

## 【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24年 5 月17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】	三島 克哉
【電話番号】	03-5405-0228
【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	<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。

**(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24年5月18日から平成25年5月16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	国 内	株 式	インデックス型
追 加 型	海 外	債 券	
		不 動 産 投 信	特 殊 型
	内 外	そ の 他 資 産 ( ) 資 産 複 合	

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 《属性区分表》

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株 式	年 1 回	グ ロー パ ル (日本を含む)			
一 般 大 型 株	年 2 回	日 本			日 経 2 2 5
中 小 型 株	年 4 回	北 米			
債 券	年 6 回 (隔月)	欧 州	ファミリーファンド	あ り	
一 般 公 債	年 12 回 (毎月)	ア ジ ア			
社 債	日 々	オ セ ア ニ ア			T O P I X
そ の 他 債 券 クレジット属性 ( )	そ の 他 ( )	中 南 米	ファンド・オブ・ファンズ	な し	
不動産投信		ア フ リ カ			
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))		中 近 東 (中 東)			そ の 他 (合成指数)
資 産 複 合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型		エ マ ー ジ ン グ			

(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。

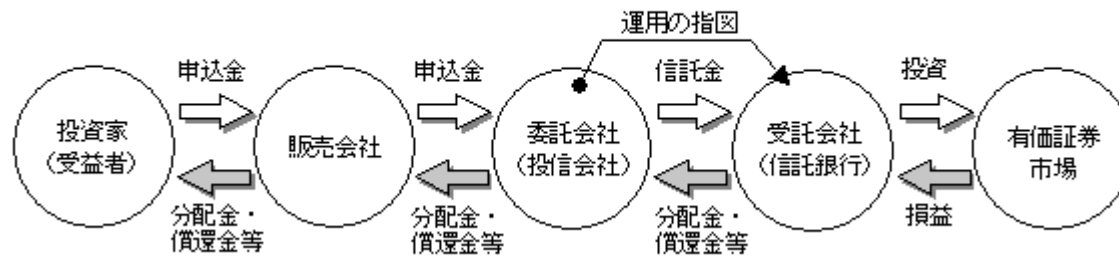
（ロ）受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

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

（ハ）販売会社

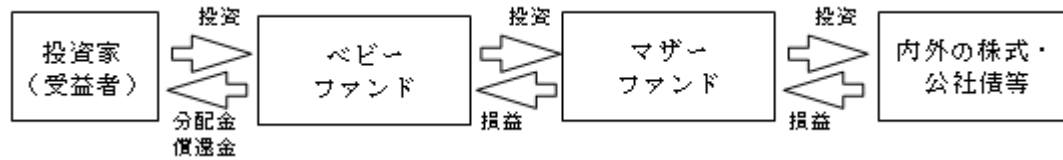
委託会社との間で締結される販売契約（名称の如何を問いません。）に基づき、当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書（目論見書）の提供、受益者からの一部解約実行請求の受付け、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を行います。

### 運営の仕組み



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「ペーパーファンド」とし、「ペーパーファンド」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。



□ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

2,000百万円（平成24年3月30日現在）

(ロ) 会社の沿革

昭和60年7月15日 三生投資顧問株式会社設立

昭和62年2月20日 証券投資顧問業の登録

昭和62年6月10日 投資一任契約にかかる業務の認可

平成11年1月1日 三井生命保険相互会社の特別勘定運用部門と統合

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

平成12年1月27日 証券投資信託委託業の認可取得

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

(ハ) 大株主の状況

（平成24年3月30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。

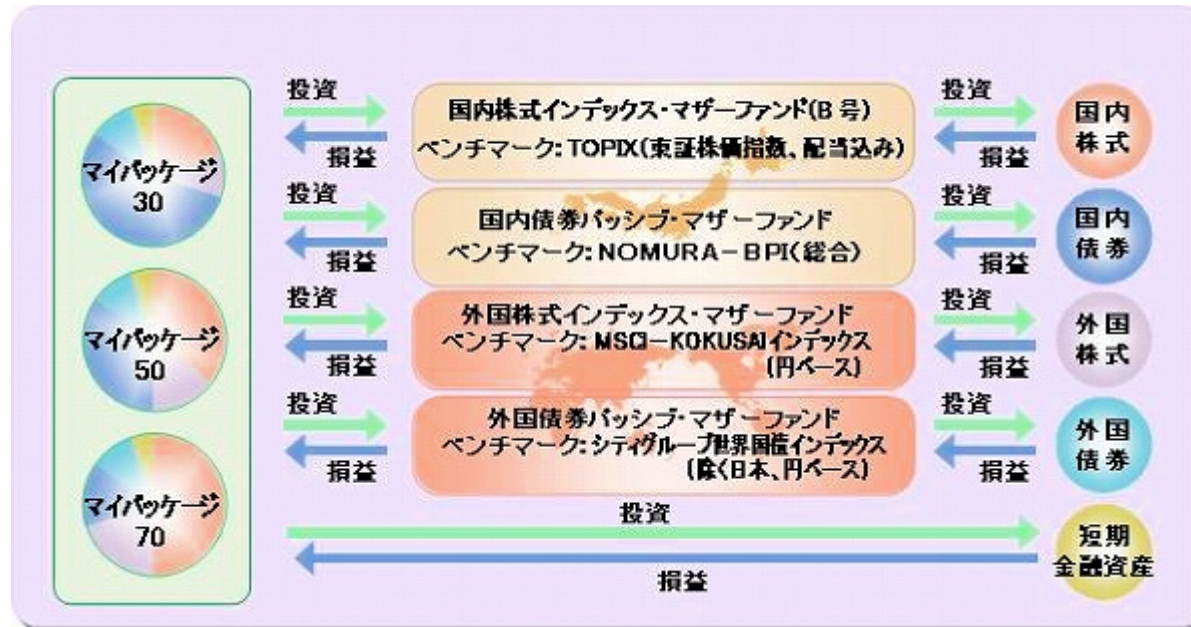
## c . マイパッケージ70

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。



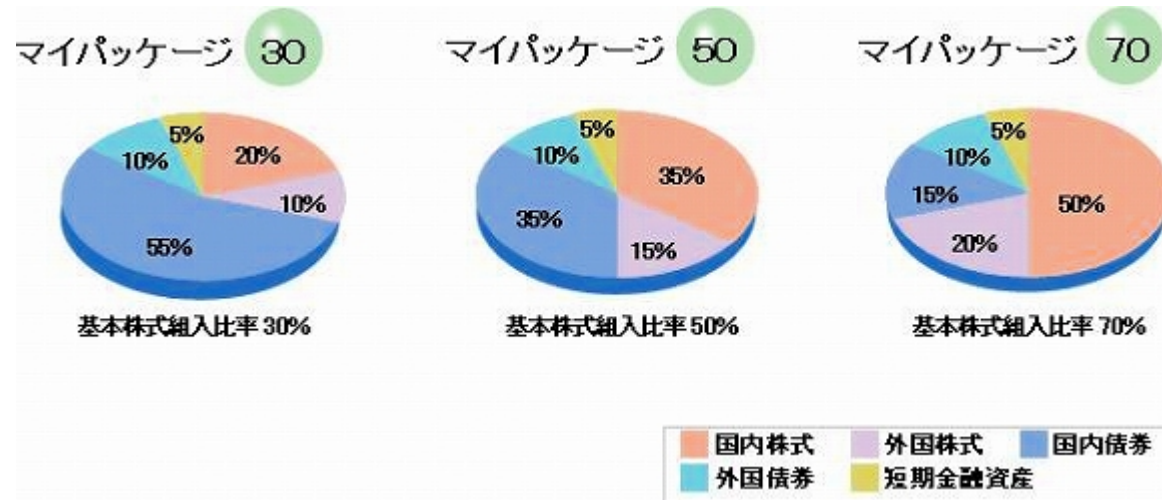
各マザーファンドは、ベンチマークに連動する投資成果を目指して運用を行います。

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

### 国内債券パッシブ・マザーファンド

わが国の公社債および短期金融資産を主要投資対象とし、N O M U R A - B P I（総合）と連動する投資成果を目指して運用を行います。ポートフォリオの作成にあたっては、マルチファクターモデルおよび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N O M U R A - B P I（総合）に近づけたポートフォリオを構築します。なお事業債の銘柄選択については、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N O M U R A - B P I（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。N O M U R A - B P I（総合）との連動性を随時チェックし、必要に応じてマルチファクターモデルおよび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、M S C I - K O K U S A Iインデックス（円ベース）と連動する投資成果を目指して運用を行います。ポートフォリオの作成にあたっては、原則として投資不適格銘柄および低流動性銘柄を除外した上で、マルチファクターモデルを活用した最適化法により推定トラッキングエラーの低減のみならず、制約条件を加えることで実績トラッキングエラーを抑えることを目指してポートフォリオを構築します。M S C I - K O K U S A Iインデックス（円ベース）との連動性を随時チェックし、必要に応じてマルチファクターモデルを使用してポートフォリオのリバランスを行います。

### 外国債券パッシブ・マザーファンド

主として日本を除く世界各国の債券に投資し、シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）と連動する投資成果を目指した運用を行います。ポートフォリオの作成にあたっては、マルチファクターモデルおよび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。



す。

**（２）【投資対象】****イ 投資対象とする資産の種類**

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

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

（ロ）特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

- １．為替手形

**ロ 投資対象とする有価証券**

委託会社は、信託金を、主として、マザーファンドの受益証券または次の有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

- １．株券または新株引受権証書
- ２．国債証券
- ３．地方債証券
- ４．特別の法律により法人の発行する債券
- ５．社債券（新株引受権証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。

#### 八 投資対象とする金融商品

委託会社は、信託金を、上記口に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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

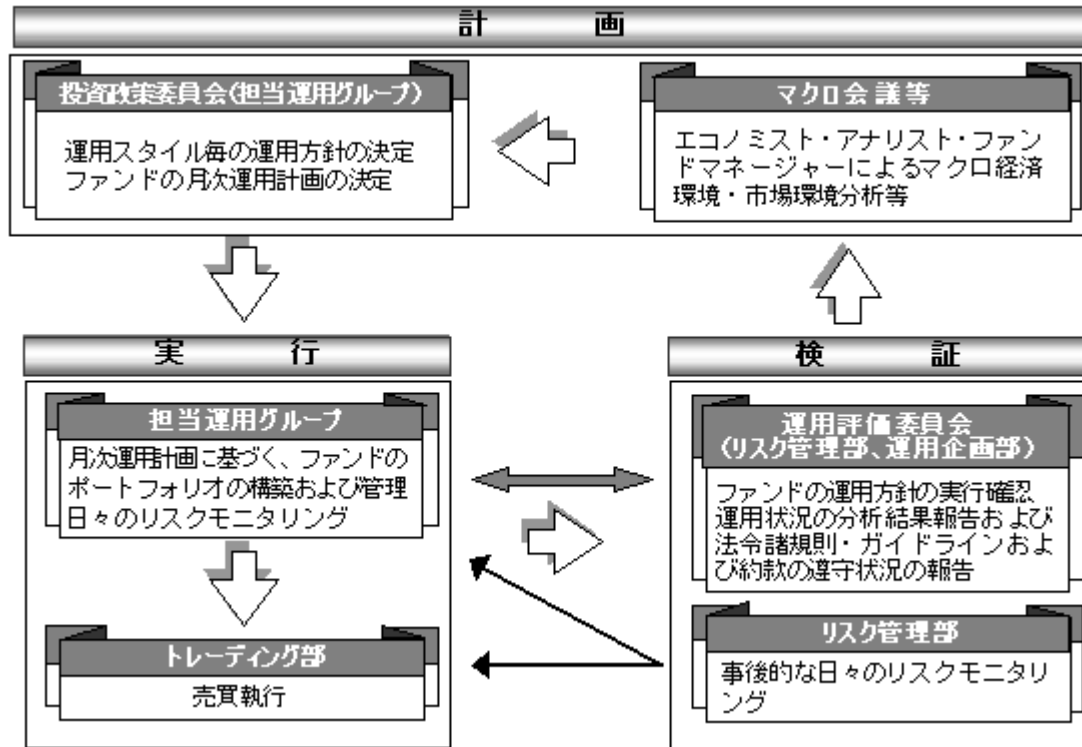
売買執行については、組織的に分離されたトレーディング部が、最良と思われる手法をもって売買を執行します。

(八) 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7名程度、運用企画部は10名程度で構成されています。

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

□ 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

（４）【分配方針】

毎決算時（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もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- ハ 留保益の運用については特に制限を定めず、委託会社の判断に基づき、前記「（１）投資方針」と同一の運用

を行います。

## （５）【投資制限】

### ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

イ 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額に対して、以下の通りとします。

マイパッケージ30 50%未満

マイパッケージ50 25%以上

マイパッケージ70 50%以上

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

ロ 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

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

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

ホ 同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

ヘ 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以内とします。

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

### ファンドの信託約款に基づくその他の投資制限

イ 投資する株式等の範囲

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

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

ロ 信用取引の指図

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

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

#### ハ 先物取引等の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めて取り扱うものとします（以下同じ。）。
- (ロ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに為替変動リスクを回避するために、わが国の取引所における通貨にかかる先物取引および通貨にかかるオプション取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- (ハ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するために、わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

#### ニ スワップ取引の指図

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

#### ホ 金利先渡取引および為替先渡取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するために、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。

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



2. 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

(ロ) 上記(イ)に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

(ハ) 委託会社は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

#### ト 有価証券の空売りの指図

(イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または借り入れた有価証券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売り付けた有価証券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。

(ロ) 有価証券の売付けの指図は、当該売付けにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。

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

#### チ 有価証券の借入れの指図

(イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入れの指図をすることができます。なお、当該有価証券の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図をするものとします。

(ロ) 有価証券の借入れの指図は、当該借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えない範囲で行うものとします。

(ハ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の借入れにかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた有価証券の一部を返還するための指図をするものとします。

(ニ) 有価証券の借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

#### リ 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

#### ヌ 外国為替予約取引の指図

(イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

(ロ) 予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

(ハ) 上記(ロ)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

#### ル 資金の借入れ

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定に資するため、信託財産において一部解約金の支払資金の不足額が生じるときは、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- (ロ) 上記（イ）の資金借入れ額は、次の各号に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。
1. 一部解約金の支払資金の手当てのために行った有価証券等の売却等による受取りの確定している資金の額の範囲内
  2. 一部解約金支払日の前営業日において確定した当該支払日における支払資金の不足額の範囲内
  3. 借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%以内
- (ハ) 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。
- (ニ) 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、T O P I X（東証株価指数、配当込み）と連動する投資成果を目指して運用を行います。

## ロ 投資態度

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

（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 - KOKUSA Iインデックス(円ベース)と連動する投資成果を目指して運用を行います。

#### ロ 投資態度

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

(ロ) 外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行わないものとします。

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

### (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。

## （外国債券バッシブ・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。

□ 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、当該発行者の経営・財務状況の変化、為替相場の変動等の影響により上下します。基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

運用の結果としてファンドに生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。したがって、当ファンドは預貯金とは異なり、投資元本が保証されているものではなく、一定の投資成果を保証するものでもありません。また、当ファンドは、預貯金や保険契約と異なり、預金保険、貯金保険、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。登録金融機関は、投資者保護基金には加入しておりません。

当ファンドが有するリスク等（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) 収益分配金に関する留意事項

分配金は、預貯金の利息とは異なり、ファンドの純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。

(チ) 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・解約に伴う組入る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る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。

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

#### 4【手数料等及び税金】

##### (1)【申込手数料】

無手数料です。

##### (2)【換金（解約）手数料】

解約手数料はありません。

##### (3)【信託報酬等】

純資産総額に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。

各ファンドの信託報酬率および実質的配分は以下の通りです。

	信託報酬率	配分		
		委託会社	販売会社	受託会社
マイパッケージ30	年0.231% (年0.22%)	年0.0945% (年0.09%)	年0.105% (年0.1%)	年0.0315% (年0.03%)
マイパッケージ50	年0.2415% (年0.23%)	年0.105% (年0.1%)	年0.105% (年0.1%)	年0.0315% (年0.03%)
マイパッケージ70	年0.252% (年0.24%)	年0.1155% (年0.11%)	年0.105% (年0.1%)	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つたりすることから、あらかじめ具体的に記載することはできません。

## （５）【課税上の取扱い】

### イ 個別元本について

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

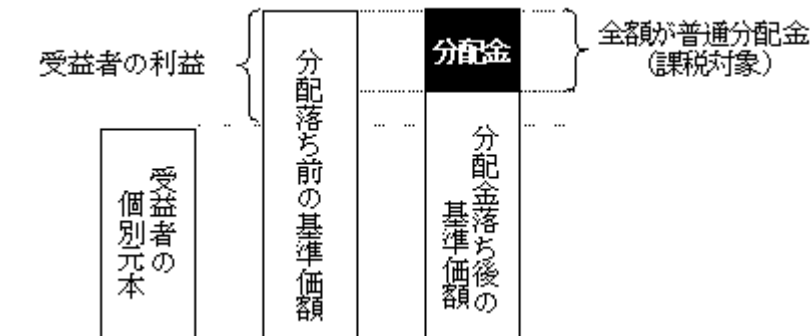
### ロ 一部解約時および償還時の課税について

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

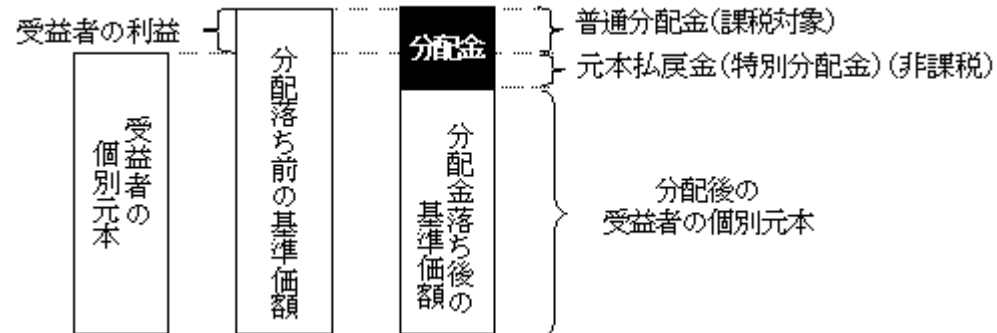
### ハ 収益分配金の課税について

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

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



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



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

## 二 個人、法人別の課税の取扱いについて

### (イ) 個人の受益者に対する課税

#### ・収益分配時

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、以下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。

時期	税率
平成24年12月31日まで	10%（所得税7%および地方税3%）
平成25年1月1日から 平成25年12月31日まで	10.147%（所得税7.147%および地方税3%）
平成26年1月1日以降	20.315%（所得税15.315%および地方税5%）

#### ・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、以下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。

時期	税率
平成24年12月31日まで	10%（所得税7%および地方税3%）

平成25年1月1日から 平成25年12月31日まで	10.147%（所得税7.147%および地方税3%）
平成26年1月1日以降	20.315%（所得税15.315%および地方税5%）

## (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、以下の税率で源泉徴収されます。

時期	税率
平成24年12月31日まで	7%（所得税のみ）
平成25年1月1日から 平成25年12月31日まで	7.147%（所得税のみ）
平成26年1月1日以降	15.315%（所得税のみ）

