align: right;">37</td> </tr> </tbody> </table> <p>減価償却費相当額及び利息相当額の算定方法</p> <p>減価償却費相当額の算定方法</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・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。</li> </ul> <p>利息相当額の算定方法</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・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。</li> </ul>	器具備品	合計		取得価額相当額	5,330	5,330	減価償却累計額相当額	5,330	5,330	期末残高相当額	-	-	1年以内	-	合計	-	支払リース料	2,067	減価償却費相当額	1,900	支払利息相当額	37	-
器具備品	合計																						
取得価額相当額	5,330	5,330																					
減価償却累計額相当額	5,330	5,330																					
期末残高相当額	-	-																					
1年以内	-																						
合計	-																						
支払リース料	2,067																						
減価償却費相当額	1,900																						
支払利息相当額	37																						

2. オペレーティング・リース取引 (借主側)		1. オペレーティング・リース取引 (借主側)	
未経過リース料(解約不能のもの)(単位:千円)		未経過リース料(解約不能のもの)(単位:千円)	
1年以内	710,121	1年以内	667,234
<u>1年超</u>	<u>962,627</u>	<u>1年超</u>	<u>1,608,004</u>
合計	1,672,748	合計	2,275,239

## （金融商品関係）

第25期(自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

営業債務である未払手数料は、すべて1年以内の支払期日であります。

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

## 信用リスクの管理

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

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

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

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

## 市場リスクの管理

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

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



合には速やかに処分することとしています。

(4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

平成22年3月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれていません（（注2）参照）。

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	15,484,883	15,484,883	-
(2)未収委託者報酬	3,405,895	3,405,895	-
(3)未収運用受託報酬	456,672	456,672	-
(4)未収投資助言報酬	426,716	426,716	-
(5)有価証券及び投資有価証券			
満期保有目的の債券	2,999,185	2,999,100	85
その他有価証券	6,874,409	6,874,409	-
(6)長期差入保証金	681,764	681,764	-
資産計	30,329,527	30,329,442	85
(1)未払金			
未払手数料	1,523,402	1,523,402	-
負債計	1,523,402	1,523,402	-

（注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資産

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

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

(5)有価証券及び投資有価証券

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

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

(6)長期差入保証金

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

負債

(1)未払金

## 未払手数料

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

	貸借対照表計上額
その他有価証券	
非上場株式	298
投資証券	48,443
合計	48,741
子会社株式	
非上場株式	236,178
合計	236,178

その他有価証券については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであり、「(5) その他有価証券」には含めておりません。また、上記の表中にある「貸借対照表計上額」は、減損処理後の帳簿価額です。当事業年度における減損処理額は、51,557千円です。

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

(注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：千円)

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	15,484,883	-	-	-
未収委託者報酬	3,405,895	-	-	-
未収運用受託報酬	456,672	-	-	-
未収投資助言報酬	426,716	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券	3,000,000	-	-	-
その他有価証券のうち				
満期があるもの	-	-	-	-
長期差入保証金	2,289	679,475	-	-
合計	22,776,457	679,475	-	-

(追加情報)

当事業年度より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

(有価証券関係)

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	-	-	-

第25期(平成22年3月31日現在)

## 1. 満期保有目的の債券

(単位：千円)

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)貸借対照表日の時価が貸借対照表計上額を超えるもの	-	-	-
小計	-	-	-
(2)貸借対照表日の時価が貸借対照表計上額を超えないもの	2,999,185	2,999,100	85
小計	2,999,185	2,999,100	85
合計	2,999,185	2,999,100	85

## 2. 子会社株式及び関連会社株式

子会社及び関連会社株式（貸借対照表計上額 関係会社株式236,178千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

## 3. その他有価証券

(単位：千円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	2,484,337	2,253,148	231,189
小計	2,484,337	2,253,148	231,189
(2)貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	4,390,071	4,483,035	92,963
小計	4,390,071	4,483,035	92,963
合計	6,874,409	6,736,184	138,225

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

## 4. 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
1,539,393	31,117	2,724

## （デリバティブ取引関係）

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。

第25期(自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

## （退職給付関係）

第24期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	第25期 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)																						
<p>1. 採用している退職給付制度の概要 当社は、確定給付型の制度として、退職一時金制度を設けております。</p>	<p>1. 採用している退職給付制度の概要 当社は、確定給付型の制度として、退職一時金制度を設けております。</p>																						
<p>2. 退職給付債務の額 (単位：千円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 60%;">退職給付債務</td> <td style="text-align: right;">972,202</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td style="text-align: right;"><u>972,202</u></td> </tr> </table>	退職給付債務	972,202	退職給付引当金	<u>972,202</u>	<p>2. 退職給付債務の額 (単位：千円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 60%;">退職給付債務</td> <td style="text-align: right;">1,137,766</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td style="text-align: right;"><u>1,137,766</u></td> </tr> </table>	退職給付債務	1,137,766	退職給付引当金	<u>1,137,766</u>														
退職給付債務	972,202																						
退職給付引当金	<u>972,202</u>																						
退職給付債務	1,137,766																						
退職給付引当金	<u>1,137,766</u>																						
<p>3. 退職給付費用の額 (単位：千円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 60%;">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;"><u>11,409</u></td> </tr> <tr> <td>退職給付費用</td> <td style="text-align: right;"><u>262,634</u></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	<u>11,409</u>	退職給付費用	<u>262,634</u>	<p>3. 退職給付費用の額 (単位：千円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 60%;">勤務費用</td> <td style="text-align: right;">154,625</td> </tr> <tr> <td>利息費用</td> <td style="text-align: right;">14,583</td> </tr> <tr> <td>数理計算上の差異の費用処理額</td> <td style="text-align: right;">12,466</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;"><u>15,677</u></td> </tr> <tr> <td>退職給付費用</td> <td style="text-align: right;"><u>197,352</u></td> </tr> </table> <p>(注) その他は、その他の関係会社からの出向者の年金掛金負担分と退職給付引当額相当額負担分になります。</p>	勤務費用	154,625	利息費用	14,583	数理計算上の差異の費用処理額	12,466	その他	<u>15,677</u>	退職給付費用	<u>197,352</u>
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	<u>11,409</u>																						
退職給付費用	<u>262,634</u>																						
勤務費用	154,625																						
利息費用	14,583																						
数理計算上の差異の費用処理額	12,466																						
その他	<u>15,677</u>																						
退職給付費用	<u>197,352</u>																						



<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>勤務期間を基準とする方法</p> <p>割引率 1.5%</p> <p>過去勤務債務の額の処理年数</p> <p>1年（発生時において費用処理する方法）</p> <p>数理計算上の差異の処理年数</p> <p>1年（発生時において費用処理する方法）</p>	<p>4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項</p> <p>退職給付見込額の期間配分方法</p> <p>勤務期間を基準とする方法</p> <p>割引率 1.5%</p> <p>過去勤務債務の額の処理年数</p> <p>1年（発生時において費用処理する方法）</p> <p>数理計算上の差異の処理年数</p> <p>1年（発生時において費用処理する方法）</p>
---	---

## （税効果会計関係）

第24期 (平成21年3月31日現在)	第25期 (平成22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 118,748	賞与引当金 119,486
未払社会保険料 12,792	未払社会保険料 12,746
未払事業所税 6,134	未払事業税 100,639
その他 5,436	未払事業所税 6,089
繰延税金資産計 143,111	その他 5,807
評価性引当額 -	繰延税金資産計 244,770
繰延税金資産合計 143,111	評価性引当額 -
繰延税金負債	繰延税金資産合計 244,770
未収還付税金 74,316	繰延税金資産の純額 244,770
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 395,589	退職給付引当金 462,957
ソフトウェア償却 101,933	ソフトウェア償却 111,245
投資有価証券評価損 56,627	投資有価証券評価損 73,440
特定外国子会社留保金額 193,760	特定外国子会社留保金額 213,896
その他有価証券評価差額金 2,362	その他 8,735
その他 14,742	繰延税金資産計 870,274
繰延税金資産計 765,014	評価性引当額 289,785
評価性引当額 730,620	繰延税金資産合計 580,489
繰延税金資産合計 34,393	繰延税金負債
繰延税金資産の純額 34,393	その他有価証券評価差額金 55,668
	繰延税金負債合計 55,668
	繰延税金資産の純額 524,820

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

	(%)
法定実効税率	40.7
(調整)	
評価性引当額の増減	5.4
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	0.2
その他	<u>1.4</u>
税効果会計適用後の法人税等の負担率	<u>48.2</u>

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

	(%)
法定実効税率	40.7
(調整)	
評価性引当額の増減	11.6
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.2
住民税均等割等	0.1
その他	<u>0.2</u>
税効果会計適用後の法人税等の負担率	<u>29.1</u>

## ( 関連当事者情報 )

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。

第25期(自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)

## 1. 親会社及び主要株主(会社等の場合に限る。)等

( 単位 : 千円 )

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の関係会社	住友生命保険(相)	大阪府大阪市中央区	199,000,000	生命保険業	% (被所有) 直接 40	当社の主要顧客	投資助言報酬	1,125,661	未収投資助言報酬	295,911
その他の関係会社	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	% (被所有) 直接27.5	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	2,495,661	未払手数料	347,340

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

## 2. その他の関係会社の子会社等

(単位:千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金 又は基金	事業の内容 又は職業	議決権等 の所有(被 所有)割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の 関係会社 の子会社	日興コー ディアル 証券(株)	東京都 千代田区	10,000,000	証券業	% -	投信の販売委託	委託販売手数料	1,019,546	未払手数料	238,828

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## ( 1株当たり情報 )

第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)
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 96,132円19銭	1株当たり純資産額 1,513,927円30銭 1株当たり当期純利益 150,963円55銭
なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。	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いません。
( 1株当たり純資産額の算定上の基礎 ) 貸借対照表の純資産の部の合計額 24,801,038千円 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 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上の基礎 ) 貸借対照表の純資産の部の合計額 26,705,677千円 普通株式に係る純資産額 26,705,677千円 普通株式の発行済株式数 17,640株 1株当たり純資産額の算定に用いられた普通株式の数 17,640株
( 1株当たり当期純利益の算定上の基礎 ) 損益計算書上の当期純利益 1,695,771千円 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。 普通株式の期中平均株式数 17,640株	( 1株当たり当期純利益の算定上の基礎 ) 損益計算書上の当期純利益 2,662,997千円 普通株式に係る当期純利益 2,662,997千円 普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。 普通株式の期中平均株式数 17,640株

## ( 重要な後発事象 )

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。

第25期(自平成21年4月1日至平成22年3月31日)

該当事項はありません。

## 中間財務諸表

## (1)中間貸借対照表

(単位：千円)

		第26期中間会計期間末 (平成22年9月30日現在)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		16,070,989
有価証券		4,943,990
前払費用		251,072
未収委託者報酬		3,680,857
未収運用受託報酬		476,281
未収投資助言報酬		424,563
未収収益		28,359
繰延税金資産		238,094
その他		3,965
流動資産合計		26,118,172
固定資産		
有形固定資産	1	282,221
無形固定資産		5,332
投資その他の資産		
投資有価証券		4,108,176
その他		1,523,074
投資その他の資産合計		5,631,251
固定資産合計		5,918,806
資産合計		32,036,978
負債の部		
流動負債		
預り金		44,787
未払金		1,890,909

未払費用		764,737
未払法人税等		980,584
前受収益		6,563
賞与引当金		322,819
その他	2	115,673
流動負債合計		4,126,076
固定負債		
退職給付引当金		1,226,435
固定負債合計		1,226,435
負債合計		5,352,511



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	14,195,382
利益剰余金合計	16,016,587
株主資本合計	26,645,571
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	38,896
評価・換算差額等合計	38,896
純資産合計	26,684,467
負債純資産合計	32,036,978

## (2)中間損益計算書

(単位：千円)

		第26期中間会計期間 (自 平成22年 4月 1日 至 平成22年 9月30日)	
営業収益			
委託者報酬			13,415,979
運用受託報酬			1,026,282
投資助言報酬			929,636
その他の営業収益			137,538
営業収益計			15,509,437
営業費用			9,566,713
一般管理費	1		3,742,792
営業利益			2,199,930
営業外収益	2		37,736
営業外費用			659
経常利益			2,237,008
特別利益			42,823
特別損失			26,822
税引前中間純利益			2,253,008
法人税、住民税及び事業税			923,945
法人税等調整額			16,386
法人税等合計			907,558
中間純利益			1,345,450

## (3)中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

第26期中間会計期間 (自 平成22年 4月 1日 至 平成22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	14,172,932
当中間期変動額	
剰余金の配当	1,323,000
中間純利益	1,345,450

当中間期変動額合計	22,450
当中間期末残高	14,195,382
利益剰余金合計	
前期末残高	15,994,137
当中間期変動額	
剰余金の配当	1,323,000
中間純利益	1,345,450
当中間期変動額合計	22,450
当中間期末残高	16,016,587
株主資本合計	
前期末残高	26,623,121
当中間期変動額	
剰余金の配当	1,323,000
中間純利益	1,345,450
当中間期変動額合計	22,450
当中間期末残高	26,645,571

評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
前期末残高	82,556
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）	43,660
当中間期変動額合計	43,660
当中間期末残高	38,896
評価・換算差額等合計	
前期末残高	82,556
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）	43,660
当中間期変動額合計	43,660
当中間期末残高	38,896
純資産合計	
前期末残高	26,705,677
当中間期変動額	
剰余金の配当	1,323,000
中間純利益	1,345,450
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	43,660
当中間期変動額合計	21,210
当中間期末残高	26,684,467

## 中間財務諸表作成の基本となる重要な事項

## 第26期中間会計期間

(自 平成22年4月1日 至 平成22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
- ・其他有価証券

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。

## 中間財務諸表作成の基本となる重要な事項の変更

<p>第26期中間会計期間 (自平成22年4月1日 至 平成22年9月30日)</p>
<p>資産除去債務に関する会計基準</p> <p>企業会計基準第18号「資産除去債務に関する会計基準」（平成20年3月31日 企業会計基準委員会）及び企業会計基準適用指針第21号「資産除去債務に関する会計基準の適用指針」（同前）が平成22年4月1日以後開始する事業年度から適用されることになったことに伴い、当中間会計期間から同会計基準及び適用指針を適用しております。</p> <p>これによる損益の影響はありません。</p>

## 注 記 事 項

(中間貸借対照表関係)

<p>第26期中間会計期間末 (平成22年9月30日現在)</p>
<p>1.有形固定資産の減価償却累計額 908,018千円</p>
<p>2.消費税等の取扱い</p> <p>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。</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。</p> <p>当座借越極度額の総額 10,000,000千円</p> <p>借入実行残高 <u>                  -</u></p> <p>差引額 10,000,000千円</p>
<p>4. 当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York)Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成27年6月までの賃借料総額83,897千円の支払保証を行っております。</p>

(中間損益計算書関係)

<p>第26期中間会計期間 (自平成22年4月1日 至 平成22年9月30日)</p>
---



1．減価償却実施額	
有形固定資産	38,651千円
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	4,445千円
受取配当金	12,720千円
為替差益	10,801千円

## （中間株主資本等変動計算書関係）

第26期中間会計期間 （自 平成22年4月1日 至 平成22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22年6月24日 定時株主総会	普通株式	1,323,000	75,000	平成22年 3月31日	平成22年 6月25日

## （リース取引関係）

第26期中間会計期間 （自 平成22年4月1日 至 平成22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	670,670千円
1年超	1,274,557千円
合計	1,945,227千円

(金融商品関係)

## 1. 金融商品の時価等に関する事項

平成22年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次の通りです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません（（注2）参照）。

(単位：千円)

第26期中間会計期間末 (平成22年9月30日現在)			
区分	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金及び預金	16,070,989	16,070,989	-
(2) 未収委託者報酬	3,680,857	3,680,857	-
(3) 未収運用受託報酬	476,281	476,281	-
(4) 未収投資助言報酬	424,563	424,563	-
(5) 有価証券及び投資有価証券			
満期保有目的の債券	2,999,963	2,999,700	263
その他有価証券	6,003,462	6,003,462	-
(6) 投資その他の資産			
長期差入保証金	681,418	681,418	-
資産計	30,337,535	30,337,271	263
(1) 未払金			
未払手数料	1,839,602	1,839,602	-
負債計	1,839,602	1,839,602	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法及びに有価証券に関する事項

資産

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

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

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

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

(6) 投資その他の資産

長期差入保証金

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

## 負債

### (1) 未払金

#### 未払手数料

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

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：千円）

第26期中間会計期間末 （平成22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	236,178
合計	236,178
(2) その他有価証券	
非上場株式	298
投資証券	48,443
合計	48,741

その他有価証券については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであり、「(5) その他有価証券」には含めておりません。また、上記の表中にある「中間貸借対照表計上額」は、減損処理後の帳簿価額です。

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

（追加情報）

前事業年度の下期より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

（有価証券関係）

1. 満期保有目的の債券

（単位：千円）

第26期中間会計期間末 （平成22年9月30日現在）			
区分	中間貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 中間貸借対照表日の時価が中間貸借対照表計上額を超えるもの	-	-	-
小計	-	-	-

(2) 中間貸借対照表日の時価が中間貸借対照表計上額を超えないもの	2,999,963	2,999,700	263
小計	2,999,963	2,999,700	263
合計	2,999,963	2,999,700	263

## 2. 子会社株式及び関連会社株式

第26期中間会計期間末 (平成22年9月30日現在)
子会社株式及び関連会社株式(中間貸借対照表計上額 236,178千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

## 3. その他有価証券

(単位：千円)

第26期中間会計期間末 (平成22年9月30日現在)			
区分	中間貸借対照表 計上額	取得原価	差額
(1) 中間貸借対照表計上額が取得 原価を超えるもの 投資信託等	2,912,845	2,755,148	157,696
小計	2,912,845	2,755,148	157,696
(2) 中間貸借対照表計上額が取得原 価を超えないもの 投資信託等	3,090,617	3,182,865	92,248
小計	3,090,617	3,182,865	92,248
合計	6,003,462	5,938,014	65,447

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

## (デリバティブ取引関係)

第26期中間会計期間 (自平成22年4月1日至平成22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26期中間会計期間 (自平成22年4月1日至平成22年9月30日)
該当事項はありません。

## （資産除去債務等）

第26期中間会計期間 （自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日）
該当事項はありません。

## （セグメント情報等）

第26期中間会計期間 （自 平成22年4月1日 至 平成22年9月30日）					
（セグメント情報）					
<p>当社は、投資運用業及び投資助言業などの金融商品取引業を中心とする営業活動を展開しております。これらの営業活動は、金融その他の役務提供を伴っており、この役務提供と一体となった営業活動を基に収益を得ております。</p> <p>従って、当社の事業区分は、「投資・金融サービス業」という単一の事業セグメントに属しており、事業の種類別セグメント情報の記載を省略しております。</p>					
（関連情報）					
1．製品及びサービスごとの情報					
（単位：千円）					
	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への売上高	13,415,979	1,026,282	929,636	137,538	15,509,437
2．地域ごとの情報					
（1）売上高					
<p>本邦の外部顧客への売上高に区分した金額が中間損益計算書の売上高の90%を超えるため、地域ごとの売上高の記載を省略しております。</p>					
（2）有形固定資産					
<p>本邦に所在している有形固定資産の金額が中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。</p>					
3．主要な顧客ごとの情報					
<p>外部顧客への売上高のうち、中間損益計算書の売上高の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。</p>					
（追加情報）					



当中間会計期間より、企業会計基準第17号「セグメント情報等の開示に関する会計基準」(平成21年3月27日 企業会計基準委員会)及び企業会計基準適用指針第20号「セグメント情報等の開示に関する会計基準の適用指針」(平成20年3月21日 企業会計基準委員会)を適用しております。

## ( 1株当たり情報 )

第26期中間会計期間 (自平成22年4月1日至平成22年9月30日)	
1株当たり純資産額	1,512,724円91銭
1株当たり中間純利益	76,272円68銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	
(注) 1株当たり純資産額の算定上の基礎	
中間貸借対照表の純資産の部の合計額	26,684,467千円
普通株式に係る純資産額	26,684,467千円
普通株式の発行済株式数	17,640株
1株当たり純資産額の算定に用いられた普通株式の数	17,640株
1株当たり中間純利益の算定上の基礎	
中間損益計算書上の中間純利益	1,345,450千円
普通株式に係る中間純利益	1,345,450千円
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26期中間会計期間 (自平成22年4月1日至平成22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22年6月24日に開催された定時株主総会において、監査体制の一層の充実を図るため、監査役の員数を1名増員し5名以内とする定款の変更が決議されました。
- ロ 訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実  
該当ありません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

イ 受託会社

(イ) 名称 住友信託銀行株式会社

(ロ) 資本金の額 342,037百万円（平成22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22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	1,770,996百万円	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	439,000百万円	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22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22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、図案およびキャッチコピーを採用すること、ファンドの形態、申込みにかかる事項、委託会社の金融商品取引業者登録番号、当該目論見書の使用開始日などを記載することがあります。
- 2．目論見書は、目論見書の別称として「投資信託説明書」と称して使用することがあります。
- 3．目論見書に当ファンドの信託約款を掲載すること、および投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨を記載することがあります。
- 4．目論見書は、電子媒体等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．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。
- 6．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。
- 7．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」および「外国債券パッシブ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」はすべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外です。

「国内株式インデックス・マザーファンド（B号）」の状況

## （1）貸借対照表

対象年月日	（平成22年2月18日現在）	（平成23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	4,655,692,047	5,202,960,110
株式	323,683,558,850	329,832,604,130
派生商品評価勘定	10,330,900	150,306,850
未収入金	103,950	8,427,700
未収配当金	275,665,370	304,877,008
未収利息	6,377	7,127
前払金	49,850,000	-
差入委託証拠金	2,565,000	-
流動資産合計	328,677,772,494	335,499,182,925
資産合計	328,677,772,494	335,499,182,925
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	60,320,550	-
前受金	-	150,310,000
未払金	-	6,490,000
未払解約金	27,988,680	935,620,148
流動負債合計	88,309,230	1,092,420,148
負債合計	88,309,230	1,092,420,148
純資産の部		
元本等		
1 元本		
元本	282,243,743,306	261,704,374,197
2 剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	46,345,719,958	72,702,388,580
元本等合計	328,589,463,264	334,406,762,777
純資産合計	328,589,463,264	334,406,762,777
負債・純資産合計	328,677,772,494	335,499,182,925

（注）「国内株式インデックス・マザーファンド（B号）」は、毎年11月30日（ただし、休業日の場合は翌営業日）に決算を行います。上記の貸借対照表は平成22年2月18日ならびに平成23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21年2月19日 至平成22年2月18日	自平成22年2月19日 至平成23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）または金融商品取引業者等から提示 される気配相場に基づいて評価しており ます。	株式（売買目的有価証券） 同左
2. デリバティブの評価基準 及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価 しております。時価評価にあたっては、原 則として、計算日に知りうる直近の日の 主たる取引所の発表する清算値段または 最終相場によっております。	先物取引 同左
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日 において、確定配当金額または予想配当 金額を計上しております。	受取配当金の計上基準 同左

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成22年2月18日現在)	(平成23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 border="0" style="margin-left: 40px;"> <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	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 border="0" style="margin-left: 40px;"> <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;">5,827,500,000円</td> </tr> </table>	<u>担保資産</u>	<u>金額</u>	株式	5,827,500,000円
<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	5,827,500,000円									
2. 受益権総数	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	平成23年2月18日現在における受益権の 総数  261,704,374,197口								
3. 1単位当たり純資産額	1.1642円 (1万口 = 11,642円)	1.2778円 (1万口 = 12,778円)								

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）および「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

・金融商品の状況に関する事項

項目	自平成22年2月19日 至平成23年2月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。当ファンドにおけるデリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、および価格変動リスクの回避を目的としております。当計算期間については、先物取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。リスクを管理する部署では、各種リスクごとに定められた頻度で、測定項目が上下限值（リミットあるいは注意レベル）内に収まっているかどうかのモニタリングを行っております。上下限値を越えていることが発見された場合は、原則として速やかに修正を行うよう、リスク管理を行う部署から関連する運用グループには是正勧告あるいは報告が行われます。また、是正勧告あるいは報告を受けた関連運用グループでは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、リスク管理を行う部署は、上下限値に抵触した事実ならびにその後の対処結果あるいは関連運用グループの対処方針の決定に関し、必要に応じて、リスク管理を行う部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告する体制となっております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。



## 金融商品の時価等に関する事項

項目	自平成22年2月19日 至平成23年2月18日
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（株式） 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (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。
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。
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。
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。
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。
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。

## . 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。

(平成23年2月18日現在)

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 株式関連

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 (TOPIX先物) 買建	4,176,470,000	-	4,326,780,000	150,310,000
		(4,176,473,150)	(-)		(150,306,850)
	買建 合計	4,176,470,000	-	4,326,780,000	150,310,000
		(4,176,473,150)	(-)		(150,306,850)

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については以下のように評価しております。

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

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

2. 株価指数先物取引の残高は契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

なお、( )内は手数料相当額を含んだ場合の金額を表わしています。

4. 株価指数先物取引の取引市場は、東京証券取引所です。

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

（関連当事者との取引に関する注記）

（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。

（自 平成22年 2月19日 至 平成23年 2月18日）

該当事項はありません。

(その他の注記)

(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
SMAM・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
SMAM・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

(平成23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	282,243,743,306円
同期中における追加設定元本額	23,959,146,161円
同期中における一部解約元本額	44,498,515,270円
平成23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	7,703,700,039円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	315,275,270円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	1,694,896,178円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	1,150,141,434円
スミセイ・DCバランスファンド（機動的資産配分型）	20,769,888円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	3,921,370円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	1,616,914円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	3,940,713円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	1,668,411円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	793,328円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	1,998,105円
国内株式指数ファンド（TOPIX）	308,411,752円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	66,595,252,003円
バランスファンドVA（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	769,490,549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＞	47,326,197,901円
SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	15,950,535,566円
SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	7,478,200,342円
SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	25,673,704,919円
SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	168,991,356円
SMAM・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	540,669,398円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	99,308,048円
SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	2,455,472,245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＞	118,783,079円
SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	1,009,666,970円
SMAM・インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞	3,265,044,425円
SMAM・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	4,573,618,771円
SMAM・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	10,853,609,614円
SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	1,257,331,564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）	10,101,230,750円
SMAM・グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	214,488,125円
SMAM・バランスファンドVA20＜適格機関投資家専用＞	2,695,777,135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）	42,332,004,092円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A＜適格機関投資家専用＞	296,208,317円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A＜適格機関投資家専用＞	147,638,885円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A＜適格機関投資家専用＞	57,521,732円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L＜適格機関投資家専用＞	832,950,919円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L＜適格機関投資家専用＞	1,431,172,633円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T＜適格機関投資家専用＞	542,331,970円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2＜適格機関投資家専用＞	272,152,694円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2＜適格機関投資家専用＞	116,049,678円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2＜適格機関投資家専用＞	24,180,537円

SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	208,839,366円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	2,390,657,838円
SMAM・国内株式インデックスファンド・VA(適格機関投資家専用)	577,488,022円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	120,671,352円
合計	261,704,374,197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	109,000	192	20,928,000	
日本水産	333,700	281	93,769,700	
マルハニチロホールディングス	553,000	154	85,162,000	
サカタのタネ	40,600	1,248	50,668,800	
ホクト	29,300	1,908	55,904,400	
住石ホールディングス	92,600	84	7,778,400	
日鉄鉱業	72,000	452	32,544,000	
三井松島産業	174,000	176	30,624,000	
国際石油開発帝石	2,868	587,000	1,683,516,000	
日本海洋掘削	7,800	3,600	28,080,000	
関東天然瓦斯開発	22,000	470	10,340,000	
石油資源開発	43,700	3,900	170,430,000	
ショーボンドホールディングス	24,100	1,772	42,705,200	
ミライト・ホールディングス	71,800	619	44,444,200	
ダイセキ環境ソリューション	24	83,400	2,001,600	
間組	140,300	71	9,961,300	
東急建設	114,300	248	28,346,400	
コムシスホールディングス	137,500	845	116,187,500	
ミサワホーム	39,300	407	15,995,100	
高松コンストラクショングループ	21,800	1,163	25,353,400	
東建コーポレーション	10,040	3,280	32,931,200	
ヤマウラ	16,000	209	3,344,000	
大成建設	1,353,000	192	259,776,000	
大林組	858,000	370	317,460,000	
清水建設	811,000	346	280,606,000	
長谷工コーポレーション	1,812,000	78	141,336,000	
松井建設	37,000	314	11,618,000	
鹿島建設	1,259,000	220	276,980,000	
鉄建建設	210,000	88	18,480,000	
安藤建設	119,000	113	13,447,000	
太平工業	62,000	386	23,932,000	
西松建設	391,000	112	43,792,000	
三井住友建設	204,600	68	13,912,800	
大豊建設	115,000	86	9,890,000	



前田建設工業	184,000	261	48,024,000	
ナカノフドー建設	28,000	213	5,964,000	
奥村組	272,000	318	86,496,000	
大和小田急建設	22,000	228	5,016,000	
東鉄工業	35,000	674	23,590,000	
イチケン	50,000	117	5,850,000	
戸田建設	307,000	318	97,626,000	
青木あすなる建設	25,000	403	10,075,000	
北野建設	72,000	209	15,048,000	
植木組	49,000	137	6,713,000	
三井ホーム	34,000	486	16,524,000	
矢作建設工業	41,100	507	20,837,700	
ピーエス三菱	27,800	260	7,228,000	
大東建託	110,700	6,940	768,258,000	
新日本建設	44,900	242	10,865,800	
N I P P O	67,000	588	39,396,000	
東亜道路工業	76,000	135	10,260,000	
前田道路	82,000	706	57,892,000	
日本道路	96,000	225	21,600,000	
東亜建設工業	254,000	109	27,686,000	
五洋建設	353,000	147	51,891,000	
大林道路	48,000	171	8,208,000	
福田組	57,000	166	9,462,000	
住友林業	197,100	730	143,883,000	
日本基礎技術	45,000	241	10,845,000	
巴コーポレーション	49,400	253	12,498,200	
パナホーム	93,000	552	51,336,000	
大和ハウス工業	707,000	1,041	735,987,000	
ライト工業	69,200	228	15,777,600	
積水ハウス	853,000	829	707,137,000	
北陸電気工事	17,000	238	4,046,000	
ユアテック	46,000	350	16,100,000	
西部電気工業	18,000	375	6,750,000	
四電工	22,000	375	8,250,000	
中電工	38,700	1,090	42,183,000	
関電工	128,000	518	66,304,000	
きんでん	185,000	767	141,895,000	
東京エネシス	32,000	578	18,496,000	
トーエネック	37,000	469	17,353,000	
住友電設	17,100	347	5,933,700	
日本電設工業	50,000	794	39,700,000	
協和エクシオ	100,600	766	77,059,600	
新日本空調	20,200	479	9,675,800	
日本電話施設	49,000	264	12,936,000	
九電工	50,000	545	27,250,000	
三機工業	67,000	543	36,381,000	

日揮	284,000	1,941	551,244,000
中外炉工業	100,000	375	37,500,000
ヤマト	31,000	302	9,362,000
太平電業	37,000	682	25,234,000
高砂熱学工業	79,900	708	56,569,200
三晃金属工業	48,000	178	8,544,000
N E C ネットズエスアイ	23,000	1,134	26,082,000
朝日工業社	36,000	387	13,932,000
大気社	45,100	1,528	68,912,800
ダイダン	39,000	458	17,862,000
日比谷総合設備	36,300	779	28,277,700
東芝プラントシステム	47,000	1,119	52,593,000
東洋エンジニアリング	174,000	337	58,638,000
千代田化工建設	187,000	755	141,185,000
新興ブランテック	55,000	875	48,125,000
日本製粉	155,000	409	63,395,000
日清製粉グループ本社	253,000	1,070	270,710,000
日東富士製粉	19,000	326	6,194,000
昭和産業	117,000	254	29,718,000
鳥越製粉	22,800	736	16,780,800
協同飼料	127,000	109	13,843,000
中部飼料	27,900	611	17,046,900
日本配合飼料	108,000	116	12,528,000
東洋精糖	64,000	125	8,000,000
日本甜菜製糖	163,000	215	35,045,000
三井製糖	119,000	358	42,602,000
森永製菓	273,000	202	55,146,000
中村屋	70,000	412	28,840,000
江崎グリコ	102,000	955	97,410,000
名糖産業	12,200	1,119	13,651,800
不二家	170,000	157	26,690,000
山崎製パン	206,000	955	196,730,000
第一屋製パン	66,000	97	6,402,000
モロゾフ	43,000	269	11,567,000
森永乳業	239,000	343	81,977,000
ヤクルト本社	152,200	2,348	357,365,600
明治ホールディングス	82,700	3,795	313,846,500
雪印メグミルク	55,600	1,489	82,788,400
プリマハム	179,000	113	20,227,000
日本ハム	196,000	1,161	227,556,000
伊藤ハム	160,000	317	50,720,000
林兼産業	115,000	93	10,695,000
丸大食品	121,000	275	33,275,000
米久	26,000	732	19,032,000
S F o o d s	14,000	771	10,794,000
サッポロホールディングス	409,000	382	156,238,000

アサヒビール	528,700	1,581	835,874,700
キリンホールディングス	1,137,000	1,176	1,337,112,000
宝ホールディングス	240,000	488	117,120,000
オエノンホールディングス	86,000	205	17,630,000
養命酒製造	21,000	802	16,842,000
三国コカ・コーラボトリング	29,200	746	21,783,200
コカ・コーラウエスト	87,400	1,519	132,760,600
コカ・コーラ セントラル ジャパン	29,900	1,121	33,517,900
ダイトードリンコ	12,300	3,335	41,020,500
伊藤園	87,200	1,436	125,219,200
キーコーヒー	21,700	1,505	32,658,500
ジャパンフーズ	4,000	838	3,352,000
日清オイリオグループ	128,000	441	56,448,000
不二製油	69,800	1,200	83,760,000
J - オイルミルズ	116,000	274	31,784,000
キッコーマン	230,000	912	209,760,000
味の素	769,000	930	715,170,000
キューピー	142,100	1,020	144,942,000
ハウス食品	98,700	1,377	135,909,900
カゴメ	100,600	1,534	154,320,400
焼津水産化学工業	11,600	879	10,196,400
アリアケジャパン	24,800	1,461	36,232,800
ニチレイ	316,000	383	121,028,000
東洋水産	123,000	1,841	226,443,000
日清食品ホールディングス	101,100	2,937	296,930,700
永谷園	21,000	878	18,438,000
フジッコ	27,000	1,032	27,864,000
ロック・フィールド	14,400	1,340	19,296,000
日本たばこ産業	5,885	346,000	2,036,210,000
わらべや日洋	17,000	1,059	18,003,000
なとり	7,800	857	6,684,600
ミヨシ油脂	112,000	137	15,344,000
片倉工業	30,600	809	24,755,400
グンゼ	181,000	362	65,522,000
東洋紡績	940,000	150	141,000,000
ユニチカ	601,000	80	48,080,000
富士紡ホールディングス	133,000	169	22,477,000
日清紡ホールディングス	166,000	904	150,064,000
倉敷紡績	260,000	162	42,120,000
シキボウ	180,000	112	20,160,000
日本毛織	91,000	740	67,340,000
トーア紡コーポレーション	115,000	75	8,625,000
ダイトーリミテッド	32,400	802	25,984,800
帝国繊維	25,000	526	13,150,000
帝人	1,008,000	404	407,232,000
東レ	2,051,000	617	1,265,467,000

サカイオーベックス	95,000	130	12,350,000	
住江織物	78,000	237	18,486,000	
日本フェルト	10,200	442	4,508,400	
イチカワ	22,000	175	3,850,000	
日本バイリーン	30,000	449	13,470,000	
日東製網	47,000	104	4,888,000	
芦森工業	82,000	135	11,070,000	
アツギ	238,000	113	26,894,000	
ダイニック	62,000	184	11,408,000	
セーレン	68,300	628	42,892,400	
東海染工	51,000	92	4,692,000	
小松精練	32,000	371	11,872,000	
ワコールホールディングス	154,000	1,129	173,866,000	
ホギメディカル	14,100	3,810	53,721,000	
サンエー・インターナショナル	13,300	1,048	13,938,400	
レナウン	47,500	217	10,307,500	
クラウドディア	2,800	1,291	3,614,800	
三陽商会	133,000	311	41,363,000	
オンワードホールディングス	178,000	770	137,060,000	
ルック	13,000	148	1,924,000	
ゴールドウイン	70,000	315	22,050,000	
東京スタイル	95,000	641	60,895,000	
デサント	62,000	438	27,156,000	
ヤマトインターナショナル	12,600	413	5,203,800	
特種東海製紙	176,000	200	35,200,000	
王子製紙	1,164,000	409	476,076,000	
三菱製紙	395,000	104	41,080,000	
北越紀州製紙	160,000	481	76,960,000	
中越バルブ工業	111,000	160	17,760,000	
巴川製紙所	55,000	288	15,840,000	
大王製紙	108,000	591	63,828,000	
日本製紙グループ本社	127,500	2,236	285,090,000	
レンゴー	210,000	564	118,440,000	
トーモク	86,000	268	23,048,000	
ザ・パック	17,600	1,432	25,203,200	
クラレ	389,000	1,162	452,018,000	
旭化成	1,535,000	582	893,370,000	
共和レザー	13,400	331	4,435,400	
コープケミカル	57,000	125	7,125,000	
昭和電工	1,759,000	181	318,379,000	
住友化学	1,820,000	467	849,940,000	
日本化成	64,000	215	13,760,000	
住友精化	54,000	426	23,004,000	
日産化学工業	190,800	1,010	192,708,000	
クレハ	170,000	473	80,410,000	
テイカ	46,000	358	16,468,000	