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24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24年3月30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	514,998,186	20.03
国内債券パッシブ・マザーファンド受益証券	日本	1,421,204,046	55.26
外国株式インデックス・マザーファンド受益証券	日本	256,282,452	9.97
外国債券パッシブ・マザーファンド受益証券	日本	258,510,487	10.05
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		120,621,985	4.69
合計(純資産総額)		2,571,617,156	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24年3月30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	2,563,224,021	35.06
国内債券パッシブ・マザーファンド受益証券	日本	2,578,030,613	35.27
外国株式インデックス・マザーファンド受益証券	日本	1,093,009,896	14.95
外国債券パッシブ・マザーファンド受益証券	日本	733,203,954	10.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		342,640,879	4.69
合計(純資産総額)		7,310,109,363	100.00

## c. 三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）

平成24年3月30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	1,722,387,544	50.15
国内債券パッシブ・マザーファンド受益証券	日本	520,668,734	15.16
外国株式インデックス・マザーファンド受益証券	日本	683,738,347	19.91

外国債券パッシブ・マザーファンド受益証券	日本	344,601,016	10.03
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		163,396,896	4.76
合計(純資産総額)		3,434,792,537	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24年3月30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	1,273,480,328	1.1157 1,420,927,093	1.1160 1,421,204,046	55.26
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）	443,581,556	1.1012 488,472,010	1.1610 514,998,186	20.03
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	218,447,260	1.1401 249,058,230	1.1834 258,510,487	10.05
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	188,332,196	1.2968 244,229,192	1.3608 256,282,452	9.97

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24年3月30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	2,310,063,274	1.1158 2,577,740,354	1.1160 2,578,030,613	35.27
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）	2,207,772,628	1.1011 2,430,978,441	1.1610 2,563,224,021	35.06
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	803,211,270	1.2968 1,041,604,375	1.3608 1,093,009,896	14.95
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	619,574,070	1.1406 706,707,173	1.1834 733,203,954	10.03

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24年3月30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）	1,483,537,937	1.1016 1,634,265,392	1.1610 1,722,387,544	50.15
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	502,453,224	1.2970 651,681,832	1.3608 683,738,347	19.91
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	466,549,045	1.1158 520,603,202	1.1160 520,668,734	15.16
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	291,195,721	1.1410 332,259,171	1.1834 344,601,016	10.03

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24年3月30日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	95.31
合計	95.31

## b . 三井住友・DC年金バランス50（標準型）

平成24年3月30日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	95.31
合計	95.31

## c . 三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）

平成24年3月30日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	95.24
合計	95.24

## 【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
第7期(平成24年2月20日)(分配落)	2,456,937,455	9,914
第7期(平成24年2月20日)(分配付)	2,456,937,455	9,914
平成23年3月末日	1,983,315,377	9,882
平成23年4月末日	1,995,607,295	9,906
平成23年5月末日	2,022,165,826	9,840
平成23年6月末日	2,205,451,833	9,855
平成23年7月末日	2,215,414,243	9,784
平成23年8月末日	2,182,799,198	9,563
平成23年9月末日	2,199,642,089	9,489
平成23年10月末日	2,253,243,202	9,636
平成23年11月末日	2,218,532,445	9,432
平成23年12月末日	2,309,300,042	9,504
平成24年1月末日	2,379,678,516	9,617
平成24年2月末日	2,500,499,617	10,010
平成24年3月末日	2,571,617,156	10,111

## 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
第7期（平成24年2月20日）（分配落）	6,937,357,284	9,064
第7期（平成24年2月20日）（分配付）	6,937,357,284	9,064
平成23年3月末日	6,016,925,267	9,171
平成23年4月末日	6,027,820,194	9,171
平成23年5月末日	6,100,591,822	9,064
平成23年6月末日	6,438,787,909	9,082
平成23年7月末日	6,421,709,027	8,977
平成23年8月末日	6,207,058,356	8,614
平成23年9月末日	6,217,101,615	8,511
平成23年10月末日	6,406,211,652	8,705
平成23年11月末日	6,230,265,408	8,423
平成23年12月末日	6,417,687,804	8,494
平成24年1月末日	6,629,149,946	8,653
平成24年2月末日	7,069,262,574	9,192
平成24年3月末日	7,310,109,363	9,341

## 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
第7期(平成24年2月20日)(分配落)	3,235,878,337	8,153
第7期(平成24年2月20日)(分配付)	3,235,878,337	8,153
平成23年3月末日	2,850,554,272	8,386
平成23年4月末日	2,851,646,556	8,365
平成23年5月末日	2,849,241,049	8,225
平成23年6月末日	3,002,348,201	8,243
平成23年7月末日	2,989,736,950	8,114
平成23年8月末日	2,854,241,933	7,636
平成23年9月末日	2,855,396,636	7,513
平成23年10月末日	2,966,084,620	7,741
平成23年11月末日	2,855,316,848	7,406
平成23年12月末日	2,933,401,024	7,473
平成24年1月末日	3,039,588,995	7,663
平成24年2月末日	3,303,473,798	8,305
平成24年3月末日	3,434,792,537	8,489

## 【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
第7期（平成23年2月19日～平成24年2月20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
第7期（平成23年2月19日～平成24年2月20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
第7期（平成23年2月19日～平成24年2月20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
第7期	1.3

（注）収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末分配落基準価額を控除した額を前期末分配落基準価額で除したものをいいます。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
第7期	4.3

## 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
第7期	7.4

## (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
第7期	624,991,852	99,146,353

（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
第7期	1,598,782,670	367,412,865

## 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
第7期	823,696,243	156,788,011

## 〔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24年3月30日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	298,842,506,030	98.21
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,445,056,056	1.79
合計(純資産総額)		304,287,562,086	100.00

株価指数先物取引の買建て 1.67%

## （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24年3月30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〕	3,322,200	2,509.90 8,338,389,780	3,570.00 11,860,254,000	3.90
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ 〔銀行業〕	19,139,400	328.14 6,280,402,716	412.00 7,885,432,800	2.59
日本	株式	本田技研工業 〔輸送用機器〕	2,161,300	2,389.64 5,164,728,932	3,145.00 6,797,288,500	2.23
日本	株式	キヤノン 〔電気機器〕	1,591,800	3,420.32 5,444,465,376	3,910.00 6,223,938,000	2.05
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ 〔銀行業〕	1,919,900	2,090.12 4,012,821,388	2,723.00 5,227,887,700	1.72
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ 〔銀行業〕	32,498,100	100.03 3,250,784,943	135.00 4,387,243,500	1.44
日本	株式	日本電信電話 〔情報・通信業〕	1,164,500	3,775.52 4,396,593,040	3,755.00 4,372,697,500	1.44

日本	株式	ファナック 〔電気機器〕	266,700	12,275.30 3,273,822,510	14,680.00 3,915,156,000	1.29
日本	株式	武田薬品工業 〔医薬品〕	1,005,700	3,145.61 3,163,539,977	3,645.00 3,665,776,500	1.20
日本	株式	三菱商事 〔卸売業〕	1,841,100	1,551.69 2,856,816,459	1,920.00 3,534,912,000	1.16
日本	株式	日立製作所 〔電気機器〕	5,752,000	423.04 2,433,326,080	531.00 3,054,312,000	1.00
日本	株式	日本たばこ産業 〔食料品〕	6,368	364,524.01 2,321,288,895	466,000.00 2,967,488,000	0.98
日本	株式	三井物産 〔卸売業〕	2,182,400	1,182.34 2,580,338,816	1,357.00 2,961,516,800	0.97
日本	株式	小松製作所 〔機械〕	1,251,000	1,895.77 2,371,608,270	2,359.00 2,951,109,000	0.97
日本	株式	日産自動車 〔輸送用機器〕	3,259,500	689.07 2,246,023,665	881.00 2,871,619,500	0.94
日本	株式	エヌ・ティ・ティ・ドコモ 〔情報・通信業〕	20,836	135,037.19 2,813,634,890	137,400.00 2,862,866,400	0.94
日本	株式	ソフトバンク 〔情報・通信業〕	1,146,300	2,545.92 2,918,388,096	2,447.00 2,804,996,100	0.92
日本	株式	ソニー 〔電気機器〕	1,599,000	1,372.12 2,194,019,880	1,704.00 2,724,696,000	0.90
日本	株式	三菱地所 〔不動産業〕	1,773,000	1,262.49 2,238,394,770	1,476.00 2,616,948,000	0.86
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス 〔小売業〕	1,058,200	2,127.23 2,251,034,786	2,458.00 2,601,055,600	0.85
日本	株式	東日本旅客鉄道 〔陸運業〕	445,800	4,695.12 2,093,084,496	5,210.00 2,322,618,000	0.76
日本	株式	信越化学工業 〔化学〕	481,200	3,805.49 1,831,201,788	4,780.00 2,300,136,000	0.76
日本	株式	パナソニック 〔電気機器〕	2,927,100	726.96 2,127,884,616	761.00 2,227,523,100	0.73

日本	株式	東京海上ホールディングス 〔保険業〕	959,400	1,832.20 1,757,812,680	2,271.00 2,178,797,400	0.72
日本	株式	K D D I 〔情報・通信業〕	3,927	504,984.02 1,983,072,246	536,000.00 2,104,872,000	0.69
日本	株式	アステラス製薬 〔医薬品〕	596,300	2,938.65 1,752,316,995	3,400.00 2,027,420,000	0.67
日本	株式	野村ホールディングス 〔証券、商品先物取引業〕	5,475,100	248.09 1,358,317,559	366.00 2,003,886,600	0.66
日本	株式	東芝 〔電気機器〕	5,395,000	346.95 1,871,795,250	364.00 1,963,780,000	0.65
日本	株式	国際石油開発帝石 〔鉱業〕	3,488	504,118.35 1,758,364,804	559,000.00 1,949,792,000	0.64
日本	株式	三菱電機 〔電気機器〕	2,562,000	712.19 1,824,630,780	732.00 1,875,384,000	0.62

## □ 種類別・業種別の投資比率

平成24年3月30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	0.10	株式（国内）	精密機器	1.41
	鉱業	0.73		その他製品	1.58
	建設業	2.35		電気・ガス業	2.94
	食料品	3.55		陸運業	3.76
	繊維製品	0.90		海運業	0.41
	パルプ・紙	0.36		空運業	0.28
	化学	5.72		倉庫・運輸関連業	0.23
	医薬品	4.66		情報・通信業	5.94
	石油・石炭製品	0.82		卸売業	5.45
	ゴム製品	0.78		小売業	4.18
	ガラス・土石製品	1.10		銀行業	9.42
	鉄鋼	1.88		証券、商品先物取引業	1.17
	非鉄金属	1.18		保険業	2.38
	金属製品	0.69		その他金融業	0.79
	機械	5.02		不動産業	2.46
	電気機器	13.55		サービス業	1.84
	輸送用機器	10.59		合計	98.21

## 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24年3月30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	593	5,102,968,900	5,082,010,000	1.67

## (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。



## 〔国内債券バッシブ・マザーファンド〕

## (1) 投資状況

平成24年3月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	383,681,467,470	76.84
地方債証券	日本	30,980,788,922	6.20
特殊債券	日本	49,574,708,370	9.93
	韓国	100,452,000	0.02
	小計	49,675,160,370	9.95
社債券	日本	29,175,449,400	5.84
	アメリカ	1,915,699,000	0.38
	オーストラリア	600,576,000	0.12
	イギリス	697,548,000	0.14
	オランダ	296,397,000	0.06
	韓国	202,358,000	0.04
	小計	32,888,027,400	6.59
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,085,665,542	0.42
合計(純資産総額)		499,311,109,704	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24年3月30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268回利付国債(10年)	13,145,000,000	104.35 13,717,838,500	103.94 13,663,701,700	1.5 2015/3/20	2.74
日本	国債証券	第277回利付国債(10年)	11,475,000,000	105.63 12,121,474,750	105.35 12,089,371,500	1.6 2016/3/20	2.42
日本	国債証券	第258回利付国債(10年)	11,793,000,000	102.95 12,141,188,700	102.32 12,067,305,180	1.3 2014/3/20	2.42

日本	国債証券	第265回利付国債（10年）	11,240,000,000	104.24 11,716,936,900	103.64 11,649,810,400	1.5 2014/12/20	2.33
日本	国債証券	第263回利付国債（10年）	11,072,000,000	104.36 11,555,803,800	103.58 11,468,709,760	1.6 2014/9/20	2.30
日本	国債証券	第274回利付国債（10年）	10,805,000,000	105.02 11,348,217,100	104.77 11,320,506,550	1.5 2015/12/20	2.27
日本	国債証券	第260回利付国債（10年）	10,685,000,000	104.12 11,125,521,500	103.25 11,032,476,200	1.6 2014/6/20	2.21
日本	国債証券	第272回利付国債（10年）	10,515,000,000	104.40 10,978,104,500	104.16 10,952,634,300	1.4 2015/9/20	2.19
日本	国債証券	第282回利付国債（10年）	10,060,000,000	106.37 10,701,600,000	106.25 10,689,655,400	1.7 2016/9/20	2.14
日本	国債証券	第284回利付国債（10年）	9,987,000,000	106.64 10,650,566,100	106.53 10,639,151,100	1.7 2016/12/20	2.13
日本	国債証券	第253回利付国債（10年）	10,390,000,000	103.08 10,710,264,000	102.18 10,616,813,700	1.6 2013/9/20	2.13
日本	国債証券	第270回利付国債（10年）	9,507,000,000	103.89 9,877,235,000	103.60 9,850,012,560	1.3 2015/6/20	1.97
日本	国債証券	第280回利付国債（10年）	8,767,000,000	107.30 9,407,349,600	106.85 9,367,802,510	1.9 2016/6/20	1.88
日本	国債証券	第256回利付国債（10年）	7,480,000,000	103.05 7,708,140,000	102.22 7,646,205,600	1.4 2013/12/20	1.53
日本	国債証券	第310回利付国債（10年）	6,600,000,000	99.57 6,571,950,000	101.62 6,707,250,000	1 2020/9/20	1.34
日本	国債証券	第313回利付国債（10年）	6,270,000,000	101.54 6,366,558,000	103.70 6,502,178,100	1.3 2021/3/20	1.30
日本	国債証券	第315回利付国債（10年）	6,330,000,000	101.21 6,406,932,400	102.63 6,497,048,700	1.2 2021/6/20	1.30
日本	国債証券	第312回利付国債（10年）	6,220,000,000	100.96 6,279,712,000	103.04 6,409,585,600	1.2 2020/12/20	1.28
日本	国債証券	第285回利付国債（10年）	5,938,000,000	106.76 6,339,601,400	106.78 6,341,071,440	1.7 2017/3/20	1.27
日本	国債証券	第305回利付国債（10年）	5,920,000,000	102.97 6,095,824,000	104.54 6,188,945,600	1.3 2019/12/20	1.24
日本	国債証券	第306回利付国債（10年）	5,850,000,000	103.57 6,059,351,000	105.15 6,151,743,000	1.4 2020/3/20	1.23
日本	国債証券	第290回利付国債（10年）	5,447,000,000	105.14 5,727,195,100	105.60 5,752,304,350	1.4 2018/3/20	1.15
日本	国債証券	第308回利付国債（10年）	4,690,000,000	102.49 4,806,781,000	104.25 4,889,512,600	1.3 2020/6/20	0.98

日本	国債証券	第320回利付国債（10年）	4,780,000,000	100.31 4,795,231,500	100.35 4,796,969,000	1 2021/12/20	0.96
日本	国債証券	第303回利付国債（10年）	4,455,000,000	104.02 4,634,091,000	105.41 4,696,149,150	1.4 2019/9/20	0.94
日本	国債証券	第297回利付国債（10年）	4,303,000,000	104.71 4,505,770,900	105.57 4,542,677,100	1.4 2018/12/20	0.91
日本	国債証券	第296回利付国債（10年）	4,013,000,000	105.49 4,233,616,100	106.22 4,262,889,510	1.5 2018/9/20	0.85
日本	国債証券	第289回利付国債（10年）	3,994,000,000	105.61 4,218,063,400	106.17 4,240,509,680	1.5 2017/12/20	0.85
日本	国債証券	第288回利付国債（10年）	3,655,000,000	106.84 3,905,002,000	107.15 3,916,332,500	1.7 2017/9/20	0.78
日本	国債証券	第286回利付国債（10年）	3,480,000,000	107.45 3,739,260,000	107.50 3,741,104,400	1.8 2017/6/20	0.75

□ 種類別の投資比率

平成24年3月30日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	76.84
地方債証券	6.20
特殊債券	9.95
社債券	6.59
合計	99.58

**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24年3月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	123,467,153,116	54.74
	カナダ	12,236,918,952	5.43
	ドイツ	8,800,472,827	3.90
	イタリア	2,307,299,152	1.02
	フランス	8,910,710,306	3.95
	オーストラリア	8,011,606,174	3.55
	イギリス	21,943,589,661	9.73
	スイス	9,567,905,817	4.24
	バミューダ	697,842,649	0.31
	香港	2,526,559,404	1.12
	シンガポール	1,722,426,699	0.76
	ニュージーランド	126,915,616	0.06
	オランダ	2,739,920,382	1.21
	スペイン	2,973,580,449	1.32
	ベルギー	1,054,506,323	0.47
	スウェーデン	3,162,539,463	1.40
	ノルウェー	910,058,857	0.40
	オーストリア	261,065,617	0.12
	ルクセンブルク	482,876,598	0.21
	フィンランド	897,609,525	0.40
	デンマーク	1,152,498,194	0.51
	アイルランド	1,478,932,661	0.66
	ギリシャ	85,489,351	0.04
	イスラエル	654,300,130	0.29
	ポルトガル	197,233,055	0.09
	ケイマン諸島	275,889,779	0.12
	モーリシャス	40,096,781	0.02
	リベリア	43,532,838	0.02
	ジャージー	854,430,847	0.38
	ガーンジー	57,847,499	0.03
アンティル	918,827,960	0.41	

	マン島	85,066,634	0.04
	小計	218,645,703,316	96.93
投資証券	アメリカ	2,921,394,504	1.30
	カナダ	51,684,750	0.02
	フランス	280,658,988	0.12
	オーストラリア	719,551,271	0.32
	イギリス	253,007,783	0.11
	香港	83,158,969	0.04
	シンガポール	98,811,859	0.04
	オランダ	35,885,604	0.02
	小計	4,444,153,728	1.97
	現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,474,362,506
合計(純資産総額)		225,564,219,550	100.00

海外金融先物取引の買建て 1.04%

## (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24年3月30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	APPLE INC 〔テクノロジー・ハードウェアおよび機器〕	111,954	30,682.34 3,435,011,688	50,124.39 5,611,626,338	2.49
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION 〔エネルギー〕	577,246	6,322.87 3,649,855,283	7,074.91 4,083,966,499	1.81
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP 〔ソフトウェア・サービス〕	141,916	14,871.45 2,110,497,918	17,117.71 2,429,277,116	1.08
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP 〔ソフトウェア・サービス〕	912,065	2,041.59 1,862,071,539	2,639.94 2,407,799,429	1.07
アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION 〔エネルギー〕	239,935	8,006.94 1,921,147,500	8,782.00 2,107,109,529	0.93
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO 〔資本財〕	1,271,645	1,227.09 1,560,431,383	1,639.69 2,085,104,225	0.92
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED 〔食品・飲料・タバコ〕	397,390	4,616.74 1,834,647,103	5,108.46 2,030,053,303	0.90
アメリカ	株式	AT&T INC 〔電気通信サービス〕	713,624	2,307.07 1,646,382,876	2,565.14 1,830,552,532	0.81
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO 〔家庭用品・パーソナル用品〕	331,275	5,139.34 1,702,535,090	5,507.55 1,824,514,255	0.81
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〕	328,798	5,160.71 1,696,831,159	5,386.73 1,771,146,905	0.79
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO 〔各種金融〕	457,685	2,347.34 1,074,345,237	3,753.61 1,717,974,333	0.76
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〕	926,101	1,594.48 1,476,655,079	1,842.69 1,706,526,127	0.76
アメリカ	株式	WELLS FARGO & COMPANY 〔銀行〕	603,219	1,979.95 1,194,347,741	2,789.52 1,682,696,652	0.75

アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A 〔ソフトウェア・サービス〕	30,841	47,931.56 1,478,257,371	53,292.81 1,643,603,796	0.73
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC 〔銀行〕	2,150,961	638.31 1,372,985,078	718.56 1,545,596,988	0.69
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE 〔食品・飲料・タバコ〕	246,087	5,440.97 1,338,953,953	6,066.44 1,492,872,980	0.66
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC. 〔食品・飲料・タバコ〕	209,250	6,119.86 1,280,582,253	7,121.76 1,490,229,012	0.66
アメリカ	株式	INTEL CORP 〔半導体・半導体製造装置〕	613,039	1,938.04 1,188,094,226	2,314.47 1,418,860,619	0.63
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC 〔電気通信サービス〕	6,057,697	221.96 1,344,594,291	229.12 1,387,955,467	0.62
イギリス	株式	BP PLC 〔エネルギー〕	2,282,750	576.58 1,316,193,930	602.71 1,375,857,390	0.61
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〕	280,958	4,446.45 1,249,268,452	4,532.96 1,273,573,286	0.56
イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS 〔エネルギー〕	438,713	2,813.30 1,234,232,511	2,861.24 1,255,264,017	0.56
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN 〔医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス〕	84,675	12,896.82 1,092,038,893	14,296.41 1,210,549,363	0.54
アメリカ	株式	ORACLE CORPORATION 〔ソフトウェア・サービス〕	486,307	2,445.15 1,189,094,776	2,408.98 1,171,508,164	0.52
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC. 〔医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス〕	367,022	2,834.73 1,040,409,411	3,124.04 1,146,592,106	0.51
アメリカ	株式	WAL-MART STORES INC 〔食品・生活必需品小売り〕	228,358	4,780.99 1,091,777,839	4,998.79 1,141,515,011	0.51
オーストラリア	株式	BHP BILLITON LTD 〔素材〕	386,857	2,988.18 1,156,000,864	2,926.66 1,132,199,874	0.50
アメリカ	株式	QUALCOMM INC 〔テクノロジー・ハードウェアおよび機器〕	202,365	4,366.75 883,678,314	5,583.16 1,129,837,529	0.50
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC 〔テクノロジー・ハードウェアおよび機器〕	647,615	1,453.11 941,061,790	1,728.45 1,119,373,838	0.50

イギリス	株式	GLAXOSMITHKLINE PLC 〔医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス〕	608,033	1,795.41 1,091,673,271	1,838.75 1,118,026,759	0.50
------	----	---	---------	---------------------------	---------------------------	------

□ 種類別・業種別の投資比率

平成24年 3月30日現在

種類	業種	投資 比率 (%)	種類	業種	投資 比率 (%)
株式（外国）	エネルギー	11.67	株式（外国）	ヘルスケア機器・サービス	2.82
	素材	7.04		医薬品・バイオテクノロジー・ ライフサイエンス	7.42
	資本財	7.35		銀行	7.30
	商業・専門サービス	0.90		各種金融	4.91
	運輸	1.72		保険	4.01
	自動車・自動車部品	1.38		不動産	0.65
	耐久消費財・アパレル	1.37		ソフトウェア・サービス	6.05
	消費者サービス	1.66		テクノロジー・ハードウェア および機器	5.33
	メディア	2.54		電気通信サービス	3.88
	小売	2.86		公益事業	3.66
	食品・生活必需品小売り	2.22		半導体・半導体製造装置	1.61
	食品・飲料・タバコ	6.82		投資証券	1.97
	家庭用品・パーソナル用品	1.77		合計	98.90

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24年3月30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 12/06	買建	54	1,564,572,703	1,551,393,783	0.69
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 12/06	買建	37	284,754,839	276,655,889	0.12
海外金融先物	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所 DJ EUR 12/06	買建	195	530,413,056	510,652,350	0.23

(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。

種類	取引所等および 資産の名称	買建/ 売建	数量 (枚)	簿価(円)	時価(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	市場外取引 米ドル	買建	143,146.02	11,838,175	11,763,739	0.01
為替予約取引	市場外取引 米ドル	売建	21,275,519.32	1,759,485,447	1,748,422,177	0.78
為替予約取引	市場外取引 カナダドル	売建	2,014,405.78	166,853,230	166,208,620	0.07
為替予約取引	市場外取引 オーストラリアドル	売建	1,366,714.81	117,223,129	116,731,111	0.05
為替予約取引	市場外取引 英ポンド	売建	3,023,883.33	397,477,285	397,126,597	0.18
為替予約取引	市場外取引 スイスフラン	売建	1,346,412.83	123,142,917	122,590,888	0.05

為替予約取引	市場外取引 シンガポールドル	売建	375,283.54	24,659,881	24,528,532	0.01
為替予約取引	市場外取引 スウェーデンクローナ	売建	3,642,874.97	45,255,435	45,098,792	0.02
為替予約取引	市場外取引 ノルウェークローネ	売建	846,380.74	12,208,195	12,145,563	0.01
為替予約取引	市場外取引 デンマーククローネ	売建	1,859,909.80	27,505,642	27,452,268	0.01
為替予約取引	市場外取引 イスラエルシェケル	売建	716,679.83	15,921,042	15,802,790	0.01
為替予約取引	市場外取引 ユーロ	売建	4,049,154.29	445,940,919	444,556,649	0.20

## (注)

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

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

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

## 〔外国債券バッシブ・マザーファンド〕

## (1) 投資状況

平成24年3月30日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	103,146,490,219	40.06
	カナダ	7,527,732,727	2.92
	ドイツ	23,431,295,895	9.10
	イタリア	23,046,594,412	8.95
	フランス	24,367,720,012	9.46
	オーストラリア	3,737,082,895	1.45
	イギリス	20,980,997,339	8.15
	スイス	1,007,580,720	0.39
	シンガポール	1,094,656,711	0.43
	マレーシア	1,301,911,758	0.51
	オランダ	6,497,320,131	2.52
	スペイン	10,978,480,519	4.26
	ベルギー	6,570,595,184	2.55
	スウェーデン	1,514,384,476	0.59
	ノルウェー	771,048,712	0.30
	オーストリア	4,432,357,429	1.72
	フィンランド	1,598,335,981	0.62
	デンマーク	2,194,241,052	0.85
	メキシコ	2,235,099,763	0.87
	アイルランド	1,869,994,741	0.73
ポーランド	1,972,696,786	0.77	
	小計	250,276,617,462	97.19
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,224,186,019	2.81
合計(純資産総額)		257,500,803,481	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24年3月30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	8,871.38 1,596,848,962	8,680.03 1,562,406,215	2.625 2020/11/15	0.61
アメリカ	国債証券	US T 3.625% 20/02/15	14,000,000	9,566.91 1,339,368,240	9,352.96 1,309,415,121	3.625 2020/2/15	0.51
アメリカ	国債証券	US T 2.625% 20/8/15	15,000,000	8,889.36 1,333,404,328	8,700.58 1,305,087,304	2.625 2020/8/15	0.51
アメリカ	国債証券	US T 3.625% 21/02/15	13,000,000	9,562.29 1,243,098,065	9,345.25 1,214,883,779	3.625 2021/2/15	0.47
アメリカ	国債証券	US T 4.75% 41/02/15	11,000,000	11,403.86 1,254,424,875	10,607.64 1,166,841,156	4.75 2041/2/15	0.45
アメリカ	国債証券	US T 3.5% 20/05/15	12,500,000	9,483.90 1,185,488,012	9,277.19 1,159,649,531	3.5 2020/5/15	0.45
アメリカ	国債証券	US T 1.375% 190228	14,000,000	8,216.76 1,150,347,538	8,129.10 1,138,074,656	1.375 2019/2/28	0.44
アメリカ	国債証券	US T 4.375% 40/05/15	11,000,000	10,746.34 1,182,097,675	10,002.77 1,100,305,782	4.375 2040/5/15	0.43
イギリス	国債証券	UKT 2% 16/01/22	8,000,000	13,776.51 1,102,121,222	13,723.32 1,097,865,806	2 2016/1/22	0.43
アメリカ	国債証券	US T 4.25% 40/11/15	11,000,000	10,551.14 1,160,625,537	9,806.29 1,078,692,381	4.25 2040/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	US T 0.25% 15/01/15	13,000,000	8,208.48 1,067,103,042	8,167.63 1,061,792,062	0.25 2015/1/15	0.41
フランス	国債証券	FRTR 3.0% 15/10/25	9,000,000	11,500.61 1,035,055,283	11,657.46 1,049,171,940	3 2015/10/25	0.41
アメリカ	国債証券	US T 3.875% 40/8/15	11,000,000	9,914.16 1,090,558,562	9,211.70 1,013,287,120	3.875 2040/8/15	0.39

アメリカ	国債証券	US T 3.375% 19/11/15	11,000,000	9,404.33 1,034,476,729	9,209.13 1,013,004,592	3.375 2019/11/15	0.39
アメリカ	国債証券	US T 3.125% 21/05/15	11,000,000	9,189.86 1,010,885,631	8,986.32 988,495,281	3.125 2021/5/15	0.38
フランス	国債証券	FRANCE 3.75% 17/04/25	8,000,000	11,822.13 945,771,084	12,028.04 962,243,280	3.75 2017/4/25	0.37
フランス	国債証券	FRTR 5% 16/10/25	7,600,000	12,471.41 947,827,418	12,619.86 959,109,588	5 2016/10/25	0.37
アメリカ	国債証券	US T 1% 14/05/15	11,000,000	8,360.65 919,671,825	8,327.51 916,026,817	1 2014/5/15	0.36
フランス	国債証券	FRTR 3.75% 21/04/25	7,700,000	11,630.56 895,553,505	11,798.88 908,514,406	3.75 2021/4/25	0.35
アメリカ	国債証券	US T 3.125% 19/05/15	10,000,000	9,235.69 923,569,030	9,081.99 908,199,500	3.125 2019/5/15	0.35
アメリカ	国債証券	US T 2.125% 21/08/15	11,000,000	8,442.45 928,669,946	8,253.67 907,904,129	2.125 2021/8/15	0.35
イギリス	国債証券	UKT 2.75% 15/01/22	6,500,000	14,028.29 911,839,113	13,922.04 904,932,600	2.75 2015/1/22	0.35
アメリカ	国債証券	US T 2.125% 14/11/30	10,500,000	8,644.71 907,695,448	8,579.22 900,818,456	2.125 2014/11/30	0.35
アメリカ	国債証券	US T 0.875% 16/12/31	11,000,000	8,292.61 912,187,907	8,188.17 900,699,662	0.875 2016/12/31	0.35
アメリカ	国債証券	US T 4.375% 39/11/15	9,000,000	10,742.48 966,824,085	9,995.71 899,614,501	4.375 2039/11/15	0.35
ドイツ	国債証券	OBL 2.5% 15/02/27	7,500,000	11,692.76 876,957,667	11,666.25 874,968,750	2.5 2015/2/27	0.34
アメリカ	国債証券	US T 2.5% 15/04/30	10,000,000	8,787.26 878,726,683	8,707.00 870,700,312	2.5 2015/4/30	0.34
アメリカ	国債証券	US T 2.25% 15/01/31	10,000,000	8,693.51 869,351,886	8,622.88 862,288,683	2.25 2015/1/31	0.33
アメリカ	国債証券	US T 2.375% 14/09/30	10,000,000	8,682.60 868,260,296	8,612.61 861,261,308	2.375 2014/9/30	0.33

ドイツ	国債証券	DBR 3% 20/07/04	7,000,000	12,187.58 853,130,628	12,221.83 855,528,660	3 2020/7/4	0.33
-----	------	-----------------	-----------	--------------------------	--------------------------	---------------	------

## □ 種類別の投資比率

平成24年3月30日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	97.19
合計	97.19

## 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24年3月30日現在

種類	取引所等および 資産の名称	買建 / 売建	数量 (枚)	簿価(円)	時価(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	市場外取引 米ドル	売建	13,334,429.91	1,105,070,286	1,095,823,449	0.43
為替予約取引	市場外取引 カナダドル	売建	2,249,511.37	186,988,889	185,607,182	0.07
為替予約取引	市場外取引 英ポンド	売建	2,599,093.05	343,035,711	341,338,889	0.13
為替予約取引	市場外取引 ユーロ	売建	9,743,792.46	1,076,100,238	1,069,770,973	0.42

(注)

- 基準日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。
  - 基準日において為替予約の受渡日（以下「当該日」という）の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
  - 基準日において当該日の対顧客先物売買相場が発表されていない場合は、以下の計算方法によっております。
 

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

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

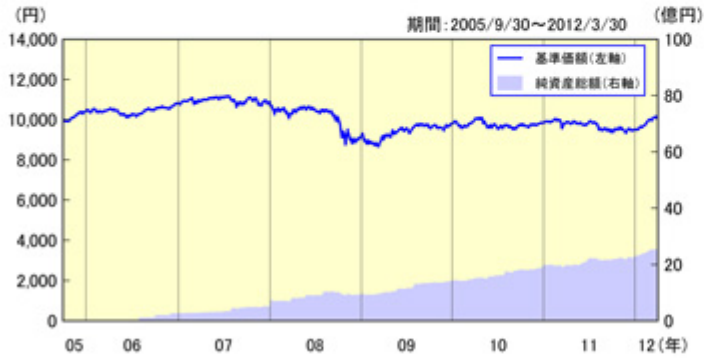
## 〔参考情報〕

基準日2012年3月30日

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

## 基準価額・純資産の推移

## &lt;マイパッケージ30&gt;



基準価額	10,111円
純資産総額	26億円

## 分配の推移

決算期	分配金
2012年2月	0円
2011年2月	0円
2010年2月	0円
2009年2月	0円
2008年2月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万円当たり、税引前です。  
 ※直近5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	9,341円
純資産総額	73億円

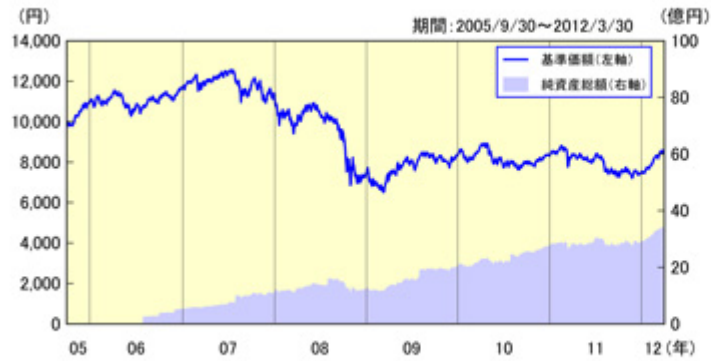
## 分配の推移

決算期	分配金
2012年2月	0円
2011年2月	0円
2010年2月	0円
2009年2月	0円
2008年2月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万円当たり、税引前です。  
 ※直近5計算期間を記載しています。



## &lt;マイパッケージ70&gt;



※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

基準価額	8,489円
純資産総額	34億円

## 分配の推移

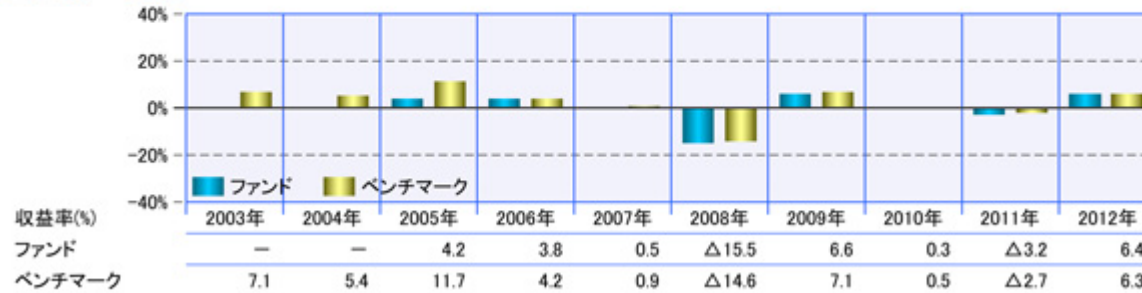
決算期	分配金
2012年2月	0円
2011年2月	0円
2010年2月	0円
2009年2月	0円
2008年2月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万口当たり、税引前です。

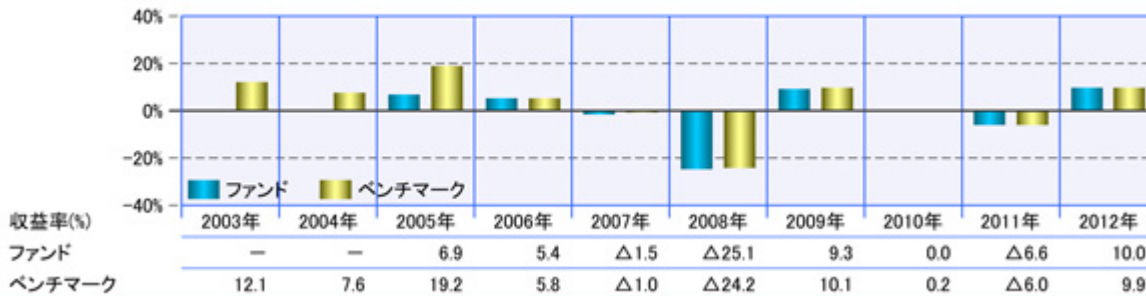
※直近5計算期間を記載しています。

## 年間収益率の推移（暦年ベース）

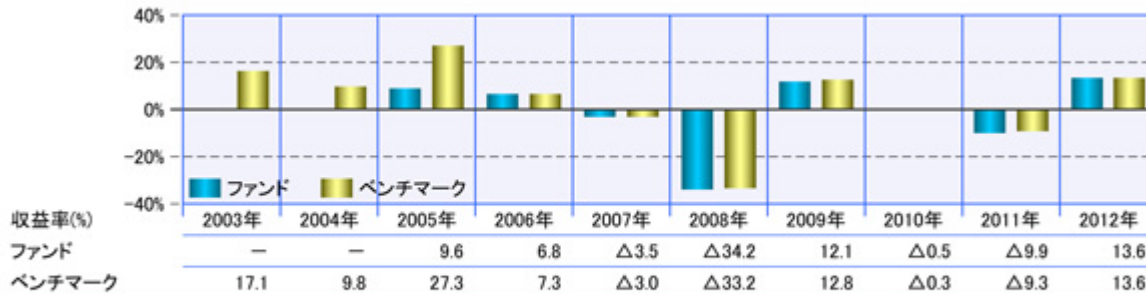
## &lt;マイパッケージ30&gt;



## &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。

2012年の収益率は、年初から2012年3月30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時までに取得申込みが行われ、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の申込受付分とします。

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

（ハ）当ファンドの取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。

販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。

ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

#### ロ 申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

#### ハ 申込手数料

無手数料です。

#### ニ 申込単位

1円以上1円単位

#### ホ 照会先

手続き等のご不明な点についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

#### ヘ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

#### ト 払込期日

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

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

## 2【換金（解約）手続等】

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

お買付けの販売会社にお申し出ください。

解約請求のお申込みに関しては、原則として午後3時までには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

- a. 委託会社は、当ファンドの信託契約を解約することが受益者にとって有利であると認めるとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、上記aの事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を当ファンドの知られたる受益者に対して交付します。ただし、当ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- c. 上記bの公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- d. 上記cの一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えると