石原産業	456,000	117	53,352,000	
片倉チッカリン	18,000	270	4,860,000	
日本曹達	159,000	447	71,073,000	
東ソー	663,000	304	201,552,000	
トクヤマ	414,000	441	182,574,000	
セントラル硝子	255,000	390	99,450,000	
東亜合成	270,000	422	113,940,000	
ダイソー	104,000	297	30,888,000	
関東電化工業	59,000	688	40,592,000	
電気化学工業	555,000	429	238,095,000	
信越化学工業	440,200	4,845	2,132,769,000	
日本カーバイド工業	74,000	262	19,388,000	
堺化学工業	85,000	496	42,160,000	
エア・ウォーター	212,000	1,105	234,260,000	
大陽日酸	346,000	749	259,154,000	
日本化学工業	103,000	232	23,896,000	
日本パーライジング	63,000	1,345	84,735,000	
高圧ガス工業	32,000	544	17,408,000	
チタン工業	33,000	542	17,886,000	
四国化成工業	38,000	511	19,418,000	
戸田工業	41,000	847	34,727,000	
ステラ ケミファ	11,900	3,745	44,565,500	
保土谷化学工業	58,000	371	21,518,000	
日本触媒	217,000	978	212,226,000	
大日精化工業	98,000	485	47,530,000	
カネカ	330,000	613	202,290,000	
三菱瓦斯化学	419,000	651	272,769,000	
三井化学	1,205,000	327	394,035,000	
J S R	220,600	1,831	403,918,600	
東京応化工業	47,400	1,920	91,008,000	
三菱ケミカルホールディングス	1,533,000	641	982,653,000	
日本合成化学工業	63,000	584	36,792,000	
ダイセル化学工業	344,000	578	198,832,000	
住友ベークライト	248,000	558	138,384,000	
積水化学工業	549,000	648	355,752,000	
日本ゼオン	246,000	834	205,164,000	
アイカ工業	76,500	1,036	79,254,000	
宇部興産	1,113,000	272	302,736,000	
積水樹脂	35,000	837	29,295,000	
タキロン	65,000	329	21,385,000	
旭有機材工業	92,000	247	22,724,000	
日立化成工業	114,300	1,986	226,999,800	
ニチバン	21,000	324	6,804,000	
リケンテクノス	46,000	321	14,766,000	
大倉工業	71,000	293	20,803,000	
積水化成品工業	60,000	373	22,380,000	

群栄化学工業	77,000	257	19,789,000
タイガースポリマー	16,400	411	6,740,400
日本カーリット	22,800	510	11,628,000
日本化薬	183,000	867	158,661,000
日本精化	21,600	561	12,117,600
A D E K A	106,000	945	100,170,000
日油	230,000	422	97,060,000
ハリマ化成	24,200	623	15,076,600
花王	720,300	2,251	1,621,395,300
第一工業製薬	44,000	331	14,564,000
三洋化成工業	73,000	723	52,779,000
大日本塗料	167,000	124	20,708,000
日本ペイント	226,000	633	143,058,000
関西ペイント	299,000	813	243,087,000
中国塗料	70,000	760	53,200,000
日本特殊塗料	24,600	421	10,356,600
藤倉化成	34,800	657	22,863,600
太陽ホールディングス	19,000	2,714	51,566,000
D I C	1,016,000	213	216,408,000
サカティンクス	48,000	441	21,168,000
東洋インキ製造	237,000	435	103,095,000
富士フイルムホールディングス	565,100	2,982	1,685,128,200
資生堂	439,400	1,712	752,252,800
ライオン	300,000	447	134,100,000
高砂香料工業	87,000	505	43,935,000
マンダム	26,000	2,181	56,706,000
ミルボン	14,000	2,195	30,730,000
ファンケル	51,200	1,210	61,952,000
コーセー	47,500	2,216	105,260,000
ドクターシーラボ	171	306,500	52,411,500
ポーラ・オルビスホールディングス	23,200	1,748	40,553,600
エステー	14,400	987	14,212,800
コニシ	20,700	1,102	22,811,400
長谷川香料	32,700	1,411	46,139,700
小林製薬	36,200	3,875	140,275,000
荒川化学工業	18,900	888	16,783,200
メック	17,900	473	8,466,700
日本高純度化学	79	268,000	21,172,000
荏原ユージライト	4,500	2,488	11,196,000
アース製薬	16,400	2,777	45,542,800
イハラケミカル工業	53,000	324	17,172,000
北興化学工業	26,000	315	8,190,000
大成ラミック	5,700	2,492	14,204,400
クミアイ化学工業	56,000	314	17,584,000
日本農薬	53,000	476	25,228,000
アキレス	223,000	129	28,767,000

有沢製作所	44,200	500	22,100,000	
日東電工	217,900	5,160	1,124,364,000	
レック	8,100	1,578	12,781,800	
アロン化成	18,000	515	9,270,000	
きもと	25,800	806	20,794,800	
藤森工業	20,100	1,375	27,637,500	
前澤化成工業	18,200	800	14,560,000	
J S P	17,100	1,482	25,342,200	
エフピコ	13,000	4,950	64,350,000	
天馬	21,300	886	18,871,800	
信越ポリマー	53,500	540	28,890,000	
東リ	74,000	164	12,136,000	
ニフコ	50,800	2,339	118,821,200	
日本バルカー工業	121,000	268	32,428,000	
ユニ・チャーム	145,100	3,220	467,222,000	
協和発酵キリン	313,000	863	270,119,000	
武田薬品工業	990,300	4,100	4,060,230,000	
アステラス製薬	586,900	3,310	1,942,639,000	
大日本住友製薬	186,400	810	150,984,000	
塩野義製薬	385,900	1,632	629,788,800	
田辺三菱製薬	218,900	1,417	310,181,300	
わかもと製薬	33,000	263	8,679,000	
あすか製薬	35,000	639	22,365,000	
日本新薬	61,000	1,115	68,015,000	
中外製薬	261,900	1,623	425,063,700	
科研製薬	111,000	1,064	118,104,000	
エーザイ	325,900	3,055	995,624,500	
ロート製薬	120,000	981	117,720,000	
小野薬品工業	131,900	4,205	554,639,500	
久光製薬	74,400	3,310	246,264,000	
有機合成薬品工業	24,000	238	5,712,000	
持田製薬	104,000	980	101,920,000	
大正製薬	212,000	1,858	393,896,000	
参天製薬	81,800	3,110	254,398,000	
扶桑薬品工業	89,000	253	22,517,000	
日本ケミファ	49,000	295	14,455,000	
ツムラ	73,600	2,699	198,646,400	
日医工	25,000	2,279	56,975,000	
キッセイ薬品工業	53,600	1,675	89,780,000	
生化学工業	49,400	965	47,671,000	
栄研化学	21,500	1,116	23,994,000	
日水製薬	8,400	733	6,157,200	
鳥居薬品	17,900	1,760	31,504,000	
東和薬品	13,700	4,535	62,129,500	
沢井製薬	17,400	7,320	127,368,000	
ゼリア新薬工業	37,000	1,013	37,481,000	

第一三共	889,400	1,867	1,660,509,800
キョーリン製薬ホールディングス	70,000	1,538	107,660,000
大幸薬品	10,600	1,027	10,886,200
大塚ホールディングス	459,000	2,013	923,967,000
昭和シェル石油	233,600	725	169,360,000
コスモ石油	727,000	297	215,919,000
ニチレキ	34,000	345	11,730,000
東燃ゼネラル石油	398,000	942	374,916,000
ユシロ化学工業	12,800	1,406	17,996,800
ビーピー・カストロール	11,300	355	4,011,500
AOCホールディングス	69,900	567	39,633,300
出光興産	31,400	9,740	305,836,000
JXホールディングス	2,936,500	575	1,688,487,500
横浜ゴム	293,000	426	124,818,000
東洋ゴム工業	228,000	216	49,248,000
ブリヂストン	828,100	1,663	1,377,130,300
住友ゴム工業	186,300	907	168,974,100
藤倉ゴム工業	13,200	409	5,398,800
オカモト	98,000	340	33,320,000
フコク	10,000	968	9,680,000
ニッタ	24,800	1,642	40,721,600
東海ゴム工業	40,600	1,175	47,705,000
三ツ星ベルト	71,000	523	37,133,000
バンドー化学	94,000	408	38,352,000
日東紡績	218,000	259	56,462,000
旭硝子	1,302,000	1,131	1,472,562,000
日本板硝子	1,137,000	236	268,332,000
石塚硝子	41,000	176	7,216,000
日本山村硝子	112,000	254	28,448,000
日本電気硝子	546,000	1,327	724,542,000
オハラ	11,600	1,105	12,818,000
住友大阪セメント	511,000	223	113,953,000
太平洋セメント	1,124,000	126	141,624,000
デイ・シイ	24,900	163	4,058,700
日本ヒューム	6,000	302	1,812,000
日本コンクリート工業	43,000	168	7,224,000
東海カーボン	247,000	493	121,771,000
日本カーボン	138,000	252	34,776,000
東洋炭素	14,300	4,600	65,780,000
ノリタケカンパニーリミテド	137,000	341	46,717,000
TOTO	376,000	657	247,032,000
日本碍子	317,000	1,505	477,085,000
日本特殊陶業	235,000	1,255	294,925,000
MARUWA	6,600	2,820	18,612,000
品川リフラクトリーズ	74,000	298	22,052,000
黒崎播磨	57,000	388	22,116,000



東京窯業	30,000	224	6,720,000	
ニッカトー	10,600	456	4,833,600	
フジインコーポレーテッド	24,000	1,306	31,344,000	
ニチアス	129,000	519	66,951,000	
ニチハ	27,500	827	22,742,500	
新日本製鐵	6,931,000	305	2,113,955,000	
住友金属工業	4,899,000	212	1,038,588,000	
神戸製鋼所	3,668,000	234	858,312,000	
日新製鋼	1,024,000	178	182,272,000	
中山製鋼所	160,000	116	18,560,000	
合同製鐵	164,000	182	29,848,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	625,900	2,728	1,707,455,200	
東京製鐵	147,600	922	136,087,200	
共英製鋼	29,800	1,424	42,435,200	
大和工業	60,000	2,731	163,860,000	
東京鐵鋼	60,000	269	16,140,000	
大阪製鐵	15,700	1,450	22,765,000	
淀川製鋼所	201,000	366	73,566,000	
東洋鋼鈑	65,000	528	34,320,000	
住友鋼管	16,300	705	11,491,500	
丸一鋼管	87,600	1,887	165,301,200	
モリ工業	49,000	420	20,580,000	
大同特殊鋼	446,000	569	253,774,000	
日本高周波鋼業	131,000	116	15,196,000	
日本金属工業	51,000	109	5,559,000	
日本冶金工業	71,500	244	17,446,000	
山陽特殊製鋼	136,000	558	75,888,000	
愛知製鋼	142,000	616	87,472,000	
日立金属	173,000	1,143	197,739,000	
日本金属	85,000	178	15,130,000	
大平洋金属	182,000	783	142,506,000	
日本電工	108,000	606	65,448,000	
栗本鐵工所	155,000	125	19,375,000	
日本鑄鐵管	45,000	131	5,895,000	
三菱製鋼	172,000	328	56,416,000	
日亜鋼業	38,000	234	8,892,000	
日本精線	24,000	508	12,192,000	
シンニッタン	31,800	453	14,405,400	
新家工業	70,000	132	9,240,000	
日本輕金属	610,000	180	109,800,000	
大紀アルミニウム工業所	44,000	287	12,628,000	
三井金属鋳業	765,000	330	252,450,000	
東邦亜鉛	148,000	467	69,116,000	
三菱マテリアル	1,648,000	302	497,696,000	
住友金属鋳山	729,000	1,576	1,148,904,000	
DOWAホールディングス	315,000	601	189,315,000	

古河機械金属	471,000	99	46,629,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	29,500	6,270	184,965,000	
東邦チタニウム	44,800	2,660	119,168,000	
住友軽金属工業	295,000	111	32,745,000	
古河スカイ	116,000	258	29,928,000	
古河電気工業	837,000	369	308,853,000	
住友電気工業	932,400	1,245	1,160,838,000	
フジクラ	396,000	438	173,448,000	
昭和電線ホールディングス	341,000	96	32,736,000	
タツタ電線	43,000	386	16,598,000	
日立電線	203,000	242	49,126,000	
沖電線	51,000	157	8,007,000	
カナレ電気	700	1,223	856,100	
平河ヒューテック	4,900	747	3,660,300	
リョービ	153,000	368	56,304,000	
アサヒホールディングス	37,100	1,789	66,371,900	
稲葉製作所	9,700	861	8,351,700	
宮地エンジニアリンググループ	67,000	93	6,231,000	
三協・立山ホールディングス	330,000	118	38,940,000	
トーカロ	15,700	1,592	24,994,400	
アルファC o	9,600	1,064	10,214,400	
SUMCO	162,700	1,537	250,069,900	
川田テクノロジーズ	6,600	1,567	10,342,200	
東洋製罐	185,800	1,568	291,334,400	
ホッカンホールディングス	56,000	299	16,744,000	
コロナ	14,000	903	12,642,000	
横河ブリッジホールディングス	48,000	513	24,624,000	
駒井ハルテック	58,000	227	13,166,000	
高田機工	25,000	208	5,200,000	
三和ホールディングス	270,000	293	79,110,000	
文化シャッター	76,000	220	16,720,000	
住生活グループ	318,900	1,928	614,839,200	
日本フィルコン	24,200	421	10,188,200	
ノーリツ	49,000	1,416	69,384,000	
長府製作所	24,200	1,944	47,044,800	
リンナイ	41,900	4,960	207,824,000	
ダイニチ工業	12,100	597	7,223,700	
日東精工	43,000	279	11,997,000	
三洋工業	47,000	113	5,311,000	
岡部	52,900	415	21,953,500	
中国工業	63,000	96	6,048,000	
東プレ	52,500	724	38,010,000	
高周波熱練	36,000	757	27,252,000	
東京製網	192,000	291	55,872,000	
パイオラックス	10,900	2,167	23,620,300	
日本発條	191,000	1,001	191,191,000	

中央発條	38,000	373	14,174,000	
三益半導体工業	21,800	1,030	22,454,000	
アタカ大機	18,000	313	5,634,000	
日本製鋼所	407,000	877	356,939,000	
日立ツール	17,500	954	16,695,000	
三浦工業	41,400	2,307	95,509,800	
タクマ	105,000	266	27,930,000	
ツガミ	76,000	601	45,676,000	
オークマ	175,000	784	137,200,000	
東芝機械	161,000	500	80,500,000	
アマダ	372,000	731	271,932,000	
アイダエンジニアリング	75,300	451	33,960,300	
牧野フライス製作所	123,000	763	93,849,000	
オーエスジー	117,700	1,197	140,886,900	
ダイジェット工業	25,000	142	3,550,000	
旭ダイヤモンド工業	56,000	1,559	87,304,000	
森精機製作所	142,300	1,071	152,403,300	
ディスコ	26,900	5,970	160,593,000	
日東工器	14,800	2,122	31,405,600	
豊和工業	157,000	87	13,659,000	
大阪機工	109,000	126	13,734,000	
オーエム製作所	25,000	536	13,400,000	
津田駒工業	63,000	230	14,490,000	
島精機製作所	34,800	1,977	68,799,600	
日阪製作所	33,000	1,194	39,402,000	
やまびこ	12,000	1,071	12,852,000	
ペガサスミシン製造	30,200	270	8,154,000	
ナブテスコ	99,800	1,980	197,604,000	
三井海洋開発	22,700	1,500	34,050,000	
レオン自動機	24,000	210	5,040,000	
S M C	78,800	14,500	1,142,600,000	
新川	21,800	904	19,707,200	
ホソカワミクロン	45,000	400	18,000,000	
ユニオンツール	16,200	2,075	33,615,000	
オイレス工業	26,800	1,630	43,684,000	
サトー	24,900	1,068	26,593,200	
日本エアーテック	10,100	413	4,171,300	
日精樹脂工業	26,900	304	8,177,600	
ワイエイシイ	10,500	685	7,192,500	
小松製作所	1,251,900	2,561	3,206,115,900	
住友重機械工業	675,000	591	398,925,000	
日立建機	118,000	2,104	248,272,000	
日工	38,000	285	10,830,000	
巴工業	9,200	1,413	12,999,600	
井関農機	276,000	229	63,204,000	
T O W A	25,700	739	18,992,300	

丸山製作所	58,000	191	11,078,000	
北川鉄工所	135,000	172	23,220,000	
クボタ	1,108,000	881	976,148,000	
荏原実業	6,800	1,207	8,207,600	
三菱化工機	82,000	193	15,826,000	
月島機械	40,000	754	30,160,000	
帝国電機製作所	9,000	1,895	17,055,000	
新東工業	54,700	881	48,190,700	
澁谷工業	15,600	815	12,714,000	
アイチ コーポレーション	42,400	378	16,027,200	
小森コーポレーション	71,200	864	61,516,800	
鶴見製作所	19,000	610	11,590,000	
住友精密工業	47,000	618	29,046,000	
酒井重工業	58,000	162	9,396,000	
荏原製作所	468,000	480	224,640,000	
石井鐵工所	43,000	172	7,396,000	
西島製作所	30,000	1,595	47,850,000	
ダイキン工業	275,600	2,812	774,987,200	
オルガノ	44,000	645	28,380,000	
トーヨーカネツ	150,000	154	23,100,000	
栗田工業	144,600	2,442	353,113,200	
椿本チエイン	137,000	491	67,267,000	
大同工業	64,000	212	13,568,000	
日本コンベヤ	82,000	86	7,052,000	
木村化工機	27,100	648	17,560,800	
アネスト岩田	48,000	397	19,056,000	
ダイフク	109,500	649	71,065,500	
加藤製作所	64,000	220	14,080,000	
油研工業	42,000	183	7,686,000	
タダノ	111,000	449	49,839,000	
フジテック	74,000	447	33,078,000	
シーケーディ	73,000	938	68,474,000	
キトー	77	103,900	8,000,300	
平和	55,300	1,435	79,355,500	
理想科学工業	21,300	1,496	31,864,800	
SANKYO	75,800	4,810	364,598,000	
日本金銭機械	25,400	707	17,957,800	
マースエンジニアリング	13,100	1,523	19,951,300	
福島工業	8,000	1,074	8,592,000	
オーイズミ	13,000	355	4,615,000	
ダイコク電機	10,100	1,039	10,493,900	
アマノ	68,800	798	54,902,400	
JUKI	50,000	178	8,900,000	
サンデン	148,000	389	57,572,000	
蛇の目ミシン工業	220,000	80	17,600,000	
マックス	43,000	1,060	45,580,000	

グローリー	69,300	1,968	136,382,400
大和冷機工業	34,000	426	14,484,000
セガサミーホールディングス	250,500	1,867	467,683,500
日本ピストンリング	110,000	244	26,840,000
リケン	102,000	428	43,656,000
帝国ピストンリング	33,200	945	31,374,000
ホシザキ電機	49,900	1,551	77,394,900
大豊工業	18,900	919	17,369,100
日本精工	559,000	811	453,349,000
N T N	582,000	453	263,646,000
ジェイテクト	266,800	1,214	323,895,200
不二越	258,000	427	110,166,000
日本トムソン	89,000	710	63,190,000
T H K	168,600	2,194	369,908,400
ユーシン精機	13,500	1,711	23,098,500
前澤給装工業	6,800	1,074	7,303,200
イーグル工業	32,000	1,073	34,336,000
日本ピラー工業	29,000	808	23,432,000
キッツ	104,300	390	40,677,000
日立工機	67,800	840	56,952,000
マキタ	164,300	3,610	593,123,000
日立造船	1,062,000	128	135,936,000
三菱重工業	4,229,000	354	1,497,066,000
I H I	1,729,000	220	380,380,000
イビデン	154,300	2,856	440,680,800
コニカミノルタホールディングス	668,000	779	520,372,000
ブラザー工業	324,900	1,332	432,766,800
ミネベア	376,000	507	190,632,000
日立製作所	5,665,000	503	2,849,495,000
東芝	4,986,000	538	2,682,468,000
三菱電機	2,524,000	983	2,481,092,000
富士電機ホールディングス	769,000	280	215,320,000
東洋電機製造	42,000	491	20,622,000
安川電機	280,000	982	274,960,000
シンフォニアテクノロジー	162,000	280	45,360,000
明電舎	252,000	378	95,256,000
オリジン電気	36,000	552	19,872,000
デンヨー	26,100	717	18,713,700
東芝テック	155,000	415	64,325,000
芝浦メカトロニクス	50,000	334	16,700,000
マブチモーター	35,600	4,210	149,876,000
日本電産	125,300	7,990	1,001,147,000
高岳製作所	106,000	474	50,244,000
ダイヘン	141,000	380	53,580,000
日新電機	44,000	600	26,400,000
大崎電気工業	40,000	800	32,000,000

オムロン	281,000	2,286	642,366,000	
日東工業	40,100	979	39,257,900	
I D E C	33,200	800	26,560,000	
エルピーダメモリ	211,500	1,286	271,989,000	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	491,000	607	298,037,000	
サクサホールディングス	74,000	163	12,062,000	
メルコホールディングス	14,400	3,250	46,800,000	
テクノメディカ	20	296,600	5,932,000	
日本電気	3,268,000	242	790,856,000	
富士通	2,433,000	550	1,338,150,000	
沖電気工業	949,000	70	66,430,000	
岩崎通信機	120,000	72	8,640,000	
電気興業	77,000	397	30,569,000	
サンケン電気	148,000	556	82,288,000	
ナカヨ通信機	26,000	217	5,642,000	
アイホン	17,000	1,326	22,542,000	
ルネサスエレクトロニクス	67,200	993	66,729,600	
セイコーエプソン	172,000	1,378	237,016,000	
ワコム	519	130,500	67,729,500	
アルバック	47,400	2,011	95,321,400	
アクセル	9,800	2,290	22,442,000	
ナナオ	21,600	2,045	44,172,000	
日本信号	60,200	672	40,454,400	
京三製作所	52,000	461	23,972,000	
能美防災	30,000	562	16,860,000	
ホーチキ	19,000	435	8,265,000	
マスプロ電工	15,600	829	12,932,400	
日本無線	78,000	246	19,188,000	
パナソニック	2,500,400	1,127	2,817,950,800	
シャープ	1,132,000	927	1,049,364,000	
アンリツ	114,000	785	89,490,000	
富士通ゼネラル	62,000	487	30,194,000	
日立国際電気	60,000	788	47,280,000	
ソニー	1,417,200	3,015	4,272,858,000	
T D K	142,100	5,800	824,180,000	
帝国通信工業	57,000	206	11,742,000	
三洋電機	1,804,000	128	230,912,000	
宮越商事	12,000	328	3,936,000	
ミツミ電機	88,200	1,462	128,948,400	
タムラ製作所	82,000	266	21,812,000	
アルプス電気	200,800	1,118	224,494,400	
バイオニア	364,800	440	160,512,000	
日本電波工業	20,800	1,654	34,403,200	
日本トリム	2,750	1,813	4,985,750	
ローランド ディー . ジー .	12,500	1,335	16,687,500	
フォスター電機	24,400	2,347	57,266,800	

クラリオン	30,000	182	5,460,000	
S M K	78,000	460	35,880,000	
ヨコオ	24,100	690	16,629,000	
東光	121,000	206	24,926,000	
ホシデン	63,000	958	60,354,000	
ヒロセ電機	40,500	9,290	376,245,000	
日本航空電子工業	60,000	686	41,160,000	
T O A	29,000	483	14,007,000	
ユニデン	81,000	294	23,814,000	
アルパイン	50,100	1,181	59,168,100	
スミダコーポレーション	16,100	1,060	17,066,000	
アイコム	14,300	2,341	33,476,300	
船井電機	23,400	2,701	63,203,400	
横河電機	254,700	640	163,008,000	
新電元工業	96,000	467	44,832,000	
山武	70,200	2,129	149,455,800	
日本光電工業	46,500	1,837	85,420,500	
チノー	57,000	228	12,996,000	
共和電業	29,000	272	7,888,000	
日本電子材料	13,300	618	8,219,400	
堀場製作所	43,300	2,681	116,087,300	
アドバンテスト	173,300	1,747	302,755,100	
小野測器	32,000	274	8,768,000	
エスベック	26,400	745	19,668,000	
パナソニック電工 S U N X	27,800	490	13,622,000	
キーエンス	56,300	22,510	1,267,313,000	
日置電機	12,500	1,691	21,137,500	
シスメックス	44,200	5,530	244,426,000	
メガチップス	23,700	1,818	43,086,600	
O B A R A	19,600	1,077	21,109,200	
日本電産コパル電子	27,000	660	17,820,000	
ミヤチテクノス	12,900	786	10,139,400	
東京電波	9,700	681	6,605,700	
澤藤電機	17,000	304	5,168,000	
コーセル	37,400	1,342	50,190,800	
日立メディコ	18,000	870	15,660,000	
オブテックス	17,800	1,252	22,285,600	
千代田インテグレ	11,300	1,347	15,221,100	
東光電気	20,000	563	11,260,000	
スタンレー電気	170,700	1,495	255,196,500	
岩崎電気	107,000	172	18,404,000	
ウシオ電機	153,800	1,710	262,998,000	
岡谷電機産業	13,300	513	6,822,900	
ヘリオス テクノ ホールディング	29,600	246	7,281,600	
日本セラミック	17,300	1,698	29,375,400	
新神戸電機	22,000	1,060	23,320,000	

日本デジタル研究所	19,100	960	18,336,000	
古河電池	20,000	582	11,640,000	
双信電機	14,400	564	8,121,600	
山一電機	25,000	347	8,675,000	
図研	17,800	685	12,193,000	
日本電子	100,000	285	28,500,000	
カシオ計算機	242,300	708	171,548,400	
ファナック	262,700	12,740	3,346,798,000	
日本シイエムケイ	55,500	438	24,309,000	
エンブラス	14,900	1,229	18,312,100	
ローム	126,400	5,780	730,592,000	
浜松ホトニクス	97,900	3,310	324,049,000	
三井ハイテック	35,800	497	17,792,600	
新光電気工業	66,100	1,009	66,694,900	
京セラ	209,800	8,690	1,823,162,000	
太陽誘電	115,000	1,368	157,320,000	
村田製作所	265,000	6,300	1,669,500,000	
ユーシン	32,700	714	23,347,800	
双葉電子工業	42,300	1,689	71,444,700	
北陸電気工業	112,000	197	22,064,000	
パナソニック電工	234,000	1,030	241,020,000	
ニチコン	80,400	1,224	98,409,600	
日本ケミコン	161,000	538	86,618,000	
K O A	32,100	993	31,875,300	
市光工業	65,000	252	16,380,000	
小糸製作所	126,000	1,479	186,354,000	
ミツバ	49,000	727	35,623,000	
スター精密	50,400	1,001	50,450,400	
大日本スクリーン製造	283,000	795	224,985,000	
キヤノン電子	22,300	2,443	54,478,900	
キヤノン	1,568,100	4,105	6,437,050,500	
リコー	757,000	1,113	842,541,000	
日本電産サンキョー	63,000	680	42,840,000	
M U T O Hホールディングス	38,000	274	10,412,000	
東京エレクトロン	198,400	5,660	1,122,944,000	
トヨタ紡織	87,900	1,406	123,587,400	
鬼怒川ゴム工業	62,000	525	32,550,000	
ユニプレス	32,900	2,086	68,629,400	
豊田自動織機	229,600	2,894	664,462,400	
モリタホールディングス	41,000	540	22,140,000	
三櫻工業	27,300	861	23,505,300	
デンソー	553,200	3,140	1,737,048,000	
東海理化電機製作所	59,200	1,627	96,318,400	
三井造船	974,000	223	217,202,000	
佐世保重工業	170,000	201	34,170,000	
川崎重工業	1,960,000	333	652,680,000	



日本車輛製造	95,000	448	42,560,000	
日本輸送機	36,000	222	7,992,000	
近畿車輛	40,000	447	17,880,000	
日産自動車	3,187,600	885	2,821,026,000	
いすゞ自動車	1,463,000	372	544,236,000	
トヨタ自動車	3,242,700	3,885	12,597,889,500	
日野自動車	317,000	476	150,892,000	
三菱自動車工業	5,215,000	120	625,800,000	
エフテック	9,300	1,782	16,572,600	
武蔵精密工業	24,700	2,231	55,105,700	
トヨタ車体	43,900	1,549	68,001,100	
日産車体	95,000	687	65,265,000	
関東自動車工業	38,800	730	28,324,000	
新明和工業	115,000	368	42,320,000	
極東開発工業	51,600	396	20,433,600	
日信工業	50,800	1,556	79,044,800	
トピー工業	214,000	247	52,858,000	
ティラド	82,000	422	34,604,000	
曙ブレーキ工業	119,100	534	63,599,400	
タチエス	33,700	1,697	57,188,900	
N O K	122,300	1,720	210,356,000	
フタバ産業	70,400	639	44,985,600	
カヤバ工業	159,000	728	115,752,000	
シロキ工業	60,000	350	21,000,000	
大同メタル工業	38,000	897	34,086,000	
プレス工業	117,000	418	48,906,000	
カルソニックカンセイ	130,000	411	53,430,000	
太平洋工業	53,000	529	28,037,000	
ケーヒン	52,800	1,867	98,577,600	
河西工業	36,000	596	21,456,000	
アイシン精機	207,500	3,245	673,337,500	
富士機工	7,000	409	2,863,000	
マツダ	1,957,000	222	434,454,000	
ダイハツ工業	268,000	1,322	354,296,000	
愛知機械工業	61,000	387	23,607,000	
今仙電機製作所	17,300	1,448	25,050,400	
本田技研工業	2,130,300	3,710	7,903,413,000	
スズキ	526,600	1,959	1,031,609,400	
富士重工業	798,000	710	566,580,000	
ヤマハ発動機	384,300	1,551	596,049,300	
ショーワ	54,300	716	38,878,800	
T B K	30,000	592	17,760,000	
エクセディ	30,400	2,775	84,360,000	
豊田合成	71,100	1,900	135,090,000	
愛三工業	29,700	915	27,175,500	
ヨロズ	14,700	1,843	27,092,100	

エフ・シー・シー	37,800	2,075	78,435,000	
シマノ	102,800	4,115	423,022,000	
タカタ	39,600	2,670	105,732,000	
テイ・エス テック	47,800	1,734	82,885,200	
日本電産トーソク	17,700	862	15,257,400	
テルモ	198,100	4,355	862,725,500	
クリエートメディック	3,800	856	3,252,800	
日機装	88,000	724	63,712,000	
島津製作所	301,000	707	212,807,000	
JMS	33,000	303	9,999,000	
クボテック	56	50,000	2,800,000	
長野計器	19,500	760	14,820,000	
東京計器	108,000	125	13,500,000	
愛知時計電機	31,000	249	7,719,000	
東京精密	48,800	1,680	81,984,000	
ニコン	440,000	1,935	851,400,000	
トプコン	62,400	474	29,577,600	
オリンパス	297,300	2,466	733,141,800	
理研計器	19,100	775	14,802,500	
タムロン	24,500	1,758	43,071,000	
HOYA	580,400	1,942	1,127,136,800	
ノーリツ鋼機	22,300	565	12,599,500	
エー・アンド・デイ	27,100	344	9,322,400	
日本電産コパル	20,300	1,298	26,349,400	
シチズンホールディングス	274,100	546	149,658,600	
リズム時計工業	139,000	145	20,155,000	
セイコーホールディングス	142,000	312	44,304,000	
ニプロ	48,300	1,678	81,047,400	
SRIスポーツ	175	92,500	16,187,500	
バンダイナムコホールディングス	294,500	939	276,535,500	
共立印刷	36,700	137	5,027,900	
フランスベッドホールディングス	189,000	117	22,113,000	
パイロットコーポレーション	241	152,100	36,656,100	
トッパン・フォームズ	51,500	811	41,766,500	
フジシールインターナショナル	26,700	1,861	49,688,700	
タカラトミー	75,200	692	52,038,400	
廣済堂	14,900	121	1,802,900	
タカノ	12,000	543	6,516,000	
プロネクサス	31,200	448	13,977,600	
ホクシン	30,300	111	3,363,300	
ウッドワン	49,000	301	14,749,000	
大建工業	114,000	267	30,438,000	
凸版印刷	709,000	764	541,676,000	
大日本印刷	766,000	1,134	868,644,000	
図書印刷	47,000	153	7,191,000	
共同印刷	78,000	194	15,132,000	

日本写真印刷	46,300	2,228	103,156,400
光村印刷	25,000	304	7,600,000
宝印刷	7,000	670	4,690,000
アシックス	235,000	1,134	266,490,000
ツツミ	11,500	2,216	25,484,000
ローランド	26,000	983	25,558,000
小松ウオール工業	7,600	813	6,178,800
ヤマハ	201,500	1,070	215,605,000
河合楽器製作所	89,000	196	17,444,000
クリナップ	26,200	640	16,768,000
ビジョン	18,100	2,509	45,412,900
パラマウントベッド	20,900	2,200	45,980,000
兼松日産農林	51,000	145	7,395,000
キングジム	17,600	619	10,894,400
リンテック	54,000	2,412	130,248,000
イトーキ	64,900	218	14,148,200
任天堂	144,400	25,370	3,663,428,000
三菱鉛筆	21,600	1,444	31,190,400
タカラスタンダード	114,000	559	63,726,000
コクヨ	130,600	686	89,591,600
ナカバヤシ	55,000	180	9,900,000
グローブライド	122,000	106	12,932,000
岡村製作所	103,000	530	54,590,000
美津濃	123,000	404	49,692,000
ユニハアー	30,200	894	26,998,800
東京電力	1,858,100	2,158	4,009,779,800
中部電力	777,400	2,204	1,713,389,600
関西電力	1,029,500	2,173	2,237,103,500
中国電力	347,700	1,754	609,865,800
北陸電力	259,100	2,069	536,077,900
東北電力	631,200	1,922	1,213,166,400
四国電力	255,200	2,471	630,599,200
九州電力	557,100	1,915	1,066,846,500
北海道電力	235,100	1,762	414,246,200
沖縄電力	15,500	4,080	63,240,000
電源開発	157,600	2,630	414,488,000
東京瓦斯	3,164,000	370	1,170,680,000
大阪瓦斯	2,533,000	315	797,895,000
東邦瓦斯	651,000	446	290,346,000
北海道瓦斯	47,000	255	11,985,000
西部瓦斯	290,000	212	61,480,000
静岡瓦斯	68,500	476	32,606,000
東武鉄道	1,076,000	463	498,188,000
相鉄ホールディングス	412,000	272	112,064,000
東京急行電鉄	1,386,000	382	529,452,000
京浜急行電鉄	650,000	669	434,850,000

小田急電鉄	804,000	776	623,904,000	
京王電鉄	649,000	547	355,003,000	
京成電鉄	406,000	576	233,856,000	
富士急行	72,000	440	31,680,000	
新京成電鉄	34,000	347	11,798,000	
東日本旅客鉄道	439,400	5,630	2,473,822,000	
西日本旅客鉄道	2,355	329,500	775,972,500	
東海旅客鉄道	2,195	737,000	1,617,715,000	
アートコーポレーション	5,700	1,791	10,208,700	
西日本鉄道	321,000	350	112,350,000	
ハマキョウレックス	8,300	2,701	22,418,300	
サカイ引越センター	4,000	1,813	7,252,000	
近畿日本鉄道	2,285,000	261	596,385,000	
阪急阪神ホールディングス	1,685,000	398	670,630,000	
南海電気鉄道	524,000	341	178,684,000	
京阪電気鉄道	562,000	346	194,452,000	
名糖運輸	9,800	699	6,850,200	
名古屋鉄道	866,000	227	196,582,000	
日本通運	1,002,000	353	353,706,000	
ヤマトホールディングス	512,600	1,318	675,606,800	
山九	311,000	394	122,534,000	
丸運	16,400	226	3,706,400	
丸全昭和運輸	81,000	293	23,733,000	
センコー	102,000	288	29,376,000	
トナミホールディングス	63,000	177	11,151,000	
日本梱包運輸倉庫	75,000	974	73,050,000	
日本石油輸送	23,000	215	4,945,000	
福山通運	174,000	441	76,734,000	
セイノーホールディングス	195,000	633	123,435,000	
神奈川中央交通	30,000	429	12,870,000	
日立物流	44,100	1,331	58,697,100	
日本郵船	2,127,000	389	827,403,000	
商船三井	1,226,000	583	714,758,000	
川崎汽船	779,000	382	297,578,000	
NSユナイテッド海運	98,000	215	21,070,000	
乾汽船	29,000	628	18,212,000	
明治海運	28,500	352	10,032,000	
飯野海運	127,000	450	57,150,000	
共栄タンカー	27,000	189	5,103,000	
第一中央汽船	158,000	215	33,970,000	
全日本空輸	3,363,000	308	1,035,804,000	
バスコ	31,000	278	8,618,000	
国際航業ホールディングス	15,000	268	4,020,000	
日新	98,000	249	24,402,000	
三菱倉庫	178,000	1,114	198,292,000	
三井倉庫	112,000	360	40,320,000	

住友倉庫	183,000	454	83,082,000
澁澤倉庫	72,000	287	20,664,000
東陽倉庫	40,000	198	7,920,000
日本トランスシティ	55,000	319	17,545,000
ケイヒン	66,000	101	6,666,000
安田倉庫	21,500	513	11,029,500
東洋埠頭	90,000	140	12,600,000
宇徳	20,800	277	5,761,600
上組	274,000	726	198,924,000
サンリツ	8,700	617	5,367,900
キムラユニティー	2,900	727	2,108,300
キューソー流通システム	5,300	864	4,579,200
郵船ロジスティクス	21,300	1,289	27,455,700
近鉄エクスプレス	22,500	2,629	59,152,500
東海運	17,100	214	3,659,400
バンテック	118	120,300	14,195,400
システナ	273	108,500	29,620,500
新日鉄ソリューションズ	21,900	1,891	41,412,900
コア	9,200	728	6,697,600
I Tホールディングス	83,300	978	81,467,400
グリー	77,900	1,330	103,607,000
コーエーテックホールディングス	54,600	674	36,800,400
三菱総合研究所	9,100	1,875	17,062,500
ドワンゴ	134	236,800	31,731,200
ベリサーブ	16	121,600	1,945,600
マクロミル	27,700	1,183	32,769,100
ティーガイア	218	160,700	35,032,600
GMOペイメントゲートウェイ	69	255,400	17,622,600
ザッパラス	164	134,000	21,976,000
インターネットイニシアティブ	160	266,400	42,624,000
ソネットエンタテインメント	149	295,400	44,014,600
S R Aホールディングス	13,300	948	12,608,400
J B I Sホールディングス	31,800	337	10,716,600
朝日ネット	11,000	355	3,905,000
パナソニック電工インフォメーションシステムズ	5,200	2,198	11,429,600
フェイス	923	12,010	11,085,230
野村総合研究所	141,400	1,982	280,254,800
サイバネットシステム	210	22,880	4,804,800
インテージ	8,000	1,874	14,992,000
シンプレクス・ホールディングス	466	41,150	19,175,900
クレスコ	8,600	608	5,228,800
フジ・メディア・ホールディングス	2,600	130,100	338,260,000
オービック	8,630	16,700	144,121,000
ティーディーシーソフトウェアエンジニアリング	5,600	765	4,284,000
ヤフー	18,306	31,150	570,231,900
トレンドマイクロ	110,700	2,725	301,657,500