きは、信託契約の解約をしません。

- e . 委託会社は、当ファンドの信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- f . 上記c ~ eまでの取扱いは、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記cの一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

(ロ) 信託契約に関する監督官庁の命令

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

(ハ) 委託会社の登録取消等に伴う取扱い

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

(ニ) 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

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

ロ 収益分配金、償還金の支払い

(イ) 収益分配金

- a . 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。分配対象額が少額の場合等には委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額については保証するものではありません。
- 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て）に支払われます。

## ハ 信託約款の変更

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

## 二 反対者の買取請求権

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

## ホ 販売会社との契約の更改等

委託会社と販売会社との間で締結される販売契約（名称の如何を問わず、ファンドの募集・販売の取扱い、受益者からの一部解約実行請求の受け付け、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を規定するもの）は、期間満了の3ヵ月前に当事者のいずれからも、何らの意思表示もない場合は、自動的に1年間更新されます。販売契約の内容は、必要に応じて、委託会社と販売会社との合意により変更されることがあります。

## へ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

## ト 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

## チ 運用にかかる報告書の開示方法

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

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

#### 4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利は次の通りです。

##### イ 分配金請求権

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

当ファンドは、分配金自動再投資専用であるため、収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日の翌営業日に再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

##### ロ 償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

##### ハ 一部解約実行請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託会社に一部解約の実行を請求することができます。詳細は、前記「第2 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」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期(平成22年2月19日から平成23年2月18日まで)および第7期(平成23年2月19日から平成24年2月20日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

【三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第6期 (平成23年2月18日現在)	第7期 (平成24年2月20日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	87,742,332	107,686,906
親投資信託受益証券	1,875,287,873	2,351,953,757
未収入金	125,000	38,000
未収利息	120	147
流動資産合計	1,963,155,325	2,459,678,810
資産合計	1,963,155,325	2,459,678,810
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	124,753	37,947
未払受託者報酬	295,527	360,465
未払委託者報酬	1,871,637	2,282,925
その他未払費用	49,197	60,018
流動負債合計	2,341,114	2,741,355
負債合計	2,341,114	2,741,355
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,952,365,458	2,478,210,957
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	8,448,753	21,273,502
元本等合計	1,960,814,211	2,456,937,455
純資産合計	1,960,814,211	2,456,937,455
負債純資産合計	1,963,155,325	2,459,678,810

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位 : 円 )

	第 6 期	第 7 期
	自 平成22年 2月19日 至 平成23年 2月18日	自 平成23年 2月19日 至 平成24年 2月20日
<b>営業収益</b>		
受取利息	37,654	49,318
有価証券売買等損益	70,892,573	8,794,116
営業収益合計	70,930,227	8,744,798
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	538,985	681,150
委託者報酬	3,413,471	4,313,833
その他費用	89,717	113,402
営業費用合計	4,042,173	5,108,385
営業利益又は営業損失 ( )	66,888,054	13,853,183
経常利益又は経常損失 ( )	66,888,054	13,853,183
当期純利益又は当期純損失 ( )	66,888,054	13,853,183
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額 ( )	1,926,945	3,462,871
期首剰余金又は期首欠損金 ( )	44,410,042	8,448,753
剰余金増加額又は欠損金減少額	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	4,693,226	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	16,795,540	19,331,943
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	53,807
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	16,795,540	19,278,136
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	8,448,753	21,273,502

**（ 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 6 期 自 平成22年 2 月19日 至 平成23年 2 月18日	第 7 期 自 平成23年 2 月19日 至 平成24年 2 月20日
1. 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
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項		計算期間の取扱い 当計算期間は当期末が休日のため、平成23年 2 月19日から平成24年 2 月20日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第 6 期 （平成23年 2 月18日現在）	第 7 期 （平成24年 2 月20日現在）
1. 受益権総数	当計算期間の末日における受益権の総数 1,952,365,458口	当計算期間の末日における受益権の総数 2,478,210,957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 21,273,502円
3. 1 単位当たり純資産額	1.0043円 （ 1 万口 = 10,043円）	0.9914円 （ 1 万口 = 9,914円）

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第 6 期 自 平成22年 2 月19日 至 平成23年 2 月18日	第 7 期 自 平成23年 2 月19日 至 平成24年 2 月20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（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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（36,292,953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（298,314,265円）、および分配準備積立金（76,234,624円）より、分配対象収益は410,841,842円（1万口当たり1,657.81円）であります。分配を行っておりません。

## （金融商品に関する注記）

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	第6期 自平成22年2月19日 至平成23年2月18日	第7期 自平成23年2月19日 至平成24年2月20日
	(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。	
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。	同左
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。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。 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。	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 同左 2) デリバティブ取引 同左 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 同左

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>	同 左
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>	同 左

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第6期 (平成23年2月18日現在)	第7期 (平成24年2月20日現在)
1．貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同 左
2．時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針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>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 同 左</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） 同 左</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>	<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 同左</p>
---	--

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

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

第7期（自 平成23年2月19日 至 平成24年2月20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	2,949,660円
合 計	2,949,660円

## （デリバティブ取引に関する注記）

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。

第7期（平成24年2月20日現在）

第7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。

第7期（自 平成23年2月19日 至 平成24年2月20日）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

項 目	第6期 （平成23年2月18日現在）	第7期 （平成24年2月20日現在）
期首元本額	1,473,303,036円	1,952,365,458円
期中追加設定元本額	638,803,489円	624,991,852円
期中一部解約元本額	159,741,067円	99,146,353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)	472,764,669円	1.1008円	520,419,347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	1,185,791,282円	1.1160円	1,323,343,070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	201,735,484円	1.2968円	261,610,575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	216,374,838円	1.1396円	246,580,765円
合計		2,076,666,273円		2,351,953,757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6期 (平成23年2月18日現在)	第7期 (平成24年2月20日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	282,133,975	305,851,942
親投資信託受益証券	5,807,319,038	6,639,444,951
未収入金	12,000	460,000
未収利息	386	418
流動資産合計	6,089,465,399	6,945,757,311
資産合計	6,089,465,399	6,945,757,311
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	209,389	463,965
未払受託者報酬	914,984	1,013,132
未払委託者報酬	6,099,851	6,754,138
その他未払費用	152,440	168,792
流動負債合計	7,376,664	8,400,027
負債合計	7,376,664	8,400,027
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	6,422,758,338	7,654,128,143
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	340,669,603	716,770,859
元本等合計	6,082,088,735	6,937,357,284
純資産合計	6,082,088,735	6,937,357,284
負債純資産合計	6,089,465,399	6,945,757,311

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	第 6 期	第 7 期
	自 平成22年 2 月19日 至 平成23年 2 月18日	自 平成23年 2 月19日 至 平成24年 2 月20日
<b>営業収益</b>		
受取利息	123,057	147,559
有価証券売買等損益	339,164,581	217,594,087
営業収益合計	339,287,638	217,446,528
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	1,686,878	1,968,668
委託者報酬	11,245,716	13,124,309
その他費用	281,021	327,985
営業費用合計	13,213,615	15,420,962
営業利益又は営業損失( )	326,074,023	232,867,490
経常利益又は経常損失( )	326,074,023	232,867,490
当期純利益又は当期純損失( )	326,074,023	232,867,490
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額( )	7,272,562	21,918,023
期首剰余金又は期首欠損金( )	521,636,636	340,669,603
剰余金増加額又は欠損金減少額	47,684,278	21,471,445
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	47,684,278	21,471,445
剰余金減少額又は欠損金増加額	185,518,706	186,623,234
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	185,518,706	186,623,234
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金( )	340,669,603	716,770,859

**（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 6 期 自 平成22年 2 月19日 至 平成23年 2 月18日	第 7 期 自 平成23年 2 月19日 至 平成24年 2 月20日
1. 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
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項		計算期間の取扱い 当計算期間は当期末が休日のため、平成23年 2 月19日から平成24年 2 月20日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第 6 期 （平成23年 2 月18日現在）	第 7 期 （平成24年 2 月20日現在）
1. 受益権総数	当計算期間の末日における受益権の総数 6,422,758,338口	当計算期間の末日における受益権の総数 7,654,128,143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 340,669,603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 716,770,859円
3. 1 単位当たり純資産額	0.9470円 （1 万口 = 9,470円）	0.9064円 （1 万口 = 9,064円）

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第 6 期 自 平成22年 2 月19日 至 平成23年 2 月18日	第 7 期 自 平成23年 2 月19日 至 平成24年 2 月20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（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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（113,182,864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（1,255,824,105円）、および分配準備積立金（301,512,671円）より、分配対象収益は1,670,519,640円（1 万口当たり2,182.50円）であります。分配を行っておりません。

## （金融商品に関する注記）

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	第6期 自平成22年2月19日 至平成23年2月18日	第7期 自平成23年2月19日 至平成24年2月20日
	(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。	
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。	同左
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいており、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。 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。	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 同左 2) デリバティブ取引 同左 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 同左

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>	同左
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>	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第6期 (平成23年2月18日現在)	第7期 (平成24年2月20日現在)
1．貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2．時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針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>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 同左</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） 同左</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。	(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 同左
---	--

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

## 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

## 第7期（自平成23年2月19日 至 平成24年2月20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	199,052,269円
合 計	199,052,269円

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 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。

## 第7期（平成24年2月20日現在）

第7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。

## 第7期（自平成23年2月19日 至 平成24年2月20日）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

項 目	第6期 （平成23年2月18日現在）	第7期 （平成24年2月20日現在）
期首元本額	5,130,131,943円	6,422,758,338円
期中追加設定元本額	1,758,746,053円	1,598,782,670円
期中一部解約元本額	466,119,658円	367,412,865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)	2,291,212,049円	1.1008円	2,522,166,223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	2,095,710,135円	1.1160円	2,338,812,510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	839,882,052円	1.2968円	1,089,159,045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	604,867,650円	1.1396円	689,307,173円
合計		5,831,671,886円		6,639,444,951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6期 (平成23年2月18日現在)	第7期 (平成24年2月20日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	126,099,698	140,653,259
親投資信託受益証券	2,783,864,641	3,099,785,596
未収利息	172	192
流動資産合計	2,909,964,511	3,240,439,047
資産合計	2,909,964,511	3,240,439,047
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	264,691	765,479
未払受託者報酬	420,603	464,736
未払委託者報酬	2,944,171	3,253,098
その他未払費用	70,036	77,397
流動負債合計	3,699,501	4,560,710
負債合計	3,699,501	4,560,710
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	3,301,833,283	3,968,741,515
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	395,568,273	732,863,178
元本等合計	2,906,265,010	3,235,878,337
純資産合計	2,906,265,010	3,235,878,337
負債純資産合計	2,909,964,511	3,240,439,047

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第 6 期	第 7 期
	自 平成22年 2月19日 至 平成23年 2月18日	自 平成23年 2月19日 至 平成24年 2月20日
<b>営業収益</b>		
受取利息	56,705	66,987
有価証券売買等損益	210,677,941	192,546,045
営業収益合計	210,734,646	192,479,058
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	769,699	912,393
委託者報酬	5,387,803	6,386,614
その他費用	128,155	151,946
営業費用合計	6,285,657	7,450,953
営業利益又は営業損失（ ）	204,448,989	199,930,011
経常利益又は経常損失（ ）	204,448,989	199,930,011
当期純利益又は当期純損失（ ）	204,448,989	199,930,011
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	2,723,125	13,466,867
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	447,378,489	395,568,273
剰余金増加額又は欠損金減少額	37,532,219	20,056,233
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	37,532,219	20,056,233
剰余金減少額又は欠損金増加額	187,447,867	170,887,994
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	187,447,867	170,887,994
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	395,568,273	732,863,178

**（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 6 期 自 平成22年 2 月19日 至 平成23年 2 月18日	第 7 期 自 平成23年 2 月19日 至 平成24年 2 月20日
1. 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
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項		計算期間の取扱い 当計算期間は当期末が休日のため、平成23年 2 月19日から平成24年 2 月20日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第 6 期 （平成23年 2 月18日現在）	第 7 期 （平成24年 2 月20日現在）
1. 受益権総数	当計算期間の末日における受益権の総数 3,301,833,283口	当計算期間の末日における受益権の総数 3,968,741,515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 395,568,273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 732,863,178円
3. 1 単位当たり純資産額	0.8802円 （1 万口 = 8,802円）	0.8153円 （1 万口 = 8,153円）

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第 6 期 自 平成22年 2 月19日 至 平成23年 2 月18日	第 7 期 自 平成23年 2 月19日 至 平成24年 2 月20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（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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益（56,581,925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（859,846,916円）、および分配準備積立金（149,930,269円）より、分配対象収益は1,066,359,110円（1 万口当たり2,686.89円）であります。分配を行っておりません。

## （金融商品に関する注記）

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	第6期 自平成22年2月19日 至平成23年2月18日	第7期 自平成23年2月19日 至平成24年2月20日
	<p>（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。</p>	
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>	同左
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 1）有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。 2）デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいており、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。 3）コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 （2）金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>	<p>（1）金融商品の内容 1）有価証券 同左 2）デリバティブ取引 同左 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 同左</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>	同左
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>	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第6期 (平成23年2月18日現在)	第7期 (平成24年2月20日現在)
1．貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2．時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針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>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 同左</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） 同左</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>	<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 同左</p>
---	--

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

## 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

## 第7期（自平成23年2月19日 至 平成24年2月20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	180,075,442円
合 計	180,075,442円

## （デリバティブ取引に関する注記）

## 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。

## 第7期（平成24年2月20日現在）

第7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。

## 第7期（自平成23年2月19日 至 平成24年2月20日）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

項 目	第6期 （平成23年2月18日現在）	第7期 （平成24年2月20日現在）
期首元本額	2,507,724,029円	3,301,833,283円
期中追加設定元本額	1,002,632,701円	823,696,243円
期中一部解約元本額	208,523,447円	156,788,011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)	1,499,047,336円	1.1008円	1,650,151,307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	418,193,740円	1.1160円	466,704,213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	510,736,718円	1.2968円	662,323,375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	281,332,662円	1.1396円	320,606,701円
合計		2,709,310,456円		3,099,785,596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24年3月30日現在
資産総額	2,579,280,397 円
負債総額	7,663,241 円
純資産総額( - )	2,571,617,156 円
発行済口数	2,543,299,237 口
1口当たり純資産額( / )	1.0111 円
( 1万口当たり純資産額	10,111 円)

**b . 三井住友・DC年金バランス50(標準型)**

	平成24年3月30日現在
資産総額	7,333,691,645 円
負債総額	23,582,282 円
純資産総額( - )	7,310,109,363 円
発行済口数	7,826,021,771 口
1口当たり純資産額( / )	0.9341 円
( 1万口当たり純資産額	9,341 円)

**c . 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)**

	平成24年3月30日現在
資産総額	3,440,048,185 円
負債総額	5,255,648 円
純資産総額( - )	3,434,792,537 円
発行済口数	4,046,295,033 口
1口当たり純資産額( / )	0.8489 円
( 1万口当たり純資産額	8,489 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24年3月30日現在
資本金の額	2,000百万円
会社が発行する株式の総数	60,000株
発行済株式総数	17,640株

##### ロ 最近5年間における資本金の額の増減

該当ありません。

##### ハ 会社の機構

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

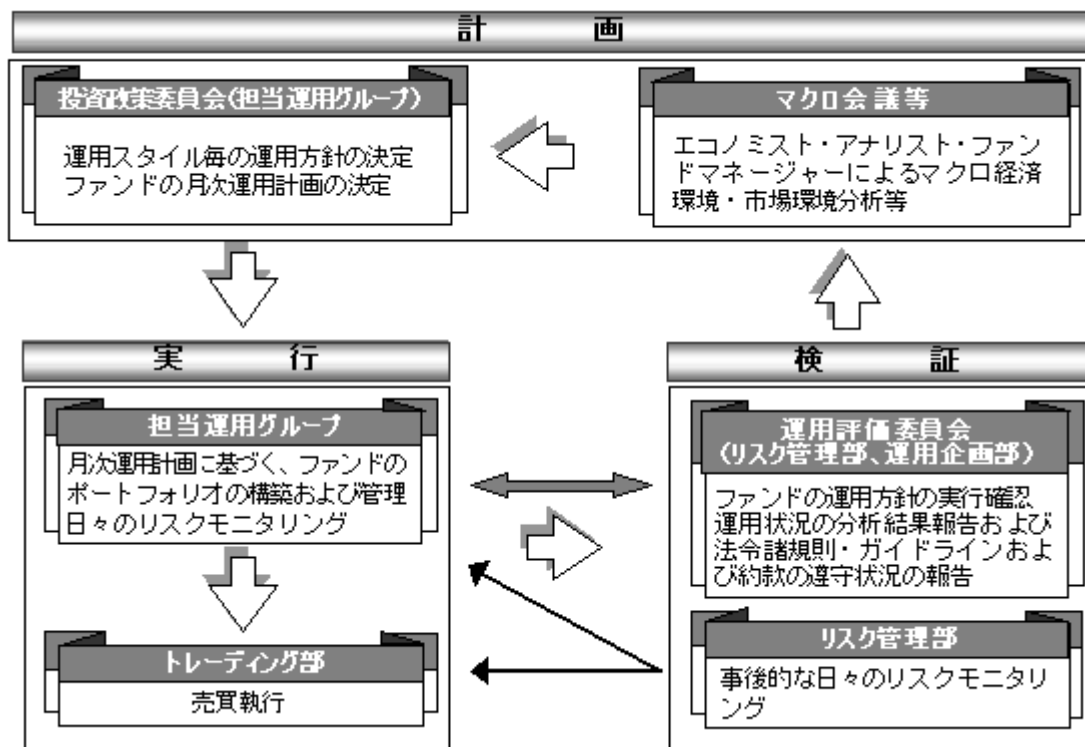
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

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24年3月30日現在、委託会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

（平成24年3月30日現在、単位：百万円）

		本数	純資産総額
株式投資信託	単位型	38 ( 2 )	48,700 ( 5,205 )
	追加型	306 ( 134 )	4,775,447 ( 3,126,843 )
	計	344 ( 136 )	4,824,147 ( 3,132,048 )
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		344 ( 136 )	4,824,147 ( 3,132,048 )

( )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26期(平成22年4月1日から平成23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、当社の中間財務諸表は、第27期中間会計期間(平成23年4月1日から平成23年9月30日まで)については、「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(平成22年4月1日から平成23年3月31日まで)の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の監査を受けております。

また、第27期中間会計期間(平成23年4月1日から平成23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 25 期 (平成22年 3月31日現在)	第 26 期 (平成23年 3月31日現在)
(資産の部)			
流動資産			
現金及び預金	2	15,484,883	17,127,600
有価証券		2,999,185	3,999,722
前払費用		248,594	264,910
未収入金		6,524	607,623
未収委託者報酬		3,405,895	3,712,698
未収運用受託報酬		456,672	326,523
未収投資助言報酬	2	426,716	412,606
未収収益		7,020	27,051
繰延税金資産		244,770	241,975
その他の流動資産		1,392	1,299
流動資産計		23,281,654	26,722,012
固定資産			
有形固定資産			
建物	1	173,574	148,698
器具備品		150,631	232,209
有形固定資産合計		324,206	380,907
無形固定資産			
電話加入権	1	150	138
商標権		6,160	4,216
無形固定資産合計		6,310	4,354
投資その他の資産			
投資有価証券		6,923,150	4,980,828
関係会社株式		236,178	234,921
長期差入保証金		681,764	681,432
長期前払費用		7,822	10,561
会員権		20,113	20,113
繰延税金資産		524,820	606,449
投資その他の資産合計		8,393,850	6,534,307
固定資産計		8,724,367	6,919,569
資産合計		32,006,022	33,641,581