日本オラクル	40,500	3,925	158,962,500
アルファシステムズ	8,000	1,433	11,464,000
フューチャーアーキテクト	316	41,100	12,987,600
シーエーシー	15,800	699	11,044,200
ソフトバンク・テクノロジー	7,200	748	5,385,600
トーセ	8,200	592	4,854,400
オービックビジネスコンサルタント	6,700	5,390	36,113,000
日立ビジネスソリューション	7,900	785	6,201,500
伊藤忠テクノソリューションズ	36,000	2,978	107,208,000
アイティフォー	33,900	293	9,932,700
東計電算	2,300	1,146	2,635,800
エクスネット	23	138,000	3,174,000
大塚商会	20,200	6,160	124,432,000
サイボウズ	472	24,270	11,455,440
アグレックス	3,300	841	2,775,300
電通国際情報サービス	20,100	650	13,065,000
ウェザーニューズ	7,200	1,853	13,341,600
C I J	23,800	281	6,687,800
ネットワンシステムズ	628	136,200	85,533,600
アルゴグラフィックス	10,700	1,143	12,230,100
エイベックス・グループ・ホールディングス	50,700	1,209	61,296,300
日本ユニシス	71,200	687	48,914,400
兼松エレクトロニクス	9,000	885	7,965,000
東京放送ホールディングス	135,900	1,152	156,556,800
日本テレビ放送網	21,820	13,280	289,769,600
テレビ朝日	623	141,400	88,092,200
スカパーJ S A Tホールディングス	1,927	31,200	60,122,400
テレビ東京ホールディングス	11,700	1,242	14,531,400
アイ・ティー・シーネットワーク	22,100	516	11,403,600
イー・アクセス	1,044	53,500	55,854,000
N E Cモバイリング	9,000	2,775	24,975,000
日本電信電話	935,800	4,085	3,822,743,000
K D D I	3,871	537,000	2,078,727,000
光通信	33,300	2,095	69,763,500
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	20,584	157,900	3,250,213,600
G M Oインターネット	25,300	486	12,295,800
学研ホールディングス	121,000	192	23,232,000
ゼンリン	38,800	996	38,644,800
昭文社	16,300	697	11,361,100
角川グループホールディングス	24,300	2,206	53,605,800
インプレスホールディングス	41,100	153	6,288,300
アイネット	12,300	490	6,027,000
松竹	158,000	648	102,384,000
東宝	162,500	1,369	222,462,500
東映	108,000	441	47,628,000
葵プロモーション	14,000	495	6,930,000

エヌ・ティ・ティ・データ	1,761	310,500	546,790,500	
D T S	25,800	952	24,561,600	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	83,300	1,546	128,781,800	
シーイーシー	18,600	456	8,481,600	
カプコン	54,900	1,544	84,765,600	
ジャステック	14,500	497	7,206,500	
住商情報システム	26,700	1,390	37,113,000	
C S K	41,500	360	14,940,000	
日本システムウエア	14,400	392	5,644,800	
アイネス	37,500	702	26,325,000	
T K C	16,900	1,707	28,848,300	
富士ソフト	34,900	1,505	52,524,500	
N S D	49,200	911	44,821,200	
コナミ	115,000	1,653	190,095,000	
福井コンピュータ	8,700	466	4,054,200	
J B C Cホールディングス	22,800	564	12,859,200	
ソフトバンク	1,103,500	3,240	3,575,340,000	
ハウスイ	35,000	113	3,955,000	
インターニックス	13,900	405	5,629,500	
高千穂交易	6,300	986	6,211,800	
伊藤忠食品	4,700	2,946	13,846,200	
エレマテック	18,300	1,243	22,746,900	
J A L U X	7,100	829	5,885,900	
トーメンデバイス	2,800	2,543	7,120,400	
東京エレクトロン デバイス	50	196,000	9,800,000	
双日	1,673,300	193	322,946,900	
アルフレッサ ホールディングス	64,700	3,290	212,863,000	
横浜冷凍	39,800	594	23,641,200	
神栄	48,000	165	7,920,000	
山下医科器械	2,200	1,148	2,525,600	
ラサ商事	9,400	419	3,938,600	
アルコニックス	4,500	2,383	10,723,500	
あい ホールディングス	46,600	353	16,449,800	
ダイワボウホールディングス	235,000	202	47,470,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	45,800	681	31,189,800	
U K Cホールディングス	17,100	1,280	21,888,000	
日本コークス工業	227,500	170	38,675,000	
ミタチ産業	7,300	465	3,394,500	
J F E 商事ホールディングス	168,000	427	71,736,000	
シップヘルスケアホールディングス	34,700	1,066	36,990,200	
富士興産	124,000	85	10,540,000	
協栄産業	39,000	183	7,137,000	
小野建	22,500	770	17,325,000	
佐鳥電機	20,200	631	12,746,200	
エコートレーディング	3,600	847	3,049,200	
伯東	15,900	933	14,834,700	

中山福	3,200	622	1,990,400
ナガイレーベン	12,100	2,057	24,889,700
菱食	23,800	1,866	44,410,800
松田産業	18,700	1,478	27,638,600
メディカルホールディングス	230,600	801	184,710,600
アドヴァン	18,400	696	12,806,400
S P K	5,800	1,319	7,650,200
アズワン	16,100	1,895	30,509,500
スズデン	6,500	547	3,555,500
尾家産業	9,500	820	7,790,000
シモジマ	17,300	1,057	18,286,100
ドウシシャ	11,700	1,942	22,721,400
高速	10,500	756	7,938,000
黒田電気	35,100	1,184	41,558,400
丸文	23,100	522	12,058,200
ハピネット	5,300	1,124	5,957,200
トーマンエレクトロニクス	9,200	1,432	13,174,400
エクセル	12,900	1,075	13,867,500
マルカキカイ	9,300	641	5,961,300
ガリバーインターナショナル	7,430	3,725	27,676,750
日本エム・ディ・エム	30,300	252	7,635,600
進和	14,500	997	14,456,500
エスケイジャパン	10,100	294	2,969,400
ダイトエレクトロン	14,900	622	9,267,800
シークス	17,800	1,150	20,470,000
田中商事	9,000	337	3,033,000
オーハシテクニカ	16,200	643	10,416,600
マクニカ	12,300	2,085	25,645,500
白銅	7,700	1,000	7,700,000
伊藤忠商事	1,738,100	893	1,552,123,300
丸紅	2,179,000	655	1,427,245,000
高島	46,000	139	6,394,000
F & A アクアホールディングス	18,200	855	15,561,000
長瀬産業	138,000	1,069	147,522,000
蝶理	191,000	114	21,774,000
豊田通商	274,700	1,620	445,014,000
三共生興	48,000	341	16,368,000
兼松	591,000	94	55,554,000
ツカモトコーポレーション	73,000	98	7,154,000
三井物産	2,150,600	1,547	3,326,978,200
日本紙パルプ商事	133,000	328	43,624,000
日立ハイテクノロジー	76,300	2,035	155,270,500
カメイ	24,000	422	10,128,000
東都水産	56,000	177	9,912,000
スターゼン	71,000	257	18,247,000
山善	96,900	503	48,740,700



椿本興業	30,000	244	7,320,000	
住友商事	1,372,000	1,289	1,768,508,000	
内田洋行	53,000	310	16,430,000	
三菱商事	1,994,200	2,359	4,704,317,800	
第一実業	59,000	387	22,833,000	
キヤノンマーケティングジャパン	83,700	1,133	94,832,100	
西華産業	97,000	232	22,504,000	
佐藤商事	26,100	547	14,276,700	
菱洋エレクトロ	28,600	939	26,855,400	
東京産業	17,000	272	4,624,000	
ユアサ商事	280,000	98	27,440,000	
神鋼商事	69,000	233	16,077,000	
阪和興業	233,000	398	92,734,000	
カナデン	23,000	551	12,673,000	
菱電商事	32,000	585	18,720,000	
フルサト工業	15,300	573	8,766,900	
岩谷産業	272,000	270	73,440,000	
すてきナイスグループ	121,000	183	22,143,000	
昭光通商	100,000	130	13,000,000	
ニチモウ	46,000	207	9,522,000	
極東貿易	41,000	173	7,093,000	
イワキ	35,000	221	7,735,000	
三愛石油	56,000	444	24,864,000	
稲畑産業	70,800	583	41,276,400	
G S Iクレオス	73,000	139	10,147,000	
明和産業	27,900	323	9,011,700	
東邦ホールディングス	76,700	1,036	79,461,200	
サンゲツ	40,800	1,990	81,192,000	
ミツウロコ	38,100	535	20,383,500	
シナネン	45,000	402	18,090,000	
伊藤忠エネクス	52,500	496	26,040,000	
ザ・トーカイ	62,000	346	21,452,000	
サンリオ	70,300	2,578	181,233,400	
サンワテクノス	14,600	735	10,731,000	
リョーサン	38,700	2,200	85,140,000	
新光商事	25,100	770	19,327,000	
トーホー	37,000	308	11,396,000	
三信電気	25,600	730	18,688,000	
東陽テクニカ	35,500	864	30,672,000	
モスフードサービス	27,800	1,570	43,646,000	
加賀電子	25,600	1,101	28,185,600	
ソーダニッカ	25,000	383	9,575,000	
立花エレテック	15,000	778	11,670,000	
P a l t a c	16,300	1,534	25,004,200	
太平洋興発	116,000	75	8,700,000	
ヤマタネ	140,000	132	18,480,000	

丸紅建材リース	31,000	110	3,410,000	
日鐵商事	62,000	284	17,608,000	
トラスコ中山	31,200	1,462	45,614,400	
オートバックスセブン	32,200	3,290	105,938,000	
加藤産業	35,800	1,423	50,943,400	
イエローハット	25,400	923	23,444,200	
富士エレクトロニクス	15,200	1,559	23,696,800	
J Kホールディングス	26,800	419	11,229,200	
日伝	9,200	2,369	21,794,800	
北沢産業	29,000	181	5,249,000	
杉本商事	13,400	758	10,157,200	
因幡電機産業	28,300	2,379	67,325,700	
住金物産	112,000	232	25,984,000	
ミスミグループ本社	84,700	2,080	176,176,000	
アルテック	18,400	342	6,292,800	
タキヒヨー	41,000	420	17,220,000	
スズケン	102,300	2,365	241,939,500	
ジェコス	19,100	337	6,436,700	
ローソン	86,300	4,140	357,282,000	
サンエー	8,300	3,245	26,933,500	
キリン堂	9,300	433	4,026,900	
ダイユーエイト	4,100	540	2,214,000	
カワチ薬品	17,400	1,770	30,798,000	
エービーシー・マート	30,300	3,285	99,535,500	
ハードオフコーポレーション	7,400	465	3,441,000	
アスクル	19,700	1,671	32,918,700	
ゲオ	430	111,200	47,816,000	
ポイント	21,560	3,950	85,162,000	
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	27,000	121	3,267,000	
くらコーポレーション	14,900	1,307	19,474,300	
キャンドゥ	99	74,300	7,355,700	
パル	8,100	3,210	26,001,000	
エディオン	93,900	875	82,162,500	
サーラコーポレーション	26,000	469	12,194,000	
パルス	122	85,700	10,455,400	
あみやき亭	44	287,200	12,636,800	
ひらまつ	60	106,700	6,402,000	
ハニーズ	23,720	1,039	24,645,080	
アルペン	15,700	1,651	25,920,700	
ビックカメラ	651	34,800	22,654,800	
D C Mホールディングス	121,200	524	63,508,800	
MonotaRO	8,000	977	7,816,000	
J . フロント リテイリング	591,000	442	261,222,000	
ドトール・日レスホールディングス	41,600	1,136	47,257,600	
マツモトキヨシホールディングス	47,100	1,847	86,993,700	
ココカラファイン	24,000	1,885	45,240,000	

三越伊勢丹ホールディングス	492,600	1,010	497,526,000
クリエイトSDホールディングス	8,800	1,937	17,045,600
CHIグループ	18,900	312	5,896,800
ブックオフコーポレーション	14,800	721	10,670,800
あさひ	11,500	1,339	15,398,500
サークルKサンクス	54,800	1,411	77,322,800
日本調剤	4,060	3,375	13,702,500
コスモス薬品	12,000	3,500	42,000,000
セブン&アイ・ホールディングス	1,042,900	2,297	2,395,541,300
ツルハホールディングス	22,700	4,070	92,389,000
サンマルクホールディングス	8,200	3,625	29,725,000
フェリシモ	7,200	1,075	7,740,000
トリドール	81	117,900	9,549,900
メディカルシステムネットワーク	1,500	685	1,027,500
総合メディカル	5,900	2,430	14,337,000
はるやま商事	14,900	484	7,211,600
カッパ・クリエイト	16,500	2,015	33,247,500
ライトオン	23,900	451	10,778,900
ジーンズメイト	12,900	285	3,676,500
良品計画	28,800	4,005	115,344,000
三城ホールディングス	33,000	835	27,555,000
コナカ	35,900	510	18,309,000
G-7ホールディングス	5,100	563	2,871,300
イオン北海道	15,700	314	4,929,800
コジマ	36,600	608	22,252,800
コーナン商事	24,000	1,175	28,200,000
エコス	11,700	475	5,557,500
ワタミ	29,400	1,729	50,832,600
マルシェ	4,300	718	3,087,400
ドン・キホーテ	47,600	2,951	140,467,600
メガネトップ	28,200	800	22,560,000
西松屋チェーン	58,700	747	43,848,900
ゼンショー	96,400	885	85,314,000
幸楽苑	11,200	1,264	14,156,800
ハークスレイ	7,200	527	3,794,400
サイゼリヤ	33,300	1,575	52,447,500
ユナイテッドアローズ	25,400	1,345	34,163,000
ハイデイ日高	9,800	1,410	13,818,000
京都きもの友禅	16,000	943	15,088,000
コロワイド	83,000	510	42,330,000
壱番屋	3,600	2,401	8,643,600
トップカルチャー	6,800	380	2,584,000
スギホールディングス	40,700	2,009	81,766,300
スクロール	38,500	358	13,783,000
ファミリーマート	84,400	3,130	264,172,000
木曽路	27,200	1,810	49,232,000

千趣会	41,800	535	22,363,000
タカキュー	34,000	176	5,984,000
ケーヨー	44,800	450	20,160,000
上新電機	54,000	868	46,872,000
日本瓦斯	26,200	1,197	31,361,400
ベスト電器	86,000	255	21,930,000
マルエツ	53,000	343	18,179,000
ロイヤルホールディングス	37,000	884	32,708,000
東天紅	32,000	152	4,864,000
いなげや	19,000	897	17,043,000
島忠	48,400	1,878	90,895,200
チヨダ	33,200	1,218	40,437,600
ライフコーポレーション	15,800	1,302	20,571,600
カスミ	34,800	476	16,564,800
リンガーハット	21,300	1,113	23,706,900
さが美	36,000	120	4,320,000
Mr Max	28,800	297	8,553,600
テンアライド	16,900	295	4,985,500
AOKIホールディングス	23,600	1,427	33,677,200
オークワ	32,000	913	29,216,000
コメリ	34,700	2,080	72,176,000
青山商事	63,900	1,412	90,226,800
しまむら	26,100	7,580	197,838,000
CFSコーポレーション	26,500	456	12,084,000
高島屋	338,000	701	236,938,000
松屋	41,500	696	28,884,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	145,000	630	91,350,000
丸栄	56,000	118	6,608,000
ニッセンホールディングス	55,900	527	29,459,300
パルコ	65,700	826	54,268,200
丸井グループ	325,400	769	250,232,600
原信ナルスホールディングス	14,600	1,306	19,067,600
ダイエー	121,900	351	42,786,900
イズミヤ	89,000	376	33,464,000
イオン	880,000	1,082	952,160,000
ユニー	203,000	837	169,911,000
イズミ	70,200	1,245	87,399,000
東武ストア	19,000	269	5,111,000
平和堂	49,000	1,083	53,067,000
フジ	28,600	1,798	51,422,800
ヤオコー	11,000	2,540	27,940,000
ゼビオ	31,000	1,874	58,094,000
ケーズホールディングス	58,100	2,754	160,007,400
Olympic	18,800	650	12,220,000
東日カーライフグループ	60,000	117	7,020,000
アインファーマシーズ	9,200	2,885	26,542,000

元気寿司	7,200	1,086	7,819,200	
ヤマダ電機	113,890	6,300	717,507,000	
アークランドサカモト	16,600	1,008	16,732,800	
ニトリホールディングス	49,550	7,460	369,643,000	
グルメ杵屋	17,000	506	8,602,000	
愛眼	17,400	473	8,230,200	
吉野家ホールディングス	665	111,200	73,948,000	
松屋フーズ	7,800	1,525	11,895,000	
サガミチェーン	34,000	494	16,796,000	
ブレナス	31,700	1,438	45,584,600	
ミニストップ	17,800	1,486	26,450,800	
アークス	32,300	1,307	42,216,100	
パロー	46,500	803	37,339,500	
ベルク	9,200	1,036	9,531,200	
大庄	14,100	1,129	15,918,900	
ファーストリテイリング	58,300	12,450	725,835,000	
サンドラッグ	48,600	2,512	122,083,200	
ヤマザワ	5,900	1,157	6,826,300	
ベルーナ	36,950	630	23,278,500	
新生銀行	1,313,000	106	139,178,000	
あおぞら銀行	920,000	183	168,360,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	18,860,000	471	8,883,060,000	
りそなホールディングス	1,543,800	454	700,885,200	
中央三井トラスト・ホールディングス	1,432,000	357	511,224,000	
三井住友フィナンシャルグループ	1,883,800	3,165	5,962,227,000	
第四銀行	326,000	308	100,408,000	
北越銀行	288,000	201	57,888,000	
西日本シティ銀行	885,000	281	248,685,000	
札幌北洋ホールディングス	378,100	446	168,632,600	
千葉銀行	985,000	572	563,420,000	
横浜銀行	1,710,000	451	771,210,000	
常陽銀行	961,000	387	371,907,000	
群馬銀行	582,000	522	303,804,000	
武蔵野銀行	41,800	2,759	115,326,200	
千葉興業銀行	49,900	607	30,289,300	
筑波銀行	117,400	296	34,750,400	
東京都民銀行	49,200	1,218	59,925,600	
七十七銀行	419,000	524	219,556,000	
青森銀行	203,000	265	53,795,000	
秋田銀行	163,000	269	43,847,000	
山形銀行	154,000	428	65,912,000	
岩手銀行	16,700	4,055	67,718,500	
東邦銀行	203,000	282	57,246,000	
東北銀行	141,000	141	19,881,000	
みちのく銀行	131,000	181	23,711,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	1,010,000	381	384,810,000	

静岡銀行	772,000	787	607,564,000	
十六銀行	315,000	285	89,775,000	
スルガ銀行	265,000	836	221,540,000	
八十二銀行	466,000	524	244,184,000	
山梨中央銀行	152,000	461	70,072,000	
大垣共立銀行	328,000	295	96,760,000	
福井銀行	216,000	270	58,320,000	
北國銀行	286,000	308	88,088,000	
清水銀行	8,000	4,060	32,480,000	
滋賀銀行	230,000	474	109,020,000	
南都銀行	234,000	443	103,662,000	
百五銀行	218,000	396	86,328,000	
京都銀行	441,000	809	356,769,000	
三重銀行	110,000	235	25,850,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	1,752,000	193	338,136,000	
広島銀行	742,000	380	281,960,000	
山陰合同銀行	145,000	649	94,105,000	
中国銀行	202,000	994	200,788,000	
鳥取銀行	76,000	189	14,364,000	
伊予銀行	267,000	776	207,192,000	
百十四銀行	280,000	352	98,560,000	
四国銀行	187,000	293	54,791,000	
阿波銀行	206,000	514	105,884,000	
鹿児島銀行	154,000	584	89,936,000	
大分銀行	162,000	322	52,164,000	
宮崎銀行	159,000	225	35,775,000	
肥後銀行	202,000	496	100,192,000	
佐賀銀行	151,000	237	35,787,000	
十八銀行	166,000	273	45,318,000	
沖縄銀行	18,500	3,455	63,917,500	
琉球銀行	53,700	998	53,592,600	
住友信託銀行	2,231,000	533	1,189,123,000	
みずほ信託銀行	2,400,000	86	206,400,000	
八千代銀行	13,800	2,967	40,944,600	
みずほフィナンシャルグループ	30,461,200	173	5,269,787,600	
紀陽ホールディングス	982,000	122	119,804,000	
山口フィナンシャルグループ	245,000	866	212,170,000	
長野銀行	101,000	196	19,796,000	
名古屋銀行	217,000	284	61,628,000	
愛知銀行	8,200	5,540	45,428,000	
第三銀行	156,000	245	38,220,000	
中京銀行	106,000	217	23,002,000	
東日本銀行	133,000	216	28,728,000	
愛媛銀行	160,000	252	40,320,000	
トマト銀行	104,000	160	16,640,000	
みなと銀行	267,000	172	45,924,000	

京葉銀行	211,000	467	98,537,000
関西アーバン銀行	367,000	155	56,885,000
栃木銀行	125,000	426	53,250,000
北日本銀行	7,700	2,175	16,747,500
東和銀行	300,000	124	37,200,000
トモニホールディングス	196,500	343	67,399,500
フィデアホールディングス	146,200	271	39,620,200
池田泉州ホールディングス	724,300	131	94,883,300
S B Iホールディングス	29,784	13,530	402,977,520
ジャフコ	34,100	2,750	93,775,000
大和証券グループ本社	2,469,000	460	1,135,740,000
野村ホールディングス	5,251,500	550	2,888,325,000
みずほ証券	646,000	241	155,686,000
みずほインベスターズ証券	606,000	90	54,540,000
岡三証券グループ	212,000	367	77,804,000
丸三証券	77,900	488	38,015,200
東洋証券	90,000	150	13,500,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	277,000	315	87,255,000
光世証券	63,000	90	5,670,000
水戸証券	80,000	145	11,600,000
いちよし証券	56,800	627	35,613,600
松井証券	150,300	599	90,029,700
だいこう証券ビジネス	14,900	336	5,006,400
マネックスグループ	1,594	24,210	38,590,740
カブドットコム証券	108,800	370	40,256,000
極東証券	33,200	699	23,206,800
岩井コスモホールディングス	26,100	578	15,085,800
N K S Jホールディングス	2,089,000	655	1,368,295,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	744,100	2,246	1,671,248,600
ソニーフィナンシャルホールディングス	1,208	349,500	422,196,000
第一生命保険	10,032	154,700	1,551,950,400
富士火災海上保険	81,000	145	11,745,000
東京海上ホールディングス	945,900	2,795	2,643,790,500
T & Dホールディングス	456,200	2,428	1,107,653,600
クレディセゾン	191,800	1,688	323,758,400
セディナ	156,700	187	29,302,900
芙蓉総合リース	24,900	3,165	78,808,500
興銀リース	36,500	2,198	80,227,000
東京センチュリーリース	60,900	1,603	97,622,700
日本証券金融	110,500	657	72,598,500
大阪証券金融	56,600	183	10,357,800
ポケットカード	34,300	361	12,382,300
リコーリース	18,600	2,344	43,598,400
イオンクレジットサービス	115,200	1,286	148,147,200
アコム	52,430	1,775	93,063,250
プロミス	96,950	889	86,188,550

ジャックス	178,000	330	58,740,000	
日立キャピタル	61,800	1,375	84,975,000	
オリックス	130,170	9,270	1,206,675,900	
三菱UFJリース	64,220	3,665	235,366,300	
アサックス	38	109,200	4,149,600	
NECキャピタルソリューション	7,800	1,462	11,403,600	
日本駐車場開発	2,953	4,190	12,373,070	
昭栄	48,900	732	35,794,800	
野村不動産ホールディングス	106,400	1,650	175,560,000	
ヒューリック	74,100	748	55,426,800	
パーク24	122,300	927	113,372,100	
三井不動産	1,177,000	1,762	2,073,874,000	
三菱地所	1,747,000	1,692	2,955,924,000	
平和不動産	199,500	249	49,675,500	
東京建物	523,000	393	205,539,000	
ダイビル	77,700	698	54,234,600	
サンケイビル	55,100	552	30,415,200	
東急不動産	513,000	466	239,058,000	
京阪神不動産	35,800	411	14,713,800	
住友不動産	599,000	2,233	1,337,567,000	
東宝不動産	32,200	594	19,126,800	
大京	326,000	165	53,790,000	
テーオーシー	106,200	363	38,550,600	
東京楽天地	47,000	295	13,865,000	
レオパレス21	18,900	134	2,532,600	
フジ住宅	32,300	441	14,244,300	
空港施設	34,600	388	13,424,800	
住友不動産販売	9,810	4,240	41,594,400	
ゴールドクレスト	24,170	2,261	54,648,370	
東栄住宅	21,000	1,265	26,565,000	
日本エスリード	15,000	957	14,355,000	
東急リバブル	29,200	1,000	29,200,000	
飯田産業	26,900	968	26,039,200	
日神不動産	9,300	649	6,035,700	
アーネストワン	48,900	1,080	52,812,000	
サンヨーハウジング名古屋	115	86,500	9,947,500	
イオンモール	114,700	2,194	251,651,800	
タクトホーム	145	97,600	14,152,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発	1,847	89,600	165,491,200	
ランドビジネス	184	19,210	3,534,640	
日本空港ビルデング	81,400	1,274	103,703,600	
日本工営	88,000	280	24,640,000	
ネクスト	77	72,500	5,582,500	
日本M&Aセンター	63	480,000	30,240,000	
アコーディア・ゴルフ	782	68,900	53,879,800	
パソナグループ	237	68,800	16,305,600	



リンクアンドモチベーション	56	48,650	2,724,400	
テンプホールディングス	36,100	770	27,797,000	
学情	15,600	303	4,726,800	
スタジオアリス	12,500	880	11,000,000	
シミック	550	28,860	15,873,000	
NECフィールディング	20,700	1,039	21,507,300	
総合警備保障	94,200	1,002	94,388,400	
カカクコム	182	469,000	85,358,000	
ルネサンス	11,700	302	3,533,400	
新日本科学	21,000	378	7,938,000	
エムスリー	111	438,000	48,618,000	
ディー・エヌ・エー	102,700	3,055	313,748,500	
博報堂DYホールディングス	36,250	5,150	186,687,500	
ぐるなび	172	118,500	20,382,000	
一休	243	40,250	9,780,750	
ジャパンベストレスキューシステム	40	73,600	2,944,000	
ジェイコムホールディングス	26	153,500	3,991,000	
PGMホールディングス	595	55,000	32,725,000	
イーピーエス	148	195,600	28,948,800	
アミューズ	4,000	975	3,900,000	
TAC	16,700	342	5,711,400	
ケネディクス	3,030	22,630	68,568,900	
電通	239,600	2,629	629,908,400	
テイクアンドギヴ・ニーズ	1,616	8,310	13,428,960	
びあ	8,200	895	7,339,000	
イオンファンタジー	9,100	1,148	10,446,800	
みらかホールディングス	64,600	3,215	207,689,000	
アルプス技研	14,100	707	9,968,700	
サニックス	53,500	205	10,967,500	
日本空調サービス	1,200	759	910,800	
オリエンタルランド	71,100	8,000	568,800,000	
ダスキン	74,500	1,612	120,094,000	
明光ネットワークジャパン	22,400	732	16,396,800	
ファルコSDホールディングス	14,200	796	11,303,200	
秀英予備校	7,600	371	2,819,600	
田谷	3,100	685	2,123,500	
ラウンドワン	68,100	540	36,774,000	
リゾートトラスト	40,700	1,378	56,084,600	
ビー・エム・エル	14,900	2,340	34,866,000	
ワタベウェディング	8,900	907	8,072,300	
もしもしホットライン	17,250	1,851	31,929,750	
東急コミュニティー	5,100	2,553	13,020,300	
リソー教育	3,368	5,260	17,715,680	
ウェアハウス	10,100	299	3,019,900	
ユー・エス・エス	34,240	6,590	225,641,600	
東京個別指導学院	21,800	245	5,341,000	

カルチュア・コンビニエンス・クラブ	146,100	596	87,075,600	
テー・オー・ダブリュー	3,800	505	1,919,000	
セントラルスポーツ	6,000	1,000	6,000,000	
リゾートソリューション	34,000	165	5,610,000	
エイチ・アイ・エス	27,100	2,234	60,541,400	
共立メンテナンス	12,300	1,426	17,539,800	
イチネンホールディングス	23,600	463	10,926,800	
建設技術研究所	14,600	470	6,862,000	
燦ホールディングス	1,300	1,388	1,804,400	
東京テアトル	117,000	135	15,795,000	
ホリプロ	3,300	832	2,745,600	
よみうりランド	65,000	322	20,930,000	
東京都競馬	199,000	126	25,074,000	
常磐興産	82,000	127	10,414,000	
カナモト	37,000	455	16,835,000	
東京ドーム	207,000	206	42,642,000	
トランス・コスモス	37,500	890	33,375,000	
乃村工藝社	56,000	313	17,528,000	
藤田観光	69,000	380	26,220,000	
日本管財	10,000	1,424	14,240,000	
白洋舎	29,000	226	6,554,000	
セコム	274,600	4,105	1,127,233,000	
セントラル警備保障	9,200	892	8,206,400	
丹青社	35,000	424	14,840,000	
メイテック	39,200	1,849	72,480,800	
アサツー ディ・ケイ	42,800	2,348	100,494,400	
応用地質	27,600	716	19,761,600	
船井総合研究所	25,700	537	13,800,900	
進学会	9,800	316	3,096,800	
ベネッセホールディングス	83,300	3,730	310,709,000	
イオンディライト	29,400	1,599	47,010,600	
ナック	4,900	1,265	6,198,500	
ニチイ学館	49,800	757	37,698,600	
ダイセキ	39,200	1,677	65,738,400	
合計	380,968,308		329,832,604,130	

差入委託証拠金代用有価証券 1,500,000 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22年2月18日現在)	(平成23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	1,043,826,652	1,014,519,204
国債証券	375,186,253,520	373,011,668,280
地方債証券	33,455,093,685	33,443,524,195
特殊債券	57,550,652,595	53,763,853,957
社債券	43,845,906,000	41,817,168,400
未収入金	576,492,000	-
未収利息	2,215,388,994	2,207,792,927
前払費用	89,616,727	62,533,852
流動資産合計	513,963,230,173	505,321,060,815
資産合計	513,963,230,173	505,321,060,815
負債の部		
流動負債		
未払金	-	150,517,500
未払解約金	716,664,000	180,100,599
流動負債合計	716,664,000	330,618,099
負債合計	716,664,000	330,618,099
純資産の部		
元本等		
1 元本		
元本	481,747,338,777	467,396,225,367
2 剰余金		
剰余金又は欠損金( )	31,499,227,396	37,594,217,349
元本等合計	513,246,566,173	504,990,442,716
純資産合計	513,246,566,173	504,990,442,716
負債・純資産合計	513,963,230,173	505,321,060,815

(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22年2月18日ならびに平成23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21年2月19日 至平成22年2月18日	自平成22年2月19日 至平成23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、特殊債券および社債券（売買目的有価証券） 個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。	国債証券、地方債証券、特殊債券および社債券（売買目的有価証券） 同左

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成22年2月18日現在)	(平成23年2月18日現在)
1. 受益権総数	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	平成23年2月18日現在における受益権の総数 467,396,225,367口
2. 1単位当たり純資産額	1.0654円 (1万口 = 10,654円)	1.0804円 (1万口 = 10,804円)

(金融商品に関する注記)

(追加情報)

当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）および「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

・金融商品の状況に関する事項

項目	自平成22年2月19日 至平成23年2月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券、地方債証券、特殊債券および社債券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。当ファンドにおけるデリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、および価格変動リスクの回避を目的としております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

3．金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。リスクを管理する部署では、各種リスクごとに定められた頻度で、測定項目が上下限值（リミットあるいは注意レベル）内に収まっているかどうかのモニタリングを行っております。上下限値を越えていることが発見された場合は、原則として速やかに修正を行うよう、リスク管理を行う部署から関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われます。また、是正勧告あるいは報告を受けた関連運用グループでは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、リスク管理を行う部署は、上下限値に抵触した事実ならびにその後の対処結果あるいは関連運用グループの対処方針の決定に関し、必要に応じて、リスク管理を行う部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告する体制となっております。</p>
4．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p>

・金融商品の時価等に関する事項

項目	自平成22年2月19日 至平成23年2月18日
1．貸借対照表計上額、時価及び差額	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>
2．時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（国債証券、地方債証券、特殊債券および社債券） 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ．取引の状況に関する事項

項目	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」）。 金利先渡し取引。
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。
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。
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。
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。
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。

## ．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22年2月18日現在）

平成22年2月18日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（平成23年2月18日現在）

平成23年2月18日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（関連当事者との取引に関する注記）

（自平成21年2月19日 至 平成22年2月18日）

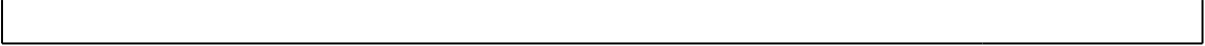
該当事項はありません。

（自平成22年2月19日 至 平成23年2月18日）

該当事項はありません。

(その他の注記)

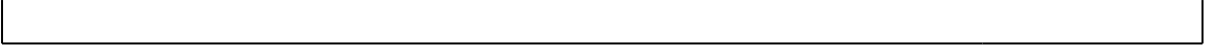
(平成22年2月18日現在)	
本有価証券報告書における開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	170,680,524,635円
同期中における追加設定元本額	327,286,589,892円
同期中における一部解約元本額	16,219,775,750円
平成22年2月18日現在における元本の内訳	
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	744,960,225円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,529,941,750円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	293,868,644円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	28,391,536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





(平成23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	481,747,338,777円
同期中における追加設定元本額	31,015,687,381円
同期中における一部解約元本額	45,366,800,791円
平成23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)	991,008,625円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,944,320,646円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	399,513,162円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	54,630,756円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	11,823,669円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	3,047,361円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	4,053,405円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	1,452,869円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	575,482円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	1,382,781円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	47,490,896,778円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	12,514,721,132円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	28,774,384,667円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	565,445,756円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	806,621,837円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	190,749,968円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	385,796,515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>	132,145,111円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	2,999,740,319円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	3,762,098,716円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	7,715,108,551円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	21,562,228,342円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,393,446,580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)	11,005,764,728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)	68,401,906,412円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	947,552,890円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	12,124,842,134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)	215,093,163,632円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	1,402,316,483円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	331,842,489円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	64,256,490円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	4,469,414,016円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	5,429,851,422円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	4,262,674,364円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	1,341,224,944円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	262,824,346円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	26,493,970円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	543,230,472円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	9,010,031,085円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	973,642,462円
合計	467,396,225,367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)	800,000,000	827,592,000	
	第2回利付国債(40年)	752,000,000	739,734,880	
	第3回利付国債(40年)	760,000,000	748,204,800	
	第237回利付国債(10年)	1,640,000,000	1,663,255,200	
	第238回利付国債(10年)	4,590,000,000	4,650,174,900	
	第239回利付国債(10年)	10,288,000,000	10,451,887,840	
	第242回利付国債(10年)	6,980,000,000	7,089,935,000	
	第243回利付国債(10年)	6,150,000,000	6,237,207,000	
	第244回利付国債(10年)	11,542,000,000	11,706,358,080	
	第247回利付国債(10年)	12,735,000,000	12,880,433,700	
	第250回利付国債(10年)	9,565,000,000	9,614,546,700	
	第253回利付国債(10年)	9,110,000,000	9,411,085,500	
	第256回利付国債(10年)	7,910,000,000	8,144,294,200	
	第258回利付国債(10年)	9,453,000,000	9,719,669,130	
	第260回利付国債(10年)	9,585,000,000	9,960,252,750	
	第263回利付国債(10年)	11,542,000,000	12,012,913,600	
	第265回利付国債(10年)	10,650,000,000	11,059,705,500	
	第268回利付国債(10年)	10,415,000,000	10,830,246,050	
	第270回利付国債(10年)	11,387,000,000	11,759,810,380	
	第272回利付国債(10年)	9,645,000,000	10,012,860,300	
	第274回利付国債(10年)	9,895,000,000	10,329,192,600	
	第277回利付国債(10年)	4,325,000,000	4,539,952,500	
	第280回利付国債(10年)	5,017,000,000	5,347,720,640	
	第282回利付国債(10年)	4,500,000,000	4,752,810,000	
	第284回利付国債(10年)	4,867,000,000	5,142,131,510	
	第285回利付国債(10年)	4,588,000,000	4,846,579,680	
	第286回利付国債(10年)	4,330,000,000	4,600,192,000	
	第288回利付国債(10年)	4,355,000,000	4,596,833,150	
	第289回利付国債(10年)	4,384,000,000	4,566,242,880	
	第290回利付国債(10年)	3,897,000,000	4,027,822,290	
	第293回利付国債(10年)	4,460,000,000	4,724,299,600	
	第296回利付国債(10年)	4,493,000,000	4,652,771,080	
	第297回利付国債(10年)	4,623,000,000	4,743,382,920	
	第299回利付国債(10年)	1,950,000,000	1,981,824,000	
	第300回利付国債(10年)	2,000,000,000	2,063,100,000	
	第301回利付国債(10年)	5,045,000,000	5,194,836,500	
	第303回利付国債(10年)	6,195,000,000	6,315,802,500	
	第305回利付国債(10年)	6,790,000,000	6,849,616,200	

第306回利付国債(10年)	7,200,000,000	7,308,792,000	
第308回利付国債(10年)	5,150,000,000	5,171,475,500	
第309回利付国債(10年)	2,200,000,000	2,170,630,000	
第310回利付国債(10年)	6,700,000,000	6,534,443,000	
第312回利付国債(10年)	3,070,000,000	3,043,260,300	
第2回利付国債(30年)	570,000,000	602,621,100	
第4回利付国債(30年)	300,000,000	341,106,000	
第5回利付国債(30年)	290,000,000	296,220,500	
第7回利付国債(30年)	549,000,000	569,724,750	
第9回利付国債(30年)	100,000,000	87,945,000	
第10回利付国債(30年)	945,000,000	780,711,750	
第12回利付国債(30年)	540,000,000	540,410,400	
第14回利付国債(30年)	1,000,000,000	1,053,990,000	
第16回利付国債(30年)	825,000,000	884,697,000	
第18回利付国債(30年)	770,000,000	796,526,500	
第19回利付国債(30年)	875,000,000	905,353,750	
第21回利付国債(30年)	605,000,000	625,763,600	
第22回利付国債(30年)	635,000,000	681,183,550	
第23回利付国債(30年)	679,000,000	728,105,280	
第24回利付国債(30年)	680,000,000	728,892,000	
第25回利付国債(30年)	810,000,000	836,422,200	
第26回利付国債(30年)	913,000,000	960,759,030	
第27回利付国債(30年)	1,060,000,000	1,137,157,400	
第28回利付国債(30年)	1,326,000,000	1,421,206,800	
第29回利付国債(30年)	1,212,000,000	1,275,484,560	
第30回利付国債(30年)	1,820,000,000	1,875,983,200	
第31回利付国債(30年)	2,010,000,000	2,031,366,300	
第32回利付国債(30年)	1,450,000,000	1,495,588,000	
第33回利付国債(30年)	1,910,000,000	1,844,849,900	
第32回利付国債(20年)	70,000,000	80,818,500	
第35回利付国債(20年)	170,000,000	196,071,200	
第37回利付国債(20年)	302,000,000	345,696,380	
第39回利付国債(20年)	458,000,000	510,761,600	
第40回利付国債(20年)	390,000,000	426,890,100	
第42回利付国債(20年)	480,000,000	535,737,600	
第43回利付国債(20年)	1,370,000,000	1,563,170,000	
第46回利付国債(20年)	775,000,000	839,999,250	
第48回利付国債(20年)	955,000,000	1,060,374,700	
第50回利付国債(20年)	918,000,000	967,920,840	
第52回利付国債(20年)	990,000,000	1,060,666,200	
第54回利付国債(20年)	1,265,000,000	1,367,174,050	
第56回利付国債(20年)	1,448,000,000	1,531,390,320	
第59回利付国債(20年)	1,395,000,000	1,426,582,800	
第61回利付国債(20年)	1,515,000,000	1,430,281,200	
第64回利付国債(20年)	1,525,000,000	1,581,989,250	
第65回利付国債(20年)	1,430,000,000	1,480,364,600	