	第 25 期 (平成22年 3月31日現在)	第 26 期 (平成23年 3月31日現在)
( 負 債 の 部 )		
流動負債		
預り金	46,362	47,190
未払金		
未払収益分配金	943	681
未払償還金	18,453	21,638
未払手数料	2 1,523,402	1,971,626
その他未払金	71,728	64,551
未払費用	869,497	824,240
未払消費税等	74,053	126,666
未払法人税等	1,264,485	1,004,164
賞与引当金	293,651	327,914
流動負債計	4,162,578	4,388,674
固定負債		
退職給付引当金	1,137,766	1,310,821
固定負債計	1,137,766	1,310,821
負債合計	5,300,344	5,699,496
( 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	14,172,932	15,381,398
利益剰余金合計	15,994,137	17,202,602
株主資本計	26,623,121	27,831,586
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	82,556	110,498
評価・換算差額等計	82,556	110,498
純資産合計	26,705,677	27,942,085
負債・純資産合計	32,006,022	33,641,581



## （２）【損益計算書】

（単位：千円）

	第 25 期 （自 平成21年 4 月 1 日 至 平成22年 3 月31日）	第 26 期 （自 平成22年 4 月 1 日 至 平成23年 3 月31日）
営業収益		
委託者報酬	21,113,167	27,350,519
運用受託報酬	2,492,177	2,113,027
投資助言報酬	1,893,038	1,828,087
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	43,853	35,635
サービス支援手数料	-	234,885
その他	12,348	26,930
営業収益計	25,559,586	31,594,086
営業費用		
支払手数料	9,706,627	14,161,927
広告宣伝費	420,508	482,728
公告費	2,339	4,634
調査費		
調査費	579,477	537,254
委託調査費	1,556,961	2,115,042
営業雑経費		
通信費	31,515	34,433
印刷費	278,539	266,803
協会費	19,271	23,235
諸会費	12,955	11,346
情報機器関連費	2,005,507	2,066,205
販売促進費	13,183	27,670
その他	66,833	79,571
営業費用計	14,693,722	19,810,852
一般管理費		
給料		
役員報酬	155,835	155,867
給料・手当	4,192,414	4,342,937
賞与	719,290	983,434
賞与引当金繰入額	293,651	327,914
交際費	19,087	21,460
寄付金	23	31
事務委託費	195,150	220,738
旅費交通費	197,842	219,278
租税公課	86,095	87,674
不動産賃借料	714,209	677,468
退職給付費用	197,352	199,545
固定資産減価償却費	97,916	100,356
諸経費	280,916	250,817
一般管理費計	7,149,786	7,587,526

営業利益

3,716,077

4,195,707

営業外収益			
受取配当金		1,710	34,115
有価証券利息		4,645	3,603
受取利息	1	16,592	7,877
為替差益		-	4,753
時効成立分配金・償還金		3,492	3,076
原稿・講演料		3,255	3,485
還付加算金		37,708	1,645
雑収入		6,291	7,033
営業外収益計		73,696	65,590
営業外費用			
為替差損		5,113	-
時効成立後支払分配金・償還金		-	659
営業外費用計		5,113	659
経常利益		3,784,660	4,260,638
特別利益			
投資有価証券償還益		2,459	7
投資有価証券売却益		31,117	71,400
特別利益計		33,577	71,407
特別損失			
固定資産除却損	2	5,302	17,318
投資有価証券償還損		-	2,679
投資有価証券評価損		51,557	-
投資有価証券売却損		2,724	20,822
関係会社株式評価損		-	1,256
特別損失計		59,583	42,077
税引前当期純利益		3,758,653	4,289,968
法人税、住民税及び事業税		1,817,726	1,852,053
法人税等調整額		722,069	93,549
法人税等合計		1,095,656	1,758,503
当期純利益		2,662,997	2,531,465

## (3)【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	第 25 期 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)	第 26 期 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23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	12,356,655	14,172,932
当期変動額		
剰余金の配当	846,720	1,323,000
当期純利益	2,662,997	2,531,465
当期変動額合計	1,816,277	1,208,465
当期末残高	14,172,932	15,381,398
利益剰余金合計		
前期末残高	14,177,860	15,994,137
当期変動額		
剰余金の配当	846,720	1,323,000
当期純利益	2,662,997	2,531,465
当期変動額合計	1,816,277	1,208,465
当期末残高	15,994,137	17,202,602
株主資本合計		
前期末残高	24,806,844	26,623,121
当期変動額		
剰余金の配当	846,720	1,323,000
当期純利益	2,662,997	2,531,465

当期変動額合計	1,816,277	1,208,465
当期末残高	26,623,121	27,831,586

評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
前期末残高	5,805	82,556
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	88,361	27,941
当期変動額合計	88,361	27,941
当期末残高	82,556	110,498
評価・換算差額合計		
前期末残高	5,805	82,556
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	88,361	27,941
当期変動額合計	88,361	27,941
当期末残高	82,556	110,498
純資産合計		
前期末残高	24,801,038	26,705,677
当期変動額		
剰余金の配当	846,720	1,323,000
当期純利益	2,662,997	2,531,465
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	88,361	27,941
当期変動額合計	1,904,639	1,236,407
当期末残高	26,705,677	27,942,085

## 重要な会計方針

項目	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23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  (2) 退職給付引当金	従業員賞与の支給に充てるため、将来の 支給見込額のうち当事業年度の負担額を 計上しております。  従業員の退職金支給に備えるため、当事 業年度末における退職給付債務に基づき 計上しております。 過去勤務債務については、その発生時に おいて一時に費用処理しております。 数理計算上の差異については、その発生 時において一時に費用処理してありま す。 (会計方針の変更) 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。	同左   従業員の退職金支給に備えるため、当事 業年度末における退職給付債務に基づき 計上しております。 過去勤務債務については、その発生時に おいて一時に費用処理しております。 数理計算上の差異については、その発生 時において一時に費用処理してありま す。
4 その他財務諸表作成のた めの基本となる重要な事項	消費税等の会計処理は税抜方式によっ ております。	同左

## 会計方針の変更

## （会計処理の変更）

第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)
-	<p>資産除去債務に関する会計基準            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。            これによる損益の影響はありません。</p>

## 注記事項

## （貸借対照表関係）

第25期 (平成22年3月31日現在)	第26期 (平成23年3月31日現在)
<p>1 有形固定資産の減価償却累計額            建 物 172,855千円            器具備品 863,358千円            無形固定資産の減価償却累計額            電話加入権 83千円            商標権 13,282千円</p>	<p>1 有形固定資産の減価償却累計額            建 物 191,415千円            器具備品 774,482千円            無形固定資産の減価償却累計額            電話加入権 95千円            商標権 15,226千円</p>
<p>2 関係会社に対する債権債務            現金及び預金 10,591,647千円            未収投資助言報酬 295,911千円            未払手数料 441,536千円</p>	<p>2 関係会社に対する債権債務            現金及び預金 11,201,422千円            未収投資助言報酬 293,061千円            未払手数料 469,104千円</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。            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。            当座貸越極度額の総額 10,000,000千円            借入実行残高 - 千円            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。            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。            当座貸越極度額の総額 10,000,000千円            借入実行残高 - 千円            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102,815千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74,617千円の支払保証を行っております。</p>



## （損益計算書関係）

第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)
1 関係会社との取引に係るもの 受取利息 5,916千円	1 関係会社との取引に係るもの 受取利息 3,867千円
2 固定資産除却損は、器具備品5,302千円であります。	2 固定資産除却損は、建物9,847千円、器具備品7,471千円 であります。

## （株主資本等変動計算書関係）

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、配当の効力発生日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

第26期(自平成22年4月1日 至平成23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

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

平成23年6月24日開催の第26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23年6月24日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	1,252,440	71,000	平成23年 3月31日	平成23年 6月27日

## (リース取引関係)

第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)
1.オペレーティング・リース取引 (借主側) 未経過リース料(解約不能のもの)(単位:千円) 1年以内 667,234 1年超 1,608,004 合計 2,275,239	1.オペレーティング・リース取引 (借主側) 未経過リース料(解約不能のもの)(単位:千円) 1年以内 672,700 1年超 958,593 合計 1,631,293

## (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、当該帳簿価額によっています。

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位:千円)

	貸借対照表計上額
その他有価証券	
非上場株式	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。

第26期(自平成22年4月1日至平成23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23年3月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれていません（（注2）参照）。

（単位：千円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	17,127,600	17,127,600	-
(2)未収委託者報酬	3,712,698	3,712,698	-
(3)未収運用受託報酬	326,523	326,523	-
(4)未収投資助言報酬	412,606	412,606	-
(5)有価証券及び投資有価証券			
満期保有目的の債券	3,999,722	3,999,600	122
その他有価証券	4,932,087	4,932,087	-
(6)長期差入保証金	681,432	681,432	-
資産計	31,192,671	31,192,549	122
(1)未払金			
未払手数料	1,971,626	1,971,626	-
負債計	1,971,626	1,971,626	-

（注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資産

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

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

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

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

(6) 長期差入保証金

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

負債

(1) 未払金

未払手数料

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位:千円)

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

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

子会社株式については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであることから、時価開示の対象とはしておりません。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、1,256千円です。

(注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位:千円)

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	17,127,600	-	-	-
未収委託者報酬	3,712,698	-	-	-
未収運用受託報酬	326,523	-	-	-
未収投資助言報酬	412,606	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券	4,000,000	-	-	-
その他有価証券のうち				
満期があるもの	-	-	-	-
長期差入保証金	13,841	667,590	-	-
合計	25,593,271	667,590	-	-

## （有価証券関係）

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

子会社株式及び関連会社株式（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



第26期(平成23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	3,999,722	3,999,600	122
小計	3,999,722	3,999,600	122
合計	3,999,722	3,999,600	122

## 2. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（貸借対照表計上額 関係会社株式234,921千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。また、上記「貸借対照表計上額」は、減損処理後の帳簿価額です。当事業年度における減損処理額は、1,256千円です。

## 3. その他有価証券

(単位：千円)

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	3,047,395	2,801,036	246,358
小計	3,047,395	2,801,036	246,358
(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	1,884,692	1,950,168	65,476
小計	1,884,692	1,950,168	65,476
合計	4,932,087	4,751,205	180,882

(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
4,845,387	71,400	20,822

## （デリバティブ取引関係）

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。

第26期(自 平成22年 4月 1日 至 平成23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25期 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)	第26期 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23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>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: 80%;">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> <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="width: 20%; text-align: right;">154,625</td> <td style="width: 20%;"></td> </tr> <tr> <td>利息費用</td> <td style="text-align: right;">14,583</td> <td></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> <td></td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;"><u>15,677</u></td> <td></td> </tr> <tr> <td>退職給付費用</td> <td style="text-align: right;"><u>197,352</u></td> <td></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> <p>4．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項 退職給付見込額の期間配分方法 勤務期間を基準とする方法 割引率 1.5% 過去勤務債務の額の処理年数 1年（発生時において費用処理する方法） 数理計算上の差異の処理年数 1年（発生時において費用処理する方法）</p>	退職給付債務	1,137,766	退職給付引当金	<u>1,137,766</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>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: 80%;">退職給付債務</td> <td style="text-align: right;">1,310,821</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td style="text-align: right;"><u>1,310,821</u></td> </tr> </table> <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="width: 20%; text-align: right;">160,751</td> <td style="width: 20%;"></td> </tr> <tr> <td>利息費用</td> <td style="text-align: right;">17,066</td> <td></td> </tr> <tr> <td>数理計算上の差異の費用処理額</td> <td style="text-align: right;">6,439</td> <td></td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;"><u>15,287</u></td> <td></td> </tr> <tr> <td>退職給付費用</td> <td style="text-align: right;"><u>199,545</u></td> <td></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> <p>4．退職給付債務等の計算の基礎に関する事項 退職給付見込額の期間配分方法 勤務期間を基準とする方法 割引率 1.5% 過去勤務債務の額の処理年数 1年（発生時において費用処理する方法） 数理計算上の差異の処理年数 1年（発生時において費用処理する方法）</p>	退職給付債務	1,310,821	退職給付引当金	<u>1,310,821</u>	勤務費用	160,751		利息費用	17,066		数理計算上の差異の費用処理額	6,439		その他	<u>15,287</u>		退職給付費用	<u>199,545</u>	
退職給付債務	1,137,766																																						
退職給付引当金	<u>1,137,766</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>																																						
退職給付債務	1,310,821																																						
退職給付引当金	<u>1,310,821</u>																																						
勤務費用	160,751																																						
利息費用	17,066																																						
数理計算上の差異の費用処理額	6,439																																						
その他	<u>15,287</u>																																						
退職給付費用	<u>199,545</u>																																						

## （税効果会計関係）

第25期 (平成22年3月31日現在)	第26期 (平成23年3月31日現在)																																																																																
<p>1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳</p> <p style="text-align: center;">(単位：千円)</p> <p>(1) 流動の部</p> <p>繰延税金資産</p> <table style="width: 100%;"> <tr><td>賞与引当金</td><td style="text-align: right;">119,486</td></tr> <tr><td>未払社会保険料</td><td style="text-align: right;">12,746</td></tr> <tr><td>未払事業税</td><td style="text-align: right;">100,639</td></tr> <tr><td>未払事業所税</td><td style="text-align: right;">6,089</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;"><u>5,807</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産計</td><td style="text-align: right;">244,770</td></tr> <tr><td>評価性引当額</td><td style="text-align: right;"><u>-</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産合計</td><td style="text-align: right;"><u>244,770</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産の純額</td><td style="text-align: right;"><u>244,770</u></td></tr> </table> <p>(2) 固定の部</p> <p>繰延税金資産</p> <table style="width: 100%;"> <tr><td>退職給付引当金</td><td style="text-align: right;">462,957</td></tr> <tr><td>ソフトウェア償却</td><td style="text-align: right;">111,245</td></tr> <tr><td>投資有価証券評価損</td><td style="text-align: right;">73,440</td></tr> <tr><td>特定外国子会社留保金額</td><td style="text-align: right;">213,896</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;"><u>8,735</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産計</td><td style="text-align: right;">870,274</td></tr> <tr><td>評価性引当額</td><td style="text-align: right;"><u>289,785</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産合計</td><td style="text-align: right;">580,489</td></tr> </table> <p>繰延税金負債</p> <table style="width: 100%;"> <tr><td>その他有価証券評価差額金</td><td style="text-align: right;"><u>55,668</u></td></tr> <tr><td>繰延税金負債合計</td><td style="text-align: right;"><u>55,668</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産の純額</td><td style="text-align: right;"><u>524,820</u></td></tr> </table>	賞与引当金	119,486	未払社会保険料	12,746	未払事業税	100,639	未払事業所税	6,089	その他	<u>5,807</u>	繰延税金資産計	244,770	評価性引当額	<u>-</u>	繰延税金資産合計	<u>244,770</u>	繰延税金資産の純額	<u>244,770</u>	退職給付引当金	462,957	ソフトウェア償却	111,245	投資有価証券評価損	73,440	特定外国子会社留保金額	213,896	その他	<u>8,735</u>	繰延税金資産計	870,274	評価性引当額	<u>289,785</u>	繰延税金資産合計	580,489	その他有価証券評価差額金	<u>55,668</u>	繰延税金負債合計	<u>55,668</u>	繰延税金資産の純額	<u>524,820</u>	<p>1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳</p> <p style="text-align: center;">(単位：千円)</p> <p>(1) 流動の部</p> <p>繰延税金資産</p> <table style="width: 100%;"> <tr><td>賞与引当金</td><td style="text-align: right;">133,428</td></tr> <tr><td>未払社会保険料</td><td style="text-align: right;">14,807</td></tr> <tr><td>未払事業税</td><td style="text-align: right;">83,126</td></tr> <tr><td>未払事業所税</td><td style="text-align: right;">6,378</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;"><u>4,235</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産計</td><td style="text-align: right;">241,975</td></tr> <tr><td>評価性引当額</td><td style="text-align: right;"><u>-</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産合計</td><td style="text-align: right;"><u>241,975</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産の純額</td><td style="text-align: right;"><u>241,975</u></td></tr> </table> <p>(2) 固定の部</p> <p>繰延税金資産</p> <table style="width: 100%;"> <tr><td>退職給付引当金</td><td style="text-align: right;">533,373</td></tr> <tr><td>ソフトウェア償却</td><td style="text-align: right;">141,119</td></tr> <tr><td>投資有価証券評価損</td><td style="text-align: right;">71,023</td></tr> <tr><td>特定外国子会社留保金額</td><td style="text-align: right;">247,489</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;"><u>4,925</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産計</td><td style="text-align: right;">997,931</td></tr> <tr><td>評価性引当額</td><td style="text-align: right;"><u>321,097</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産合計</td><td style="text-align: right;">676,833</td></tr> </table> <p>繰延税金負債</p> <table style="width: 100%;"> <tr><td>その他有価証券評価差額金</td><td style="text-align: right;"><u>70,383</u></td></tr> <tr><td>繰延税金負債合計</td><td style="text-align: right;"><u>70,383</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産の純額</td><td style="text-align: right;"><u>606,449</u></td></tr> </table>	賞与引当金	133,428	未払社会保険料	14,807	未払事業税	83,126	未払事業所税	6,378	その他	<u>4,235</u>	繰延税金資産計	241,975	評価性引当額	<u>-</u>	繰延税金資産合計	<u>241,975</u>	繰延税金資産の純額	<u>241,975</u>	退職給付引当金	533,373	ソフトウェア償却	141,119	投資有価証券評価損	71,023	特定外国子会社留保金額	247,489	その他	<u>4,925</u>	繰延税金資産計	997,931	評価性引当額	<u>321,097</u>	繰延税金資産合計	676,833	その他有価証券評価差額金	<u>70,383</u>	繰延税金負債合計	<u>70,383</u>	繰延税金資産の純額	<u>606,449</u>
賞与引当金	119,486																																																																																
未払社会保険料	12,746																																																																																
未払事業税	100,639																																																																																
未払事業所税	6,089																																																																																
その他	<u>5,807</u>																																																																																
繰延税金資産計	244,770																																																																																
評価性引当額	<u>-</u>																																																																																
繰延税金資産合計	<u>244,770</u>																																																																																
繰延税金資産の純額	<u>244,770</u>																																																																																
退職給付引当金	462,957																																																																																
ソフトウェア償却	111,245																																																																																
投資有価証券評価損	73,440																																																																																
特定外国子会社留保金額	213,896																																																																																
その他	<u>8,735</u>																																																																																
繰延税金資産計	870,274																																																																																
評価性引当額	<u>289,785</u>																																																																																
繰延税金資産合計	580,489																																																																																
その他有価証券評価差額金	<u>55,668</u>																																																																																
繰延税金負債合計	<u>55,668</u>																																																																																
繰延税金資産の純額	<u>524,820</u>																																																																																
賞与引当金	133,428																																																																																
未払社会保険料	14,807																																																																																
未払事業税	83,126																																																																																
未払事業所税	6,378																																																																																
その他	<u>4,235</u>																																																																																
繰延税金資産計	241,975																																																																																
評価性引当額	<u>-</u>																																																																																
繰延税金資産合計	<u>241,975</u>																																																																																
繰延税金資産の純額	<u>241,975</u>																																																																																
退職給付引当金	533,373																																																																																
ソフトウェア償却	141,119																																																																																
投資有価証券評価損	71,023																																																																																
特定外国子会社留保金額	247,489																																																																																
その他	<u>4,925</u>																																																																																
繰延税金資産計	997,931																																																																																
評価性引当額	<u>321,097</u>																																																																																
繰延税金資産合計	676,833																																																																																
その他有価証券評価差額金	<u>70,383</u>																																																																																
繰延税金負債合計	<u>70,383</u>																																																																																
繰延税金資産の純額	<u>606,449</u>																																																																																
<p>2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳</p> <p style="text-align: center;">(%)</p> <table style="width: 100%;"> <tr><td>法定実効税率</td><td style="text-align: right;">40.7</td></tr> <tr><td>(調整)</td><td></td></tr> <tr><td>評価性引当額の増減</td><td style="text-align: right;">11.6</td></tr> <tr><td>交際費等永久に損金に算入されない項目</td><td style="text-align: right;">0.2</td></tr> <tr><td>住民税均等割等</td><td style="text-align: right;">0.1</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;"><u>0.2</u></td></tr> <tr><td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td><td style="text-align: right;"><u>29.1</u></td></tr> </table>	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>	<p>2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳</p> <p style="text-align: center;">法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、記載を省略しております。</p>																																																																		
法定実効税率	40.7																																																																																
(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>																																																																																