	第70回利付国債(20年)	2,540,000,000	2,770,708,200	
	第72回利付国債(20年)	1,453,000,000	1,529,747,460	
	第74回利付国債(20年)	2,054,000,000	2,156,802,700	
	第75回利付国債(20年)	1,510,000,000	1,583,053,800	
	第78回利付国債(20年)	1,550,000,000	1,582,054,000	
	第82回利付国債(20年)	1,750,000,000	1,826,405,000	
	第84回利付国債(20年)	1,920,000,000	1,972,992,000	
	第85回利付国債(20年)	2,050,000,000	2,127,941,000	
	第88回利付国債(20年)	2,027,000,000	2,153,869,930	
	第90回利付国債(20年)	1,980,000,000	2,072,545,200	
	第92回利付国債(20年)	1,649,000,000	1,700,481,780	
	第93回利付国債(20年)	2,137,000,000	2,171,320,220	
	第95回利付国債(20年)	2,040,000,000	2,153,709,600	
	第97回利付国債(20年)	2,027,000,000	2,106,296,240	
	第99回利付国債(20年)	2,188,000,000	2,239,483,640	
	第100回利付国債(20年)	1,387,000,000	1,437,847,420	
	第101回利付国債(20年)	635,000,000	676,351,200	
	第102回利付国債(20年)	2,182,000,000	2,319,640,560	
	第105回利付国債(20年)	2,360,000,000	2,403,164,400	
	第107回利付国債(20年)	2,448,000,000	2,489,958,720	
	第109回利付国債(20年)	2,720,000,000	2,680,315,200	
	第111回利付国債(20年)	2,496,000,000	2,569,806,720	
	第113回利付国債(20年)	3,802,000,000	3,850,855,700	
	第114回利付国債(20年)	2,383,000,000	2,410,618,970	
	第116回利付国債(20年)	2,900,000,000	2,975,951,000	
	第118回利付国債(20年)	350,000,000	347,816,000	
	第119回利付国債(20年)	860,000,000	827,380,200	
	第120回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,098,143,400	
	第121回利付国債(20年)	2,450,000,000	2,393,650,000	
	第122回利付国債(20年)	1,250,000,000	1,201,312,500	
	第123回利付国債(20年)	1,240,000,000	1,249,610,000	
	国債証券 小計	362,381,000,000	373,011,668,280	
地方債証券	第1回東京都公募公債(20年)	100,000,000	98,969,000	
	第1回東京都公募公債(30年)	100,000,000	99,120,000	
	第2回東京都公募公債(3年)	200,000,000	200,990,000	
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	102,362,000	
	第7回東京都公募公債(20年)	100,000,000	103,860,000	
	第8回東京都公募公債(20年)	100,000,000	105,886,000	
	第8回東京都公募公債(30年)	400,000,000	392,608,000	
	第577回東京都公募公債	100,000,000	100,709,000	
	第579回東京都公募公債	100,000,000	100,837,000	
	第582回東京都公募公債	100,000,000	101,292,000	
	第583回東京都公募公債	648,500,000	657,494,695	
	第584回東京都公募公債	100,000,000	101,368,000	
	第588回東京都公募公債	100,000,000	101,566,000	

第596回東京都公募公債	100,000,000	100,827,000	
第598回東京都公募公債	200,000,000	200,744,000	
第602回東京都公募公債	200,000,000	205,416,000	
第603回東京都公募公債	200,000,000	206,078,000	
第604回東京都公募公債	100,000,000	103,100,000	
第608回東京都公募公債	600,000,000	620,982,000	
第610回東京都公募公債	100,000,000	104,449,000	
第613回東京都公募公債	100,000,000	103,714,000	
第623回東京都公募公債	200,000,000	206,124,000	
第628回東京都公募公債	100,000,000	104,527,000	
第629回東京都公募公債	100,000,000	103,846,000	
第634回東京都公募公債	106,000,000	112,410,880	
第642回東京都公募公債	200,000,000	212,186,000	
第643回東京都公募公債	100,000,000	105,274,000	
第646回東京都公募公債	100,000,000	107,011,000	
第652回東京都公募公債	200,000,000	209,892,000	
第653回東京都公募公債	200,000,000	207,964,000	
第660回東京都公募公債	700,000,000	727,496,000	
第662回東京都公募公債	100,000,000	104,352,000	
第668回東京都公募公債	200,000,000	205,992,000	
平成13年度第1回北海道公募公債	113,800,000	114,436,142	
平成16年度第3回北海道公募公債	100,000,000	103,330,000	
平成17年度第4回北海道公募公債	100,000,000	102,496,000	
平成17年度第9回北海道公募公債	100,000,000	103,531,000	
平成18年度第8回北海道公募公債(5年)	100,000,000	100,921,000	
平成19年度第2回北海道公募公債	100,000,000	105,337,000	
平成19年度第7回北海道公募公債	100,000,000	104,986,000	
平成20年度第4回北海道公募公債	100,000,000	105,706,000	
平成20年度第9回北海道公募公債(5年)	300,000,000	309,585,000	
平成20年度第12回北海道公募公債	100,000,000	103,621,000	
平成20年度第15回北海道公募公債(5年)	200,000,000	204,040,000	
第1回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	109,539,000	
第3回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	103,360,000	
第7回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	103,059,000	
第25回神奈川県公募公債(5年)	400,000,000	404,660,000	
第26回神奈川県公募公債(5年)	100,000,000	101,618,000	
第27回神奈川県公募公債(5年)	100,000,000	101,429,000	
第122回神奈川県公募公債	200,000,000	206,314,000	
第129回神奈川県公募公債	100,000,000	103,892,000	
第143回神奈川県公募公債	100,000,000	105,643,000	
第144回神奈川県公募公債	300,000,000	317,934,000	
第147回神奈川県公募公債	100,000,000	106,887,000	
第149回神奈川県公募公債	100,000,000	106,038,000	
第157回神奈川県公募公債	115,600,000	119,643,688	
第3回大阪府公募公債(7年)	200,000,000	206,794,000	
第26回大阪府公募公債(5年)	200,000,000	201,702,000	

第31回大阪府公募公債(5年)	100,000,000	101,724,000	
第52回大阪府公募公債(5年)	400,000,000	404,144,000	
第261回大阪府公募公債(10年)	105,000,000	107,951,550	
第262回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,574,000	
第267回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,390,000	
第277回大阪府公募公債(10年)	600,000,000	617,760,000	
第299回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	211,670,000	
第303回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	106,001,000	
第306回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	210,612,000	
第313回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,924,000	
平成14年度第2回京都府公募公債	300,000,000	303,897,000	
平成19年度第1回京都府公募公債	130,260,000	137,776,002	
平成14年度第5回兵庫県公募公債	100,000,000	100,874,000	
平成15年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	101,620,000	
平成16年度第12回兵庫県公募公債	100,000,000	102,958,000	
平成17年度第2回兵庫県公募公債	200,000,000	206,088,000	
平成17年度第6回兵庫県公募公債	101,000,000	103,695,690	
平成19年度第8回兵庫県公募公債(5年)	100,000,000	101,455,000	
平成20年度第5回兵庫県公募公債	100,000,000	105,812,000	
平成21年度第3回兵庫県公募公債	200,000,000	205,690,000	
平成21年度第11回兵庫県公募公債	200,000,000	206,186,000	
平成21年度第23回兵庫県公募公債	200,000,000	200,932,000	
平成18年度第2回静岡県公募公債	100,000,000	106,736,000	
平成18年度第3回静岡県公募公債(5年)	100,000,000	100,622,000	
平成18年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	106,065,000	
平成19年度第7回静岡県公募公債	100,000,000	105,705,000	
平成20年度第1回静岡県公募公債	200,000,000	207,942,000	
平成20年度第7回静岡県公募公債	100,000,000	104,441,000	
平成21年度第5回静岡県公募公債	300,000,000	302,697,000	
平成14年度第2回愛知県公募公債(10年)	110,000,000	111,856,800	
平成17年度第2回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,950,000	
平成18年度第4回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	105,766,000	
平成19年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	106,333,000	
平成20年度第5回愛知県公募公債(5年)	500,000,000	509,060,000	
平成21年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,365,000	
平成21年度第7回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	205,090,000	
平成19年度第3回広島県公募公債	200,000,000	208,800,000	
平成20年度第1回広島県公募公債	100,000,000	105,388,000	
平成15年度第3回埼玉県公募公債	205,670,000	212,136,264	
平成16年度第3回埼玉県公募公債	100,000,000	104,844,000	
平成16年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	103,240,000	
平成17年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	104,490,000	
平成18年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	106,095,000	
平成19年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	106,576,000	
平成21年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	102,761,000	
平成21年度第4回埼玉県公募公債	200,000,000	203,982,000	

平成18年度第1回福岡県公募公債	100,000,000	107,365,000	
平成19年度第2回福岡県公募公債	100,000,000	107,067,000	
平成20年度第9回福岡県公募公債	200,000,000	202,518,000	
平成16年度第9回千葉県公募公債	100,000,000	103,702,000	
平成18年度第1回千葉県公募公債	200,000,000	213,416,000	
平成18年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	105,790,000	
平成19年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	105,596,000	
平成21年度第2回千葉県公募公債	345,000,000	355,387,950	
平成13年度第1回新潟県公募公債	155,000,000	156,212,100	
平成14年度第1回新潟県公募公債	240,000,000	243,326,400	
平成17年度第1回新潟県公募公債	200,000,000	205,788,000	
平成19年度第1回岐阜県公募公債(10年)	200,000,000	212,160,000	
第1回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,805,000	
第2回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,591,000	
第4回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,794,000	
第6回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,280,000	
第7回共同発行市場公募地方債	319,400,000	327,963,114	
第12回共同発行市場公募地方債	437,000,000	449,742,920	
第15回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,691,000	
第20回共同発行市場公募地方債	300,000,000	310,635,000	
第21回共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,615,000	
第22回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,458,000	
第23回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,868,000	
第27回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,987,000	
第29回共同発行市場公募地方債	300,000,000	310,344,000	
第30回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,036,000	
第31回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,976,000	
第32回共同発行市場公募地方債	300,000,000	313,470,000	
第33回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,517,000	
第35回共同発行市場公募地方債	400,000,000	418,380,000	
第36回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,611,000	
第38回共同発行市場公募地方債	200,000,000	213,416,000	
第40回共同発行市場公募地方債	300,000,000	321,969,000	
第46回共同発行市場公募地方債	200,000,000	211,628,000	
第55回共同発行市場公募地方債	200,000,000	212,038,000	
第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,124,000	
第57回共同発行市場公募地方債	300,000,000	313,899,000	
第62回共同発行市場公募地方債	200,000,000	210,112,000	
第64回共同発行市場公募地方債	300,000,000	315,630,000	
第65回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,003,000	
第73回共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,633,000	
第75回共同発行市場公募地方債	900,000,000	931,446,000	
第77回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,164,000	
平成13年度第2回大阪市公募公債	100,000,000	100,366,000	
平成14年度第11回大阪市公募公債	100,000,000	100,804,000	
平成18年度第2回大阪市公募公債	200,000,000	212,292,000	



	平成18年度第3回大阪市公募公債	100,000,000	106,716,000	
	平成18年度第6回大阪市公募公債	300,000,000	318,825,000	
	平成19年度第5回大阪市公募公債	100,000,000	106,255,000	
	平成19年度第10回大阪市公募公債	100,000,000	104,494,000	
	平成21年度第4回大阪市公募公債	300,000,000	306,990,000	
	第1回名古屋市公募公債(20年)	200,000,000	206,648,000	
	第3回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	102,335,000	
	第11回名古屋市公募公債(5年)	300,000,000	305,100,000	
	第12回ひ号名古屋市公募公債	100,000,000	102,991,000	
	第455回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	106,226,000	
	第1回京都市公募公債(30年)	100,000,000	104,291,000	
	第7回京都市公募公債(20年)	100,000,000	103,991,000	
	平成18年度第3回京都市公募公債	200,000,000	212,398,000	
	平成15年度第1回神戸市公募公債	100,000,000	100,470,000	
	平成19年度第10回神戸市公募公債	100,000,000	104,257,000	
	第4回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	102,642,000	
	第9回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	105,413,000	
	第14回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	103,750,000	
	平成17年度第4回横浜市公募公債	200,000,000	208,314,000	
	平成17年度第3回横浜市公募公債	100,000,000	104,374,000	
	平成18年度第4回横浜市公募公債	300,000,000	318,834,000	
	平成18年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	106,191,000	
	平成18年度第3回横浜市公募公債	200,000,000	212,402,000	
	平成20年度第6回横浜市公募公債	200,000,000	205,570,000	
	第22回横浜市公募公債	100,000,000	101,742,000	
	平成13年度第2回札幌市公募公債	200,000,000	201,618,000	
	平成18年度第4回札幌市公募公債	200,000,000	211,428,000	
	第2回川崎市15年公募公債	100,000,000	102,617,000	
	第4回川崎市15年公募公債	100,000,000	106,181,000	
	第19回川崎市公募公債(5年)	100,000,000	102,442,000	
	平成15年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	102,981,000	
	平成19年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	104,231,000	
	平成18年度第4回福岡市公募公債	100,000,000	105,623,000	
	平成18年度第5回福岡市公募公債(5年)	100,000,000	100,807,000	
	平成20年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	103,254,000	
	平成21年度第7回福岡市公募公債	200,000,000	200,040,000	
	平成19年度第1回広島市公募公債	100,000,000	104,881,000	
	平成21年度第1回千葉市公募公債	200,000,000	205,962,000	
	地方債証券 小計	32,332,230,000	33,443,524,195	
特殊債券	第27回韓国産業銀行円貨債券(2007)	100,000,000	101,601,000	
	第1回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	103,792,000	
	第2回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	204,476,000	
	第3回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	210,518,000	
	第5回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,977,000	
	第9回日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,928,000	

第10回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,541,000	
第15回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	105,548,000	
第20回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	105,016,000	
第20回日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,528,000	
第23回政府保証日本政策投資銀行債券	200,000,000	208,006,000	
第24回日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,308,000	
第27回日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,365,000	
第30回日本政策投資銀行債券	100,000,000	105,374,000	
第36回日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,074,000	
第51回日本政策投資銀行債券	100,000,000	105,165,000	
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	150,039,360	
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	208,374,000	
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	304,860,000	
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	165,463,920	
第7回道路債券	100,000,000	111,457,000	
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	104,763,000	
第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,134,000	
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	104,939,000	
第9回道路債券	100,000,000	109,093,000	
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	106,864,000	
第16回道路債券	200,000,000	202,522,000	
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	109,147,140	
第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,376,000	
第21回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,250,000	
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	296,196,000	
第23回道路債券	200,000,000	206,162,000	
第23回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	208,606,000	
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	317,940,000	
第26回道路債券	300,000,000	310,203,000	
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	529,965,000	
第27回道路債券	100,000,000	107,414,000	
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	103,271,000	
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	210,780,000	
第30回道路債券	100,000,000	103,824,000	
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	105,369,000	
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	163,094,940	
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	319,737,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,141,000	
第39回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,263,000	
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	319,686,000	
第40回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,111,000	
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	421,140,000	
第42回道路債券	100,000,000	104,191,000	
第44回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,390,000	
第45回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,694,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	207,068,000	

第48回日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	414,716,000	
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	103,802,000	
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	208,890,000	
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	205,950,000	
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	524,845,000	
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	105,627,000	
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	104,849,000	
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	207,830,000	
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	103,878,000	
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	201,336,000	
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	101,390,000	
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	301,422,000	
第313回政府保証道路債券	200,000,000	203,334,000	
第325回政府保証道路債券	100,000,000	102,663,000	
第327回政府保証道路債券	552,000,000	570,618,960	
第329回政府保証道路債券	300,000,000	311,397,000	
第330回政府保証道路債券	100,000,000	104,522,000	
第335回政府保証道路債券	100,000,000	103,319,000	
第336回政府保証道路債券	200,000,000	206,720,000	
第337回政府保証道路債券	100,000,000	102,993,000	
第338回政府保証道路債券	200,000,000	207,664,000	
第339回政府保証道路債券	100,000,000	103,467,000	
第340回政府保証道路債券	100,000,000	103,621,000	
第341回政府保証道路債券	100,000,000	103,083,000	
第346回政府保証道路債券	301,000,000	311,793,860	
第1回政府保証地方公営企業等金融機構債券	300,000,000	311,907,000	
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券	300,000,000	307,968,000	
第1回公営企業債券(5年)	500,000,000	507,620,000	
第2回地方公営企業等金融機構債券(20年)	100,000,000	102,502,000	
第3回公営企業債券(20年)	100,000,000	93,476,000	
第5回公営企業債券(20年)	100,000,000	104,788,000	
第6回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	101,332,000	
第6回公営企業債券	100,000,000	100,643,000	
第7回政府保証地方公営企業等金融機構債券	500,000,000	510,075,000	
第7回公営企業債券	400,000,000	410,876,000	
第10回公営企業債券	100,000,000	104,182,000	
第11回公営企業債券(20年)	100,000,000	103,484,000	
第12回公営企業債券	100,000,000	103,513,000	
第15回公営企業債券	100,000,000	103,016,000	
第16回公営企業債券(20年)	100,000,000	102,489,000	
第17回公営企業債券	100,000,000	104,152,000	
第17回公営企業債券(20年)	100,000,000	105,995,000	
第18回公営企業債券(20年)	100,000,000	108,271,000	
第20回公営企業債券	100,000,000	106,888,000	
第22回公営企業債券(20年)	100,000,000	104,130,000	
第24回公営企業債券(20年)	200,000,000	206,116,000	

第30回公営企業債券	100,000,000	106,445,000	
第809回政府保証公営企業債券	202,000,000	204,052,320	
第810回政府保証公営企業債券	200,000,000	202,268,000	
第813回政府保証公営企業債券	201,000,000	203,814,000	
第815回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,478,000	
第818回政府保証公営企業債券	102,000,000	103,625,880	
第821回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,488,000	
第823回政府保証公営企業債券	200,000,000	202,090,000	
第824回政府保証公営企業債券	600,000,000	606,402,000	
第825回政府保証公営企業債券	500,000,000	505,430,000	
第826回政府保証公営企業債券	300,000,000	302,637,000	
第827回政府保証公営企業債券	200,000,000	201,300,000	
第829回政府保証公営企業債券	500,000,000	509,270,000	
第833回政府保証公営企業債券	200,000,000	206,194,000	
第834回政府保証公営企業債券	200,000,000	206,340,000	
第836回政府保証公営企業債券	300,000,000	308,049,000	
第838回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,373,000	
第840回政府保証公営企業債券	200,000,000	207,556,000	
第841回政府保証公営企業債券	100,000,000	104,525,000	
第843回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,584,000	
第844回政府保証公営企業債券	400,000,000	416,020,000	
第846回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,334,000	
第847回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,357,000	
第849回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,813,000	
第851回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,074,000	
第852回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,104,000	
第858回政府保証公営企業債券	200,000,000	208,388,000	
第861回政府保証公営企業債券	300,000,000	314,238,000	
第863回政府保証公営企業債券	100,000,000	106,850,000	
第865回政府保証公営企業債券	300,000,000	320,853,000	
第866回政府保証公営企業債券	200,000,000	213,928,000	
第875回政府保証公営企業債券	200,000,000	210,720,000	
第883回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,088,000	
第884回政府保証公営企業債券	300,000,000	309,021,000	
第885回政府保証公営企業債券	200,000,000	209,988,000	
第886回政府保証公営企業債券	200,000,000	211,216,000	
第3回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	101,994,000	
第187回政府保証首都高速道路債券	193,000,000	199,060,200	
第195回政府保証首都高速道路債券	400,000,000	413,340,000	
第197回政府保証首都高速道路債券	300,000,000	311,400,000	
第199回政府保証首都高速道路債券	200,000,000	207,136,000	
第4回阪神高速道路債券	200,000,000	202,312,000	
第17回中小企業債券	100,000,000	100,742,000	
第23回中小企業債券	100,000,000	102,064,000	
第150回政府保証中小企業債券	71,000,000	71,014,910	
第165回政府保証中小企業債券	100,000,000	101,373,000	

第2回日本鉄道建設債券	100,000,000	101,820,000	
第6回国際協力銀行債券	100,000,000	101,365,000	
第10回国際協力銀行債券	300,000,000	308,526,000	
第15回国際協力銀行債券	200,000,000	207,962,000	
第21回国際協力銀行債券	100,000,000	104,044,000	
第27回国際協力銀行債券	100,000,000	105,313,000	
第8回都市再生債券	200,000,000	207,186,000	
第17回政府保証都市再生債券	500,000,000	501,745,000	
第18回政府保証都市再生債券	400,000,000	400,940,000	
第19回都市再生債券	100,000,000	106,385,000	
第27回都市再生債券	300,000,000	304,698,000	
第3回本州四国連絡橋債券	100,000,000	104,733,000	
第7回本州四国連絡橋債券	100,000,000	104,471,000	
第332回東京交通債券	100,000,000	111,108,000	
第342回東京交通債券	100,000,000	108,560,000	
第35回政府保証電源開発債券	600,000,000	604,284,000	
第13回関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,970,000	
第16回関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,692,000	
第38回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	101,498,000	
第51回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	106,160,000	
第14回独立行政法人福祉医療機構債券	200,000,000	212,872,000	
第17回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	106,147,000	
第127回政府保証預金保険機構債券	100,000,000	100,687,000	
第143回政府保証預金保険機構債券	100,000,000	100,971,000	
第153回政府保証預金保険機構債券	100,000,000	101,530,000	
第1回貸付債権担保住宅金融公庫債券	53,680,000	55,118,087	
第1回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	87,802,000	87,814,292	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	120,806,000	124,297,293	
第2回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	90,226,000	90,720,438	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	185,433,000	192,926,347	
第3回貸付債権担保住宅金融公庫債券	32,507,000	33,372,661	
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	45,579,000	46,394,864	
第4回貸付債権担保住宅金融公庫債券	36,236,000	37,043,700	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,259,000	77,683,825	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	198,387,000	203,318,900	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	49,658,000	50,221,618	
第6回貸付債権担保住宅金融公庫債券	79,288,000	81,519,957	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	53,669,000	55,888,749	
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	162,864,000	169,249,897	
第7回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	68,889,000	70,419,024	
第8回貸付債権担保住宅金融公庫債券	40,917,000	41,369,951	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	166,692,000	172,402,867	
第8回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,836,000	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	111,732,000	115,801,279	
第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	73,261,000	76,061,768	
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券	42,806,000	42,616,369	

第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	171,537,000	177,564,810
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	77,128,000	79,326,919
第11回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	77,624,000	79,899,935
第12回貸付債権担保住宅金融公庫債券	48,871,000	49,226,780
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	79,067,000	80,858,658
第14回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	211,026,000
第16回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	162,796,000	165,950,986
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	167,400,000	170,952,228
第19回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	84,121,000	87,135,055
第21回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,589,000
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	173,464,000	181,852,719
第25回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	207,180,000
第26回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	258,333,000	267,222,238
第27回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	87,335,000	89,718,372
第28回貸付債権担保住宅金融公庫債券	62,176,000	62,731,231
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,131,000	92,039,974
第29回貸付債権担保住宅金融公庫債券	65,902,000	66,603,856
第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,552,000	92,165,636
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,617,000	92,597,887
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券	69,034,000	69,161,712
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	70,217,000	70,346,199
第32回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	186,454,000	188,014,619
第33回貸付債権担保住宅金融公庫債券	70,432,000	70,470,737
第34回貸付債権担保住宅金融公庫債券	144,030,000	145,549,516
第35回貸付債権担保住宅金融公庫債券	71,899,000	72,473,473
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,800,000	96,923,734
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	70,187,000	71,335,961
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,091,000	96,779,011
第38回貸付債権担保住宅金融公庫債券	140,440,000	142,871,016
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	70,426,000	71,123,217
第40回貸付債権担保住宅金融公庫債券	138,772,000	141,547,440
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	72,324,000	74,425,735
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	141,026,000	147,582,298
第43回貸付債権担保住宅金融公庫債券	139,534,000	145,556,287
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,443,000	97,885,722
第44回貸付債権担保住宅金融公庫債券	69,557,000	72,457,526
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	198,960,000
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	72,653,000	75,176,965
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	74,407,000	76,380,273
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	149,372,000	154,668,731
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	149,536,000	155,343,978
第3回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	63,246,000	65,096,577
第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,330,000	77,933,404
第5回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	134,732,000	137,402,388
第15回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	159,406,000	162,605,278
第36回国民生活債券	100,000,000	101,589,000

第6回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	103,612,000	
第10回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	107,777,000	
第1回新東京国際空港債券	300,000,000	302,427,000	
第3回新東京国際空港債券	100,000,000	101,852,000	
第4回政府保証新東京国際空港債券	100,000,000	101,852,000	
第5回新東京国際空港債券	100,000,000	103,493,000	
第7回日本学生支援債券	300,000,000	302,370,000	
第3回沖縄振興開発金融公庫債券	200,000,000	206,738,000	
第5回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	102,925,000	
い第682号商工債	300,000,000	303,444,000	
い第687号商工債	200,000,000	203,950,000	
い第703号商工債	200,000,000	205,698,000	
い第711号商工債	100,000,000	101,590,000	
い第712号商工債	100,000,000	101,044,000	
い第675号農林債	100,000,000	100,742,000	
い第679号農林債	200,000,000	202,114,000	
い第681号農林債	100,000,000	101,164,000	
い第682号農林債	200,000,000	202,274,000	
い第684号農林債	100,000,000	101,338,000	
い第687号農林債	100,000,000	101,944,000	
い第690号農林債	400,000,000	406,728,000	
い第695号農林債	200,000,000	203,278,000	
い第696号農林債	500,000,000	511,165,000	
い第697号農林債	200,000,000	205,056,000	
い第698号農林債	100,000,000	102,588,000	
い第704号農林債	200,000,000	204,678,000	
い第707号農林債	100,000,000	102,581,000	
い第708号農林債	300,000,000	305,880,000	
い第712号農林債	300,000,000	303,231,000	
い第713号農林債	100,000,000	100,705,000	
い第714号農林債	400,000,000	404,208,000	
第597回あおぞら債	100,000,000	101,510,000	
第240回信金中金債(5年)	200,000,000	202,328,000	
第243回信金中金債(5年)	100,000,000	100,334,000	
第195回しんきん中金債券	50,000,000	50,008,000	
第203回信金中金債(5年)	100,000,000	100,862,000	
第209回信金中金債(5年)	100,000,000	101,273,000	
第215回信金中金債(5年)	200,000,000	203,988,000	
第216回信金中金債(5年)	200,000,000	203,472,000	
第218回信金中金債(5年)	300,000,000	304,956,000	
第221回信金中金債(5年)	100,000,000	101,705,000	
第225回信金中金債(5年)	500,000,000	511,100,000	
第227回信金中金債(5年)	100,000,000	102,572,000	
第228回信金中金債(5年)	400,000,000	411,068,000	
第229回信金中金債(5年)	300,000,000	308,037,000	
第230回信金中金債(5年)	100,000,000	102,283,000	

	第231回信中金債(5年)	100,000,000	102,605,000	
	第233回信中金債(5年)	500,000,000	513,385,000	
	第236回信中金債(5年)	200,000,000	202,460,000	
	第104号商工債(3年)	500,000,000	503,050,000	
	第108号商工債(3年)	500,000,000	504,145,000	
	第110号商工債(3年)	200,000,000	201,966,000	
	第113号商工債(3年)	300,000,000	302,286,000	
	第2回韓国中小企業銀行	100,000,000	100,776,000	
	第1回政府保証東日本高速道路債券	137,000,000	143,317,070	
	第3回政府保証東日本高速道路債券	100,000,000	106,837,000	
	第5回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,838,000	
	第1回政府保証中日本高速道路債券	250,000,000	261,527,500	
	第1回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	103,185,000	
	第3回政府保証中日本高速道路債券	163,000,000	170,651,220	
	第5回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	210,120,000	
	第6回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	103,946,000	
	第10回政府保証中日本高速道路債券	100,000,000	105,949,000	
	第12回政府保証中日本高速道路債券	103,000,000	109,137,770	
	第14回政府保証中日本高速道路債券	100,000,000	106,555,000	
	第19回政府保証中日本高速道路債券	124,000,000	128,697,120	
	第21回政府保証中日本高速道路債券	200,000,000	209,914,000	
	第25回政府保証中日本高速道路債券	200,000,000	205,234,000	
	第5回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,419,000	
	第8回政府保証西日本高速道路債券	233,000,000	245,474,820	
	第15回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	105,602,000	
	第19回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	101,977,000	
	第5回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	206,276,000	
	第18回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	202,976,000	
	第1回緑資源債券	100,000,000	101,263,000	
	第3回東京地下鉄株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	212,046,000	
	特殊債券 小計	52,225,093,000	53,763,853,957	
社債券	第9回株式会社ポスコ円貨社債(2006)	200,000,000	204,358,000	
	第1回メリルリンチ・アンド・カンパニー・インク	200,000,000	199,146,000	
	第14回メリルリンチ・アンド・カンパニー・インク	100,000,000	100,818,000	
	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	202,478,000	
	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	100,450,000	
	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	102,265,000	
	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	101,712,000	
	第3回ジェイ・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニー	300,000,000	306,450,000	
	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	100,403,000	
	第8回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク	100,000,000	100,834,000	
	第9回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク	100,000,000	103,497,000	
	第10回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク	100,000,000	97,818,000	
	第11回シティグループ・インク円貨社債(2003)	200,000,000	199,516,000	
	第17回シティグループ・インク円貨債券	100,000,000	94,814,000	



第22回シティグループ・インク円貨債券	300,000,000	308,577,000	
第7回ザ・ベアー・スターンズ・カンパニーズ・インク	200,000,000	201,556,000	
第3回バンク・オブ・アメリカ・コーポレーション	200,000,000	203,262,000	
第5回バンク・オブ・アメリカ・コーポレーション	100,000,000	101,060,000	
第6回バンク・オブ・アメリカ・コーポレーション	100,000,000	100,682,000	
第4回バークレイズ・バンク・ピーエルシー円貨社債(2010)	300,000,000	300,399,000	
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	100,203,000	
第4回ウォルマート・ストアーズ・インク円貨社債(2010)	100,000,000	100,311,000	
H S B C 銀行 P L C 第1回円貨社債	200,000,000	202,894,000	
H S B C 銀行 P L C 第2回円貨社債	200,000,000	198,392,000	
第1回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	304,389,000	
第7回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	204,590,000	
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	101,895,000	
第19回味の素株式会社無担保社債	100,000,000	102,680,000	
第4回日本たばこ産業株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	203,938,000	
第1回株式会社三越伊勢丹ホールディングス無担保社債	200,000,000	199,760,000	
第23回王子製紙株式会社無担保社債	100,000,000	100,504,000	
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	100,840,000	
第25回住友化学工業株式会社無担保社債	100,000,000	102,942,000	
第38回住友化学株式会社無担保社債	100,000,000	103,975,000	
第33回三菱化学株式会社無担保社債	200,000,000	211,154,000	
第35回三菱化学株式会社無担保社債	100,000,000	106,032,000	
第35回三井化学株式会社無担保社債	100,000,000	105,686,000	
第26回新日本石油株式会社無担保社債	200,000,000	214,542,000	
第4回株式会社ブリヂストン無担保社債	200,000,000	202,090,000	
第16回住友ゴム工業株式会社無担保社債	100,000,000	106,598,000	
第12回旭硝子株式会社無担保社債	200,000,000	210,318,000	
第30回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	113,805,000	
第48回新日本製鐵株式会社無担保社債	200,000,000	203,190,000	
第49回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	100,875,000	
第55回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	103,894,000	
第47回住友金属工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,802,000	
第52回住友金属工業株式会社無担保社債	100,000,000	102,277,000	
第4回株式会社神戸製鋼所無担保社債	100,000,000	102,486,000	
第46回株式会社神戸製鋼所無担保社債	100,000,000	105,126,000	
第9回ジェイエフイーホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,692,000	
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	102,073,000	
第11回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	101,394,000	
第15回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	104,122,000	
第18回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	106,107,000	
第7回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	101,993,000	
第12回株式会社日立製作所無担保社債	200,000,000	201,048,000	
第50回株式会社東芝無担保社債	100,000,000	99,827,000	
第38回日本電気株式会社無担保社債	100,000,000	102,309,000	
第6回パナソニック株式会社無担保社債	300,000,000	302,664,000	
第7回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	205,264,000	

第21回シャープ株式会社無担保社債	100,000,000	100,924,000	
第24回シャープ株式会社無担保社債	200,000,000	201,760,000	
第12回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	100,708,000	
第21回ソニー株式会社無担保社債	200,000,000	201,414,000	
第22回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	102,425,000	
第26回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	105,495,000	
第20回三洋電機株式会社無担保社債	200,000,000	209,244,000	
第5回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	102,456,000	
第20回三菱重工工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,703,000	
第22回三菱重工工業株式会社無担保社債	100,000,000	106,410,000	
第7回トヨタ自動車株式会社無担保社債	400,000,000	409,340,000	
第9回トヨタ自動車株式会社無担保社債	300,000,000	304,839,000	
第5回アイシン精機株式会社無担保社債	100,000,000	102,610,000	
第3回凸版印刷株式会社無担保社債	100,000,000	102,559,000	
第43回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	106,695,000	
第56回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,051,000	
第57回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	101,191,000	
第63回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	101,467,000	
第70回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	103,540,000	
第61回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	104,475,000	
第63回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	102,831,000	
第23回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,541,000	
第25回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,702,000	
第30回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	104,187,000	
第67回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	104,634,000	
第69回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	105,911,000	
第72回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,243,000	
第32回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	101,036,000	
第38回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	98,635,000	
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	104,823,000	
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	302,610,000	
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	202,150,000	
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	203,680,000	
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	213,878,000	
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	105,207,000	
第15回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	200,000,000	204,910,000	
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	408,976,000	
株式会社東京三菱銀行第8回無担保社債	100,000,000	103,698,000	
第9回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	111,219,000	
第11回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	200,000,000	214,404,000	
株式会社三菱東京UFJ銀行第12回無担保社債	200,000,000	212,684,000	
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	300,000,000	290,679,000	
第56回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	101,709,000	
第72回株式会社東京三菱銀行無担保社債	100,000,000	102,877,000	
第85回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	100,928,000	
第90回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	101,811,000	

第92回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	400,000,000	407,792,000	
第95回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	101,589,000	
第100回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	200,000,000	204,670,000	
第103回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	200,000,000	201,720,000	
第104回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	102,641,000	
第105回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	100,435,000	
第110回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	101,399,000	
第4回株式会社りそな銀行無担保社債	200,000,000	216,990,000	
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	101,553,000	
第11回株式会社静岡銀行無担保社債	100,000,000	102,594,000	
第7回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	104,339,000	
第8回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	99,920,000	
第11回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	98,621,000	
中央三井信託銀行第3回無担保社債	100,000,000	104,745,000	
第4回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	100,558,000	
第5回株式会社三井住友銀行無担保社債	300,000,000	308,742,000	
第7回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	104,164,000	
第8回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	104,553,000	
第9回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	104,150,000	
第20回株式会社三井住友銀行無担保社債	300,000,000	316,296,000	
第37回株式会社三井住友銀行無担保社債	200,000,000	201,658,000	
第39回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	101,227,000	
第42回株式会社三井住友銀行無担保社債	200,000,000	202,980,000	
第43回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	101,772,000	
第45回株式会社三井住友銀行無担保社債	200,000,000	204,488,000	
第8回株式会社みずほ銀行無担保社債	200,000,000	209,394,000	
第9回株式会社みずほ銀行無担保社債	100,000,000	101,196,000	
第10回株式会社みずほ銀行無担保社債	100,000,000	104,675,000	
第32回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	101,822,000	
第16回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	200,000,000	198,640,000	
第11回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,586,000	
第17回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	103,385,000	
第21回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	106,444,000	
第26回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	101,355,000	
第34回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	201,606,000	
第36回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,366,000	
第111回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,969,000	
第113回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	101,797,000	
第115回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	101,133,000	
第118回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	103,584,000	
第129回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	103,985,000	
第130回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	105,848,000	
第6回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	101,122,000	
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	101,425,000	
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	202,170,000	
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	101,805,000	

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	508,745,000	
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	312,576,000	
第28回三井不動産株式会社無担保社債	300,000,000	309,042,000	
第58回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	109,026,000	
第65回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	94,933,000	
第66回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	100,836,000	
第87回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	104,731,000	
第53回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,868,000	
第58回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,648,000	
第63回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	106,872,000	
第28回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	104,029,000	
第41回小田急電鉄株式会社無担保社債	200,000,000	214,894,000	
第42回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	106,245,000	
第2回東日本旅客鉄道株式会社社債	200,000,000	233,972,000	
第7回東日本旅客鉄道株式会社社債	200,000,000	229,878,000	
第9回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	113,963,000	
第15回東日本旅客鉄道株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	111,368,000	
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	200,000,000	216,696,000	
第34回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	109,202,000	
第52回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	104,066,000	
第3回西日本旅客鉄道株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	229,918,000	
第5回西日本旅客鉄道株式会社社債	200,000,000	226,766,000	
第3回東海旅客鉄道株式会社普通社債	100,000,000	112,043,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	106,672,000	
第11回東海旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	95,147,000	
第19回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	203,062,000	
第21回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	104,906,000	
第28回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	106,079,000	
第41回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	100,830,000	
第42回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	205,716,000	
第40回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	98,186,000	
第48回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	103,671,000	
第51回日本電信電話株式会社電信電話債券	300,000,000	320,325,000	
第53回日本電信電話株式会社電信電話債券	300,000,000	310,650,000	
第56回日本電信電話株式会社電信電話債券	300,000,000	304,620,000	
第6回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	102,496,000	
第8回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	102,421,000	
第15回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	104,765,000	
第15回株式会社エヌ・ティ・ティ・ドコモ無担保社債	200,000,000	211,894,000	
第425回東京電力株式会社社債	100,000,000	115,182,000	
第506回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	100,686,000	
第514回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,656,000	
第515回東京電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	206,528,000	
第516回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,293,000	
第522回東京電力株式会社社債(一般担保付)	300,000,000	320,955,000	
第524回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	105,603,000	

第526回東京電力株式会社社債(一般担保付)	300,000,000	316,443,000	
第527回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,224,000	
第528回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	105,366,000	
第532回東京電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	210,406,000	
第533回東京電力株式会社社債(一般担保付)	500,000,000	517,915,000	
第535回東京電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	210,530,000	
第537回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	104,236,000	
第541回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	101,603,000	
第544回東京電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	212,848,000	
第545回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	105,468,000	
第546回東京電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	206,624,000	
第547回東京電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	210,338,000	
第552回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,147,000	
第406回中部電力株式会社社債	200,000,000	226,590,000	
第408回中部電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	114,336,000	
第409回中部電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	232,906,000	
第469回中部電力株式会社社債	100,000,000	103,286,000	
第471回中部電力株式会社社債	300,000,000	308,631,000	
第474回中部電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	104,899,000	
第475回中部電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	213,396,000	
第486回中部電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	208,558,000	
第432回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	101,566,000	
第433回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,693,000	
第440回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,984,000	
第449回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	107,521,000	
第451回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	105,868,000	
第453回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	105,896,000	
第459回関西電力株式会社社債(一般担保付)	300,000,000	305,061,000	
第465回関西電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	207,212,000	
第466回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,556,000	
第467回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	104,060,000	
第472回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	104,819,000	
第306回中国電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	231,074,000	
第310回中国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	114,403,000	
第340回中国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	100,593,000	
第349回中国電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	211,828,000	
第273回北陸電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,785,000	
第279回北陸電力株式会社社債(一般担保付)	30,000,000	31,254,900	
第284回北陸電力株式会社社債(一般担保付)	400,000,000	414,460,000	
第286回北陸電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	106,030,000	
第368回東北電力株式会社社債(一般担保付)	450,000,000	510,970,500	
第372回東北電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	233,654,000	
第376回東北電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	114,126,000	
第408回東北電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	101,477,000	
第431回東北電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	107,090,000	
第444回東北電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,104,000	

第445回東北電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	104,833,000	
第229回四国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	115,809,000	
第245回四国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	105,186,000	
第253回四国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	92,956,000	
第268回四国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	104,071,000	
第346回九州電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	106,408,000	
第372回九州電力株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	201,630,000	
第380回九州電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	104,185,000	
第384回九州電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	103,577,000	
第394回九州電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	105,914,000	
第400回九州電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	103,824,000	
第405回九州電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	104,833,000	
第408回九州電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	103,501,000	
第258回北海道電力株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	233,422,000	
第299回北海道電力株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	204,180,000	
第300回北海道電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	104,225,000	
第11回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	102,270,000	
第14回電源開発株式会社無担保社債	200,000,000	207,834,000	
第19回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	106,259,000	
第21回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	104,619,000	
第23回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	105,287,000	
第17回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	221,982,000	
第25回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	103,472,000	
第18回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	197,412,000	
第22回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	105,519,000	
第27回東邦瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	94,476,000	
第30回東邦瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	106,771,000	
第20回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	500,000,000	508,270,000	
社債券 小計	40,280,000,000	41,817,168,400	
合計		502,036,214,832	

## 「外国株式インデックス・マザーファンド」の状況

## (1) 貸借対照表

対象年月日	(平成22年2月18日現在)	(平成23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	449,031,802	730,510,210
コール・ローン	1,192,585,849	405,797,597
株式	232,698,461,859	242,196,727,337
新株予約権証券	162,927	-
投資証券	3,725,678,832	3,938,342,659
派生商品評価勘定	38,611,709	43,217,265
未収入金	429,523,927	9,174,377
未収配当金	391,027,598	389,408,578
未収利息	1,633	555
差入委託証拠金	558,407,050	1,391,194,614
流動資産合計	239,483,493,186	249,104,373,192
資産合計	239,483,493,186	249,104,373,192
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,628,558	-
未払金	1,046,642,058	-
未払解約金	3,466,000	240,095,516
流動負債合計	1,052,736,616	240,095,516
負債合計	1,052,736,616	240,095,516
純資産の部		
元本等		
1 元本		
元本	194,883,523,384	180,122,951,127
2 剰余金		
剰余金又は欠損金( )	43,547,233,186	68,741,326,549
元本等合計	238,430,756,570	248,864,277,676
純資産合計	238,430,756,570	248,864,277,676
負債・純資産合計	239,483,493,186	249,104,373,192

(注) 「外国株式インデックス・マザーファンド」は、毎年11月30日（ただし、休業日の場合は翌営業日）に決算を行います。上記の貸借対照表は平成22年2月18日ならびに平成23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21年2月19日 至平成22年2月18日	自平成22年2月19日 至平成23年2月18日
1. 有価証券の評価基準及び 評価方法	株式、新株予約権証券および投資証券 (売買目的有価証券) 移動平均法に基づき、原則として時価で 評価しております。時価評価にあたって は、取引所もしくは店頭市場における最 終相場（最終相場のないものについて は、それに準じる価額）または金融商品 取引業者等から提示される気配相場に基 づいて評価しております。 なお売買停止措置がとられている銘柄 について、必要であると判断された場合 は、委託者としての忠実義務に基づき合 理的事由をもって時価と認める評価額に より評価しております。	株式、新株予約権証券および投資証券 (売買目的有価証券) 同左
2. デリバティブの評価基準 及び評価方法	(1)先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価 しております。時価評価にあたっては、原 則として、計算日に知りうる直近の日の 主たる取引所の発表する清算値段または 最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価 しております。時価評価にあたっては、原 則として、わが国における対顧客先物相 場の仲値によっております。	(1)先物取引 同左 (2)為替予約取引 同左
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日に おいて、その金額が確定しているもの については当該金額、未だ確定してい ない場合には入金日基準で計上して おります。	受取配当金の計上基準 同左
4. その他財務諸表作成のた めの基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」 第60条および第61条に基づいて処理 しております。	外貨建資産等の会計処理 同左

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成22年2月18日現在)	(平成23年2月18日現在)
1. 受益権総数	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	平成23年2月18日現在における受益権の 総数 180,122,951,127口
2. 1単位当たり純資産額	1.2235円 (1万口 = 12,235円)	1.3816円 (1万口 = 13,816円)



（金融商品に関する注記）

（追加情報）

当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）および「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

・金融商品の状況に関する事項

項目	自平成22年2月19日 至平成23年2月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、新株予約権証券および投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。当ファンドにおけるデリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、先物取引および為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。リスクを管理する部署では、各種リスクごとに定められた頻度で、測定項目が上下限值（リミットあるいは注意レベル）内に収まっているかどうかのモニタリングを行っております。上下限値を越えていることが発見された場合は、原則として速やかに修正を行うよう、リスク管理を行う部署から関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われます。また、是正勧告あるいは報告を受けた関連運用グループでは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、リスク管理を行う部署は、上下限値に抵触した事実ならびにその後の対処結果あるいは関連運用グループの対処方針の決定に関し、必要に応じて、リスク管理を行う部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告する体制となっております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	自平成22年2月19日 至平成23年2月18日
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（株式、新株予約権証券および投資証券） 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (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。 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。 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」）。 金利先渡取引および為替先渡取引。 外国為替の売買の予約取引。
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。
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。
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。
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。
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。

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

（平成23年2月18日現在）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	SP500	1,642,391,084 (19,700,025米ドル)	( )	1,672,985,790 (20,067,000米ドル)	30,594,706 (366,975米ドル)
	DJ EUR	652,206,270 (5,747,830ユーロ)	( )	660,792,545 (5,823,500ユーロ)	8,586,275 (75,670ユーロ)
	FTSE	331,169,515 (2,455,290英ポンド)	( )	335,205,799 (2,485,215英ポンド)	4,036,284 (29,925英ポンド)
	買建 合計	2,625,766,869		2,668,984,134	43,217,265

（注）1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については以下のように評価しております。

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

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

（自 平成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。

（自 平成22年2月19日 至 平成23年2月18日）

該当事項はありません。

(その他の注記)

(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



(平成23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	194,883,523,384円
同期中における追加設定元本額	17,122,641,225円
同期中における一部解約元本額	31,883,213,482円
平成23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	2,963,262,287円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	145,975,261円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	671,128,573円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	427,007,035円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	8,905,867円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	1,761,962円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	902,488円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	2,659,006円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	1,143,736円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	553,436円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	1,619,543円
外国株式指数ファンド	151,743,992円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	37,615,974,714円
バランスファンドVA(安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	356,959,299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 >	21,915,894,418円
SMAM・バランスファンドVA25 < 適格機関投資家専用 >	9,959,556,009円
SMAM・バランスファンドVA37.5 < 適格機関投資家専用 >	6,067,790,889円
SMAM・バランスファンドVA50 < 適格機関投資家専用 >	23,714,133,222円
SMAM・バランスファンドVL30 < 適格機関投資家限定 >	77,297,467円
SMAM・バランスファンドVL50 < 適格機関投資家限定 >	332,125,812円
世界6資産バランスファンドVA < 適格機関投資家限定 >	69,123,065円
SMAM・バランスファンドVA75 < 適格機関投資家専用 >	2,588,308,795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 >	163,881,910円
SMAM・インデックス・バランスVA25 < 適格機関投資家専用 >	625,034,828円
SMAM・インデックス・バランスVA50 < 適格機関投資家専用 >	3,018,322,449円
SMAM・バランスファンドVA40 < 適格機関投資家専用 >	4,212,450,625円
SMAM・バランスファンドVA35 < 適格機関投資家専用 >	7,572,681,864円
SMAM・バランスVA株40T < 適格機関投資家限定 >	1,155,501,594円
三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	3,311,152,348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)	9,325,870,924円
SMAM・グローバルバランス40VA < 適格機関投資家限定 >	589,157,259円
SMAM・バランスファンドVA20 < 適格機関投資家専用 >	2,492,088,402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)	39,088,917,056円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A < 適格機関投資家専用 >	92,113,576円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A < 適格機関投資家専用 >	54,396,357円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A < 適格機関投資家専用 >	22,809,086円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L < 適格機関投資家専用 >	253,999,049円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L < 適格機関投資家専用 >	571,249,877円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T < 適格機関投資家専用 >	499,497,047円
合計	180,122,951,127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	15,280	57.35	876,308.00	
ANADARKO PETROLEUM CORP	62,414	81.30	5,074,258.20	
APACHE CORPORATION	48,467	120.62	5,846,089.54	
ARCH COAL INC	20,777	33.99	706,210.23	
BAKER HUGHES INC	54,973	71.19	3,913,527.87	
CABOT OIL & GAS CORPORATION	12,620	40.79	514,769.80	
CAMERON INTERNATIONAL CORP	30,612	59.62	1,825,087.44	
CHESAPEAKE ENERGY CORPORATION	81,815	30.49	2,494,539.35	
CHEVRON CORPORATION	254,907	97.17	24,769,313.19	
CIMAREX ENERGY CO	10,800	114.00	1,231,200.00	
CONCHO RESOURCES INC	11,000	105.23	1,157,530.00	
CONOCOPHILLIPS	178,496	75.52	13,480,017.92	
CONSOL ENERGY INC	27,962	46.79	1,308,341.98	
DENBURY RESOURCES INC	47,454	23.06	1,094,289.24	
DEVON ENERGY CORPORATION	52,594	87.12	4,581,989.28	
DIAMOND OFFSHORE DRILLING,INC.	9,156	75.97	695,581.32	
EL PASO CORPORATION	90,220	18.00	1,623,960.00	
EOG RESOURCES INC	32,308	104.22	3,367,139.76	
EXXON MOBIL CORPORATION	645,793	83.88	54,169,116.84	
FMC TECHNOLOGIES INC	15,415	92.24	1,421,879.60	
HALLIBURTON CO	115,181	48.43	5,578,215.83	
HELMERICH & PAYNE INC	13,800	61.58	849,804.00	
HESS CORPORATION	38,637	84.13	3,250,530.81	
KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	10,447	64.86	677,592.42	
MARATHON OIL CORP	91,323	50.08	4,573,455.84	
MURPHY OIL CORPORATION	23,697	72.67	1,722,060.99	
NABORS INDUSTRIES LTD	35,784	27.68	990,501.12	
NATIONAL-OILWELL VARCO INC.	52,953	81.40	4,310,374.20	
NEWFIELD EXPLORATION CO	17,287	69.20	1,196,260.40	
NOBLE CORPORATION	32,318	41.33	1,335,702.94	
NOBLE ENERGY INC	21,811	87.75	1,913,915.25	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	102,842	105.85	10,885,825.70	
PEABODY ENERGY CORP	33,853	66.04	2,235,652.12	
PETROHAWK ENERGY CORP	37,322	20.58	768,086.76	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	14,615	100.54	1,469,392.10	
PLAINS EXPLORATION & PRODUCTION COMPANY	17,100	38.91	665,361.00	
PRIDE INTERNATIONAL INC	23,200	40.55	940,760.00	
RANGE RESOURCES CORPORATION	20,071	48.69	977,256.99	
ROWAN COMPANIES INC	15,145	40.11	607,465.95	

SCHLUMBERGER LTD	173,434	94.37	16,366,966.58	
SOUTHWESTERN ENERGY COMPANY	43,761	36.19	1,583,710.59	
SPECTRA ENERGY CORPORATION	83,663	26.46	2,213,722.98	
SUNOCO INC	14,794	42.92	634,958.48	
ULTRA PETROLEUM CORP	19,548	47.46	927,748.08	
VALERO ENERGY CORP	71,795	30.29	2,174,670.55	
WEATHERFORD INTL LTD	92,945	26.08	2,424,005.60	
WILLIAMS COS INC	74,611	30.08	2,244,298.88	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	26,565	93.94	2,495,516.10	
AIRGAS INC	9,700	64.15	622,255.00	
ALCOA INC	129,995	17.52	2,277,512.40	
ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	10,880	69.16	752,460.80	
BALL CORPORATION	11,403	36.90	420,770.70	
BALL CORPORATION-NEW	11,403	36.90	420,770.70	
CELANESE CORPORATION	19,323	44.97	868,955.31	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	9,020	147.81	1,333,246.20	
CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	17,570	99.52	1,748,566.40	
CROWN HOLDINGS INC	21,100	37.98	801,378.00	
DOW CHEMICAL	146,784	38.76	5,689,347.84	
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	115,308	55.59	6,409,971.72	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	8,927	96.27	859,402.29	
ECOLAB INC	28,997	47.12	1,366,338.64	
FMC CORPORATION	8,200	81.77	670,514.00	
FREEPORT-MCMORAN COPPER-B	119,882	55.24	6,622,281.68	
INTERNATIONAL PAPER CO	52,575	30.29	1,592,496.75	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	10,392	57.10	593,383.20	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,943	92.08	547,231.44	
MEADWESTVACO CORP	20,415	30.76	627,965.40	
MONSANTO CO	68,257	74.15	5,061,256.55	
MOSAIC CO/THE	19,443	86.75	1,686,680.25	
NEWMONT MINING CORP	62,488	58.96	3,684,292.48	
NUCOR CORP	40,506	48.88	1,979,933.28	
OWENS-ILLINOIS INC	21,339	31.34	668,764.26	
PPG INDUSTRIES INC	21,223	89.45	1,898,397.35	
PRAXAIR INC	38,370	98.32	3,772,538.40	
SEALED AIR CORP	21,138	28.31	598,416.78	
SIGMA-ALDRICH	15,456	63.70	984,547.20	
THE LUBRIZOL CORPORATION	8,900	114.59	1,019,851.00	
UNITED STATES STEEL CORPORATION	18,809	63.64	1,197,004.76	
VULCAN MATERIALS CO	16,753	46.98	787,055.94	
WEYERHAEUSER CO	69,099	25.16	1,738,530.84	
3M COMPANY	86,049	92.73	7,979,323.77	
AGCO CORP	12,100	56.77	686,917.00	
AMETEK INC	20,640	42.94	886,281.60	
BOEING CO	88,336	72.24	6,381,392.64	
BUCYRUS INTERNATIONAL INC-A	9,900	90.95	900,405.00	

CATERPILLAR INC	79,640	103.36	8,231,590.40	
COOPER INDUSTRIES PLC-CL-A	20,552	65.11	1,338,140.72	
CUMMINS INC	23,848	111.82	2,666,683.36	
DANAHER CORP	70,584	51.15	3,610,371.60	
DEERE & CO	53,524	95.26	5,098,696.24	
DOVER CORP	23,074	67.34	1,553,803.16	
EATON CORP	20,376	110.87	2,259,087.12	
EMERSON ELECTRIC CO	95,438	61.66	5,884,707.08	
FASTENAL COMPANY	17,234	63.09	1,087,293.06	
FIRST SOLAR,INC.	7,220	170.80	1,233,176.00	
FLOWERVE CORPORATION	6,919	130.74	904,590.06	
FLUOR CORP	23,036	75.63	1,742,212.68	
FOSTER WHEELER AG	15,796	39.63	625,995.48	
GENERAL DYNAMICS CORP	40,671	77.30	3,143,868.30	
GENERAL ELECTRIC CO	1,356,243	21.52	29,186,349.36	
GOODRICH CORPORATION	15,937	90.79	1,446,920.23	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	92,562	57.36	5,309,356.32	
ILLINOIS TOOL WORKS	54,060	54.94	2,970,056.40	
INGERSOLL-RAND PLC	41,203	46.79	1,927,888.37	
ITT CORPORATION	21,466	59.09	1,268,425.94	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	15,890	52.01	826,438.90	
JOY GLOBAL INC	13,059	98.07	1,280,696.13	
KBR,INC.	18,785	35.06	658,602.10	
L-3 COMMUNICATIONS HLDGS INC	15,010	80.35	1,206,053.50	
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	39,047	81.90	3,197,949.30	
MASCO CORP	43,766	13.20	577,711.20	
NORTHROP GRUMMAN CORP	35,258	68.90	2,429,276.20	
PACCAR INC	42,316	52.41	2,217,781.56	
PALL CORPORATION	15,476	55.50	858,918.00	
PARKER HANNIFIN CORPORATIOM	20,529	91.65	1,881,482.85	
PENTAIR INC	12,050	38.54	464,407.00	
PRECISION CASTPARTS CORP	17,800	149.10	2,653,980.00	
QUANTA SERVICES INC	25,859	24.03	621,391.77	
RAYTHEON COMPANY	46,881	51.50	2,414,371.50	
ROCKWELL AUTOMATION INC	18,498	89.81	1,661,305.38	
ROCKWELL COLLINS INC.	19,964	65.59	1,309,438.76	
ROPER INDUSTRIES INC	12,300	84.59	1,040,457.00	
SPX CORP	5,868	84.00	492,912.00	
TEXTRON INC	34,318	28.32	971,885.76	
TYCO INTERNATIONAL LTD	63,670	46.79	2,979,119.30	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	111,933	84.54	9,462,815.82	
URS CORPORATION	10,900	47.41	516,769.00	
WW GRAINGER INC	7,600	134.00	1,018,400.00	
AVERY DENNISON CORP	13,262	41.08	544,802.96	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	4,000	265.54	1,062,160.00	
CINTAS CORP	16,913	29.32	495,889.16	

DUN & BRADSTREET CORP	6,801	84.73	576,248.73	
EQUIFAX INC	15,542	36.09	560,910.78	
IHS INC-CLASS A	5,400	84.35	455,490.00	
IRON MOUNTAIN INC	22,122	26.97	596,630.34	
MANPOWER INC	10,692	67.20	718,502.40	
NETFLIX INC	5,780	235.63	1,361,941.40	
PITNEY BOWES INC	25,773	25.96	669,067.08	
REPUBLIC SERVICES INC	49,094	29.99	1,472,329.06	
ROBERT HALF INTL INC	17,091	32.51	555,628.41	
RR DONNELLEY & SONS CO	25,698	19.27	495,200.46	
STERICYCLE,INC.	10,400	86.28	897,312.00	
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	14,200	33.43	474,706.00	
WASTE MANAGEMENT INC	57,224	37.98	2,173,367.52	
C.H.ROBINSON WORLDWIDE,INC.	21,160	75.01	1,587,211.60	
CSX CORP	48,306	74.91	3,618,602.46	
DELTA AIR LINES INC	28,000	11.65	326,200.00	
EXPEDITORS INTL WASH INC	27,178	54.45	1,479,842.10	
FEDEX CORP	38,141	97.47	3,717,603.27	
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	11,300	42.89	484,657.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	46,577	65.20	3,036,820.40	
SOUTHWEST AIRLINES	24,000	12.50	300,000.00	
UNION PACIFIC CORP	62,960	97.82	6,158,747.20	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	11,000	27.45	301,950.00	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	92,186	76.33	7,036,557.38	
AUTOLIV INC	11,200	75.86	849,632.00	
BORGWARNER INC	13,900	80.01	1,112,139.00	
FORD MOTOR COMPANY	386,189	15.97	6,167,438.33	
GENERAL MOTORS CO	65,600	36.37	2,385,872.00	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	27,034	14.90	402,806.60	
HARLEY-DAVIDSON INC	28,986	42.41	1,229,296.26	
JOHNSON CONTROLS INC	85,583	42.07	3,600,476.81	
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	13,500	58.82	794,070.00	
COACH INC	38,345	56.65	2,172,244.25	
D.R.HORTON INC	33,948	12.69	430,800.12	
FORTUNE BRANDS INC	18,802	62.17	1,168,920.34	
GARMIN LTD	15,016	33.43	501,984.88	
HASBRO INC	16,714	45.61	762,325.54	
LEGGETT & PLATT INC	17,215	23.50	404,552.50	
MATTEL INC	45,782	25.85	1,183,464.70	
MOHAWK INDUSTRIES INC	6,883	59.04	406,372.32	
NEWELL RUBBERMAID INC	34,244	20.10	688,304.40	
NIKE INC -CL B	47,202	86.04	4,061,260.08	
POLO RALPH LAUREN CORPORATION	8,438	124.92	1,054,074.96	
PULTE GROUP INC	43,751	7.76	339,507.76	
STANLEY BLACK & DECKER INC	20,028	74.95	1,501,098.60	
TOLL BROTHERS INC	16,939	21.90	370,964.10	

VF CORP	11,065	87.61	969,404.65	
WHIRLPOOL CORP	9,384	83.28	781,499.52	
APOLLO GROUP INC-CL A	17,373	43.64	758,157.72	
CARNIVAL CORP	57,988	45.96	2,665,128.48	
DARDEN RESTAURANTS INC	17,140	49.94	855,971.60	
DEVRY INC	8,600	53.75	462,250.00	
H&R BLOCK INC	41,192	14.22	585,750.24	
INTL GAME TECHNOLOGY	37,160	16.98	630,976.80	
LAS VEGAS SANDS CORP	42,300	48.91	2,068,893.00	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	36,837	40.96	1,508,843.52	
MCDONALD'S CORPORATION	135,038	75.98	10,260,187.24	
MGM MIRAGE	44,000	14.94	657,360.00	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	17,471	47.19	824,456.49	
STARBUCKS CORP	94,157	33.50	3,154,259.50	
STARWOOD HOTELS & RESORTS	23,964	64.58	1,547,595.12	
WYNN RESORTS LTD	10,421	128.46	1,338,681.66	
YUM! BRANDS INC	59,204	51.38	3,041,901.52	
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	32,320	37.46	1,210,707.20	
CBS CORP-CL B	80,893	22.35	1,807,958.55	
COMCAST CORP-CL A	263,089	25.22	6,635,104.58	
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	90,989	23.90	2,174,637.10	
DIRECTV-CLASS A	109,710	44.29	4,859,055.90	
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-A	16,630	43.31	720,245.30	
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-C	18,230	38.63	704,224.90	
DISH NETWORK CORP.	25,464	23.46	597,385.44	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	62,125	12.55	779,668.75	
LIBERTY GLOBAL INC-A	15,740	42.34	666,431.60	
LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	12,963	40.57	525,908.91	
MCGRAW-HILL COMPANIES INC	40,251	38.23	1,538,795.73	
NEWS CORP-CL A	232,722	17.43	4,056,344.46	
NEWS CORPORATION-CLASS B	55,331	18.48	1,022,516.88	
OMNICOM GROUP	38,769	50.20	1,946,203.80	
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	11,100	53.17	590,187.00	
THE WALT DISNEY CO.	230,329	43.70	10,065,377.30	
TIME WARNER CABLE,INC.	45,000	72.05	3,242,250.00	
TIME WARNER INC	141,650	37.68	5,337,372.00	
VIACOM INC-CLASS B	70,588	45.65	3,222,342.20	
VIRGIN MEDIA INC	40,577	28.15	1,142,242.55	
WASHINGTON POST CO B	817	446.84	365,068.28	
ABERCROMBIE & FITCH CO -CL A	11,771	58.67	690,604.57	
ADVANCE AUTO PARTS	11,038	62.81	693,296.78	
AMAZON.COM INC	45,232	187.76	8,492,760.32	
AMERICAN EAGLE OUTFITTERS INC	24,500	15.97	391,265.00	
AUTOZONE INC	3,508	255.57	896,539.56	
BED BATH & BEYOND INC	32,949	49.44	1,628,998.56	
BEST BUY COMPANY INC	45,426	32.86	1,492,698.36	

CARMAX INC	28,322	36.42	1,031,487.24	
DOLLAR GENERAL CORP	12,000	29.52	354,240.00	
DOLLAR TREE INC	15,550	52.35	814,042.50	
EXPEDIA INC	26,283	21.01	552,205.83	
FAMILY DOLLAR STORES	16,736	52.67	881,485.12	
GAMESTOP CORP-CL A	18,147	20.11	364,936.17	
GAP INC/THE	58,371	23.03	1,344,284.13	
GENUINE PARTS CO	19,884	54.13	1,076,320.92	
HOME DEPOT INC	212,566	38.18	8,115,769.88	
J.C.PENNEY CO INC (HLDG CO)	27,397	36.94	1,012,045.18	
KOHL'S CORP	37,557	53.54	2,010,801.78	
LIBERTY MEDIA-INTERACTIVE A	72,707	17.44	1,268,010.08	
LIMITED BRANDS	34,993	33.15	1,160,017.95	
LOWE'S COMPANIES INC	176,525	26.14	4,614,363.50	
MACY'S INC	53,048	24.06	1,276,334.88	
NORDSTROM INC	21,935	46.48	1,019,538.80	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC NEW	17,800	55.25	983,450.00	
PETSMART INC	15,091	41.71	629,445.61	
PRICELINE.COM INC	6,112	455.27	2,782,610.24	
ROSS STORES INC	14,936	71.14	1,062,547.04	
SEARS HOLDINGS CORP	5,310	92.87	493,139.70	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	11,290	85.12	961,004.80	
STAPLES INC	93,776	21.51	2,017,121.76	
TARGET CORP	86,919	53.15	4,619,744.85	
TIFFANY & CO	16,407	63.86	1,047,751.02	
TJX COMPANIES INC	52,595	49.20	2,587,674.00	
URBAN OUTFITTERS,INC.	16,700	37.86	632,262.00	
COSTCO WHOLESALE CORP	55,204	74.84	4,131,467.36	
CVS CAREMARK CORPORATION	172,453	32.76	5,649,560.28	
KROGER CO	77,569	23.09	1,791,068.21	
SAFEWAY INC	48,149	22.45	1,080,945.05	
SYSCO CORP	75,485	28.39	2,143,019.15	
WAL-MART STORES INC	258,740	54.75	14,166,015.00	
WALGREEN CO	123,706	42.61	5,271,112.66	
WHOLE FOODS MARKET INC	18,000	60.46	1,088,280.00	
ALTRIA GROUP INC	265,056	24.73	6,554,834.88	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	80,692	37.48	3,024,336.16	
BROWN-FORMAN CORPORATION	10,115	67.70	684,785.50	
BUNGE LIMITED	17,438	74.22	1,294,248.36	
CAMPBELL SOUP CO	25,579	34.94	893,730.26	
COCA-COLA CO/THE	263,787	64.55	17,027,450.85	
COCA-COLA ENTERPRISES INC	44,704	26.97	1,205,666.88	
CONAGRA FOODS INC	55,563	22.80	1,266,836.40	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	24,323	21.06	512,242.38	
DR.PEPPER SNAPPLE GROUP,INC	29,737	36.20	1,076,479.40	
GENERAL MILLS INC	81,114	36.11	2,929,026.54	

HANSEN NATURAL CORPORATION	9,600	57.41	551,136.00	
HJ HEINZ CO	40,819	48.36	1,974,006.84	
HORMEL FOODS CORPORATION	8,700	26.52	230,724.00	
HORMEL FOODS CORPORATION NEW	8,700	26.52	230,724.00	
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	15,500	66.65	1,033,075.00	
KELLOGG CO	33,634	53.00	1,782,602.00	
KRAFT FOODS INC-A	222,011	30.84	6,846,819.24	
LORILLARD INC	19,120	79.19	1,514,112.80	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	14,830	45.97	681,735.10	
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	26,100	61.21	1,597,581.00	
MOLSON COORS BREWING COMPANY	19,925	45.91	914,756.75	
PEPSICO INC	201,474	64.70	13,035,367.80	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	232,352	60.84	14,136,295.68	
RALCORP HOLDINGS INC	7,450	65.01	484,324.50	
REYNOLDS AMERICAN INC	43,544	34.38	1,497,042.72	
SARA LEE CORP	80,711	16.96	1,368,858.56	
THE HERSHEY COMPANY	20,410	50.08	1,022,132.80	
TYSON FOODS INC-CL A	36,900	18.74	691,506.00	
AVON PRODUCTS INC	54,613	28.32	1,546,640.16	
CHURCH & DWIGHT CO INC	9,200	73.84	679,328.00	
CLOROX COMPANY	18,061	67.38	1,216,950.18	
COLGATE-PALMOLIVE CO	61,485	78.40	4,820,424.00	
ENERGIZER HOLDINGS INC	8,277	69.52	575,417.04	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	14,262	93.76	1,337,205.12	
KIMBERLY-CLARK CORP	51,730	65.37	3,381,590.10	
PROCTER & GAMBLE CO	359,670	64.00	23,018,880.00	
AETNA INC	53,202	38.36	2,040,828.72	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	11,200	93.37	1,045,744.00	
AMERISOURCEBERGEN CORP	36,218	37.43	1,355,639.74	
BARD(C.R.) INC	12,310	98.12	1,207,857.20	
BAXTER INTERNATIONAL INC	74,566	52.55	3,918,443.30	
BECKMAN COULTER INC	8,891	83.00	737,953.00	
BECTON DICKINSON & CO	29,116	80.26	2,336,850.16	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	198,125	7.40	1,466,125.00	
CARDINAL HEALTH INC	44,990	41.86	1,883,281.40	
CAREFUSION CORPORATION	29,445	28.00	824,460.00	
CERNER CORP	8,680	100.09	868,781.20	
CIGNA CORP	34,411	43.52	1,497,566.72	
COVENTRY HEALTH CARE INC	18,113	30.37	550,091.81	
COVIDIEN PLC	63,175	51.09	3,227,610.75	
DAVITA INC	13,008	80.04	1,041,160.32	
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	16,609	36.51	606,394.59	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	14,160	89.15	1,262,364.00	
EXPRESS SCRIPTS INC	65,524	56.77	3,719,797.48	
HENRY SCHEIN INC	11,150	69.29	772,583.50	
HOLOGIC INC	34,680	20.45	709,206.00	

HOSPIRA INC	21,733	54.54	1,185,317.82	
HUMANA INC.	21,043	61.78	1,300,036.54	
INTUITIVE SURGICAL INC	4,949	340.99	1,687,559.51	
LABORATORY CRP OF AMR HLDGS	12,996	87.89	1,142,218.44	
MCKESSON CORP	32,967	80.42	2,651,206.14	
MEDCO HEALTH SOLUTIONS INC	54,522	63.33	3,452,878.26	
MEDTRONIC INC	137,154	40.27	5,523,191.58	
OMNICARE INC	15,500	26.84	416,020.00	
PATTERSON COS INC	10,732	34.35	368,644.20	
QUEST DIAGNOSTICS	20,799	57.28	1,191,366.72	
ST JUDE MEDICAL INC	42,720	47.59	2,033,044.80	
STRYKER CORP	38,253	60.78	2,325,017.34	
UNITEDHEALTH GROUP INC	142,752	42.59	6,079,807.68	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	15,967	70.57	1,126,791.19	
WELLPOINT INC	50,560	67.21	3,398,137.60	
ZIMMER HOLDINGS INC	25,697	62.25	1,599,638.25	
ABBOTT LABORATORIES	195,294	46.32	9,046,018.08	
ALLERGAN INC	38,708	75.58	2,925,550.64	
AMGEN INC	121,993	52.41	6,393,653.13	
BIOGEN IDEC INC	30,097	67.65	2,036,062.05	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	217,339	25.77	5,600,826.03	
CELGENE CORP	59,072	53.63	3,168,031.36	
CEPHALON INC	9,463	58.45	553,112.35	
COVANCE INC	8,500	58.37	496,145.00	
ELI LILLY & CO	132,873	34.86	4,631,952.78	
FOREST LABORATORIES,INC.	35,530	34.26	1,217,257.80	
GENZYME CORP - GENL DIVISION	31,860	75.29	2,398,739.40	
GILEAD SCIENCES INC	105,414	39.29	4,141,716.06	
HUMAN GENOME SCIENCES INC	23,800	26.13	621,894.00	
ILLUMINA INC	15,900	72.23	1,148,457.00	
JOHNSON & JOHNSON	349,376	60.79	21,238,567.04	
LIFE TECHNOLOGIES CORPORATION	23,215	53.76	1,248,038.40	
MERCK & CO. INC.	389,811	33.10	12,902,744.10	
MYLAN INC	38,900	23.61	918,429.00	
PERRIGO CO	10,200	76.12	776,424.00	
PFIZER INC	1,019,116	19.37	19,740,276.92	
PHARMACEUTICAL PRODUCT DEVELOPMENT INC	14,700	27.60	405,720.00	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	52,326	57.20	2,993,047.20	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	26,708	39.85	1,064,313.80	
WARNER CHILCOTT PLC	15,000	25.01	375,150.00	
WATERS CORP	11,321	80.49	911,227.29	
WATSON PHARMACEUTICALS INC	17,400	55.97	973,878.00	
BB & T CORPORATION	87,863	28.40	2,495,309.20	
COMERICA INC	22,150	39.17	867,615.50	
FIFTH THIRD BANCORP	116,738	15.09	1,761,576.42	
HUDSON CITY BANCORP INC	59,969	11.40	683,646.60	



KEYCORP	114,915	9.44	1,084,797.60	
M & T BANK CORP	10,228	89.99	920,417.72	
MARSHALL & ILSLEY CORPORATION	59,652	7.54	449,776.08	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	52,300	18.82	984,286.00	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	45,000	13.36	601,200.00	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	67,001	64.03	4,290,074.03	
REGIONS FINANCIAL CORPORATION	157,470	7.70	1,212,519.00	
SUNTRUST BANKS INC	62,103	31.65	1,965,559.95	
US BANCORP	244,090	28.36	6,922,392.40	
WELLS FARGO & COMPANY	630,432	32.95	20,772,734.40	
AMERICAN EXPRESS COMPANY	137,177	45.78	6,279,963.06	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	31,951	64.29	2,054,129.79	
BANK OF AMERICA CORP	1,271,779	14.81	18,835,046.99	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP(THE)	154,901	31.20	4,832,911.20	
BLACKROCK INC	11,250	204.59	2,301,637.50	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	57,586	52.13	3,001,958.18	
CIT GROUP INC	23,700	44.96	1,065,552.00	
CITIGROUP INC	3,683,518	4.94	18,196,578.92	
CME GROUP INC.	8,580	302.60	2,596,308.00	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	70,281	21.99	1,545,479.19	
EATON VANCE CORP	15,000	33.81	507,150.00	
FRANKLIN RESOURCES INC	19,975	129.69	2,590,557.75	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	62,129	167.16	10,385,483.64	
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	7,708	128.90	993,561.20	
INVESCO LIMITED	60,239	27.42	1,651,753.38	
JEFFERIES GROUP INC	13,400	25.22	337,948.00	
JPMORGAN CHASE & CO	502,863	47.82	24,046,908.66	
LEGG MASON INC	20,603	36.63	754,687.89	
LEUCADIA NATIONAL CORPORATION	24,856	34.17	849,329.52	
MOODY'S CORP	25,616	30.48	780,775.68	
MORGAN STANLEY	158,405	30.69	4,861,449.45	
NASDAQ STOCK MARKET INC	16,080	28.72	461,898.00	
NORTHERN TRUST CORP	27,505	54.04	1,486,370.20	
NYSE EURONEXT	32,129	36.98	1,188,130.42	
SCHWAB (CHARLES) CORP	130,852	19.42	2,541,145.84	
SEI INVESTMENTS COMPANY	17,324	23.28	403,302.72	
SLM CORPORATION	64,061	15.15	970,524.15	
STATE STREET CORP	63,267	46.04	2,912,812.68	
T ROWE PRICE GROUP INC	32,362	70.33	2,276,019.46	
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	28,294	21.33	603,511.02	
ACE LIMITED	42,708	63.34	2,705,124.72	
AFLAC INC	60,045	59.28	3,559,467.60	
ALLSTATE CORP	65,833	31.61	2,080,981.13	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	15,500	42.06	651,930.00	
AON CORPORATION	37,539	51.92	1,949,024.88	
ARCH CAPITAL GROUP LTD.	6,500	89.61	582,465.00	