## （資産除去債務関係）

第26期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

該当事項はありません。

## （セグメント情報等）

第26期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

## 1. セグメント情報

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

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

## 2. 関連情報

## (1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への売上高	27,350,519	2,113,027	1,828,087	302,451	31,594,086

## (2) 地域ごとの情報

## 売上高

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## （追加情報）

当事業年度より、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。

## (関連当事者情報)

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。

第26期(自平成22年4月1日至平成23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	210,000,000	生命保険業	(被所有)% 直接 40	当社の主要顧客	投資助言報酬	1,130,782	未収投資助言報酬	293,061
その他の関係会社	(株)三井住友銀行	東京都 千代田区	1,770,996,505	銀行業	(被所有)% 直接 27.5	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	4,558,604	未払手数料	374,320

(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	2,174,385	未払手数料	110,182

(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25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)
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	1株当たり純資産額 1,584,018円42銭 1株当たり当期純利益 143,507円12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 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 27,942,085千円 普通株式に係る純資産額 27,942,085千円 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 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	( 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 2,531,465千円 普通株式に係る当期純利益 2,531,465千円 普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。 普通株式の期中平均株式数 17,640株

## ( 重要な後発事象 )

第25期(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。

第26期(自平成22年4月1日至平成23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27期中間会計期間 (平成23年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		15,908,684
有価証券		3,999,550
前払費用		273,540
未収委託者報酬		3,692,782
未収運用受託報酬		419,703
未収投資助言報酬		408,845
未収収益		16,131
繰延税金資産		216,398
その他		698
流動資産合計		24,936,334
固定資産		
有形固定資産	1	404,703
無形固定資産		149,325
投資その他の資産		
投資有価証券		5,686,023
その他		1,633,657
投資その他の資産合計		7,319,680
固定資産合計		7,873,709
資産合計		32,810,044
負債の部		
流動負債		
預り金		46,972
未払金		2,205,225
未払費用		834,591
未払法人税等		756,091
前受収益		8,761
賞与引当金		320,687
その他	2	80,148
流動負債合計		4,252,478
固定負債		
退職給付引当金		1,396,073
固定負債合計		1,396,073
負債合計		5,648,551



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	15,201,075
利益剰余金合計	17,022,279
株主資本合計	27,651,263
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	489,771
評価・換算差額等合計	489,771
純資産合計	27,161,492
負債純資産合計	32,810,044

## (2)中間損益計算書

(単位：千円)

		第27期中間会計期間 (自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日)
営業収益		
委託者報酬		13,337,108
運用受託報酬		991,578
投資助言報酬		879,806
その他の営業収益		107,846
営業収益計		15,316,340
営業費用		9,774,282
一般管理費	1	3,826,719
営業利益		1,715,338
営業外収益	2	32,554
経常利益		1,747,893
特別利益	3	111,902
特別損失		29,977
税引前中間純利益		1,829,819
法人税、住民税及び事業税		744,821
法人税等調整額		12,881
法人税等合計		757,702
中間純利益		1,072,117

## (3)中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

	第27期中間会計期間 (自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日)
株主資本	
資本金	
当期首残高	2,000,000
当中間期末残高	2,000,000
資本剰余金	
資本準備金	
当期首残高	8,628,984
当中間期末残高	8,628,984
資本剰余金合計	
当期首残高	8,628,984
当中間期末残高	8,628,984
利益剰余金	
利益準備金	
当期首残高	284,245
当中間期末残高	284,245
その他利益剰余金	
配当準備積立金	
当期首残高	60,000
当中間期末残高	60,000
別途積立金	
当期首残高	1,476,959
当中間期末残高	1,476,959
繰越利益剰余金	
当期首残高	15,381,398
当中間期変動額	
剰余金の配当	1,252,440
中間純利益	1,072,117
当中間期変動額合計	180,322
当中間期末残高	15,201,075
利益剰余金合計	
当期首残高	17,202,602
当中間期変動額	
剰余金の配当	1,252,440
中間純利益	1,072,117
当中間期変動額合計	180,322
当中間期末残高	17,022,279
株主資本合計	
当期首残高	27,831,586
当中間期変動額	
剰余金の配当	1,252,440
中間純利益	1,072,117
当中間期変動額合計	180,322

| 当中間期末残高

27,651,263 |

評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
当期首残高	110,498
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）	600,269
当中間期変動額合計	600,269
当中間期末残高	489,771
評価・換算差額等合計	
当期首残高	110,498
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）	600,269
当中間期変動額合計	600,269
当中間期末残高	489,771
純資産合計	
当期首残高	27,942,085
当中間期変動額	
剰余金の配当	1,252,440
中間純利益	1,072,117
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	600,269
当中間期変動額合計	780,592
当中間期末残高	27,161,492

## 重要な会計方針

## 第27期中間会計期間

(自平成23年4月1日至平成23年9月30日)

## 1. 資産の評価基準及び評価方法

## (1) 有価証券

- ・満期保有目的の債券...償却原価法
- ・子会社株式及び関連会社株式...移動平均法による原価法
- ・その他有価証券

時価のあるもの...中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

時価のないもの...移動平均法による原価法

## 2. 固定資産の減価償却の方法

## (1) 有形固定資産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 3～50年

器具備品 3～20年

## (2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

## 3. 引当金の計上基準

## (1) 賞与引当金

従業員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。

## 追加情報

<p>第27期中間会計期間 (自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日)</p>
<p>会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準</p> <p>当中間会計期間の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。</p>

## 注 記 事 項

(中間貸借対照表関係)

<p>第27期中間会計期間 (平成23年9月30日)</p>						
<p>1. 有形固定資産の減価償却累計額 812,990千円</p>						
<p>2. 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債のその他に含めて表示しております。</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> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 60%;">当座借越極度額の総額</td> <td style="text-align: right;">10,000,000千円</td> </tr> <tr> <td>借入実行残高</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> <tr> <td style="border-top: 1px solid black;">差引額</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">10,000,000千円</td> </tr> </table>	当座借越極度額の総額	10,000,000千円	借入実行残高	-	差引額	10,000,000千円
当座借越極度額の総額	10,000,000千円					
借入実行残高	-					
差引額	10,000,000千円					
<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60,830千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27期中間会計期間 (自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日)</p>						
<p>1. 減価償却実施額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 15%;">有形固定資産</td> <td style="text-align: right;">66,377千円</td> </tr> <tr> <td>無形固定資産</td> <td style="text-align: right;">4,380千円</td> </tr> </table>	有形固定資産	66,377千円	無形固定資産	4,380千円		
有形固定資産	66,377千円					
無形固定資産	4,380千円					
<p>2. 営業外収益のうち主要なもの</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 15%;">受取利息</td> <td style="text-align: right;">3,030千円</td> </tr> <tr> <td>受取配当金</td> <td style="text-align: right;">17,068千円</td> </tr> <tr> <td>為替差益</td> <td style="text-align: right;">6,222千円</td> </tr> </table>	受取利息	3,030千円	受取配当金	17,068千円	為替差益	6,222千円
受取利息	3,030千円					
受取配当金	17,068千円					
為替差益	6,222千円					
<p>3. 特別利益のうち主要なもの</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 15%;">受取和解金</td> <td style="text-align: right;">108,451千円</td> </tr> </table>	受取和解金	108,451千円				
受取和解金	108,451千円					

## （中間株主資本等変動計算書関係）

第27期中間会計期間 （自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日）					
1. 発行済株式数に関する事項					
	当事業年度 期首株式数	当中間会計期 間 増加株式数	当中間会計期間 減少株式数	当中間会計期間 末株式数	
普通株式	17,640株	-	-	17,640株	
2. 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23年6月24日 定時株主総会	普通株式	1,252,440	71,000	平成23年 3月31日	平成23年 6月27日

## （リース取引関係）

第27期中間会計期間 （自 平成23年4月1日 至 平成23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	672,143千円
1年超	621,833千円
合 計	1,293,976千円



(金融商品関係)

## 1. 金融商品の時価等に関する事項

平成23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27期中間会計期間 (平成23年9月30日)			
区分	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1) 現金及び預金	15,908,684	15,908,684	-
(2) 未収委託者報酬	3,692,782	3,692,782	-
(3) 未収運用受託報酬	419,703	419,703	-
(4) 未収投資助言報酬	408,845	408,845	-
(5) 有価証券及び投資有価証券			
満期保有目的の債券	3,999,550	3,999,200	350
その他有価証券	5,637,282	5,637,282	-
(6) 投資その他の資産			
長期差入保証金	680,723	680,723	-
資産計	30,747,572	30,747,222	350
(1) 未払金			
未払手数料	2,068,789	2,068,789	-
負債計	2,068,789	2,068,789	-

(注1) 金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資産

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

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

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

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

(6) 投資その他の資産

長期差入保証金

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

負債

(1) 未払金

未払手数料

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

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：千円）

第27期中間会計期間 （平成23年9月30日）	
内容	中間貸借対照表計上額
(1) 子会社株式	234,921
合計	234,921
(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。

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。

（有価証券関係）

1．満期保有目的の債券

（単位：千円）

第27期中間会計期間 （平成23年9月30日）			
区分	中間貸借対照表 計上額	時価	差額
(1) 中間貸借対照表日の時価が中間 貸借対照表計上額を超えるもの	-	-	-
小計	-	-	-
(2) 中間貸借対照表日の時価が中間 貸借対照表計上額を超えないもの	3,999,550	3,999,200	350
小計	3,999,550	3,999,200	350
合計	3,999,550	3,999,200	350

2．子会社株式及び関連会社株式

第27期中間会計期間 （平成23年9月30日）	
子会社株式及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額 234,921千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載していません。	

## 3. その他有価証券

(単位：千円)

第27期中間会計期間 (平成23年9月30日)			
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	96,513	90,990	5,523
小計	96,513	90,990	5,523
(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	5,540,768	6,036,063	495,294
小計	5,540,768	6,036,063	495,294
合計	5,637,282	6,127,053	489,771

(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。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。当中間会計期間における減損処理額は301千円です。

## (デリバティブ取引関係)

第27期中間会計期間 (自平成23年4月1日至平成23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27期中間会計期間 (自平成23年4月1日至平成23年9月30日)	
該当事項はありません。	

## (資産除去債務等)

第27期中間会計期間 (自平成23年4月1日至平成23年9月30日)	
該当事項はありません。	

## (セグメント情報等)

## 第27期中間会計期間

(自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日)

## (セグメント情報)

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

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

## (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	13,337,108	991,578	879,806	107,846	15,316,340

## 2. 地域ごとの情報

## (1) 売上高

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

## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

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

## （ 1株当たり情報 ）

第27期中間会計期間 (自 平成23年4月1日 至 平成23年9月30日)	
1株当たり純資産額	1,539,767円16銭
1株当たり中間純利益	60,777円60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	27,161,492千円
普通株式に係る純資産額	27,161,492千円
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	1,072,117千円
普通株式に係る中間純利益	1,072,117千円
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27期中間会計期間 (自 平成23年4月1日 至 平成23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23年6月24日に開催された定時株主総会において、監査体制の見直しにより監査役の員数を1名減員し4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 三井住友信託銀行株式会社

(ロ) 資本金の額 342,037百万円（平成24年4月1日現在）

(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23年9月末現在）

- ・ 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

ロ 販売会社

(イ) 名称	(ロ) 資本金の額	(ハ) 事業の内容
損保ジャパンDC証券株式会社	3,000百万円	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社みずほコーポレート銀行	1,404,065百万円	銀行法に基づき、銀行業を営んでいます。
株式会社三井住友銀行	1,770,996百万円	
住友生命保険相互会社	539,000百万円	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23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23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23年2月18日現在）	（平成24年2月20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	5,202,960,110	5,042,969,514
株式	329,832,604,130	304,191,724,375
派生商品評価勘定	150,306,850	82,871,850
未収入金	8,427,700	64,371,700
未収配当金	304,877,008	332,423,447
未収利息	7,127	6,908
流動資産合計	335,499,182,925	309,714,367,794
資産合計	335,499,182,925	309,714,367,794
負債の部		
流動負債		
前受金	150,310,000	82,875,000
未払金	6,490,000	39,980,000
未払解約金	935,620,148	2,259,702,291
流動負債合計	1,092,420,148	2,382,557,291
負債合計	1,092,420,148	2,382,557,291
純資産の部		
元本等		
元本		
元本	261,704,374,197	279,179,562,739
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	72,702,388,580	28,152,247,764
元本等合計	334,406,762,777	307,331,810,503
純資産合計	334,406,762,777	307,331,810,503
負債純資産合計	335,499,182,925	309,714,367,794

（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23年2月18日ならびに平成24年2月20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22年2月19日 至平成23年2月18日	自平成23年2月19日 至平成24年2月20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。	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23年2月18日現在)	(平成24年2月20日現在)								
1. 担保資産	代用として、担保に供している資産は次 の通りであります。 <table style="margin-left: 40px; border: none;"> <tr> <td style="text-align: center;"><u>担保資産</u></td> <td style="text-align: center;"><u>金額</u></td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">株式</td> <td style="text-align: right;">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	代用として、担保に供している資産は次 の通りであります。 <table style="margin-left: 40px; border: none;"> <tr> <td style="text-align: center;"><u>担保資産</u></td> <td style="text-align: center;"><u>金額</u></td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">株式</td> <td style="text-align: right;">6,030,000,000円</td> </tr> </table>	<u>担保資産</u>	<u>金額</u>	株式	6,030,000,000円
<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	6,030,000,000円									
2. 受益権総数	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	平成24年2月20日現在における受益権の 総数  279,179,562,739口								
3. 1単位当たり純資産額	1.2778円 (1万口 = 12,778円)	1.1008円 (1万口 = 11,008円)								

## （金融商品に関する注記）

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自平成22年2月19日 至平成23年2月18日	自平成23年2月19日 至平成24年2月20日
	（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。	
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。	同左
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、株式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。 当計算期間については、先物取引を行っております。 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。	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 同左 2) デリバティブ取引 同左 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 同左

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>	同左
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>	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成23年2月18日現在）	（平成24年2月20日現在）
1．貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2．時価の算定方法	<p>(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。</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>(1) 有価証券（株式） 同左</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） 同左</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>	<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 同左</p>
---	--

（デリバティブ取引に関する注記）

（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 (4,176,473,150)	- (-)	4,326,780,000	150,310,000 (150,306,850)
	買建合計	4,176,470,000 (4,176,473,150)	- (-)	4,326,780,000	150,310,000 (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。

(平成24年2月20日現在)

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 株式関連

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 (TOPIX先物)				
	買建	1,708,545,000 (1,708,548,150)	- (-)	1,791,420,000	82,875,000 (82,871,850)
	買建 合計	1,708,545,000 (1,708,548,150)	- (-)	1,791,420,000	82,875,000 (82,871,850)

## (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。

(自平成23年2月19日 至 平成24年2月20日)

該当事項はありません。

(その他の注記)

(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・国内株式バッシブ・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



(平成24年2月20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	261,704,374,197円
同期中における追加設定元本額	51,504,132,677円
同期中における一部解約元本額	34,028,944,135円
平成24年2月20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	8,699,211,010円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	472,764,669円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,291,212,049円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,499,047,336円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	48,236,661円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	5,061,533円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	5,697,573円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	5,285,666円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	6,121,503円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	1,633,499円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	3,813,683円
国内株式指数ファンド(TOPIX)	755,727,626円
三井住友・DC日本株式インデックスファンドS	998,902円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	66,543,177,310円
バランスファンドVA(安定運用型)〈適格機関投資家限定〉	734,957,213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〉	50,777,820,468円
SMAM・バランスファンドVA25〈適格機関投資家専用〉	17,432,044,586円
SMAM・バランスファンドVA37.5〈適格機関投資家専用〉	7,695,125,701円
SMAM・バランスファンドVA50〈適格機関投資家専用〉	26,424,550,083円
SMAM・バランスファンドVL30〈適格機関投資家限定〉	190,145,350円
SMAM・バランスファンドVL50〈適格機関投資家限定〉	571,318,235円
世界6資産バランスファンドVA〈適格機関投資家限定〉	93,853,831円
SMAM・バランスファンドVA75〈適格機関投資家専用〉	2,482,455,376円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型〈適格機関投資家限定〉	129,331,048円
SMAM・インデックス・バランスVA25〈適格機関投資家専用〉	1,082,014,049円
SMAM・インデックス・バランスVA50〈適格機関投資家専用〉	3,280,266,031円
SMAM・バランスファンドVA40〈適格機関投資家専用〉	5,033,398,785円
SMAM・バランスファンドVA35〈適格機関投資家専用〉	10,981,670,707円
SMAM・バランスVA株40T〈適格機関投資家限定〉	1,355,988,658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)	11,192,189,526円
SMAM・グローバルバランス40VA〈適格機関投資家限定〉	231,177,164円
SMAM・バランスファンドVA20〈適格機関投資家専用〉	3,013,212,648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)	47,341,971,393円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A〈適格機関投資家専用〉	331,708,452円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A〈適格機関投資家専用〉	167,987,484円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A〈適格機関投資家専用〉	58,474,730円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L〈適格機関投資家専用〉	869,245,159円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L〈適格機関投資家専用〉	1,495,038,026円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T〈適格機関投資家専用〉	575,871,389円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2〈適格機関投資家専用〉	384,398,450円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2〈適格機関投資家専用〉	166,625,443円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2〈適格機関投資家専用〉	33,463,137円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2〈適格機関投資家専用〉	361,541,751円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2〈適格機関投資家専用〉	3,637,844,215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)	551,054,624円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2〈適格機関投資家専用〉	137,711,799円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA〈適格機関投資家限定〉	20,763,058円
SMAM・FGグローバルバランス25VA〈適格機関投資家限定〉	6,355,150円
合計	279,179,562,739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	106,000	201	21,306,000	
日本水産	361,200	274	98,968,800	
マルハニチロホールディングス	616,000	139	85,624,000	
サカタのタネ	43,900	1,125	49,387,500	
ホクト	29,800	1,686	50,242,800	
住石ホールディングス	115,100	101	11,625,100	
日鉄鉱業	81,000	381	30,861,000	
三井松島産業	202,000	173	34,946,000	
国際石油開発帝石	3,707	572,000	2,120,404,000	
日本海洋掘削	8,500	2,747	23,349,500	
関東天然瓦斯開発	27,000	440	11,880,000	
石油資源開発	42,400	3,900	165,360,000	
ショーボンドホールディングス	24,800	1,818	45,086,400	
ミライト・ホールディングス	83,400	605	50,457,000	
間組	119,600	231	27,627,600	
東急建設	108,210	218	23,589,780	
コムシスホールディングス	145,500	872	126,876,000	
ミサワホーム	33,600	722	24,259,200	
高松コンストラクショングループ	24,000	1,255	30,120,000	
東建コーポレーション	11,370	2,817	32,029,290	
ヤマウラ	15,000	224	3,360,000	
大成建設	1,543,000	204	314,772,000	
大林組	914,000	346	316,244,000	
清水建設	931,000	323	300,713,000	
長谷工コーポレーション	1,960,500	60	117,630,000	
松井建設	34,000	319	10,846,000	
鹿島建設	1,434,000	242	347,028,000	
不動テトラ	231,400	154	35,635,600	
鉄建建設	193,000	110	21,230,000	
安藤建設	116,000	129	14,964,000	
太平工業	56,000	406	22,736,000	
西松建設	409,000	180	73,620,000	
三井住友建設	219,000	77	16,863,000	
大豊建設	94,000	115	10,810,000	
前田建設工業	194,000	312	60,528,000	
佐田建設	122,000	82	10,004,000	
ナカノフドー建設	25,000	180	4,500,000	
奥村組	287,000	321	92,127,000	
大和小田急建設	19,500	214	4,173,000	