ASSURANT INC	13,289	41.24	548,038.36	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	14,803	37.40	553,632.20	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	108,100	84.93	9,180,933.00	
CHUBB CORP	39,591	60.26	2,385,753.66	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	20,333	33.88	688,983.70	
EVEREST RE GROUP LTD	6,903	89.10	615,057.30	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL INC-CL A	29,561	14.19	419,470.59	
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	60,800	13.75	836,000.00	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	53,986	30.79	1,662,228.94	
LINCOLN NATIONAL CORP	39,427	32.49	1,280,983.23	
LOEWS CORPORATION	41,710	43.24	1,803,540.40	
MARSH & MCLENNAN COS	68,956	30.75	2,120,397.00	
METLIFE INC	118,263	47.72	5,643,510.36	
OLD REPUBLIC INTL CORP	32,961	12.87	424,208.07	
PARTNERRE LTD	9,068	81.94	743,031.92	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	39,900	34.14	1,362,186.00	
PROGRESSIVE CORP	80,583	20.40	1,643,893.20	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	59,264	67.32	3,989,652.48	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	6,763	70.20	474,762.60	
TORCHMARK CORPORATION	9,939	64.72	643,252.08	
TRANSATLANTIC HOLDINGS INC	8,000	52.08	416,640.00	
TRAVELERS COS INC(THE)	59,778	59.78	3,573,528.84	
UNUM GROUP	41,670	26.78	1,115,922.60	
VALIDUS HOLDINGS LTD	7,600	31.27	237,652.00	
W.R.BERKLEY CORPORATION	17,343	29.77	516,301.11	
WHITE MOUNTAINS INSURANCE GROUP LTD.	1,050	368.25	386,662.50	
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	22,398	39.11	875,985.78	
XL GROUP PLC	42,100	23.40	985,140.00	
CB RICHARD ELLIS GROUP INC-A	36,000	25.27	909,720.00	
ACCENTURE PLC-CL A	81,223	54.04	4,389,290.92	
ACTIVISION BLIZZARD INC	69,020	11.03	761,290.60	
ADOBE SYSTEMS INC	65,716	34.98	2,298,745.68	
AKAMAI TECHNOLOGIES	23,506	42.67	1,003,001.02	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	6,950	78.71	547,034.50	
AUTODESK INC	28,034	43.66	1,223,964.44	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	62,776	49.84	3,128,755.84	
BMC SOFTWARE INC	22,078	50.80	1,121,562.40	
CA INC	50,913	25.50	1,298,281.50	
CITRIX SYSTEMS INC	24,198	72.40	1,751,935.20	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATION	38,205	76.88	2,937,200.40	
COMPUTER SCIENCES CORP	19,862	48.46	962,512.52	
EBAY INC	148,831	34.69	5,162,947.39	
ELECTRONIC ARTS INC	42,181	19.36	816,624.16	
F5 NETWORKS INC	10,240	122.93	1,258,803.20	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	33,112	31.77	1,051,968.24	
FISERV INC	18,876	63.56	1,199,758.56	

GOOGLE INC-CL A	31,271	625.26	19,552,505.46	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	160,026	164.24	26,282,670.24	
INTUIT INC	37,122	50.44	1,872,433.68	
LENDER PROCESSING SERVICES,INC.	11,400	33.27	379,278.00	
MASTERCARD INC-CL A	13,674	251.82	3,443,386.68	
MCAFEE INC	19,412	47.91	930,028.92	
MICROSOFT CORP	988,002	27.21	26,883,534.42	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	30,500	19.38	591,090.00	
ORACLE CORPORATION	509,629	33.01	16,822,853.29	
PAYCHEX INC	41,544	33.45	1,389,646.80	
RED HAT INC	23,300	45.58	1,062,014.00	
SAIC INC	45,900	16.46	755,514.00	
SALESFORCE.COM,INC.	14,735	140.94	2,076,750.90	
SYMANTEC CORPORATION	101,213	18.63	1,885,598.19	
SYNOPSYS INC	18,684	28.54	533,241.36	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	21,919	17.72	388,404.68	
VERISIGN INC	22,318	36.89	823,311.02	
VISA INC	63,716	76.14	4,851,336.24	
VMWARE INC	9,400	89.85	844,590.00	
WESTERN UNION COMPANY	83,446	21.50	1,794,089.00	
YAHOO! INC	163,010	17.77	2,896,687.70	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	44,458	43.92	1,952,595.36	
AMPHENOL CORPORATION -CL A	22,244	57.46	1,278,140.24	
APPLE INC	115,897	358.30	41,525,895.10	
ARROW ELECTRONICS INC	14,290	42.63	609,182.70	
AVAGO TECHNOLOGIES LTD.	19,400	33.63	652,422.00	
AVNET INC	18,700	36.92	690,404.00	
CISCO SYSTEMS INC	724,031	18.68	13,524,899.08	
CORNING INC	197,002	22.96	4,523,165.92	
DELL INC	221,852	15.34	3,403,209.68	
DOLBY LABORATORIES INC-CL A	7,300	51.49	375,877.00	
EMC CORP/MASS	261,303	27.22	7,112,667.66	
FLEXTRONICS INTL LTD	101,331	8.44	855,233.64	
FLIR SYSTEMS INC	20,940	32.17	673,639.80	
HARRIS CORP	16,650	48.46	806,859.00	
HEWLETT-PACKARD CO	295,994	48.62	14,391,228.28	
JUNIPER NETWORKS INC	65,123	44.23	2,880,390.29	
MOTOROLA MOBILITY HOLDINGS INC	35,697	29.83	1,064,841.51	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	40,797	38.92	1,587,819.24	
NETAPP INC	45,544	54.77	2,494,444.88	
QUALCOMM INC	203,720	59.00	12,019,480.00	
SANDISK CORP	29,500	51.74	1,526,330.00	
SEAGATE TECHNOLOGY	59,968	13.86	831,156.48	
TERADATA CORP	21,677	48.82	1,058,271.14	
TYCO ELECTRONICS LTD	55,629	37.89	2,107,782.81	
WESTERN DIGITAL CORP	29,523	33.65	993,448.95	

XEROX CORP	172,540	11.37	1,961,779.80
AMERICAN TOWER CORPORATION -CL A	50,109	54.65	2,738,456.85
AT&T INC	749,251	28.50	21,353,653.50
CENTURYLINK INC	38,512	42.17	1,624,051.04
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	37,222	44.22	1,645,956.84
FRONTIER COMMUNICATIONS CORPORATION	128,980	9.43	1,216,281.40
METROPCS COMMUNICATIONS INC.	32,700	13.12	429,024.00
NII HOLDINGS INC	21,479	42.00	902,118.00
QWEST COMMUNICATIONS INTL	194,888	6.96	1,356,420.48
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	13,000	43.66	567,580.00
SPRINT NEXTEL CORP	380,323	4.43	1,684,830.89
TELEPHONE AND DATA SYSTEMS	6,500	34.13	221,845.00
VERIZON COMMUNICATIONS INC	358,020	36.37	13,021,187.40
WINDSTREAM CORPORATION	64,500	13.23	853,335.00
AES CORPORATION	85,066	12.84	1,092,247.44
ALLEGHENY ENERGY INC	21,112	25.23	532,655.76
ALLIANT ENERGY CORP	14,248	39.04	556,241.92
AMEREN CORPORATION	29,424	28.76	846,234.24
AMERICAN ELECTRIC POWER	60,050	35.85	2,152,792.50
AMERICAN WATER WORKS CO INC	21,800	27.32	595,576.00
CALPINE CORP	43,100	14.72	634,432.00
CENTERPOINT ENERGY INC	53,409	15.91	849,737.19
CONSOLIDATED EDISON INC	35,747	48.90	1,748,028.30
CONSTELLATION ENERGY GROUP	24,023	31.25	750,718.75
DOMINION RESOURCES INC/VA	74,825	44.18	3,305,768.50
DTE ENERGY COMPANY	21,773	46.85	1,020,065.05
DUKE ENERGY CORP	168,369	18.12	3,050,846.28
EDISON INTERNATIONAL	38,953	36.92	1,438,144.76
ENERGEN CORPORATION	8,700	59.68	519,216.00
ENTERGY CORP	23,579	71.81	1,693,207.99
EQT CORPORATION	18,380	47.49	872,866.20
EXELON CORP	84,556	41.37	3,498,081.72
FIRSTENERGY CORP	38,195	38.27	1,461,722.65
INTEGRYS ENERGY GROUP,INC.	10,300	49.21	506,863.00
MDU RESOURCES GROUP INC	23,200	21.42	496,944.00
NEXTERA ENERGY INC	49,860	54.24	2,704,406.40
NISOURCE INC	33,692	19.07	642,506.44
NORTHEAST UTILITIES	21,800	33.62	732,916.00
NRG ENERGY INC	33,525	20.84	698,661.00
NSTAR	13,700	44.56	610,472.00
ONEOK INC	12,400	63.08	782,192.00
P G & E CORPORATION	49,074	45.56	2,235,811.44
PEPCO HOLDINGS INC	28,834	18.93	545,827.62
PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	13,444	41.72	560,883.68
PPL CORPORATION	61,844	25.01	1,546,718.44
PROGRESS ENERGY INC	36,876	45.92	1,693,345.92

PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	64,048	32.07	2,054,019.36	
QEP RESOURCES INC	22,311	39.30	876,822.30	
SCANA CORP	14,663	40.57	594,877.91	
SEMPRA ENERGY	30,061	52.97	1,592,331.17	
SOUTHERN CO	106,218	37.82	4,017,164.76	
WISCONSIN ENERGY CORP	15,216	58.82	895,005.12	
XCEL ENERGY INC	59,012	23.78	1,403,305.36	
ADVANCED MICRO DEVICES	73,485	9.44	693,698.40	
ALTERA CORPORATION	38,570	41.81	1,612,611.70	
ANALOG DEVICES	37,305	41.19	1,536,592.95	
APPLIED MATERIALS INC	172,129	16.42	2,826,358.18	
BROADCOM CORP-CL A	57,522	42.22	2,428,578.84	
CREE INC	12,500	55.32	691,500.00	
INTEL CORP	705,622	21.97	15,502,515.34	
KLA-TENCOR CORPORATION	20,924	49.53	1,036,365.72	
LAM RESEARCH CORP	16,064	54.97	883,038.08	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	28,658	35.55	1,018,791.90	
LSI CORPORATION	78,857	6.71	529,130.47	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	68,074	19.02	1,294,767.48	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	39,400	27.51	1,083,894.00	
MEMC ELECTRONIC MATERIALS	26,206	14.84	388,897.04	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	22,608	38.31	866,112.48	
MICRON TECHNOLOGY INC	113,241	11.80	1,336,243.80	
NATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	28,892	15.86	458,227.12	
NVIDIA CORP	73,794	25.68	1,895,029.92	
TEXAS INSTRUMENTS INC	151,841	36.48	5,539,159.68	
XILINX INC	32,753	33.87	1,109,344.11	
米ドル 小計	41,516,668		1,587,959,999.41	
(邦貨換算額)			(132,388,225,150)	(単位：円)
カナダドル				
ARC RESOURCES LTD	18,000	26.50	477,000.00	
ATHABASCA OIL SANDS CORP	26,000	16.47	428,220.00	
BAYTEX ENERGY CORPORATION	14,800	52.45	776,260.00	
BONAVISTA ENERGY CORPORATION	8,300	30.64	254,312.00	
CAMECO CORP	49,060	42.47	2,083,578.20	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	138,290	47.23	6,531,436.70	
CANADIAN OIL SANDS LTD	30,559	29.06	888,044.54	
CENOVUS ENERGY INC	95,548	36.59	3,496,101.32	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	29,100	43.67	1,270,797.00	
ENBRIDGE INC	46,029	57.38	2,641,144.02	
ENCANA CORP	94,048	30.48	2,866,583.04	
ENERPLUS CORP	24,190	30.55	739,004.50	
HUSKY ENERGY INC	33,342	28.82	960,916.44	
IMPERIAL OIL LTD	37,964	47.81	1,815,058.84	
MEG ENERGY CORPORATION	5,000	46.10	230,500.00	

NEXEN INC	66,908	24.75	1,655,973.00	
NIKO RESOURCES LTD	5,880	81.30	478,044.00	
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORPORATION	31,100	30.89	960,679.00	
PENGROWTH ENERGY CORPORATION	37,600	12.42	466,992.00	
PENN WEST PETROLEUM LTD	56,767	26.61	1,510,569.87	
PETROBAKKEN ENERGY LTD-A	11,100	21.79	241,869.00	
PROGRESS ENERGY RESOURCES CORP	21,400	12.96	277,344.00	
SUNCOR ENERGY INC	197,192	44.48	8,771,100.16	
TALISMAN ENERGY INC	127,532	23.61	3,011,030.52	
TRANSCANADA CORP	88,277	37.93	3,348,346.61	
VERMILION ENERGY INC	10,500	50.20	527,100.00	
AGNICO-EAGLE MINES	21,550	71.73	1,545,781.50	
AGRIUM INC	19,923	95.70	1,906,631.10	
BARRICK GOLD CORP	125,339	49.91	6,255,669.49	
CENTERRA GOLD INC	21,000	18.07	379,470.00	
ELDORADO GOLD CORPORATION	70,200	16.93	1,188,486.00	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	10,700	130.66	1,398,062.00	
FRANCO-NEVADA CORPORATION	15,500	31.75	492,125.00	
GOLDCORP INC	99,999	44.10	4,409,955.90	
IAMGOLD CORP	43,500	21.48	934,380.00	
INMET MINING CORPORATION	6,322	73.70	465,931.40	
IVANHOE MINES LTD	39,600	27.43	1,086,228.00	
KINROSS GOLD CORP	142,924	16.37	2,339,665.88	
OSISKO MINING CORPORATION	43,000	13.67	587,810.00	
PAN AMERICAN SILVER CORP	11,972	34.95	418,421.40	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	37,488	61.44	2,303,262.72	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN NEW	74,976	61.44	4,606,525.44	
SHERRITT INTERNATIONAL CORPORATION	36,500	9.49	346,385.00	
SILVER WHEATON CORPORATION	40,600	36.22	1,470,532.00	
SINO-FOREST CORPORATION-CL A	30,871	22.57	696,758.47	
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	74,117	55.87	4,140,916.79	
YAMANA GOLD INC	96,570	12.20	1,178,154.00	
BOMBARDIER INC 'B'	184,659	6.50	1,200,283.50	
CAE INC	32,014	13.09	419,063.26	
FINNING INTERNATIONAL INC	21,750	28.00	609,000.00	
SNC-LAVALIN GROUP INC	19,581	61.06	1,195,615.86	
RITCHIE BROS. AUCTIONEERS	12,400	25.75	319,300.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	58,434	71.59	4,183,290.06	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	21,286	67.90	1,445,319.40	
MAGNA INTERNATIONAL INC	27,412	56.80	1,557,001.60	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	15,500	29.99	464,845.00	
TIM HORTONS INC	21,500	41.71	896,765.00	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	43,506	21.17	921,022.02	
THOMSON REUTERS CORP	47,078	39.08	1,839,808.24	
YELLOW MEDIA INC	69,500	5.67	394,065.00	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	9,758	64.87	633,001.46	

ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B	16,600	27.00	448,200.00	
EMPIRE CO LTD A	4,400	53.93	237,292.00	
LOBLAW COMPANIES LTD	14,333	40.10	574,753.30	
METRO INC -A	12,500	44.48	556,000.00	
SHOPPERS DRUG MART CORP	27,620	40.61	1,121,648.20	
WESTON (GEORGE) LTD	6,480	70.63	457,682.40	
SAPUTO INC	19,040	41.13	783,115.20	
VITERRA INC	45,000	11.79	530,550.00	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	34,393	40.30	1,386,037.90	
BANK OF MONTREAL	70,679	61.31	4,333,329.49	
BANK OF NOVA SCOTIA	137,651	60.99	8,395,334.49	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	49,022	82.46	4,042,354.12	
NATIONAL BANK OF CANADA	20,561	75.00	1,542,075.00	
ROYAL BANK OF CANADA	180,532	56.50	10,200,058.00	
TORONTO-DOMINION BANK	110,583	80.83	8,938,423.89	
CI FINANCIAL CORP	19,200	22.49	431,808.00	
IGM FINANCIAL INC	15,601	45.74	713,589.74	
ONEX CORPORATION	12,923	34.48	445,585.04	
TMX GROUP INC	9,421	40.48	381,362.08	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,560	395.00	1,011,200.00	
GREAT-WEST LIFECO INC	34,904	27.60	963,350.40	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANC	11,000	38.23	420,530.00	
INTACT FINANCIAL CORPORATION	13,900	51.30	713,070.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	223,845	19.04	4,262,008.80	
POWER CORP OF CANADA	45,260	28.77	1,302,130.20	
POWER FINANCIAL CORP	31,786	31.37	997,126.82	
SUN LIFE FINANCIAL INC	72,683	33.02	2,399,992.66	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	64,693	31.93	2,065,647.49	
BROOKFIELD PROPERTIES CORP	32,363	17.32	560,527.16	
CGI GROUP INC - CL A	31,587	19.68	621,632.16	
OPEN TEXT CORPORATION	7,500	56.93	426,975.00	
RESEARCH IN MOTION	61,521	68.66	4,224,031.86	
BCE INC	32,920	35.80	1,178,536.00	
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	55,000	35.00	1,925,000.00	
TELUS CORPORATION	4,400	48.58	213,752.00	
TELUS CORPORATION -NON VOTE	20,897	46.50	971,710.50	
CANADIAN UTILITIES LIMITED	10,800	51.01	550,908.00	
FORTIS INC	22,790	33.51	763,692.90	
TRANSALTA CORP	27,268	20.83	567,992.44	
カナダドル 小計	4,565,731		172,596,550.49	
( 邦貨換算額 )			(14,608,572,033)	( 単位 : 円 )
ユーロ				
COMPAGNIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE-VERITA	17,550	23.58	413,916.75	
ENI SPA	329,483	18.33	6,039,423.39	
FUGRO NV-CVA	8,345	60.97	508,794.65	

GALP ENERGIA SGPS S.A	30,500	15.25	465,125.00	
NESTE OIL OYJ	16,085	12.76	205,244.60	
OMV AG	18,889	34.41	649,970.49	
REPSOL YPF SA	92,990	24.48	2,276,395.20	
SAIPEM	33,320	37.70	1,256,164.00	
SBM OFFSHORE NV	22,287	18.15	404,620.48	
TECHNIP S.A.	12,569	74.30	933,876.70	
TENARIS S.A.	60,869	17.62	1,072,511.78	
TOTAL SA	267,996	43.50	11,657,826.00	
ACERINOX SA	10,236	13.30	136,138.80	
AIR LIQUIDE	35,658	94.15	3,357,200.70	
AKZO NOBEL	29,516	50.14	1,479,932.24	
ARCELOR MITTAL	109,648	27.76	3,044,376.72	
BASF SE	116,363	60.97	7,094,652.11	
CIMPOR-CIMENTOS DE PORTUGAL	20,500	4.90	100,532.00	
CRH PLC	96,080	16.37	1,572,829.60	
ERAMET	750	265.95	199,462.50	
HEIDELBERGCEMENT AG	17,500	51.26	897,050.00	
IMERYS SA	4,515	51.58	232,883.70	
K+S AG	18,120	57.70	1,045,524.00	
KONINKLIJKE DSM NV	19,481	43.73	852,001.53	
LAFARGE SA	25,332	45.99	1,165,145.34	
LANXESS	10,000	57.16	571,600.00	
LINDE AG	21,531	111.15	2,393,170.65	
OUTOKUMPU OYJ	15,029	13.27	199,434.83	
RAUTARUUKKI OYJ	12,273	17.61	216,127.53	
SALZGITTER AG	5,570	60.79	338,600.30	
SOLVAY SA	7,685	84.17	646,846.45	
STORA ENSO OYJ-R SHS	72,712	8.43	612,962.16	
THYSSENKRUPP AG	42,758	30.14	1,288,939.91	
UMICORE	14,450	38.52	556,614.00	
UPM-KYMMENE OYJ	63,776	14.48	923,476.48	
VOESTALPINE AG	13,753	33.20	456,599.60	
WACKER CHEMIE AG	2,150	139.30	299,495.00	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	18,235	33.84	617,072.40	
ALSTOM RGPT	26,413	43.02	1,136,419.32	
BEKAERT NV	5,000	76.59	382,950.00	
BOSKALIS WESTMINSTER NV	8,800	37.44	329,516.00	
BOUYGUES	29,131	33.50	975,888.50	
BRENNTAG AG	3,000	76.00	228,000.00	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	49,923	41.86	2,090,026.39	
EIFFAGE SA	5,600	40.05	224,308.00	
EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	51,080	21.77	1,112,011.60	
FINMECCANICA SPA	49,089	9.49	466,100.05	
FOMENTO DE CONSTRUC Y CONTRA	5,502	22.91	126,050.82	
GEA GROUP AG	20,300	22.96	466,088.00	



HOCHTIEF AG	6,337	69.60	441,055.20
KONE OYJ-B	19,300	39.73	766,789.00
LEGRAND SA	20,100	29.30	589,030.50
MAN SE	13,493	84.70	1,142,857.10
METSO OYJ	16,771	37.46	628,241.66
PHILIPS ELECTRONICS NV	124,445	23.45	2,918,235.25
PRYSMIAN SPA	25,400	15.50	393,700.00
SAFRAN SA	21,277	25.68	546,393.36
SCHNEIDER ELECTRIC SA	30,907	117.95	3,645,480.65
SIEMENS AG-REG	104,351	97.29	10,152,308.79
THALES SA	10,475	27.42	287,224.50
VALLOUREC	13,900	79.70	1,107,830.00
VINCI S.A.	56,063	43.96	2,464,809.79
WARTSILA OYJ-B SHARES	10,051	54.45	547,276.95
ZARDOYA OTIS SA	19,500	11.55	225,225.00
BIC	3,400	63.64	216,376.00
BUREAU VERITAS SA	6,520	56.30	367,076.00
EDENRED	19,367	18.28	354,028.76
RANDSTAD HOLDING NV	14,298	39.80	569,060.40
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	36,110	15.18	548,149.80
AEROPORTS DE PARIS (ADP)	3,800	64.35	244,530.00
AIR FRANCE-KLM	19,327	12.45	240,621.15
ATLANTIA SPA	32,326	16.84	544,369.84
BRISA	26,718	5.22	139,467.96
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	28,179	15.58	439,028.82
DEUTSCHE POST AG-REG	109,648	13.81	1,514,787.12
FERROVIAL SA	54,368	8.91	484,418.88
FRAPORT AG	5,000	52.35	261,750.00
GROUPE EUROTUNNEL SA	64,000	7.42	475,264.00
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP	128,344	2.97	382,336.77
RYANAIR HOLDINGS PLC	1,656	3.63	6,019.56
TNT NV	48,993	20.61	1,009,745.73
VOPAK	9,100	34.80	316,725.50
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	42,246	61.04	2,578,695.84
BAYERISCHE MOTOREN WERKE(BMW)AG-PFD	7,041	40.00	281,640.00
CONTINENTAL AG	6,600	62.55	412,830.00
DAIMLER AG	114,073	52.97	6,042,446.81
FIAT INDUSTRIAL SPA	97,516	10.28	1,002,464.48
FIAT SPA	97,516	7.20	702,115.20
MICHELIN (CGDE)-B	21,845	60.28	1,316,816.60
NOKIAN RENKAAT OYJ	13,997	30.70	429,707.90
PEUGEOT SA	19,955	29.78	594,259.90
PIRELLI & C.	33,352	5.96	198,777.92
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PREF	10,865	66.40	721,436.00
RENAULT SA	24,225	45.37	1,099,088.25
VOLKSWAGEN AG	3,944	112.50	443,700.00

VOLKSWAGEN AG PFD	21,725	121.05	2,629,811.25	
ADIDAS AG	25,924	48.30	1,252,129.20	
CHRISTIAN DIOR SA	8,220	106.85	878,307.00	
HERMES INTERNATIONAL	1,343	145.65	195,607.95	
LUXOTTICA GROUP SPA	15,130	22.09	334,221.70	
LVMH MOET HENNESSY LOUI V SA	30,888	117.45	3,627,795.60	
PUMA AG	666	214.50	142,857.00	
ACCOR SA	19,567	35.27	690,128.09	
AUTOGRILL SPA	13,200	10.51	138,732.00	
OPAP SA	30,006	16.30	489,097.80	
SODEXO	12,086	49.99	604,239.57	
TUI AG	15,500	10.11	156,705.00	
AXEL SPRINGER AG	1,800	120.75	217,350.00	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	13,600	28.89	392,904.00	
GESTEVISION TELECINCO SA	22,600	9.36	211,536.00	
JC DECAUX S.A.	7,300	23.99	175,163.50	
KABEL DEUTSCHLAND HOLDINGS AG	6,800	40.52	275,570.00	
LAGARDERE S.C.A.	14,571	33.41	486,817.11	
M6-METROPOLE TELEVISION	8,300	18.16	150,728.00	
MEDIASET SPA	86,634	4.74	410,861.74	
PAGESJAUNES SA	19,000	7.08	134,691.00	
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-PFD	10,000	23.77	237,700.00	
PUBLICIS GROUPE	15,200	40.83	620,616.00	
REED ELSEVIER NV	86,196	9.80	845,410.36	
SANOMA OYJ	10,500	16.17	169,785.00	
SES	37,296	18.80	701,164.80	
TELEVISION FRANCAISE (T.F.1)	13,376	14.60	195,356.48	
VIVENDI SA	157,777	20.83	3,287,283.79	
WOLTERS KLUWER-CVA	38,242	17.57	672,103.15	
INDITEX	27,253	54.79	1,493,191.87	
PPR	9,686	115.85	1,122,123.10	
CARREFOUR SA	75,116	35.54	2,669,622.64	
CASINO GUICHARD PERRACHON	6,840	72.21	493,916.40	
COLRUYT NV	8,945	36.75	328,728.75	
DELHAIZE GROUP	13,078	57.95	757,870.10	
JERONIMO MARTINS SGPS S.A.	27,800	12.29	341,662.00	
KESKO OYJ-B SHS	8,334	32.31	269,271.54	
KONINKLIJKE AHOLD NV	148,797	9.82	1,462,079.32	
METRO AG	16,429	55.25	907,702.25	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	90,994	40.23	3,660,688.62	
COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	22,629	20.92	473,398.68	
DANONE	74,260	45.56	3,383,656.90	
HEINEKEN HOLDING NV	13,939	33.03	460,474.86	
HEINEKEN NV	33,100	37.86	1,253,331.50	
KERRY GROUP PLC-A	21,598	25.40	548,589.20	
PARMALAT SPA	215,000	2.19	470,850.00	

PERNOD-RICARD SA	25,477	67.61	1,722,499.97	
SUEDZUCKER AG	8,500	20.36	173,060.00	
UNILEVER NV-CVA	206,920	21.84	4,520,167.40	
BEIERSDORF AG	12,440	43.22	537,719.00	
HENKEL AG & CO KGAA	17,300	38.30	662,590.00	
HENKEL AG & CO KGAA	22,578	45.24	1,021,428.72	
L'OREAL	30,250	85.52	2,586,980.00	
BIOMERIEUX	1,800	80.85	145,530.00	
CELESIO AG	9,104	19.28	175,570.64	
ESSILOR INTERNATIONAL	25,503	51.65	1,317,229.95	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	24,440	47.66	1,164,810.40	
FRESENIUS SE & CO KGAA	14,120	62.48	882,217.60	
BAYER AG	104,403	56.58	5,907,121.74	
ELAN CORPORATION PLC	76,166	4.98	379,306.68	
GRIFOLS S.A.	16,200	11.84	191,808.00	
MERCK KGAA	8,381	62.59	524,566.79	
ORION OYJ	11,098	16.39	181,896.22	
QIAGEN N.V.	27,400	14.60	400,040.00	
SANOFI-AVENTIS	132,836	51.36	6,822,456.96	
UCB SA	13,497	27.41	370,020.25	
ALPHA BANK A.E.	58,321	4.59	267,693.39	
ANGLO IRISH BANK CORPORATION PLC	96,000	0.00	96.00	
BANCA CARIGE S.P.A	84,000	1.80	151,788.00	
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	258,414	1.01	262,548.62	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	541,884	9.42	5,109,424.23	
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	308,402	0.63	195,218.46	
BANCO DE SABADELL SA	134,475	3.30	443,767.50	
BANCO DE VALENCIA SA	30,032	3.91	117,575.28	
BANCO ESPIRITO SANTO,S.A(BES)	72,900	3.20	233,352.90	
BANCO POPOLARE SPA	202,182	2.73	551,956.86	
BANCO POPULAR ESPANOL	113,047	4.64	525,103.31	
BANCO SANTANDER SA	1,043,241	9.31	9,719,876.39	
BANK OF CYPRUS PUBLIC CO LTD	112,500	3.28	369,000.00	
BANKINTER,S.A.	37,500	5.00	187,500.00	
BNP PARIBAS	121,403	58.77	7,134,854.31	
COMMERZBANK AG	94,343	5.94	561,246.50	
CREDIT AGRICOLE SA	123,690	12.17	1,505,307.30	
DEXIA	75,950	3.51	266,584.50	
EFG EUROBANK ERGASIAS	44,991	4.50	202,459.50	
ERSTE GROUP BANK AG	25,213	38.85	979,525.05	
INTESA SANPAOLO	981,490	2.58	2,534,697.92	
INTESA SANPAOLO-RNC	108,503	2.24	243,046.72	
KBC GROUPE SA	20,251	32.50	658,157.50	
NATIONAL BANK OF GREECE S.A.	120,339	7.48	900,135.72	
NATIXIS	103,000	4.13	426,111.00	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	5,750	44.25	254,437.50	

SOCIETE GENERALE	80,179	52.04	4,172,515.16
UNICREDIT SPA	1,697,241	1.99	3,389,390.27
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	78,394	7.87	617,352.75
AGEAS	292,000	2.49	729,708.00
CNP-CIE NATL A PORTEFEUILLE	3,700	41.86	154,882.00
CRITERIA CAIXACORP SA	103,507	5.05	522,710.35
DEUTSCHE BANK AG -REG	118,226	47.85	5,657,705.23
DEUTSCHE BOERSE AG	24,847	57.89	1,438,392.83
EURAZEO	4,200	55.43	232,806.00
EXOR SPA	7,897	23.21	183,289.37
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	9,955	68.34	680,324.70
ING GROEP NV-CVA	484,942	9.21	4,468,740.53
MEDIOBANCA SPA	58,668	7.90	463,770.54
POHJOLA BANK PLC	17,903	10.03	179,567.09
AEGON NV	195,788	5.62	1,101,111.71
ALLIANZ SE-REG	57,579	107.30	6,178,226.70
ASSICURAZIONI GENERALI	149,151	16.84	2,511,702.84
AXA SA	218,194	15.40	3,360,187.60
CNP ASSURANCES	19,484	16.74	326,162.16
DELTA LLOYD NV	9,600	18.75	180,000.00
HANNOVER RUECKVERSICHERUNGS AG	7,400	43.27	320,235.00
MAPFRE SA	93,649	2.73	256,317.31
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	24,434	125.20	3,059,136.80
SAMPO OYJ-A SHS	54,054	22.83	1,234,052.82
SCOR SE	20,958	21.26	445,567.08
VIENNA INSURANCE GROUP AG WIENER VERSICH	4,800	42.98	206,304.00
IMMOFINANZ AG	125,000	3.24	405,250.00
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	27,000	14.93	403,110.00
ATOS ORIGIN	5,731	42.58	244,025.98
CAP GEMINI SA	18,304	42.89	785,058.56
DASSAULT SYSTEMES SA	7,233	56.29	407,145.57
INDRA SISTEMAS SA	11,128	14.34	159,631.16
SAP AG	108,820	44.51	4,843,578.20
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	15,500	12.20	189,100.00
ALCATEL-LUCENT	302,916	3.66	1,108,672.56
NEOPOST SA	3,718	66.00	245,388.00
NOKIA OYJ	473,267	6.71	3,177,987.90
BELGACOM SA	19,531	27.16	530,559.61
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	359,742	9.96	3,584,109.54
ELISA OYJ	17,422	16.65	290,076.30
FRANCE TELECOM SA	235,120	16.19	3,806,592.80
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	32,849	7.59	249,323.91
ILIAD SA	2,000	77.28	154,560.00
KONINKLIJKE KPN NV	199,875	11.68	2,335,539.37
MOBISTAR SA	3,264	45.72	149,246.40
PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	73,352	8.55	627,159.60

TELECOM ITALIA SPA	1,200,901	1.05	1,262,146.95	
TELECOM ITALIA-RNC	762,811	0.87	668,985.24	
TELEFONICA S.A.	520,872	18.45	9,610,088.40	
TELEKOM AUSTRIA AG	43,626	10.47	456,764.22	
A2A S.P.A.	131,000	1.16	152,353.00	
ACCIONA S.A.	3,430	67.76	232,416.80	
E.ON AG	227,982	24.68	5,626,595.76	
EDP RENOVAVEIS SA	27,000	4.55	122,850.00	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	238,624	2.91	694,395.84	
ELECTRICITE DE FRANCE(EDF)	32,949	32.62	1,074,796.38	
ENAGAS	21,000	16.21	340,410.00	
ENEL GREEN POWER SPA	200,000	1.66	332,800.00	
ENEL SPA	841,547	4.32	3,641,794.64	
FORTUM OYJ	55,281	21.86	1,208,442.66	
GAS NATURAL SDG SA	42,046	12.76	536,506.96	
GDF SUEZ	156,805	29.85	4,681,413.27	
IBERDROLA RENOVABLES	99,000	2.76	273,636.00	
IBERDROLA SA	511,845	6.47	3,313,684.53	
PUBLIC POWER CORP	16,106	12.67	204,063.02	
RED ELECTRICA CORPORATION S.A.	14,300	38.66	552,838.00	
RWE AG	53,330	52.22	2,784,892.60	
RWE AG-NON VTG PFD	4,813	50.20	241,612.60	
SNAM RETE GAS	179,283	4.01	718,924.83	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	33,900	15.80	535,620.00	
TERNA SPA	164,846	3.36	555,118.90	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	43,830	24.26	1,063,315.80	
VERBUND AG	7,970	28.70	228,739.00	
ASML HOLDING NV	55,282	32.71	1,808,274.22	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	137,000	8.03	1,100,932.00	
STMICROELECTRONICS NV	84,305	9.49	800,054.45	
ユーロ 小計	22,618,726		328,015,145.18	
(邦貨換算額)			(37,219,878,523)	(単位：円)
英ポンド				
AMEC PLC	42,935	11.50	493,752.50	
BG GROUP PLC	427,295	14.97	6,396,606.15	
BP PLC	2,383,584	4.89	11,664,068.30	
CAIRN ENERGY PLC	176,000	4.21	742,016.00	
ESSAR ENERGY PLC	42,000	5.17	217,350.00	
PETROFAC LIMITED	32,500	15.13	491,725.00	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	449,706	21.73	9,774,359.91	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	341,630	21.58	7,374,083.55	
TULLOW OIL PLC	113,800	13.70	1,559,060.00	
ANGLO AMERICAN PLC	166,791	32.95	5,496,597.40	
ANTOFAGASTA PLC	50,670	14.10	714,447.00	
BHP BILLITON PLC	279,997	24.44	6,844,526.66	

EURASIAN NATURAL RESOURCES CORPORATION	33,700	10.00	337,000.00	
FRESNILLO PLC	22,200	14.76	327,672.00	
JOHNSON MATTHEY PLC	26,901	19.59	526,990.59	
KAZAKHMYS PLC	26,200	15.05	394,310.00	
LONMIN PLC	21,656	18.52	401,069.12	
RANDGOLD RESOURCES LTD	11,922	49.19	586,443.18	
REXAM PLC	114,549	3.71	424,976.79	
RIO TINTO PLC	183,893	44.98	8,272,426.60	
VEDANTA RESOURCES PLC	14,400	24.00	345,600.00	
XSTRATA PLC	260,417	14.40	3,750,004.80	
BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	42,000	5.54	232,890.00	
BAE SYSTEMS PLC	437,735	3.40	1,492,238.61	
BALFOUR BEATTY PLC	86,839	3.57	310,188.90	
BUNZL PLC	40,808	7.78	317,486.24	
COBHAM PLC	145,074	2.23	323,660.09	
INVENSYS PLC	101,258	3.45	350,048.90	
ROLLS-ROYCE GROUP PLC	238,193	6.31	1,502,997.83	
SMITHS GROUP PLC	51,366	13.63	700,118.58	
WEIR GROUP PLC/THE	26,000	16.95	440,700.00	
WOLSELEY PLC	35,832	21.41	767,163.12	
AGGREKO PLC	34,400	14.71	506,024.00	
CAPITA GROUP PLC	74,599	6.77	505,035.23	
EXPERIAN PLC	128,894	7.85	1,012,462.37	
G4S PLC	180,927	2.66	482,351.38	
INTERTEK GROUP PLC	19,700	17.87	352,039.00	
SERCO GROUP PLC	61,528	5.43	334,404.68	
FIRSTGROUP PLC	63,315	3.76	238,317.66	
BURBERRY GROUP PLC	53,437	11.95	638,572.15	
CARNIVAL PLC	23,267	29.25	680,559.75	
COMPASS GROUP PLC	236,378	5.68	1,343,808.93	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	35,349	14.16	500,541.84	
THOMAS COOK GROUP PLC	116,000	1.95	226,896.00	
TUI TRAVEL PLC	62,000	2.46	153,078.00	
WHITBREAD PLC	23,456	18.39	431,355.84	
BRITISH SKY BROADCASTING PLC	146,655	7.49	1,098,445.95	
ITV PLC	480,000	0.87	419,760.00	
PEARSON PLC	102,653	10.48	1,075,803.44	
REED ELSEVIER PLC	154,148	5.61	865,541.02	
WPP PLC	158,467	8.36	1,325,576.45	
HOME RETAIL GROUP	108,094	2.35	254,020.90	
KINGFISHER PLC	301,840	2.56	774,219.60	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	203,199	3.61	734,361.18	
NEXT PLC	22,344	19.67	439,506.48	
SAINSBURY (J) PLC	149,638	3.85	576,106.30	
TESCO PLC	1,022,082	4.03	4,118,990.46	
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	271,792	2.82	766,725.23	

ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	46,800	10.59	495,612.00	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	252,726	24.43	6,174,096.18	
DIAGEO PLC	319,010	11.90	3,796,219.00	
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	129,770	19.25	2,498,072.50	
SABMILLER PLC	119,410	20.88	2,493,877.85	
UNILEVER PLC	162,097	18.06	2,927,471.82	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	77,663	32.79	2,546,569.77	
SMITH & NEPHEW PLC	111,783	7.35	821,605.05	
ASTRAZENECA PLC	181,521	30.25	5,491,010.25	
GLAXOSMITHKLINE PLC	658,643	11.85	7,808,212.76	
SHIRE PLC	71,600	17.39	1,245,124.00	
BARCLAYS PLC	1,444,627	3.33	4,818,553.35	
HSBC HOLDINGS PLC	2,233,303	7.30	16,323,211.62	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,167,754	0.69	3,574,535.44	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	2,202,954	0.49	1,079,447.46	
STANDARD CHARTERED PLC	295,243	16.95	5,004,368.85	
3I GROUP PLC	119,000	3.15	375,445.00	
ICAP PLC	71,716	5.52	396,230.90	
INVESTEC PLC	66,000	4.76	314,292.00	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	18,902	9.20	173,992.91	
MAN GROUP PLC	227,945	3.09	704,350.05	
SCHRODERS PLC	14,200	17.58	249,636.00	
ADMIRAL GROUP PLC	25,200	17.25	434,700.00	
AVIVA PLC	360,434	4.69	1,690,435.46	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	743,491	1.21	901,854.58	
OLD MUTUAL PLC	690,324	1.36	943,672.90	
PRUDENTIAL PLC	324,753	7.42	2,409,667.26	
RESOLUTION LTD	183,068	2.94	539,135.26	
RSA INSURANCE GROUP PLC	431,885	1.43	619,754.97	
STANDARD LIFE PLC	294,048	2.42	712,478.30	
AUTONOMY CORP PLC	29,800	17.03	507,494.00	
SAGE GROUP PLC (THE)	163,063	2.92	477,285.40	
ARM HOLDINGS PLC	166,000	6.30	1,045,800.00	
BT GROUP PLC	970,899	1.84	1,792,279.55	
CABLE & WIRELESS WORLDWIDE	351,018	0.75	265,018.59	
INMARSAT PLC	54,000	6.83	369,090.00	
VODAFONE GROUP PLC	6,690,038	1.80	12,092,243.68	
CENTRICA PLC	648,735	3.44	2,232,945.87	
INTERNATIONAL POWER PLC	194,253	3.47	675,417.68	
NATIONAL GRID PLC	447,617	5.72	2,560,369.24	
SCOTTISH & SOUTHERN ENERGY	116,608	11.96	1,394,631.68	
SEVERN TRENT PLC	30,994	14.54	450,652.76	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	86,391	5.87	507,547.12	
英ポンド 小計	37,657,299		195,361,490.72	
(邦貨換算額)			(26,350,357,868)	(単位：円)

スイスフラン				
TRANSOCEAN LTD	40,700	77.70	3,162,390.00	
GIVAUDAN-REG	1,050	942.00	989,100.00	
HOLCIM LTD-REG	31,497	68.90	2,170,143.30	
SIKA AG	248	2,066.00	512,368.00	
SYNGENTA AG	11,911	312.30	3,719,805.30	
ABB LTD	277,603	22.41	6,221,083.23	
GEBERIT AG-REG	5,050	202.70	1,023,635.00	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,500	105.00	262,500.00	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	6,210	104.40	648,324.00	
ADECCO SA-REG	15,534	63.50	986,409.00	
SGS SA	707	1,614.00	1,141,098.00	
KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	6,855	128.80	882,924.00	
CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-BR A	65,877	55.15	3,633,116.55	
THE SWATCH GROUP AG-B	4,019	410.20	1,648,593.80	
THE SWATCH GROUP AG-REG	5,200	74.45	387,140.00	
ARYZTA AG	11,300	43.00	485,900.00	
LINDT & SPRUENGLI AG	116	2,604.00	302,064.00	
LINDT & SPRUENGLI AG-REG	13	28,300.00	367,900.00	
NESTLE SA-REGISTERED	439,100	52.90	23,228,390.00	
SONOVA HOLDING AG	5,942	121.40	721,358.80	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	970	233.20	226,204.00	
SYNTHES INC	7,650	129.80	992,970.00	
ACTELION LTD	13,016	53.55	697,006.80	
LONZA GROUP AG-REG	5,652	81.35	459,790.20	
NOVARTIS AG-REG SHS	267,783	54.20	14,513,838.60	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	89,030	138.30	12,312,849.00	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	142,026	44.65	6,341,460.90	
GAM HOLDING LTD	27,273	17.55	478,641.15	
JULIUS BAER GROUP LTD	25,573	43.61	1,115,238.53	
PARGESA HOLDING SA-BR	3,200	90.25	288,800.00	
UBS AG-REGISTERED	463,525	18.75	8,691,093.75	
BALOISE HOLDING AG	6,200	102.10	633,020.00	
SWISS LIFE HOLDING AG	4,070	160.20	652,014.00	
SWISS RE-REG	45,200	58.20	2,630,640.00	
ZURICH FINANCIAL SERVICES AG	18,398	273.70	5,035,532.60	
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	24,282	18.64	452,616.48	
SWISSCOM AG-REG	2,977	416.50	1,239,920.50	
スイスフラン 小計	2,078,257		109,255,879.49	
(邦貨換算額)			(9,587,203,425)	(単位：円)
スウェーデンクローナ				
BOLIDEN AB	34,000	131.20	4,460,800.00	
HOLMEN AB-B SHARES	6,133	226.00	1,386,058.00	
SSAB AB-A SHARES	22,942	99.50	2,282,729.00	
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	74,742	109.00	8,146,878.00	



ALFA LAVAL AB	41,552	127.40	5,293,724.80	
ASSA ABLOY AB-B	39,466	178.80	7,056,520.80	
ATLAS COPCO AB-A SHS	86,232	155.10	13,374,583.20	
ATLAS COPCO AB-B SHS	49,796	138.50	6,896,746.00	
HEXAGON AB-B SHS	31,400	136.50	4,286,100.00	
SANDVIK AB	129,454	118.50	15,340,299.00	
SCANIA AB-B SHS	42,132	132.50	5,582,490.00	
SKANSKA AB-B SHS	48,690	126.40	6,154,416.00	
SKF AB-B SHARES	49,648	165.30	8,206,814.40	
VOLVO AB-B SHS	173,300	107.70	18,664,410.00	
SECURITAS AB-B SHS	42,457	73.35	3,114,220.95	
ELECTROLUX AB-SER B	30,083	160.10	4,816,288.30	
HUSQVARNA AB-B SHS	49,983	53.10	2,654,097.30	
MODERN TIMES GROUP-B SHS	6,300	418.00	2,633,400.00	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	131,144	207.80	27,251,723.20	
SWEDISH MATCH AB	29,571	188.80	5,583,004.80	
GETINGE AB-B SHS	25,538	146.80	3,748,978.40	
NORDEA BANK AB	408,729	72.15	29,489,797.35	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A	182,523	57.30	10,458,567.90	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	62,708	210.10	13,174,950.80	
SWEDBANK AB - A SHARES	90,260	101.80	9,188,468.00	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	13,000	108.30	1,407,900.00	
INVESTOR AB-B SHS	57,949	145.10	8,408,399.90	
KINNEVIK INVESTMENT AB-B	27,000	143.10	3,863,700.00	
RATOS AB-B SHS	14,000	251.00	3,514,000.00	
ERICSSON LM-B SHS	380,023	79.60	30,249,830.80	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	9,440	577.50	5,451,600.00	
TELE2 AB -B SHS	38,273	144.20	5,518,966.60	
TELIASONERA AB	289,271	53.05	15,345,826.55	
スウェーデンクローナ 小計	2,717,739		293,006,290.05	
(邦貨換算額)			(3,814,941,896)	(単位：円)
ノルウェークローネ				
AKER SOLUTIONS ASA	20,600	114.80	2,364,880.00	
SEADRILL LID	35,495	208.90	7,414,905.50	
STATOIL ASA	140,064	139.60	19,552,934.40	
SUBSEA 7 SA	37,000	137.80	5,098,600.00	
NORSK HYDRO ASA	111,797	46.10	5,153,841.70	
YARA INTERNATIONAL ASA	24,005	305.30	7,328,726.50	
ORKLA ASA	100,350	52.60	5,278,410.00	
RENEWABLE ENERGY CORP AS	50,670	21.48	1,088,391.60	
DNB NOR ASA	127,019	85.00	10,796,615.00	
TELENOR ASA	103,592	91.50	9,478,668.00	
ノルウェークローネ 小計	750,592		73,555,972.70	
(邦貨換算額)			(1,076,123,880)	(単位：円)

デンマーククローネ				
NOVOZYMES A/S-B SHARES	5,703	755.00	4,305,765.00	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	26,862	168.90	4,536,991.80	
A P MOLLER - MAERSK A/S	166	53,700.00	8,914,200.00	
A P MOLLER-MAERSK A/S-A	68	52,300.00	3,556,400.00	
DSV A/S	26,280	115.80	3,043,224.00	
CARLSBERG AS-B	13,816	558.50	7,716,236.00	
COLOPLAST-B	2,952	776.00	2,290,752.00	
WILLIAM DEMANT HOLDING	2,860	451.50	1,291,290.00	
NOVO NORDISK A/S-B	52,953	669.00	35,425,557.00	
DANSKE BANK A/S	58,898	126.00	7,421,148.00	
TRYG A/S	3,368	292.00	983,456.00	
デンマーククローネ 小計	193,926		79,485,019.80	
( 邦貨換算額 )			(1,209,762,001)	( 単位 : 円 )
オーストラリアドル				
CALTEX AUSTRALIA LIMITED	18,000	14.56	262,080.00	
ORIGIN ENERGY LIMITED	109,881	16.85	1,851,494.85	
PALADIN ENERGY LIMITED	88,000	5.08	447,040.00	
SANTOS LTD	105,511	14.24	1,502,476.64	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	79,376	42.50	3,373,480.00	
WORLEY PARSONS LIMITED	23,400	28.75	672,750.00	
ALUMINA LTD	296,977	2.53	751,351.81	
AMCOR LIMITED	153,527	6.68	1,025,560.36	
BHP BILLITON LTD	425,630	46.64	19,851,383.20	
BLUESCOPE STEEL LTD	234,327	2.32	543,638.64	
BORAL LIMITED	95,596	5.51	526,733.96	
FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	156,000	6.87	1,071,720.00	
INCITEC PIVOT LTD	200,000	4.50	900,000.00	
JAMES HARDIE INDUSTRIES SE	56,003	6.57	367,939.71	
MACARTHUR COAL LIMITED	22,400	12.52	280,448.00	
NEWCREST MINING LIMITED	97,578	38.49	3,755,777.22	
ONESTEEL LIMITED	174,695	2.93	511,856.35	
ORICA LIMITED	46,423	26.55	1,232,530.65	
OZ MINERALS LIMITED	386,524	1.73	668,686.52	
RIO TINTO LIMITED	54,981	87.65	4,819,084.65	
SIMS METAL MANAGEMENT LTD	22,195	18.95	420,595.25	
CSR LIMITED	207,940	1.18	246,408.90	
LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	16,905	31.79	537,409.95	
BRAMBLES LIMITED	183,532	7.37	1,352,630.84	
ASCIANO LTD	364,000	1.73	631,540.00	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	133,138	2.52	335,507.76	
QR NATIONAL LTD	215,000	3.00	645,000.00	
TOLL HOLDINGS LIMITED	80,620	6.19	499,037.80	
BILLABONG INTERNATIONAL LTD	23,211	8.00	185,688.00	
CROWN LTD	54,965	8.67	476,546.55	

TABCORP HOLDINGS LIMITED	83,545	7.58	633,271.10	
TATTS GROUP LTD	172,000	2.49	428,280.00	
FAIRFAX MEDIA LTD	265,729	1.37	365,377.37	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	79,432	2.94	233,530.08	
METCASH LTD	104,000	4.14	430,560.00	
WESFARMERS LIMITED	127,484	34.25	4,366,327.00	
WESFARMERS LIMITED-PPP	18,754	34.55	647,950.70	
WOOLWORTHS LIMITED	157,698	26.69	4,208,959.62	
COCA-COLA AMATIL LIMITED	69,917	11.42	798,452.14	
FOSTER'S GROUP LTD	245,619	5.77	1,417,221.63	
GOODMAN FIELDER LIMITED	167,000	1.23	206,245.00	
COCHLEAR LIMITED	7,203	78.96	568,748.88	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	15,000	17.65	264,750.00	
SONIC HEALTHCARE LTD	49,926	11.76	587,129.76	
CSL LIMITED	69,314	35.70	2,474,509.80	
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	322,992	25.65	8,284,744.80	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	47,400	9.80	464,520.00	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	196,468	53.99	10,607,307.32	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	269,811	26.42	7,128,406.62	
WESTPAC BANKING CORPORATION	378,477	24.29	9,193,206.33	
ASX LTD	21,410	38.67	827,924.70	
MACQUARIE GROUP LTD	43,932	39.49	1,734,874.68	
AMP LIMITED	269,161	5.50	1,480,385.50	
AXA ASIA PACIFIC HOLDINGS LTD	131,340	6.44	845,829.60	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	271,006	3.73	1,010,852.38	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	131,473	18.52	2,434,879.96	
SUNCORP GROUP LTD	160,481	8.72	1,399,394.32	
COMPUTERSHARE LIMITED	55,029	9.73	535,432.17	
TELSTRA CORPORATION LIMITED	543,187	2.98	1,618,697.26	
AGL ENERGY LIMITED	62,769	14.77	927,098.13	
オーストラリアドル 小計	8,663,892		115,871,264.46	
(邦貨換算額)			(9,778,376,007)	(単位：円)
ニュージーランドドル				
FLETCHER BUILDING LTD	81,957	8.34	683,521.38	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	130,557	2.24	292,447.68	
SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP	82,890	3.31	274,365.90	
TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	256,909	2.23	572,907.07	
CONTACT ENERGY LIMITED	35,256	6.22	219,292.32	
ニュージーランドドル 小計	587,569		2,042,534.35	
(邦貨換算額)			(129,414,976)	(単位：円)
香港ドル				
MONGOLIA ENERGY CORPORATION LTD.	450,000	1.95	877,500.00	
HUTCHISON WHAMPOA LTD	269,000	93.15	25,057,350.00	
NWS HOLDINGS LTD	160,500	12.68	2,035,140.00	

CATHAY PACIFIC AIRWAYS	142,000	19.46	2,763,320.00	
MTR CORPORATION	183,500	28.25	5,183,875.00	
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	31,000	73.15	2,267,650.00	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	96,000	25.95	2,491,200.00	
SANDS CHINA LTD	312,000	18.96	5,915,520.00	
SHANGRI-LA ASIA LTD.	166,000	19.40	3,220,400.00	
SJM HOLDINGS LIMITED	185,000	12.00	2,220,000.00	
WYNN MACAU LTD	202,000	21.35	4,312,700.00	
ESPRIT HOLDINGS LTD	141,927	40.80	5,790,621.60	
LI & FUNG LTD	293,600	47.70	14,004,720.00	
LIFESTYLE INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED	73,000	18.90	1,379,700.00	
BANK OF EAST ASIA	198,620	32.30	6,415,426.00	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	475,500	23.95	11,388,225.00	
HANG SENG BANK LTD	97,200	121.90	11,848,680.00	
WING HANG BANK LIMITED	22,000	98.50	2,167,000.00	
HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	129,700	166.50	21,595,050.00	
AIA GROUP LTD	980,000	21.85	21,413,000.00	
CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	176,000	120.80	21,260,800.00	
HANG LUNG GROUP LTD	107,000	46.75	5,002,250.00	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	310,000	32.90	10,199,000.00	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	140,000	50.00	7,000,000.00	
HOPEWELL HOLDINGS LTD	72,000	24.70	1,778,400.00	
HYSAN DEVELOPMENT CO	75,000	35.10	2,632,500.00	
KERRY PROPERTIES LTD	91,500	38.50	3,522,750.00	
NEW WORLD DEVELOPMENT	324,000	13.86	4,490,640.00	
SINO LAND CO	312,000	14.00	4,368,000.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	180,000	123.40	22,212,000.00	
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	99,500	112.30	11,173,850.00	
WHARF HOLDINGS LTD	171,000	52.80	9,028,800.00	
WHEELOK&COMPANY LTD	115,000	28.65	3,294,750.00	
FOXCONN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	298,000	5.61	1,671,780.00	
PCCW LIMITED	510,000	3.59	1,830,900.00	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	49,000	36.75	1,800,750.00	
CLP HOLDINGS LTD	248,100	62.50	15,506,250.00	
HONG KONG & CHINA GAS	550,765	17.32	9,539,249.80	
HONGKONG ELECTRIC HOLDINGS	178,500	50.05	8,933,925.00	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	25,500	108.70	2,771,850.00	
香港ドル 小計	8,641,412		300,365,522.40	
(邦貨換算額)			(3,216,914,744)	(単位：円)
シンガポールドル				
COSCO CORP SINGAPORE LTD	95,000	2.12	201,400.00	
FRASER & NEAVE LTD	132,000	6.08	802,560.00	
KEPPEL CORP LTD	161,000	11.78	1,896,580.00	
NOBLE GROUP LTD	369,400	2.15	794,210.00	
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	123,820	4.94	611,670.80	

SEMBCORP MARINE LTD	103,400	5.32	550,088.00	
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG	231,000	3.25	750,750.00	
YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	170,000	1.90	323,000.00	
COMFORTDELGRO CORP LTD	258,000	1.57	405,060.00	
NEPTUNE ORIENT LINES LTD	140,000	2.20	308,000.00	
SINGAPORE AIRLINES LTD	67,266	14.20	955,177.20	
GENTING SINGAPORE PLC	771,000	2.02	1,557,420.00	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	185,250	3.92	726,180.00	
CYCLE & CARRIAGE LTD	14,000	32.78	458,920.00	
OLAM INTERNATIONAL LTD	141,000	2.97	418,770.00	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	891,600	0.67	601,830.00	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	238,000	5.30	1,261,400.00	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	216,000	14.58	3,149,280.00	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	313,000	9.55	2,989,150.00	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	157,000	18.72	2,939,040.00	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	104,000	8.32	865,280.00	
CAPITALAND LTD	331,000	3.40	1,125,400.00	
CAPITAMALLS ASIA LTD	190,000	1.92	364,800.00	
CITY DEVELOPMENTS LTD	70,000	10.72	750,400.00	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LIMITED	220,000	1.90	418,000.00	
KEPPEL LAND LTD	90,000	4.24	381,600.00	
UOL GROUP LIMITED	62,000	4.53	280,860.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,008,015	2.96	2,983,724.40	
STARHUB LIMITED	80,000	2.56	204,800.00	
シンガポールドル 小計	6,932,751		29,075,350.40	
(邦貨換算額)			(1,900,074,148)	(単位：円)
イスラエルシュケル				
DELEK GROUP LTD	530	868.00	460,040.00	
ISRAEL CHEMICALS LIMITED	55,000	64.00	3,520,000.00	
ISRAEL CORPORATION LTD/THE	310	4,551.00	1,410,810.00	
MAKHTESHIM-AGAN INDUSTRIES LTD	32,000	18.55	593,600.00	
ELBIT SYSTEMS LTD	3,000	188.30	564,900.00	
TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	118,400	188.20	22,282,880.00	
BANK HAPOALIM BM	135,000	17.53	2,366,550.00	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	156,000	17.57	2,740,920.00	
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	70,000	7.63	534,450.00	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	16,000	38.40	614,400.00	
NICE SYSTEMS LTD	8,200	128.30	1,052,060.00	
BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	211,000	10.18	2,147,980.00	
CELLCOM ISRAEL LTD	6,700	115.80	775,860.00	
PARTNER COMMUNICATIONS COMPANY LTD	11,000	69.58	765,380.00	
イスラエルシュケル 小計	823,140		39,829,830.00	
(邦貨換算額)			(916,882,686)	(単位：円)
合計	137,747,702		242,196,727,337	単位：円

(外貨建有価証券邦貨換算額合計)			(242,196,727,337)	(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、572銘柄、信託財産純資産総額に対する比率53.2%、合計に対する比率54.7%です。  
カナダドル表示の株式については、100銘柄、信託財産純資産総額に対する比率5.9%、合計に対する比率6.0%です。  
ユーロ表示の株式については、263銘柄、信託財産純資産総額に対する比率15.0%、合計に対する比率15.4%です。  
英ポンド表示の株式については、101銘柄、信託財産純資産総額に対する比率10.6%、合計に対する比率10.9%です。  
スイスフラン表示の株式については、37銘柄、信託財産純資産総額に対する比率3.9%、合計に対する比率4.0%です。  
スウェーデンクローナ表示の株式については、33銘柄、信託財産純資産総額に対する比率1.5%、合計に対する比率1.6%です。  
ノルウェークローネ表示の株式については、10銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.4%、合計に対する比率0.4%です。  
デンマーククローネ表示の株式については、11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3.9%、合計に対する比率4.0%です。  
ニュージーランドドル表示の株式については、5銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.1%、合計に対する比率0.1%です。  
香港ドル表示の株式については、40銘柄、信託財産純資産総額に対する比率1.3%、合計に対する比率1.3%です。  
シンガポールドル表示の株式については、29銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.8%、合計に対する比率0.8%です。  
イスラエルシェケル表示の株式については、14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。

## (b) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	口数	評価額	備考
投資証券	米ドル			
	AMB PROPERTY CORP	20,450	732,928.00	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	91,400	1,607,726.00	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,857	1,256,046.33	
	BOSTON PROPERTIES INC	17,279	1,633,038.29	
	DUKE REALTY CORP	31,773	433,383.72	
	EQUITY RESIDENTIAL	35,886	1,925,642.76	
	FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	7,804	636,494.24	
	GENERAL GROWTH PROPERTIES	55,155	872,000.55	
	HCP,INC.	45,257	1,668,625.59	
	HEALTH CARE REIT INC	17,800	881,812.00	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	85,351	1,617,401.45	
	KIMCO REALTY CORPORATION	49,732	937,448.20	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	15,247	520,837.52	
	MACERICH COMPANY/THE	16,900	836,719.00	
	PLUM CREEK TIMBER COMPANY	20,607	872,294.31	
	PROLOGIS	71,652	1,152,880.68	
	PUBLIC STORAGE	18,593	2,052,481.27	
	RAYONIER INC	9,600	594,816.00	
	REGENCY CENTERS CORP	11,100	484,959.00	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	37,442	4,048,603.46	
	VENTAS INC	20,279	1,126,295.66	
	VORNADO REALTY TRUST	20,771	1,839,687.47	
	米ドル 小計	710,935	27,732,121.50	
	(邦貨換算額)		(2,312,026,969)	(単位：円)
	カナダドル			
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	14,700	352,065.00	
	カナダドル 小計	14,700	352,065.00	
	(邦貨換算額)		(29,798,781)	(単位：円)
	ユーロ			
	CORIO NV	7,898	387,278.43	
	FONCIERE DES REGIONS	3,200	249,024.00	
	GECINA SA	2,430	225,941.40	
	ICADE	2,770	225,478.00	
	KLEPIERRE	12,532	356,472.74	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	11,691	1,689,934.05	
	ユーロ 小計	40,521	3,134,128.62	
	(邦貨換算額)		(355,629,574)	(単位：円)
	英ポンド			
	BRITISH LAND CO PLC	110,305	620,465.62	
	CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP PLC	65,855	252,092.94	

	HAMMERSON PLC	85,497	377,041.77	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	96,227	707,749.58	
	SEGRO PLC	98,434	322,272.91	
	英ポンド 小計	456,318	2,279,622.82	
	(邦貨換算額)		(307,475,525)	(単位：円)
	オーストラリアドル			
	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	265,612	494,038.32	
	DEXUS PROPERTY GROUP	599,804	539,823.60	
	GOODMAN GROUP	850,000	578,000.00	
	GPT GROUP	223,494	708,475.98	
	LEND LEASE GROUP	64,872	587,740.32	
	MAP GROUP	51,000	160,140.00	
	MIRVAC GROUP	436,710	556,805.25	
	SP AUSNET	90,000	79,200.00	
	STOCKLAND	303,614	1,159,805.48	
	TRANSURBAN GROUP	166,123	870,484.52	
	WESTFIELD GROUP	280,993	2,770,590.98	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	374,993	1,019,980.96	
	オーストラリアドル 小計	3,707,215	9,525,085.41	
	(邦貨換算額)		(803,821,957)	(単位：円)
	香港ドル			
	LINK REIT	273,500	6,796,475.00	
	香港ドル 小計	273,500	6,796,475.00	
	(邦貨換算額)		(72,790,247)	(単位：円)
	シンガポールドル			
	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	178,000	359,560.00	
	CAPITAMALL TRUST	280,000	509,600.00	
	シンガポールドル 小計	458,000	869,160.00	
	(邦貨換算額)		(56,799,606)	(単位：円)
	合計		3,938,342,659	単位：円
	(外貨建有価証券邦貨換算額合計)		(3,938,342,659)	(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。
- 米ドル表示の投資証券については、22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58.7%です。  
カナダ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0.8%です。  
ユーロ表示の投資証券については、6銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.1%、合計に対する比率9.0%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7.8%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20.4%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1.8%です。

シンガポールドル表示の投資証券については、2銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.0%、  
合計に対する比率1.4%です。

#### 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22年2月18日現在)	(平成23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	1,385,373,567	2,376,894,301
コール・ローン	945,750,933	1,700,580,582
国債証券	249,345,450,647	251,531,322,830
派生商品評価勘定	-	46,985
未収利息	2,941,603,143	2,782,609,035
前払費用	218,285,393	163,078,168
流動資産合計	254,836,463,683	258,554,531,901
資産合計	254,836,463,683	258,554,531,901
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	17,653
未払金	-	629,852,786
未払解約金	40,125,360	100,000
流動負債合計	40,125,360	629,970,439
負債合計	40,125,360	629,970,439
純資産の部		
元本等		
1 元本		
元本	215,320,683,575	232,040,596,375
2 剰余金		
剰余金又は欠損金( )	39,475,654,748	25,883,965,087
元本等合計	254,796,338,323	257,924,561,462
純資産合計	254,796,338,323	257,924,561,462
負債・純資産合計	254,836,463,683	258,554,531,901

(注) 「外国債券パッシブ・マザーファンド」は、毎年12月17日(ただし、休業日の場合は翌営業日)に決算を行います。上記の貸借対照表は平成22年2月18日ならびに平成23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21年2月19日 至平成22年2月18日	自平成22年2月19日 至平成23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、 わが国における対顧客先物相 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22年2月18日現在)	(平成23年2月18日現在)
1. 受益権総数	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	平成23年2月18日現在における 受益権の総数 232,040,596,375口
2. 1単位当たり純資産額	1.1833円 (1万円 = 11,833円)	1.1115円 (1万円 = 11,115円)

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）および「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。

・金融商品の状況に関する事項

項目	自平成22年2月19日 至平成23年2月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。当ファンドにおけるデリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。リスクを管理する部署では、各種リスクごとに定められた頻度で、測定項目が上下限值（リミットあるいは注意レベル）内に収まっているかどうかのモニタリングを行っております。上下限値を越えていることが発見された場合は、原則として速やかに修正を行うよう、リスク管理を行う部署から関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われます。また、是正勧告あるいは報告を受けた関連運用グループでは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、リスク管理を行う部署は、上下限値に抵触した事実ならびにその後の対処結果あるいは関連運用グループの対処方針の決定に関し、必要に応じて、リスク管理を行う部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告する体制となっております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	自平成22年2月19日 至平成23年2月18日
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（国債証券） 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (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。 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。 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」）。 金利先渡取引および為替先渡取引。 外国為替の売買の予約取引。
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。
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。
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。
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。
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。

## ・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22年2月18日現在）

平成22年2月18日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（平成23年2月18日現在）

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場外取引	為替予約取引				
	買建				
	米ドル	248,357,535	-	248,389,120	31,585
	カナダドル	162,883,640	-	162,899,040	15,400
	ユーロ	222,544,458	-	222,526,805	17,653
	買建 合計	633,785,633	-	633,814,965	29,332

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

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

（自 平成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。

（自 平成22年2月19日 至 平成23年2月18日）

該当事項はありません。

(その他の注記)

(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
SMAM・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



(平成23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	215,320,683,575円
同期中における追加設定元本額	22,035,975,976円
同期中における一部解約元本額	5,316,063,176円
平成23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	2,171,554,836円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	179,994,598円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	552,141,648円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	263,272,135円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	14,549,658円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	4,174,195円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	1,519,331円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	2,959,485円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	1,186,971円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	541,958円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	1,151,969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>	5,433,965,999円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	12,526,169,077円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	40,453,671,792円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	13,319,828,368円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	28,268,981,057円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	91,524,028円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	196,747,885円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	53,611,192円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	1,562,315,688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>	194,802,342円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	2,567,424,101円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	3,717,387,890円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	7,561,241,821円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	18,059,352,339円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,353,591,991円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	15,005,560,777円
三井住友・外国債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	2,321,117,028円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	11,055,432,469円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	469,277,232円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	11,859,320,187円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	46,680,131,946円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	313,637,724円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	97,474,185円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	26,779,741円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	451,561,788円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	1,624,794,486円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	421,550,044円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	300,170,848円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	77,178,050円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	11,445,110円

SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	2,671,844,411円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	99,657,995円
合計	232,040,596,375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 0.375% 12/08/31	5,000,000.00	4,987,109.40	
	US T 0.375% 12/09/30	9,000,000.00	8,968,359.42	
	US T 0.375% 12/10/31	5,000,000.00	4,976,953.15	
	US T 0.5% 12/11/30	8,000,000.00	7,973,125.04	
	US T 0.5% 13/10/15	5,000,000.00	4,916,796.90	
	US T 0.5% 13/11/15	7,000,000.00	6,870,390.66	
	US T 0.625% 12/07/31	10,000,000.00	10,019,531.30	
	US T 0.625% 12/12/31	7,500,000.00	7,483,007.85	
	US T 0.625% 2012/06/30	10,000,000.00	10,024,218.80	
	US T 0.75% 13/08/15	8,000,000.00	7,944,375.04	
	US T 0.75% 13/09/15	6,000,000.00	5,948,437.50	
	US T 0.75% 13/12/15	7,000,000.00	6,907,578.16	
	US T 0.75% 2012/05/31	10,000,000.00	10,044,531.30	
	US T 0.875% 12/01/31	12,000,000.00	12,064,687.56	
	US T 0.875% 12/02/29	8,000,000.00	8,040,000.00	
	US T 1 14/01/15	3,000,000.00	2,976,093.75	
	US T 1% 12/03/31	11,000,000.00	11,074,765.68	
	US T 1% 12/04/30	10,000,000.00	10,070,312.50	
	US T 1% 13/07/15	8,000,000.00	8,001,250.00	
	US T 1.125% 12/12/15	9,000,000.00	9,063,281.25	
	US T 1.125% 2013/06/15	6,000,000.00	6,023,906.28	
	US T 1.25% 15/08/31	8,000,000.00	7,709,375.04	
	US T 1.25% 15/09/30	7,000,000.00	6,730,390.66	
	US T 1.25% 15/10/31	5,000,000.00	4,794,140.65	
	US T 1.375% 12/03/15	7,000,000.00	7,073,828.16	
	US T 1.375% 12/04/15	8,000,000.00	8,089,375.04	
	US T 1.375% 12/05/15	8,500,000.00	8,602,929.73	
	US T 1.375% 12/09/15	7,000,000.00	7,085,312.50	
	US T 1.375% 12/10/15	8,000,000.00	8,096,875.04	
	US T 1.375% 12/11/15	10,000,000.00	10,118,750.00	
	US T 1.375% 12/2/15	8,000,000.00	8,079,375.04	
	US T 1.375% 13/02/15	10,000,000.00	10,110,937.50	
	US T 1.375% 13/03/15	8,000,000.00	8,086,250.00	
	US T 1.375% 13/05/15	8,000,000.00	8,078,125.04	
	US T 1.375% 2013/01/15	10,000,000.00	10,114,843.80	
	US T 1.5% 12/07/15	9,000,000.00	9,130,781.25	
	US T 1.5% 13/12/31	7,000,000.00	7,049,218.75	
	US T 1.75% 12/08/15	10,000,000.00	10,182,031.30	

	US T 1.75% 13/04/15	10,000,000.00	10,189,843.80
	US T 1.75% 14/01/31	6,500,000.00	6,588,359.37
	US T 1.75% 14/03/31	8,000,000.00	8,090,625.04
	US T 1.75% 15/7/31	5,000,000.00	4,939,062.50
	US T 1.875% 12/06/15	8,000,000.00	8,151,875.04
	US T 1.875% 14/02/28	6,000,000.00	6,096,562.50
	US T 1.875% 14/04/30	8,000,000.00	8,111,875.04
	US T 1.875% 17/08/31	3,000,000.00	2,820,937.50
	US T 1.875% 17/09/30	6,000,000.00	5,625,937.50
	US T 1.875% 17/10/31	6,000,000.00	5,617,500.00
	US T 1.875% 2015/06/30	7,000,000.00	6,965,000.00
	US T 11.25% 15/02/15	2,000,000.00	2,732,500.00
	US T 2% 13/11/30	7,000,000.00	7,152,578.16
	US T 2.125% 14/11/30	10,500,000.00	10,664,882.86
	US T 2.125% 2015/05/31	8,000,000.00	8,056,875.04
	US T 2.25% 14/05/31	9,000,000.00	9,241,171.92
	US T 2.25% 15/01/31	8,000,000.00	8,141,250.00
	US T 2.25% 17/11/30	7,000,000.00	6,705,781.25
	US T 2.375% 14/08/31	8,000,000.00	8,220,000.00
	US T 2.375% 14/09/30	10,000,000.00	10,267,187.50
	US T 2.375% 14/10/31	8,000,000.00	8,202,500.00
	US T 2.375% 15/02/28	11,000,000.00	11,235,468.75
	US T 2.375% 16/03/31	5,500,000.00	5,501,718.75
	US T 2.375% 17/7/31	5,000,000.00	4,858,593.75
	US T 2.5% 13/03/31	4,500,000.00	4,656,445.33
	US T 2.5% 15/03/31	9,000,000.00	9,229,218.75
	US T 2.5% 15/04/30	10,000,000.00	10,239,062.50
	US T 2.50% 2017/06/30	5,000,000.00	4,909,765.65
	US T 2.625% 14/06/30	9,000,000.00	9,343,828.17
	US T 2.625% 14/07/31	10,000,000.00	10,373,437.50
	US T 2.625% 16/02/29	5,000,000.00	5,073,437.50
	US T 2.625% 16/04/30	5,000,000.00	5,057,031.25
	US T 2.625% 20/11/15	3,000,000.00	2,768,437.50
	US T 2.625% 20/8/15	15,000,000.00	13,914,843.75
	US T 2.625% 2014/12/31	8,000,000.00	8,265,625.04
	US T 2.75 17/12/31	4,000,000.00	3,950,000.00
	US T 2.75% 13/02/28	3,700,000.00	3,844,820.33
	US T 2.75% 13/10/31	5,500,000.00	5,732,890.62
	US T 2.75% 16/11/30	7,000,000.00	7,049,218.75
	US T 2.75% 19/02/15	15,000,000.00	14,527,734.45
	US T 2.75% 2017/05/31	7,000,000.00	6,983,593.75
	US T 2.875% 13/01/31	4,000,000.00	4,165,937.52
	US T 3% 16/08/31	7,000,000.00	7,173,906.25
	US T 3% 16/09/30	7,000,000.00	7,168,437.50
	US T 3% 17/02/28	7,000,000.00	7,122,500.00
	US T 3.125% 13/04/30	4,500,000.00	4,721,835.96

	US T 3.125% 13/08/31	5,500,000.00	5,786,601.59	
	US T 3.125% 13/09/30	6,500,000.00	6,840,234.37	
	US T 3.125% 16/10/31	6,000,000.00	6,174,375.00	
	US T 3.125% 17/01/31	7,000,000.00	7,176,093.75	
	US T 3.125% 17/04/30	7,000,000.00	7,148,750.00	
	US T 3.125% 19/05/15	16,000,000.00	15,863,750.08	
	US T 3.25% 16/05/31	4,000,000.00	4,164,375.00	
	US T 3.25% 16/06/30	6,000,000.00	6,240,937.50	
	US T 3.25% 16/07/31	5,000,000.00	5,196,093.75	
	US T 3.25% 17/03/31	8,000,000.00	8,240,000.00	
	US T 3.25% 2016/12/31	8,000,000.00	8,263,750.00	
	US T 3.375% 12/11/30	3,000,000.00	3,144,140.64	
	US T 3.375% 13/06/30	5,000,000.00	5,285,156.25	
	US T 3.375% 13/07/31	5,500,000.00	5,819,687.50	
	US T 3.375% 19/11/15	15,000,000.00	15,030,468.75	
	US T 3.5% 13/05/31	5,000,000.00	5,294,921.90	
	US T 3.5% 18/02/15	8,500,000.00	8,792,187.50	
	US T 3.5% 20/05/15	15,000,000.00	15,056,250.00	
	US T 3.5% 39/02/15	6,000,000.00	4,905,937.50	
	US T 3.625 12/12/31	3,500,000.00	3,688,398.45	
	US T 3.625% 13/05/15	3,650,000.00	3,873,562.50	
	US T 3.625% 19/08/15	16,000,000.00	16,402,500.00	
	US T 3.625% 20/02/15	15,000,000.00	15,262,500.00	
	US T 3.75% 18/11/15	13,000,000.00	13,558,593.75	
	US T 3.875% 12/10/31	3,000,000.00	3,165,703.14	
	US T 3.875% 13/02/15	3,800,000.00	4,035,125.00	
	US T 3.875% 18/05/15	6,000,000.00	6,342,187.50	
	US T 3.875% 40/8/15	11,000,000.00	9,587,187.50	
	US T 4% 12/11/15	5,000,000.00	5,288,281.25	
	US T 4% 14/02/15	6,500,000.00	7,023,046.87	
	US T 4% 18/08/15	8,000,000.00	8,501,250.00	
	US T 4% 2015/02/15	7,700,000.00	8,360,515.62	
	US T 4.125 15/05/15	7,200,000.00	7,853,625.00	
	US T 4.125% 12/08/31	2,500,000.00	2,636,718.75	
	US T 4.25% 12/09/30	3,000,000.00	3,176,718.75	
	US T 4.25% 13/08/15	7,000,000.00	7,552,343.75	
	US T 4.25% 13/11/15	6,900,000.00	7,483,265.62	
	US T 4.25% 14/08/15	5,400,000.00	5,906,250.00	
	US T 4.25% 14/11/15	6,100,000.00	6,682,359.37	
	US T 4.25% 15/08/15	7,600,000.00	8,327,937.50	
	US T 4.25% 17/11/15	5,000,000.00	5,421,875.00	
	US T 4.25% 39/05/15	9,000,000.00	8,416,406.25	
	US T 4.25% 40/11/15	9,000,000.00	8,385,468.75	
	US T 4.375% 12/08/15	3,700,000.00	3,910,437.50	
	US T 4.375% 38/02/15	4,200,000.00	4,033,148.44	
	US T 4.375% 39/11/15	9,000,000.00	8,583,750.00	