東鉄工業	39,000	751	29,289,000
イチケン	43,000	151	6,493,000
浅沼組	121,000	79	9,559,000
戸田建設	320,000	286	91,520,000
熊谷組	242,000	89	21,538,000
青木あすなる建設	22,500	437	9,832,500
北野建設	72,000	188	13,536,000
植木組	47,000	203	9,541,000
三井ホーム	31,000	423	13,113,000
矢作建設工業	38,000	395	15,010,000
ピーエス三菱	24,500	411	10,069,500
大東建託	116,100	6,780	787,158,000
新日本建設	38,800	235	9,118,000
N I P P O	70,000	857	59,990,000
東亜道路工業	64,000	218	13,952,000
前田道路	84,000	923	77,532,000
日本道路	91,000	314	28,574,000
東亜建設工業	276,000	161	44,436,000
東洋建設	492,000	81	39,852,000
五洋建設	394,000	254	100,076,000
大林道路	38,000	244	9,272,000
世紀東急工業	122,000	65	7,930,000
福田組	56,000	273	15,288,000
住友林業	208,900	703	146,856,700
日本基礎技術	38,600	320	12,352,000
日成ビルド工業	111,000	181	20,091,000
エス・バイ・エル	174,000	164	28,536,000
巴コーポレーション	40,700	322	13,105,400
パナホーム	110,000	532	58,520,000
大和ハウス工業	757,000	1,009	763,813,000
ライト工業	66,200	467	30,915,400
積水ハウス	855,000	746	637,830,000
日特建設	100,000	113	11,300,000
北陸電気工事	18,000	236	4,248,000
ユアテック	42,000	446	18,732,000
西部電気工業	25,000	351	8,775,000
四電工	28,000	338	9,464,000
中電工	41,400	842	34,858,800
関電工	139,000	420	58,380,000
きんでん	198,000	631	124,938,000
東京エネシス	34,000	461	15,674,000
トーエネック	46,000	447	20,562,000
住友電設	21,200	549	11,638,800
日本電設工業	54,000	751	40,554,000
協和エクシオ	97,000	713	69,161,000
新日本空調	25,900	450	11,655,000

日本電話施設	49,000	255	12,495,000
九電工	55,000	500	27,500,000
三機工業	68,000	418	28,424,000
日揮	284,000	2,189	621,676,000
中外炉工業	103,000	279	28,737,000
ヤマト	29,000	306	8,874,000
太平電業	41,000	617	25,297,000
高砂熱学工業	86,200	620	53,444,000
三晃金属工業	42,000	236	9,912,000
朝日工業社	31,000	334	10,354,000
大気社	46,400	1,609	74,657,600
ダイダン	41,000	521	21,361,000
日比谷総合設備	36,800	836	30,764,800
東芝プラントシステム	50,000	899	44,950,000
東洋エンジニアリング	167,000	325	54,275,000
千代田化工建設	245,000	883	216,335,000
新興プランテック	62,700	683	42,824,100
日本製粉	176,000	366	64,416,000
日清製粉グループ本社	274,000	945	258,930,000
日東富士製粉	23,000	299	6,877,000
昭和産業	118,000	248	29,264,000
鳥越製粉	25,600	674	17,254,400
協同飼料	125,000	98	12,250,000
中部飼料	27,400	531	14,549,400
日本配合飼料	120,000	116	13,920,000
東洋精糖	63,000	101	6,363,000
日本甜菜製糖	167,000	182	30,394,000
三井製糖	116,000	266	30,856,000
森永製菓	291,000	189	54,999,000
中村屋	74,000	408	30,192,000
江崎グリコ	110,000	896	98,560,000
名糖産業	14,400	1,007	14,500,800
不二家	193,000	165	31,845,000
山崎製パン	224,000	1,075	240,800,000
モロゾフ	45,000	272	12,240,000
カルビー	17,300	3,580	61,934,000
森永乳業	266,000	297	79,002,000
ヤクルト本社	165,500	2,401	397,365,500
明治ホールディングス	90,600	3,355	303,963,000
雪印メグミルク	67,600	1,510	102,076,000
プリマハム	185,000	132	24,420,000
日本ハム	232,000	1,006	233,392,000
伊藤ハム	176,000	312	54,912,000
林兼産業	139,000	83	11,537,000
丸大食品	144,000	322	46,368,000
米久	27,000	743	20,061,000

S Foods	16,500	696	11,484,000
サッポロホールディングス	511,000	298	152,278,000
アサヒグループホールディングス	572,000	1,806	1,033,032,000
キリンホールディングス	1,226,000	972	1,191,672,000
宝ホールディングス	261,000	509	132,849,000
オエノンホールディングス	84,000	190	15,960,000
養命酒製造	23,000	762	17,526,000
三国コカ・コーラボトリング	21,500	683	14,684,500
コカ・コーラウエスト	103,800	1,357	140,856,600
コカ・コーラ セントラル ジャパン	30,300	1,003	30,390,900
ダイドードリンコ	13,600	3,130	42,568,000
伊藤園	84,600	1,324	112,010,400
キーコーヒー	23,000	1,475	33,925,000
ジャパンフーズ	4,700	828	3,891,600
日清オイリオグループ	118,000	328	38,704,000
不二製油	75,000	1,082	81,150,000
J - オイルミルズ	118,000	228	26,904,000
キッコーマン	250,000	875	218,750,000
味の素	806,000	927	747,162,000
キューピー	148,900	1,120	166,768,000
ハウス食品	104,400	1,401	146,264,400
カゴメ	117,100	1,574	184,315,400
焼津水産化学工業	12,500	735	9,187,500
アリアケジャパン	29,200	1,581	46,165,200
ニチレイ	343,000	382	131,026,000
東洋水産	132,000	1,960	258,720,000
日清食品ホールディングス	118,500	2,943	348,745,500
永谷園	28,000	885	24,780,000
フジッコ	29,000	1,009	29,261,000
ロック・フィールド	12,600	1,376	17,337,600
日本たばこ産業	6,773	440,000	2,980,120,000
わらべや日洋	16,900	1,052	17,778,800
なとり	12,300	888	10,922,400
ミヨシ油脂	109,000	110	11,990,000
片倉工業	38,000	738	28,044,000
グンゼ	196,000	243	47,628,000
東洋紡績	1,197,000	115	137,655,000
ユニチカ	649,000	51	33,099,000
富士紡ホールディングス	119,000	169	20,111,000
日清紡ホールディングス	181,000	726	131,406,000
倉敷紡績	289,000	157	45,373,000
シキボウ	200,000	113	22,600,000
日本毛織	95,000	582	55,290,000
トーア紡コーポレーション	151,000	61	9,211,000
ダイドーリミテッド	35,100	675	23,692,500
帝国繊維	25,000	563	14,075,000

帝人	1,171,000	261	305,631,000
東レ	2,066,000	573	1,183,818,000
サカイオーベックス	96,000	142	13,632,000
住江織物	89,000	151	13,439,000
日本フェルト	12,000	409	4,908,000
イチカワ	26,000	166	4,316,000
日本バイリーン	36,000	347	12,492,000
日東製網	53,000	170	9,010,000
芦森工業	77,000	116	8,932,000
アツギ	219,000	99	21,681,000
ダイニック	61,000	159	9,699,000
セーレン	72,900	472	34,408,800
小松精練	39,000	388	15,132,000
ワコールホールディングス	168,000	1,001	168,168,000
ホギメディカル	17,100	3,320	56,772,000
レナウン	92,500	155	14,337,500
クラウドピア	3,700	1,072	3,966,400
T S Iホールディングス	129,600	437	56,635,200
三陽商会	138,000	210	28,980,000
オンワードホールディングス	178,000	637	113,386,000
ルック	64,000	233	14,912,000
ゴールドウイン	64,000	441	28,224,000
デサント	72,000	422	30,384,000
ヤマトインターナショナル	16,300	377	6,145,100
特種東海製紙	184,000	180	33,120,000
王子製紙	1,247,000	392	488,824,000
三菱製紙	430,000	82	35,260,000
北越紀州製紙	175,000	509	89,075,000
中越バルブ工業	107,000	166	17,762,000
巴川製紙所	56,000	190	10,640,000
大王製紙	124,000	535	66,340,000
日本製紙グループ本社	138,900	1,753	243,491,700
レンゴー	230,000	552	126,960,000
トーモク	88,000	222	19,536,000
ザ・パック	16,400	1,179	19,335,600
クラレ	452,400	1,113	503,521,200
旭化成	1,656,000	495	819,720,000
共和レザー	15,400	300	4,620,000
コープケミカル	62,000	119	7,378,000
昭和電工	1,778,000	173	307,594,000
住友化学	1,963,000	337	661,531,000
日本化成	61,000	153	9,333,000
住友精化	56,000	355	19,880,000
日産化学工業	213,700	801	171,173,700
クレハ	185,000	406	75,110,000
テイカ	50,000	293	14,650,000

石原産業	492,000	87	42,804,000	
片倉チッカリン	24,000	226	5,424,000	
日本曹達	171,000	369	63,099,000	
東ソー	766,000	237	181,542,000	
トクヤマ	450,000	296	133,200,000	
セントラル硝子	277,000	366	101,382,000	
東亜合成	349,000	361	125,989,000	
ダイソー	117,000	254	29,718,000	
関東電化工業	69,000	294	20,286,000	
電気化学工業	598,000	322	192,556,000	
信越化学工業	511,400	4,360	2,229,704,000	
日本カーバイド工業	108,000	128	13,824,000	
堺化学工業	93,000	310	28,830,000	
エア・ウォーター	230,000	1,007	231,610,000	
大陽日酸	373,000	536	199,928,000	
日本化学工業	116,000	147	17,052,000	
日本パーライジング	69,000	1,171	80,799,000	
高圧ガス工業	42,000	477	20,034,000	
チタン工業	37,000	374	13,838,000	
四国化成工業	42,000	437	18,354,000	
戸田工業	39,000	620	24,180,000	
ステラ ケミファ	13,500	2,227	30,064,500	
保土谷化学工業	63,000	274	17,262,000	
日本触媒	207,000	940	194,580,000	
大日精化工業	106,000	362	38,372,000	
カネカ	349,000	452	157,748,000	
三菱瓦斯化学	493,000	520	256,360,000	
三井化学	1,214,000	278	337,492,000	
J S R	260,600	1,623	422,953,800	
東京応化工業	50,800	1,835	93,218,000	
三菱ケミカルホールディングス	1,778,500	482	857,237,000	
日本合成化学工業	59,000	494	29,146,000	
ダイセル	372,000	522	194,184,000	
住友ベークライト	249,000	476	118,524,000	
積水化学工業	592,000	670	396,640,000	
日本ゼオン	269,000	730	196,370,000	
アイカ工業	72,700	1,149	83,532,300	
宇部興産	1,197,000	236	282,492,000	
積水樹脂	38,000	802	30,476,000	
タキロン	66,000	271	17,886,000	
旭有機材工業	96,000	226	21,696,000	
日立化成工業	123,200	1,512	186,278,400	
ニチバン	24,000	261	6,264,000	
リケンテクノス	48,000	244	11,712,000	
大倉工業	74,000	253	18,722,000	
積水化成品工業	73,000	282	20,586,000	

群栄化学工業	77,000	207	15,939,000
タイガースポリマー	18,200	318	5,787,600
日本カーリット	23,400	407	9,523,800
日本化薬	191,000	758	144,778,000
日本精化	24,800	553	13,714,400
A D E K A	122,400	761	93,146,400
日油	225,000	404	90,900,000
ハリマ化成	25,700	567	14,571,900
花王	757,400	2,048	1,551,155,200
第一工業製薬	57,000	230	13,110,000
三洋化成工業	87,000	534	46,458,000
大日本塗料	183,000	96	17,568,000
日本ペイント	269,000	644	173,236,000
関西ペイント	321,000	777	249,417,000
中国塗料	89,000	542	48,238,000
日本特殊塗料	22,500	327	7,357,500
藤倉化成	39,400	410	16,154,000
太陽ホールディングス	23,900	2,167	51,791,300
D I C	1,103,000	152	167,656,000
サカティンクス	51,000	372	18,972,000
東洋インキS Cホールディングス	247,000	321	79,287,000
富士フイルムホールディングス	608,800	1,990	1,211,512,000
資生堂	475,100	1,395	662,764,500
ライオン	317,000	466	147,722,000
高砂香料工業	93,000	381	35,433,000
マンダム	28,500	1,941	55,318,500
ミルボン	14,300	2,354	33,662,200
ファンケル	69,900	1,048	73,255,200
コーセー	45,400	1,810	82,174,000
ドクターシーラボ	177	374,000	66,198,000
ポーラ・オルビスホールディングス	30,200	2,015	60,853,000
エステー	18,000	1,003	18,054,000
コニシ	20,600	1,055	21,733,000
長谷川香料	36,600	1,205	44,103,000
小林製薬	39,400	3,925	154,645,000
荒川化学工業	22,700	730	16,571,000
メック	26,400	329	8,685,600
日本高純度化学	80	210,000	16,800,000
荏原ユーザライト	5,000	2,260	11,300,000
アース製薬	18,400	2,844	52,329,600
イハラケミカル工業	49,000	326	15,974,000
北興化学工業	29,000	236	6,844,000
大成ラミック	6,700	2,525	16,917,500
クミアイ化学工業	69,000	341	23,529,000
日本農薬	67,000	349	23,383,000
アキレス	231,000	118	27,258,000



有沢製作所	52,400	350	18,340,000
日東電工	235,900	3,325	784,367,500
レック	9,400	1,249	11,740,600
きもと	25,500	526	13,413,000
藤森工業	21,700	1,220	26,474,000
前澤化成工業	20,400	843	17,197,200
J S P	18,500	1,210	22,385,000
エフピコ	13,000	5,410	70,330,000
天馬	22,600	807	18,238,200
信越ポリマー	57,800	358	20,692,400
東リ	78,000	169	13,182,000
ニフコ	63,400	2,083	132,062,200
日本バルカー工業	114,000	226	25,764,000
ユニ・チャーム	157,500	4,075	641,812,500
協和発酵キリン	385,000	909	349,965,000
武田薬品工業	1,067,900	3,505	3,742,989,500
アステラス製薬	632,100	3,250	2,054,325,000
大日本住友製薬	201,700	830	167,411,000
塩野義製薬	445,400	1,084	482,813,600
田辺三菱製薬	284,700	1,048	298,365,600
わかもと製薬	40,000	236	9,440,000
あすか製薬	36,000	508	18,288,000
日本新薬	60,000	945	56,700,000
中外製薬	330,200	1,271	419,684,200
科研製薬	110,000	1,008	110,880,000
エーザイ	350,800	3,185	1,117,298,000
ロート製薬	121,000	946	114,466,000
小野薬品工業	138,700	4,325	599,877,500
久光製薬	87,600	3,550	310,980,000
有機合成薬品工業	32,000	203	6,496,000
持田製薬	93,000	914	85,002,000
参天製薬	96,300	3,140	302,382,000
扶桑薬品工業	99,000	208	20,592,000
日本ケミファ	51,000	371	18,921,000
ツムラ	78,000	2,303	179,634,000
日医工	49,900	1,769	88,273,100
キッセイ薬品工業	50,700	1,552	78,686,400
生化学工業	53,600	897	48,079,200
栄研化学	23,100	1,083	25,017,300
日水製薬	10,100	723	7,302,300
鳥居薬品	19,100	1,476	28,191,600
東和薬品	15,000	3,340	50,100,000
沢井製薬	19,100	7,840	149,744,000
ゼリア新薬工業	42,000	1,348	56,616,000
第一三共	959,700	1,454	1,395,403,800
キョーリン製薬ホールディングス	69,000	1,420	97,980,000

大幸薬品	14,800	831	12,298,800	
ダイト	9,300	1,115	10,369,500	
大塚ホールディングス	565,500	2,187	1,236,748,500	
大正製薬ホールディングス	68,500	6,970	477,445,000	
日本コークス工業	248,500	119	29,571,500	
昭和シェル石油	249,600	563	140,524,800	
コスモ石油	783,000	231	180,873,000	
ニチレキ	38,000	442	16,796,000	
東燃ゼネラル石油	425,000	762	323,850,000	
ユシロ化学工業	17,400	883	15,364,200	
ビービー・カストロール	11,500	335	3,852,500	
AOCホールディングス	69,900	538	37,606,200	
MORESCO	8,000	920	7,360,000	
出光興産	33,500	8,470	283,745,000	
JXホールディングス	3,161,800	509	1,609,356,200	
横浜ゴム	343,000	528	181,104,000	
東洋ゴム工業	224,000	215	48,160,000	
ブリヂストン	892,500	1,910	1,704,675,000	
住友ゴム工業	222,900	1,005	224,014,500	
藤倉ゴム工業	19,000	316	6,004,000	
オカモト	103,000	299	30,797,000	
フコク	12,700	752	9,550,400	
ニッタ	29,400	1,409	41,424,600	
東海ゴム工業	54,300	938	50,933,400	
三ツ星ベルト	76,000	430	32,680,000	
パンドー化学	105,000	321	33,705,000	
日東紡績	214,000	273	58,422,000	
旭硝子	1,401,000	697	976,497,000	
日本板硝子	1,224,000	141	172,584,000	
石塚硝子	40,000	150	6,000,000	
日本山村硝子	106,000	202	21,412,000	
日本電気硝子	549,000	724	397,476,000	
オハラ	11,100	853	9,468,300	
住友大阪セメント	583,000	240	139,920,000	
太平洋セメント	1,682,000	175	294,350,000	
デイ・シイ	33,900	273	9,254,700	
日本ヒューム	23,000	383	8,809,000	
日本コンクリート工業	50,000	262	13,100,000	
東海カーボン	245,000	425	104,125,000	
日本カーボン	130,000	218	28,340,000	
東洋炭素	14,700	3,240	47,628,000	
ノリタケカンパニーリミテド	149,000	253	37,697,000	
TOTO	436,000	608	265,088,000	
日本碍子	372,000	1,012	376,464,000	
日本特殊陶業	244,000	1,060	258,640,000	
MARUWA	8,800	3,235	28,468,000	