	US T 4.375% 40/05/15	11,000,000.00	10,479,218.75	
	US T 4.5 15/11/15	5,800,000.00	6,413,531.25	
	US T 4.5% 12/03/31	3,500,000.00	3,659,960.95	
	US T 4.5% 12/04/30	3,000,000.00	3,147,656.25	
	US T 4.5% 160215	5,400,000.00	5,970,375.00	
	US T 4.5% 17/05/15	5,000,000.00	5,507,031.25	
	US T 4.5% 36/02/15	5,500,000.00	5,424,375.00	
	US T 4.5% 38/05/15	4,500,000.00	4,408,242.21	
	US T 4.5% 39/08/15	9,000,000.00	8,773,593.75	
	US T 4.625% 12/02/29	2,500,000.00	2,608,984.37	
	US T 4.625% 12/07/31	3,000,000.00	3,179,062.50	
	US T 4.625% 16/11/15	5,200,000.00	5,775,250.00	
	US T 4.625% 17/02/15	5,000,000.00	5,551,562.50	
	US T 4.625% 40/02/15	10,000,000.00	9,943,750.00	
	US T 4.75% 12/01/31	3,000,000.00	3,126,093.75	
	US T 4.75% 12/05/31	3,500,000.00	3,694,414.08	
	US T 4.75% 14/05/15	6,400,000.00	7,087,000.00	
	US T 4.75% 17/08/15	5,000,000.00	5,579,296.90	
	US T 4.75% 37/02/15	4,000,000.00	4,093,125.00	
	US T 4.875% 12/02/15	5,820,000.00	6,080,990.62	
	US T 4.875% 12/06/30	3,500,000.00	3,711,367.20	
	US T 4.875% 16/08/15	4,900,000.00	5,514,796.87	
	US T 5% 37/05/15	4,000,000.00	4,246,875.00	
	US T 5.125% 16/05/15	5,700,000.00	6,472,171.87	
	US T 5.25% 28/11/15	3,000,000.00	3,324,843.75	
	US T 5.25% 29/02/15	2,000,000.00	2,217,500.00	
	US T 5.375% 31/02/15	4,020,000.00	4,516,218.75	
	US T 5.5% 28/08/15	2,000,000.00	2,281,250.00	
	US T 6% 26/02/15	3,000,000.00	3,607,031.25	
	US T 6.125% 27/11/15	4,000,000.00	4,873,750.00	
	US T 6.125% 29/08/15	2,420,000.00	2,958,071.87	
	US T 6.25% 23/08/15	4,500,000.00	5,535,000.00	
	US T 6.25% 30/05/15	3,000,000.00	3,723,750.00	
	US T 6.5% 26/11/15	2,000,000.00	2,523,125.00	
	US T 6.625% 27/02/15	2,000,000.00	2,555,312.50	
	US T 6.75% 26/08/15	1,000,000.00	1,290,781.25	
	US T 6.875% 25/08/15	2,000,000.00	2,603,750.00	
	US T 7.125% 23/02/15	3,400,000.00	4,474,187.50	
	US T 7.25% 16/05/15	4,000,000.00	4,967,500.00	
	US T 7.25% 22/08/15	2,500,000.00	3,316,796.87	
	US T 7.5% 16/11/15	3,400,000.00	4,299,406.25	
	US T 7.5% 24/11/15	2,000,000.00	2,734,375.00	
	US T 7.625% 25/02/15	2,000,000.00	2,765,937.50	
	US T 7.875% 21/02/15	2,000,000.00	2,740,312.50	
	US T 8% 21/11/15	2,800,000.00	3,888,500.00	
	US T 8.125% 19/08/15	3,300,000.00	4,513,265.62	

	US T 8.125% 21/05/15	2,000,000.00	2,788,125.00	
	US T 8.125% 21/08/15	2,000,000.00	2,795,312.50	
	US T 8.75% 17/05/15	3,000,000.00	4,047,187.50	
	US T 8.75% 20/08/15	3,000,000.00	4,305,468.75	
	US T 8.875% 17/08/15	2,000,000.00	2,730,312.50	
	US T 8.875% 190215	2,100,000.00	2,966,085.94	
	US T-BOND 8.5% 20/02/15	2,000,000.00	2,812,500.00	
	米ドル 小計	1,161,110,000.00	1,200,448,595.59	
	(邦貨換算額)		(100,081,399,414)	(単位：円)
	カナダドル			
	CAN 1.5% 12/06/01	1,000,000.00	998,910.00	
	CAN 1.5% 12/12/01	3,000,000.00	2,983,560.00	
	CAN 1.5% 2012/03/01	1,000,000.00	1,000,370.00	
	CAN 1.75% 2013/03/01	4,000,000.00	3,987,600.00	
	CAN 2% 12/09/01	3,000,000.00	3,013,440.00	
	CAN 2% 14/12/01	4,000,000.00	3,927,600.00	
	CAN 2% 16/06/01	2,000,000.00	1,914,020.00	
	CAN 2.5% 13/09/01	1,000,000.00	1,009,810.00	
	CAN 2.5% 2015/06/01	1,000,000.00	994,450.00	
	CAN 3% 14/06/01	4,500,000.00	4,588,470.00	
	CAN 3% 15/12/01	2,000,000.00	2,020,200.00	
	CAN 3.25% 21/06/01	2,000,000.00	1,943,720.00	
	CAN 3.5% 13/06/01	4,500,000.00	4,649,490.00	
	CAN 3.5% 20/06/01	3,000,000.00	3,004,500.00	
	CAN 3.75% 11/09/01	2,000,000.00	2,026,780.00	
	CAN 3.75% 12/06/01	2,000,000.00	2,054,380.00	
	CAN 3.75% 19/06/01	5,000,000.00	5,133,500.00	
	CAN 4% 16/06/01	3,000,000.00	3,165,060.00	
	CAN 4% 17/06/01	3,000,000.00	3,160,200.00	
	CAN 4% 41/06/01	3,000,000.00	3,080,400.00	
	CAN 4.25% 18/06/01	2,500,000.00	2,666,250.00	
	CAN 4.5% 15/06/01	3,000,000.00	3,226,320.00	
	CAN 5% 14/06/01	2,500,000.00	2,706,900.00	
	CAN 5% 37/06/01	4,000,000.00	4,718,160.00	
	CAN 5.25% 12/06/01	2,620,000.00	2,740,677.20	
	CAN 5.25% 13/06/01	2,000,000.00	2,144,160.00	
	CAN 5.75% 29/06/01	2,800,000.00	3,499,468.00	
	CAN 5.75% 33/06/01	3,000,000.00	3,829,620.00	
	CAN 8% 23/06/01	980,000.00	1,396,039.40	
	CAN 8% 27/06/01	2,000,000.00	3,016,260.00	
	CAN 9% 25/06/01	1,480,000.00	2,336,712.80	
	CANADA-GOV'T 1.25 111201	1,000,000.00	999,550.00	
	カナダドル 小計	81,880,000.00	87,936,577.40	
	(邦貨換算額)		(7,442,951,911)	(単位：円)

	メキシコペソ			
	MEX BONOS 8% 200611	50,000,000.00	52,117,750.00	
	MEX BONOS 8.5% 290531	50,000,000.00	51,823,400.00	
	MEX BONOS 8.5% 381118	30,000,000.00	30,563,880.00	
	MEX BONOS 9% 121220	100,000,000.00	106,666,400.00	
	MEX BONOS 9.5% 141218	80,000,000.00	88,664,000.00	
	メキシコペソ 小計	310,000,000.00	329,835,430.00	
	(邦貨換算額)		(2,282,461,175)	(単位:円)
	ユーロ			
	BGB 2% 12/3/28	1,500,000.00	1,503,750.00	
	BGB 2.75% 16/03/28	2,000,000.00	1,930,600.00	
	BGB 3.25% 16/09/28	3,500,000.00	3,437,700.00	
	BGB 3.5% 15/03/28	1,500,000.00	1,517,100.00	
	BGB 3.75% 15/09/28	3,300,000.00	3,354,450.00	
	BGB 3.75% 20/09/28	4,000,000.00	3,877,200.00	
	BGB 4% 13/03/28	2,800,000.00	2,892,400.00	
	BGB 4% 14/03/28	3,200,000.00	3,312,960.00	
	BGB 4% 17/03/28	2,500,000.00	2,536,250.00	
	BGB 4% 18/03/28	2,500,000.00	2,523,250.00	
	BGB 4% 19/03/28	3,000,000.00	3,007,500.00	
	BGB 4% 2022/03/28	3,000,000.00	2,934,600.00	
	BGB 4.25% 13/09/28	3,000,000.00	3,125,100.00	
	BGB 4.25% 14/09/28	3,500,000.00	3,648,750.00	
	BGB 4.25% 2041/03/28	1,000,000.00	938,800.00	
	BGB 4.25% 21/09/28	1,000,000.00	1,001,800.00	
	BGB 5% 12/09/28	3,700,000.00	3,870,200.00	
	BGB 5% 35/03/28	4,000,000.00	4,239,600.00	
	BGB 5.5% 17/09/28	1,740,000.00	1,910,346.00	
	BGB 5.5% 28/03/28	3,000,000.00	3,348,600.00	
	BGB 8% 12/12/24	1,600,000.00	1,763,520.00	
	BGB 8% 15/03/28	2,000,000.00	2,364,200.00	
	BKO 1% 12/12/14	5,000,000.00	4,966,250.00	
	BTNS 0.75% 12/09/20	2,700,000.00	2,673,810.00	
	BTNS 2% 15/07/12	6,000,000.00	5,870,700.00	
	BTNS 2.25% 16/02/25	2,000,000.00	1,963,000.00	
	BTNS 2.5% 14/01/12	6,500,000.00	6,604,975.00	
	BTNS 2.5% 15/01/15	5,500,000.00	5,528,600.00	
	BTNS 3% 14/07/12	4,500,000.00	4,638,600.00	
	BTNS 3.75% 13/01/12	5,000,000.00	5,200,250.00	
	BTNS 4.5% 12/07/12	5,900,000.00	6,140,130.00	
	BTNS 4.5% 13/07/12	5,500,000.00	5,858,600.00	
	BTPS 2% 12/12/15	5,000,000.00	4,965,000.00	
	BTPS 2% 13/06/01	4,000,000.00	3,928,400.00	
	BTPS 2.25% 13/11/01	3,000,000.00	2,939,100.00	
	BTPS 2.5% 12/07/01	4,000,000.00	4,020,400.00	



	BTPS 3% 12/03/01	4,500,000.00	4,551,300.00	
	BTPS 3% 15/04/15	5,000,000.00	4,896,000.00	
	BTPS 3% 15/06/15	4,000,000.00	3,903,600.00	
	BTPS 3% 15/11/01	1,000,000.00	968,700.00	
	BTPS 3.5% 14/06/01	5,000,000.00	5,040,000.00	
	BTPS 3.75% 13/12/15	5,000,000.00	5,092,000.00	
	BTPS 3.75% 15/08/01	7,200,000.00	7,246,800.00	
	BTPS 3.75% 16/08/01	7,000,000.00	7,000,000.00	
	BTPS 3.75% 21/03/01	5,000,000.00	4,631,500.00	
	BTPS 3.75% 21/08/01	6,300,000.00	5,843,880.00	
	BTPS 4% 12/04/15	4,500,000.00	4,603,050.00	
	BTPS 4% 17/02/01	6,000,000.00	6,027,000.00	
	BTPS 4% 20/09/01	5,500,000.00	5,253,600.00	
	BTPS 4% 37/02/01	5,500,000.00	4,523,750.00	
	BTPS 4.25 12/10/15	4,000,000.00	4,121,600.00	
	BTPS 4.25 13/08/01	5,810,000.00	5,988,948.00	
	BTPS 4.25 19/02/01	6,400,000.00	6,368,640.00	
	BTPS 4.25% 13/04/15	4,500,000.00	4,636,800.00	
	BTPS 4.25% 14/08/01	6,900,000.00	7,109,760.00	
	BTPS 4.25% 15/02/01	6,000,000.00	6,171,600.00	
	BTPS 4.25% 19/09/01	6,000,000.00	5,913,600.00	
	BTPS 4.25% 20/03/01	6,000,000.00	5,859,600.00	
	BTPS 4.5% 18/02/01	6,000,000.00	6,109,800.00	
	BTPS 4.5% 18/08/01	5,000,000.00	5,072,000.00	
	BTPS 4.5% 19/03/01	5,000,000.00	5,033,500.00	
	BTPS 4.5% 20/02/01	5,500,000.00	5,495,050.00	
	BTPS 4.5% 26/03/01	3,000,000.00	2,826,000.00	
	BTPS 4.75% 13/02/01	5,300,000.00	5,514,120.00	
	BTPS 4.75% 23/08/01	4,500,000.00	4,460,400.00	
	BTPS 5% 12/02/01	7,400,000.00	7,620,520.00	
	BTPS 5% 25/03/01	5,000,000.00	4,989,500.00	
	BTPS 5% 34/08/01	4,970,000.00	4,748,835.00	
	BTPS 5% 39/08/01	5,000,000.00	4,725,000.00	
	BTPS 5% 40/09/01	4,000,000.00	3,763,200.00	
	BTPS 5.25 17/08/01	5,000,000.00	5,328,000.00	
	BTPS 5.25% 29/11/01	7,200,000.00	7,202,160.00	
	BTPS 5.75% 33/02/01	3,700,000.00	3,867,240.00	
	BTPS 6% 31/05/01	7,900,000.00	8,501,980.00	
	BTPS 6.5% 27/11/01	5,960,000.00	6,775,924.00	
	BTPS 7.25% 26/11/01	2,000,000.00	2,433,000.00	
	BTPS 9.00% 23/11/01	3,000,000.00	4,130,700.00	
	BUNDESOLIGA 2% 16/02/26	2,000,000.00	1,963,500.00	
	BUNDESSCHATZ 0.5% 120615	2,500,000.00	2,477,550.00	
	BUNDESSCHATZ 0.75% 120914	4,000,000.00	3,965,120.00	
	BUNDESSCHATZ 1% 12/03/16	5,000,000.00	4,996,350.00	
	DBR 2.25% 20/09/04	4,000,000.00	3,697,200.00	

	DBR 2.5% 21/01/04	2,000,000.00	1,877,400.00
	DBR 3% 20/07/04	5,000,000.00	4,917,000.00
	DBR 3.25% 15/07/04	5,500,000.00	5,738,425.00
	DBR 3.25% 20/01/04	5,500,000.00	5,558,300.00
	DBR 3.25% 42/07/04	1,000,000.00	929,000.00
	DBR 3.5% 160104	5,200,000.00	5,468,840.00
	DBR 3.5% 19/07/04	6,000,000.00	6,187,800.00
	DBR 3.75% 13/07/04	5,800,000.00	6,094,350.00
	DBR 3.75% 15/01/04	6,000,000.00	6,369,600.00
	DBR 3.75% 17/01/04	5,000,000.00	5,301,000.00
	DBR 3.75% 19/01/04	6,000,000.00	6,316,200.00
	DBR 4% 18/01/04	5,000,000.00	5,356,000.00
	DBR 4% 37/01/04	6,200,000.00	6,439,320.00
	DBR 4.00% 16/07/04	5,900,000.00	6,337,190.00
	DBR 4.25% 14/01/04	5,700,000.00	6,097,860.00
	DBR 4.25% 14/07/04	6,500,000.00	6,992,700.00
	DBR 4.25% 17/07/04	5,000,000.00	5,437,500.00
	DBR 4.25% 18/07/04	5,200,000.00	5,644,600.00
	DBR 4.25% 39/07/04	3,500,000.00	3,853,850.00
	DBR 4.5% 13/01/04	6,700,000.00	7,084,312.00
	DBR 4.75% 28/07/04	3,000,000.00	3,379,800.00
	DBR 4.75% 34/07/04	4,600,000.00	5,278,960.00
	DBR 4.75% 40/07/04	4,000,000.00	4,729,200.00
	DBR 5% 12/07/04	7,220,000.00	7,585,765.20
	DBR 5.5% 31/01/04	4,300,000.00	5,305,770.00
	DBR 5.625% 28/01/04	3,980,000.00	4,899,380.00
	DBR 6% 16/06/20	890,000.00	1,041,122.00
	DBR 6.25% 24/01/04	2,700,000.00	3,473,010.00
	DBR 6.25% 300104	2,200,000.00	2,938,320.00
	DBR 6.5% 27/07/04	3,000,000.00	4,016,700.00
	FINNISH GO 1.75% 160415	1,000,000.00	958,600.00
	FINNISH GO 3.875% 170915	2,000,000.00	2,104,000.00
	FRANCE 3.75% 17/04/25	6,000,000.00	6,277,800.00
	FRANCE 3.75% 19/10/25	5,000,000.00	5,122,000.00
	FRANCE O.A.T.3.5% 150425	4,600,000.00	4,806,540.00
	FRANCE O.A.T.3.5% 200425	7,000,000.00	6,995,800.00
	FRANCE O.A.T.4% 600425	2,000,000.00	1,965,400.00
	FRANCE O.A.T.5% 12/04/25	4,700,000.00	4,910,090.00
	FRANCE OAT4% 141025	5,000,000.00	5,323,500.00
	FRTR 2.5% 20/10/25	4,000,000.00	3,650,000.00
	FRTR 3.0% 15/10/25	8,000,000.00	8,164,000.00
	FRTR 3.25% 16/04/25	6,700,000.00	6,886,930.00
	FRTR 3.5% 26/04/25	4,000,000.00	3,804,000.00
	FRTR 3.75% 21/04/25	7,700,000.00	7,800,100.00
	FRTR 4% 13/04/25	5,700,000.00	5,986,710.00
	FRTR 4% 13/10/25	5,060,000.00	5,350,950.00

	FRTR 4% 14/04/25	5,300,000.00	5,627,540.00
	FRTR 4% 18/04/25	6,000,000.00	6,324,000.00
	FRTR 4% 38/10/25	6,500,000.00	6,426,550.00
	FRTR 4% 55/04/25	4,170,000.00	4,067,835.00
	FRTR 4.25% 17/10/25	4,500,000.00	4,828,950.00
	FRTR 4.25% 18/10/25	5,000,000.00	5,346,000.00
	FRTR 4.25% 19/04/25	6,900,000.00	7,352,640.00
	FRTR 4.25% 23/10/25	5,000,000.00	5,243,500.00
	FRTR 4.5% 41/04/25	3,000,000.00	3,211,200.00
	FRTR 4.75% 12/10/25	5,800,000.00	6,117,260.00
	FRTR 4.75% 35/04/25	4,600,000.00	5,072,880.00
	FRTR 5% 16/10/25	6,200,000.00	6,912,380.00
	FRTR 5.5% 29/04/25	5,000,000.00	5,943,000.00
	FRTR 5.75% 32/10/25	4,700,000.00	5,836,460.00
	FRTR 6.00% 25/10/25	3,500,000.00	4,336,150.00
	FRTR 8.5% 12/12/26	1,000,000.00	1,127,200.00
	FRTR 8.5% 19/10/25	2,550,000.00	3,529,965.00
	FRTR 8.5% 23/04/25	3,200,000.00	4,715,200.00
	IRISH 3.9% 12/03/05	1,000,000.00	995,000.00
	IRISH 4% 14/01/15	2,500,000.00	2,275,000.00
	IRISH 4.4% 19/06/18	1,500,000.00	1,125,000.00
	IRISH 4.5% 18/10/18	2,000,000.00	1,564,000.00
	IRISH 4.5% 20/04/18	2,490,000.00	1,795,539.00
	IRISH 4.6% 16/04/18	2,800,000.00	2,347,520.00
	IRISH 5% 13/04/18	2,000,000.00	1,945,600.00
	IRISH 5% 2020/10/18	2,000,000.00	1,475,600.00
	IRISH 5.4% 25/03/13	2,000,000.00	1,430,400.00
	IRISH 5.9% 19/10/18	2,000,000.00	1,685,000.00
	ITALY 5.75% 16/07/25	1,000,000.00	1,082,300.00
	NETHERLANDS 2.75 150115	3,500,000.00	3,580,850.00
	NETHERLANDS 3.25% 150715	3,100,000.00	3,221,830.00
	NETHERLANDS 3.5% 200715	4,000,000.00	4,040,000.00
	NETHERLANDS 3.75% 140715	3,400,000.00	3,597,540.00
	NETHERLANDS 3.75% 230115	2,000,000.00	2,033,400.00
	NETHERLANDS 3.75% 420115	2,000,000.00	2,004,200.00
	NETHERLANDS 4% 16/07/15	3,300,000.00	3,530,010.00
	NETHERLANDS 4% 18/07/15	3,500,000.00	3,712,800.00
	NETHERLANDS 4% 19/07/15	3,500,000.00	3,697,050.00
	NETHERLANDS 4.25% 130715	4,400,000.00	4,672,800.00
	NETHERLANDS 4.5% 170715	3,600,000.00	3,937,320.00
	NETHERLANDS 5% 12/07/15	4,000,000.00	4,206,800.00
	NETHERLANDS 5.5% 280115	3,000,000.00	3,648,000.00
	NETHERLANDS 7.5% 230115	1,000,000.00	1,381,900.00
	NETHERLANDS G1.75%130115	2,000,000.00	2,012,400.00
	NETHERLANDS GOVT4%370115	3,000,000.00	3,106,500.00
	OBL 1.75% 15/10/09	4,000,000.00	3,907,200.00

	OBL 2.25% 14/04/11	5,000,000.00	5,074,250.00	
	OBL 2.25% 15/04/10	4,000,000.00	4,017,400.00	
	OBL 2.5% 14/10/10	4,000,000.00	4,076,200.00	
	OBL 2.5% 15/02/27	4,500,000.00	4,568,175.00	
	OBL 3.5% 13/04/12	4,500,000.00	4,693,275.00	
	OBL 4% 12/04/13	4,000,000.00	4,130,080.00	
	OBL 4% 13/10/11	4,000,000.00	4,241,800.00	
	OBL 4.25% 12/10/12	4,000,000.00	4,189,400.00	
	PGB 3.35% 15/10/15	2,000,000.00	1,736,900.00	
	PGB 3.6% 14/10/15	2,000,000.00	1,817,200.00	
	PGB 3.85% 21/04/15	2,000,000.00	1,503,600.00	
	PGB 4.10% 37/04/15	2,000,000.00	1,389,800.00	
	PGB 4.2% 16/10/15	1,000,000.00	888,000.00	
	PGB 4.35% 17/10/16	1,400,000.00	1,215,900.00	
	PGB 4.375% 14/06/16	2,000,000.00	1,886,900.00	
	PGB 4.45% 18/06/15	2,000,000.00	1,674,000.00	
	PGB 4.75% 19/06/14	2,000,000.00	1,681,000.00	
	PGB 4.8% 20/06/15	2,000,000.00	1,660,000.00	
	PGB 4.95% 23/10/25	2,000,000.00	1,600,800.00	
	PGB 5% 12/06/15	1,500,000.00	1,509,000.00	
	PGB 5.45% 13/09/23	2,000,000.00	2,010,000.00	
	RAGB 3.2% 17/02/20	1,000,000.00	1,012,300.00	
	RAGB 3.4% 14/10/20	3,000,000.00	3,109,500.00	
	RAGB 3.5% 15/07/15	2,200,000.00	2,279,200.00	
	RAGB 3.5% 21/09/15	3,000,000.00	2,962,500.00	
	RAGB 3.65% 22/04/20	1,000,000.00	991,000.00	
	RAGB 3.8% 13/10/20	3,000,000.00	3,145,500.00	
	RAGB 3.9% 20/07/15	3,500,000.00	3,578,750.00	
	RAGB 4% 16/09/15	3,000,000.00	3,163,500.00	
	RAGB 4.15% 37/03/15	2,000,000.00	2,028,000.00	
	RAGB 4.3% 14/07/15	2,400,000.00	2,557,200.00	
	RAGB 4.3% 17/09/15	1,500,000.00	1,596,750.00	
	RAGB 4.35% 19/03/15	2,200,000.00	2,338,600.00	
	RAGB 4.65% 18/01/15	3,000,000.00	3,258,000.00	
	RAGB 4.85% 26/03/15	2,000,000.00	2,187,000.00	
	RAGB 5% 12/07/15	3,000,000.00	3,147,000.00	
	RAGB 6.25% 27/07/15	2,000,000.00	2,529,200.00	
	RFGB 3.125% 14/09/15	1,500,000.00	1,555,200.00	
	RFGB 3.375% 20/04/15	2,000,000.00	1,988,400.00	
	RFGB 4% 25/07/04	1,000,000.00	1,027,100.00	
	RFGB 4.25% 12/09/15	2,000,000.00	2,083,000.00	
	RFGB 4.25% 15/07/04	1,300,000.00	1,398,670.00	
	RFGB 4.375% 19/07/04	1,000,000.00	1,081,000.00	
	RFGB 5.375% 13/07/04	1,500,000.00	1,626,150.00	
	SPGB 2.3% 2013/04/30	4,500,000.00	4,407,750.00	
	SPGB 2.5% 13/10/31	4,000,000.00	3,888,000.00	

	SPGB 2.75% 12/04/30	3,500,000.00	3,518,900.00	
	SPGB 3% 15/04/30	3,000,000.00	2,870,100.00	
	SPGB 3.15% 16/01/31	3,800,000.00	3,599,740.00	
	SPGB 3.3% 14/10/31	3,000,000.00	2,951,100.00	
	SPGB 3.8% 17/01/31	4,000,000.00	3,818,000.00	
	SPGB 3.9% 12/10/31	3,500,000.00	3,552,500.00	
	SPGB 4% 20/04/30	4,000,000.00	3,668,000.00	
	SPGB 4.1% 18/07/30	4,000,000.00	3,784,000.00	
	SPGB 4.2% 13/07/30	3,500,000.00	3,564,750.00	
	SPGB 4.2% 37/01/31	3,250,000.00	2,478,450.00	
	SPGB 4.25% 14/01/31	3,500,000.00	3,565,450.00	
	SPGB 4.3% 19/10/31	3,000,000.00	2,818,500.00	
	SPGB 4.4% 15/01/31	3,800,000.00	3,887,780.00	
	SPGB 4.6% 19/07/30	3,500,000.00	3,368,750.00	
	SPGB 4.65% 25/07/30	3,500,000.00	3,112,200.00	
	SPGB 4.7% 41/07/30	2,000,000.00	1,632,200.00	
	SPGB 4.75% 14/07/30	3,500,000.00	3,619,000.00	
	SPGB 4.8% 24/01/31	3,300,000.00	3,066,030.00	
	SPGB 4.85% 20/10/31	3,000,000.00	2,932,500.00	
	SPGB 4.9% 40/07/30	4,000,000.00	3,393,600.00	
	SPGB 5% 12/07/30	3,100,000.00	3,201,990.00	
	SPGB 5.5% 17/07/30	4,280,000.00	4,457,620.00	
	SPGB 5.5% 21/04/30	1,000,000.00	1,009,800.00	
	SPGB 5.75% 32/07/30	3,700,000.00	3,600,100.00	
	SPGB 6% 29/01/31	4,900,000.00	4,942,630.00	
	SPGB 6.15% 13/01/31	3,600,000.00	3,808,800.00	
	ユーロ 小計	930,270,000.00	953,296,271.20	
	(邦貨換算額)		(108,170,527,893)	(単位:円)
	英ポンド			
	UKT 2% 16/01/22	2,000,000.00	1,928,000.00	
	UKT 2.25% 14/03/07	7,000,000.00	7,060,200.00	
	UKT 2.75% 15/01/22	5,500,000.00	5,565,450.00	
	UKT 3.75% 19/09/07	6,000,000.00	6,023,700.00	
	UKT 3.75% 20/09/07	4,000,000.00	3,970,000.00	
	UKT 4% 16/09/07	4,800,000.00	5,062,560.00	
	UKT 4% 22/03/07	3,000,000.00	2,999,100.00	
	UKT 4% 60/01/22	2,000,000.00	1,848,000.00	
	UKT 4.25% 27/12/07	3,800,000.00	3,757,820.00	
	UKT 4.25% 32/06/07	3,800,000.00	3,699,870.00	
	UKT 4.25% 36/03/07	4,800,000.00	4,632,960.00	
	UKT 4.25% 39/09/07	3,500,000.00	3,382,575.00	
	UKT 4.25% 40/12/07	3,000,000.00	2,889,300.00	
	UKT 4.25% 46/12/07	3,900,000.00	3,766,347.00	
	UKT 4.25% 49/12/07	3,500,000.00	3,387,440.00	
	UKT 4.25% 55/12/07	5,000,000.00	4,883,300.00	

	UKT 4.5% 13/03/07	6,700,000.00	7,110,207.50	
	UKT 4.5% 19/03/07	5,200,000.00	5,523,960.00	
	UKT 4.5% 34/09/07	4,000,000.00	3,990,840.00	
	UKT 4.5% 42/12/07	5,000,000.00	5,029,660.05	
	UKT 4.75% 15/09/07	4,400,000.00	4,798,640.00	
	UKT 4.75% 20/03/07	5,200,000.00	5,593,068.00	
	UKT 4.75% 30/12/07	3,800,000.00	3,959,600.00	
	UKT 4.75% 38/12/07	4,500,000.00	4,694,400.00	
	UKT 5% 12/03/07	7,560,000.00	7,874,798.40	
	UKT 5% 14/09/07	5,500,000.00	6,014,250.00	
	UKT 5% 18/03/07	3,500,000.00	3,865,050.00	
	UKT 5% 25/03/07	4,400,000.00	4,784,560.00	
	UKT 5.25% 12/06/07	5,500,000.00	5,797,550.00	
	UKT 6.0% 281207	3,000,000.00	3,617,400.00	
	UKT 8% 13/09/27	2,500,000.00	2,913,250.00	
	UKT 8% 15/12/07	1,900,000.00	2,358,470.00	
	UKT 8% 21/06/07	2,620,000.00	3,534,904.00	
	UKT 8.75% 17/08/25	2,300,000.00	3,070,500.00	
	英債券 小計	143,180,000.00	149,387,729.95	
	(邦貨換算額)		(20,149,417,015)	(単位：円)
	スイスフラン			
	SWITZERLAND 2.5% 160312	2,000,000.00	2,121,000.00	
	SWITZERLAND 2.75% 120610	1,500,000.00	1,544,400.00	
	SWITZERLAND 3% 180108	1,000,000.00	1,094,700.00	
	SWITZERLAND 3% 19/05/12	2,000,000.00	2,200,400.00	
	SWITZERLAND 4% 13/02/11	2,000,000.00	2,133,400.00	
	SWITZERLAND 4% 280408	900,000.00	1,135,350.00	
	SWITZERLAND 4% 230211	1,000,000.00	1,211,500.00	
	SWITZERLAND 4.25% 140106	800,000.00	878,560.00	
	SWITZERLAND 4.25% 170605	2,000,000.00	2,335,000.00	
	スイスフラン 小計	13,200,000.00	14,654,310.00	
	(邦貨換算額)		(1,285,915,702)	(単位：円)
	スウェーデンクローナ			
	SGB 3% 16/07/12	17,000,000.00	16,879,300.00	
	SGB 3.5% 39/03/30	10,000,000.00	9,412,800.00	
	SGB 3.75% 17/08/12	13,200,000.00	13,551,120.00	
	SGB 4.25% 19/03/12	20,000,000.00	21,273,600.00	
	SGB 4.5% 15/08/12	13,000,000.00	13,793,000.00	
	SGB 5% 20/12/01	20,000,000.00	22,662,000.00	
	SGB 5.5% 12/10/08	16,000,000.00	16,860,800.00	
	SGB 6.75% 14/05/05	19,100,000.00	21,418,740.00	
	スウェーデンクローナ 小計	128,300,000.00	135,851,360.00	
	(邦貨換算額)		(1,768,784,707)	(単位：円)

	ノルウェークロネ			
	NORWAY GOV 4.25% 170519	10,000,000.00	10,425,000.00	
	NORWAY GOV 4.5% 19/05/22	6,000,000.00	6,357,000.00	
	NORWAY GOV 5% 150515	10,000,000.00	10,760,800.00	
	NORWAY GOV 6.5% 130515	16,000,000.00	17,356,000.00	
	ノルウェークロネ 小計	42,000,000.00	44,898,800.00	
	(邦貨換算額)		(656,869,444)	(単位：円)
	デンマーククロネ			
	DGB 4% 12/11/15	10,000,000.00	10,435,000.00	
	DGB 4% 15/11/15	16,000,000.00	17,062,400.00	
	DGB 4% 17/11/15	15,000,000.00	16,080,000.00	
	DGB 4% 19/11/15	21,000,000.00	22,167,600.00	
	DGB 4.5% 39/11/15	27,000,000.00	31,217,400.00	
	DGB 5% 13/11/15	20,820,000.00	22,562,634.00	
	DGB 6% 11/11/15	13,000,000.00	13,465,400.00	
	DGB 7% 24/11/10	5,080,000.00	6,986,016.00	
	デンマーククロネ 小計	127,900,000.00	139,976,450.00	
	(邦貨換算額)		(2,130,441,569)	(単位：円)
	ポーランドズロチ			
	POLGB 0% 11/07/25	5,000,000.00	4,911,000.00	
	POLGB 0% 12/01/25	5,000,000.00	4,797,500.00	
	POLGB 0% 12/10/25	6,000,000.00	5,545,800.00	
	POLGB 4.75% 12/04/25	7,000,000.00	7,000,000.00	
	POLGB 5.00% 13/10/24	6,500,000.00	6,448,000.00	
	POLGB 5.25% 13/04/25	5,000,000.00	5,005,000.00	
	POLGB 5.25% 17/10/25	8,000,000.00	7,675,200.00	
	POLGB 5.25% 2020/10/25	5,000,000.00	4,620,000.00	
	POLGB 5.5% 19/10/25	6,000,000.00	5,658,000.00	
	POLGB 5.5% 2015/04/25	5,000,000.00	4,958,500.00	
	POLGB 5.75% 14/04/25	8,000,000.00	8,056,000.00	
	POLGB 5.75% 22/09/23	10,200,000.00	9,589,020.00	
	POLGB 6.25% 15/10/24	7,500,000.00	7,680,000.00	
	ポーランドズロチ 小計	84,200,000.00	81,944,020.00	
	(邦貨換算額)		(2,383,751,541)	(単位：円)
	オーストラリアドル			
	ACGB 4.5% 20/04/15	3,000,000.00	2,752,770.00	
	ACGB 4.75% 12/11/15	2,000,000.00	1,990,466.00	
	ACGB 4.75% 16/06/15	2,000,000.00	1,935,014.00	
	ACGB 5.25% 19/03/15	3,000,000.00	2,927,673.00	
	ACGB 5.5% 13/12/15	2,000,000.00	2,012,000.00	
	ACGB 5.75% 11/06/15	2,000,000.00	2,005,902.00	
	ACGB 5.75% 12/04/15	3,000,000.00	3,033,300.00	
	ACGB 5.75% 21/05/15	2,000,000.00	2,006,800.00	

	ACGB 5.75% 22/07/15	2,000,000.00	2,010,000.00	
	ACGB 6% 17/02/15	3,300,000.00	3,379,896.30	
	ACGB 6.25% 14/06/15	3,000,000.00	3,088,308.00	
	ACGB 6.25% 15/04/15	3,000,000.00	3,100,875.00	
	ACGB 6.5% 13/05/15	3,540,000.00	3,642,914.88	
	オーストラリアドル 小計	33,840,000.00	33,885,919.18	
	(邦貨換算額)		(2,859,632,719)	(単位：円)
	シンガポールドル			
	SIGB 1.625% 130401	3,000,000.00	3,069,198.00	
	SIGB 2.25% 13/07/01	1,000,000.00	1,045,628.00	
	SIGB 3.125% 22/09/01	1,000,000.00	1,022,847.00	
	SIGB 3.25% 20/09/01	2,000,000.00	2,097,360.00	
	SIGB 3.5% 12/07/01	1,000,000.00	1,046,460.00	
	SIGB 3.5% 27/03/01	2,000,000.00	2,079,470.00	
	SIGB 3.625 140701	2,500,000.00	2,771,142.50	
	SIGB 3.75% 160901	1,000,000.00	1,110,834.00	
	SIGB 4% 18/09/01	1,200,000.00	1,343,732.40	
	シンガポールドル 小計	14,700,000.00	15,586,671.90	
	(邦貨換算額)		(1,018,589,008)	(単位：円)
	マレーシアリングット			
	MALAYSIAN 2.509 12/08/27	6,000,000.00	5,956,860.00	
	MALAYSIAN 3.502 27/05/31	4,000,000.00	3,548,448.00	
	MALAYSIAN 3.702 13/02/25	8,000,000.00	8,089,320.00	
	MALAYSIAN 3.718 12/06/15	8,000,000.00	8,079,728.00	
	MALAYSIAN 3.814% 17/02/15	2,000,000.00	2,021,948.00	
	MALAYSIAN 4.24 18/02/07	5,000,000.00	5,132,720.00	
	MALAYSIAN 4.262 16/09/15	3,000,000.00	3,103,539.00	
	MALAYSIAN 4.378 19/11/29	5,000,000.00	5,148,500.00	
	MALAYSIAN 5.094 14/04/30	6,000,000.00	6,316,194.00	
	マレーシアリングット 小計	47,000,000.00	47,397,257.00	
	(邦貨換算額)		(1,300,580,732)	(単位：円)
	合計		251,531,322,830	単位：円
	(外貨建有価証券邦貨換算額合計)		(251,531,322,830)	(単位：円)

(注)

1. 合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券にかかるもので、内書きであります。
2. 米ドル表示の債券については、183銘柄、信託財産純資産総額に対する比率38.8%、合計に対する比率39.8%です。  
カナダドル表示の債券については、32銘柄、信託財産純資産総額に対する比率2.9%、合計に対する比率3.0%です。  
メキシコペソ表示の債券については、5銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.9%、合計に対する比率0.9%です。  
ユーロ表示の債券については、246銘柄、信託財産純資産総額に対する比率41.9%、合計に対する比率43.0%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7.8%、



合計に対する比率8.0%です。

スイスフラン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。

スウェーデンクローナ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0.7%、

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、4銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.3%、

合計に対する比率0.3%です。

デンマーククローネ表示の債券については、8銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.8%、

合計に対する比率0.8%です。

ポーランドズロチ表示の債券については、13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、13銘柄、信託財産純資産総額に対する比率1.1%、

合計に対する比率1.1%です。

シンガポールドル表示の債券については、9銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.4%、

合計に対する比率0.4%です。

マレーシアリングgit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。

#### 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。

## 独立監査人の監査報告書

平成23年4月12日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 鈴木 敏夫 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）の平成22年2月19日から平成23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23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23年4月12日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 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22年2月19日から平成23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23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23年4月12日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 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22年2月19日から平成23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23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  
業務執行社員 公認会計士 鈴木 敏夫 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DC年金バランス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（前期）へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成22年 6月18日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

あずさ監査法人

指 定 社 員      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期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友アセットマネジメント株式会社の平成22年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

---

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

[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。

## 独立監査人の中間監査報告書

平成22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

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 鈴木 敏夫 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 辰巳 幸久 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友アセットマネジメント株式会社の平成22年4月1日から平成23年3月31日までの第26期事業年度の中間会計期間（平成22年4月1日から平成22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22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22年4月1日から平成22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。