品川リフラクトリーズ	70,000	233	16,310,000
黒崎播磨	66,000	278	18,348,000
東京窯業	30,000	203	6,090,000
ニッカトー	11,000	515	5,665,000
フジミインコーポレーテッド	26,000	1,026	26,676,000
エーアンドエーマテリアル	88,000	86	7,568,000
ニチアス	126,000	449	56,574,000
ニチハ	33,200	923	30,643,600
新日本製鐵	7,475,000	224	1,674,400,000
住友金属工業	5,287,000	161	851,207,000
神戸製鋼所	3,952,000	142	561,184,000
日新製鋼	1,026,000	134	137,484,000
中山製鋼所	172,000	95	16,340,000
合同製鐵	172,000	208	35,776,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	676,100	1,712	1,157,483,200
東京製鐵	148,500	642	95,337,000
共英製鋼	32,100	1,425	45,742,500
大和工業	65,200	2,488	162,217,600
東京鐵鋼	63,000	300	18,900,000
大阪製鐵	18,400	1,456	26,790,400
淀川製鋼所	203,000	359	72,877,000
東洋鋼鈑	61,000	309	18,849,000
住友鋼管	21,300	651	13,866,300
丸一鋼管	86,100	1,758	151,363,800
モリ工業	46,000	288	13,248,000
大同特殊鋼	474,000	504	238,896,000
日本高周波鋼業	131,000	105	13,755,000
日本冶金工業	100,500	136	13,668,000
山陽特殊製鋼	141,000	424	59,784,000
愛知製鋼	154,000	420	64,680,000
日立金属	188,000	971	182,548,000
日本金属	85,000	146	12,410,000
大平洋金属	196,000	439	86,044,000
日本電工	105,000	340	35,700,000
栗本鐵工所	151,000	196	29,596,000
日本鑄鉄管	42,000	182	7,644,000
三菱製鋼	177,000	251	44,427,000
日亜鋼業	49,000	207	10,143,000
日本精線	22,000	385	8,470,000
シンニッタン	30,300	385	11,665,500
新家工業	71,000	133	9,443,000
日本輕金属	655,000	119	77,945,000
大紀アルミニウム工業所	50,000	297	14,850,000
三井金属鋳業	768,000	229	175,872,000
東邦亜鉛	156,000	343	53,508,000
三菱マテリアル	1,770,000	257	454,890,000

住友金属鉱山	734,000	1,190	873,460,000
DOWAホールディングス	336,000	506	170,016,000
古河機械金属	499,000	75	37,425,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	29,100	3,450	100,395,000
東邦チタニウム	48,700	1,406	68,472,200
住友軽金属工業	712,000	79	56,248,000
古河スカイ	121,000	230	27,830,000
古河電気工業	899,000	217	195,083,000
住友電気工業	1,005,500	1,021	1,026,615,500
フジクラ	426,000	270	115,020,000
昭和電線ホールディングス	385,000	79	30,415,000
タツタ電線	57,000	415	23,655,000
日立電線	234,000	186	43,524,000
平河ヒューテック	7,800	767	5,982,600
リョービ	160,000	311	49,760,000
アサヒホールディングス	39,900	1,612	64,318,800
稲葉製作所	13,400	941	12,609,400
宮地エンジニアリンググループ	106,000	162	17,172,000
三協・立山ホールディングス	408,000	137	55,896,000
トーカロ	17,500	1,692	29,610,000
アルファC o	10,700	1,039	11,117,300
SUMCO	154,100	781	120,352,100
川田テクノロジーズ	7,900	1,240	9,796,000
東洋製罐	196,200	1,159	227,395,800
ホッカインホールディングス	67,000	237	15,879,000
コロナ	14,600	1,230	17,958,000
横河ブリッジホールディングス	59,000	551	32,509,000
駒井ハルテック	66,000	251	16,566,000
高田機工	30,000	217	6,510,000
三和ホールディングス	292,000	278	81,176,000
文化シャッター	80,000	280	22,400,000
住生活グループ	372,800	1,694	631,523,200
日本ファイルコン	27,100	403	10,921,300
ノーリツ	57,700	1,494	86,203,800
長府製作所	25,600	1,957	50,099,200
リンナイ	45,600	5,620	256,272,000
ダイニチ工業	16,000	786	12,576,000
日東精工	46,000	227	10,442,000
三洋工業	49,000	170	8,330,000
岡部	55,200	406	22,411,200
東プレ	55,900	784	43,825,600
高周波熱錬	39,700	755	29,973,500
東京製綱	188,000	177	33,276,000
パイオラックス	12,300	1,975	24,292,500
日本発條	207,500	840	174,300,000
中央発條	44,000	290	12,760,000

三益半導体工業	25,700	784	20,148,800
アタカ大機	19,000	276	5,244,000
日本製鋼所	440,000	621	273,240,000
日立ツール	17,700	857	15,168,900
三浦工業	41,700	2,234	93,157,800
タクマ	104,000	371	38,584,000
ツガミ	74,000	586	43,364,000
オークマ	173,000	651	112,623,000
東芝機械	161,000	427	68,747,000
アマダ	398,000	578	230,044,000
アイダエンジニアリング	77,200	439	33,890,800
牧野フライス製作所	148,000	582	86,136,000
オーエスジー	126,700	1,224	155,080,800
ダイジェット工業	43,000	171	7,353,000
旭ダイヤモンド工業	71,400	1,062	75,826,800
森精機製作所	152,300	823	125,342,900
ディスコ	29,100	4,315	125,566,500
日東工器	15,200	1,841	27,983,200
豊和工業	175,000	76	13,300,000
島精機製作所	37,700	1,537	57,944,900
日阪製作所	37,000	851	31,487,000
やまびこ	12,500	1,033	12,912,500
ペガサスミシン製造	31,800	223	7,091,400
ナブテスコ	118,700	1,885	223,749,500
三井海洋開発	24,700	1,502	37,099,400
レオン自動機	27,000	200	5,400,000
S M C	85,200	13,880	1,182,576,000
新川	24,000	434	10,416,000
ホソカワミクロン	49,000	410	20,090,000
ユニオンツール	13,600	1,434	19,502,400
オイレス工業	31,900	1,482	47,275,800
サトーホールディングス	29,200	1,073	31,331,600
日本エアーテック	9,100	374	3,403,400
日精樹脂工業	24,000	377	9,048,000
ワイエイシイ	15,200	649	9,864,800
小松製作所	1,350,200	2,423	3,271,534,600
住友重機械工業	725,000	446	323,350,000
日立建機	144,400	1,694	244,613,600
日工	44,000	296	13,024,000
巴工業	10,800	1,583	17,096,400
井関農機	297,000	203	60,291,000
T O W A	27,800	470	13,066,000
丸山製作所	71,000	185	13,135,000
北川鉄工所	146,000	154	22,484,000
クボタ	1,305,000	804	1,049,220,000
荏原実業	6,800	1,203	8,180,400

三菱化工機	87,000	160	13,920,000
月島機械	43,000	655	28,165,000
帝国電機製作所	10,600	1,495	15,847,000
新東工業	64,100	781	50,062,100
澁谷工業	17,100	870	14,877,000
アイチ コーポレーション	49,700	336	16,699,200
小森コーポレーション	83,600	561	46,899,600
鶴見製作所	22,000	650	14,300,000
住友精密工業	44,000	508	22,352,000
酒井重工業	55,000	182	10,010,000
荏原製作所	470,000	303	142,410,000
石井鐵工所	50,000	167	8,350,000
西島製作所	32,300	1,049	33,882,700
ダイキン工業	347,000	2,375	824,125,000
オルガノ	54,000	600	32,400,000
トーヨーカネツ	166,000	183	30,378,000
栗田工業	156,300	2,093	327,135,900
椿本チエイン	144,000	480	69,120,000
大同工業	64,000	146	9,344,000
日本コンベヤ	106,000	86	9,116,000
木村化工機	29,800	370	11,026,000
アネスト岩田	47,000	347	16,309,000
ダイフク	124,000	472	58,528,000
加藤製作所	69,000	291	20,079,000
油研工業	61,000	173	10,553,000
タダノ	137,000	525	71,925,000
フジテック	81,000	513	41,553,000
シーケーディ	78,300	602	47,136,600
キトー	116	62,900	7,296,400
平和	59,300	1,467	86,993,100
理想科学工業	20,700	1,169	24,198,300
SANKYO	82,500	3,755	309,787,500
日本金銭機械	26,200	604	15,824,800
マースエンジニアリング	14,700	1,447	21,270,900
福島工業	7,900	1,050	8,295,000
オーイズミ	17,000	247	4,199,000
ダイコク電機	13,400	915	12,261,000
アマノ	76,900	714	54,906,600
JUKI	79,000	176	13,904,000
サンデン	151,000	282	42,582,000
蛇の目ミシン工業	296,000	70	20,720,000
マックス	41,000	988	40,508,000
グローリー	80,300	1,698	136,349,400
大和冷機工業	39,000	425	16,575,000
セガサミーホールディングス	294,300	1,471	432,915,300
日本ピストンリング	110,000	191	21,010,000

リケン	102,000	340	34,680,000
T P R	32,100	1,178	37,813,800
ホシザキ電機	53,900	1,762	94,971,800
大豊工業	19,100	909	17,361,900
日本精工	605,000	637	385,385,000
N T N	634,000	355	225,070,000
ジェイテクト	260,500	902	234,971,000
不二越	281,000	438	123,078,000
日本トムソン	90,000	491	44,190,000
T H K	182,000	1,755	319,410,000
ユーシン精機	14,200	1,575	22,365,000
前澤給装工業	9,200	1,078	9,917,600
イーグル工業	36,000	731	26,316,000
日本ピラー工業	30,000	611	18,330,000
キッツ	119,100	353	42,042,300
日立工機	66,100	679	44,881,900
マキタ	177,600	3,230	573,648,000
日立造船	1,073,500	110	118,085,000
三菱重工業	4,561,000	381	1,737,741,000
I H I	1,855,000	204	378,420,000
イビデン	179,500	1,863	334,408,500
コニカミノルタホールディングス	718,500	654	469,899,000
ブラザー工業	350,900	1,020	357,918,000
ミネベア	410,000	374	153,340,000
日立製作所	6,110,000	462	2,822,820,000
東芝	5,734,000	347	1,989,698,000
三菱電機	2,724,000	728	1,983,072,000
富士電機	824,000	213	175,512,000
東洋電機製造	52,000	325	16,900,000
安川電機	322,000	790	254,380,000
シンフォニアテクノロジー	177,000	187	33,099,000
明電舎	271,000	292	79,132,000
オリジン電気	44,000	301	13,244,000
デンヨー	27,000	1,011	27,297,000
東芝テック	162,000	283	45,846,000
芝浦メカトロニクス	55,000	233	12,815,000
マブチモーター	35,100	3,640	127,764,000
日本電産	147,500	7,610	1,122,475,000
高岳製作所	118,000	235	27,730,000
ダイヘン	165,000	290	47,850,000
J V C ケンウッド	172,700	374	64,589,800
第一精工	7,100	2,594	18,417,400
日新電機	57,000	528	30,096,000
大崎電気工業	41,000	799	32,759,000
オムロン	304,300	1,762	536,176,600
日東工業	41,900	903	37,835,700

I D E C	36,700	818	30,020,600
エルピーダメモリ	364,500	310	112,995,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	525,000	436	228,900,000
サクサホールディングス	79,000	206	16,274,000
メルコホールディングス	16,000	1,959	31,344,000
日本電気	3,752,000	156	585,312,000
富士通	2,620,000	413	1,082,060,000
沖電気工業	1,082,000	83	89,806,000
岩崎通信機	139,000	80	11,120,000
電気興業	89,000	409	36,401,000
サンケン電気	147,000	334	49,098,000
ナカヨ通信機	26,000	339	8,814,000
アイホン	15,700	1,551	24,350,700
ルネサスエレクトロニクス	75,400	612	46,144,800
セイコーエプソン	184,400	1,067	196,754,800
ワコム	558	144,000	80,352,000
アルバック	52,300	982	51,358,600
アクセル	12,800	1,700	21,760,000
ナナオ	23,700	1,752	41,522,400
日本信号	65,800	509	33,492,200
京三製作所	57,000	349	19,893,000
能美防災	37,000	521	19,277,000
ホーチキ	25,000	402	10,050,000
日本無線	64,000	203	12,992,000
パナソニック	3,111,600	724	2,252,798,400
シャープ	1,319,000	558	736,002,000
アンリツ	132,000	888	117,216,000
富士通ゼネラル	66,000	505	33,330,000
日立国際電気	63,000	666	41,958,000
ソニー	1,699,600	1,681	2,857,027,600
T D K	142,300	4,075	579,872,500
帝国通信工業	62,000	144	8,928,000
ミツミ電機	100,000	751	75,100,000
タムラ製作所	91,000	230	20,930,000
アルプス電気	216,600	689	149,237,400
パイオニア	384,000	395	151,680,000
日本電波工業	22,300	1,200	26,760,000
日本トリム	3,550	1,900	6,745,000
ローランド ディー . ジー .	12,800	972	12,441,600
フォスター電機	26,500	1,243	32,939,500
クラリオン	71,000	170	12,070,000
S M K	89,000	280	24,920,000
ヨコオ	22,600	456	10,305,600
東光	141,000	173	24,393,000
ホシデン	75,200	627	47,150,400
ヒロセ電機	47,200	8,030	379,016,000



日本航空電子工業	64,000	627	40,128,000
TOA	31,000	575	17,825,000
ユニデン	86,000	296	25,456,000
アルパイン	53,200	1,042	55,434,400
スミダコーポレーション	18,700	548	10,247,600
アイコム	15,000	2,021	30,315,000
船井電機	25,900	1,823	47,215,700
横河電機	298,800	761	227,386,800
新電元工業	101,000	400	40,400,000
山武	69,100	1,766	122,030,600
日本光電工業	54,500	1,972	107,474,000
チノー	50,000	237	11,850,000
共和電業	31,000	236	7,316,000
日本電子材料	12,100	399	4,827,900
堀場製作所	50,300	2,498	125,649,400
アドバンテスト	204,300	1,052	214,923,600
小野測器	36,000	284	10,224,000
エスベック	29,300	557	16,320,100
パナソニック電工SUNX	26,300	402	10,572,600
キーエンス	60,700	20,230	1,227,961,000
日置電機	12,900	1,328	17,131,200
シスメックス	95,800	2,848	272,838,400
メガチップス	23,300	1,394	32,480,200
OBARA GROUP	21,500	1,035	22,252,500
日本電産コパル電子	27,100	458	12,411,800
ミヤチテクノス	15,500	662	10,261,000
東京電波	11,600	400	4,640,000
コーセル	38,800	1,116	43,300,800
日立メディコ	21,000	932	19,572,000
オプテックス	18,600	1,006	18,711,600
千代田インテグレ	13,000	970	12,610,000
東光電気	21,000	335	7,035,000
スタンレー電気	182,000	1,357	246,974,000
岩崎電気	109,000	186	20,274,000
ウシオ電機	164,700	1,186	195,334,200
岡谷電機産業	15,500	351	5,440,500
ヘリオス テクノ ホールディング	32,700	149	4,872,300
日本セラミック	17,900	1,412	25,274,800
日本デジタル研究所	24,600	890	21,894,000
古河電池	21,000	394	8,274,000
双信電機	17,900	359	6,426,100
図研	17,100	605	10,345,500
日本電子	105,000	217	22,785,000
カシオ計算機	260,300	538	140,041,400
ファナック	283,500	14,410	4,085,235,000
日本シイエムケイ	63,000	401	25,263,000

エンブラス	14,800	1,649	24,405,200	
ローム	134,000	3,860	517,240,000	
浜松ホトニクス	104,700	2,753	288,239,100	
三井ハイテック	37,100	362	13,430,200	
新光電気工業	94,200	678	63,867,600	
京セラ	225,600	7,060	1,592,736,000	
太陽誘電	121,800	796	96,952,800	
村田製作所	286,200	4,755	1,360,881,000	
ユーシン	39,700	640	25,408,000	
双葉電子工業	45,700	1,329	60,735,300	
北陸電気工業	120,000	120	14,400,000	
ニチコン	87,600	966	84,621,600	
日本ケミコン	158,000	326	51,508,000	
K O A	34,500	764	26,358,000	
市光工業	77,000	153	11,781,000	
小糸製作所	136,000	1,374	186,864,000	
ミツバ	52,000	753	39,156,000	
スター精密	45,100	768	34,636,800	
大日本スクリーン製造	261,000	629	164,169,000	
キャノン電子	24,400	1,920	46,848,000	
キャノン	1,690,000	3,590	6,067,100,000	
リコー	818,000	673	550,514,000	
日本電産サンキョー	62,000	536	33,232,000	
MUTOHホールディングス	33,000	381	12,573,000	
東京エレクトロン	229,100	4,400	1,008,040,000	
トヨタ紡織	96,700	978	94,572,600	
鬼怒川ゴム工業	62,000	629	38,998,000	
ユニプレス	43,400	2,249	97,606,600	
豊田自動織機	247,900	2,503	620,493,700	
モリタホールディングス	44,000	520	22,880,000	
三櫻工業	33,900	634	21,492,600	
デンソー	671,900	2,656	1,784,566,400	
東海理化電機製作所	62,400	1,467	91,540,800	
三井造船	1,059,000	154	163,086,000	
佐世保重工業	184,000	145	26,680,000	
川崎重工業	1,984,000	246	488,064,000	
日本車輛製造	98,000	358	35,084,000	
日本輸送機	40,000	243	9,720,000	
近畿車輛	42,000	292	12,264,000	
日産自動車	3,436,600	808	2,776,772,800	
いすゞ自動車	1,725,000	432	745,200,000	
トヨタ自動車	3,529,600	3,350	11,824,160,000	1
日野自動車	389,000	554	215,506,000	
三菱自動車工業	6,123,000	99	606,177,000	
エフテック	10,500	1,266	13,293,000	
武蔵精密工業	26,000	1,899	49,374,000	

日産車体	75,000	834	62,550,000
新明和工業	123,000	369	45,387,000
極東開発工業	48,400	742	35,912,800
日信工業	49,900	1,376	68,662,400
トピー工業	201,000	231	46,431,000
ティラド	103,000	306	31,518,000
曙ブレーキ工業	134,500	422	56,759,000
タチエス	34,800	1,603	55,784,400
NOK	132,600	1,597	211,762,200
フタバ産業	75,600	500	37,800,000
カヤバ工業	185,000	457	84,545,000
シロキ工業	63,000	242	15,246,000
大同メタル工業	40,000	986	39,440,000
プレス工業	126,000	450	56,700,000
カルソニックカンセイ	158,000	453	71,574,000
太平洋工業	58,000	436	25,288,000
ケーヒン	57,400	1,594	91,495,600
河西工業	36,000	416	14,976,000
アイシン精機	222,400	2,869	638,065,600
富士機工	34,000	283	9,622,000
マツダ	2,272,000	161	365,792,000
ダイハツ工業	252,000	1,550	390,600,000
愛知機械工業	62,000	320	19,840,000
今仙電機製作所	20,400	1,074	21,909,600
本田技研工業	2,296,100	2,975	6,830,897,500
スズキ	568,500	1,922	1,092,657,000
富士重工業	861,000	580	499,380,000
ヤマハ発動機	445,500	1,163	518,116,500
ショーワ	56,000	616	34,496,000
T B K	30,000	501	15,030,000
エクセディ	37,100	2,375	88,112,500
豊田合成	75,400	1,453	109,556,200
愛三工業	29,500	692	20,414,000
ヨロズ	16,300	1,727	28,150,100
エフ・シー・シー	44,400	1,867	82,894,800
シマノ	103,300	4,600	475,180,000
タカタ	49,800	1,994	99,301,200
テイ・エス テック	57,100	1,552	88,619,200
日本電産トーソク	14,000	990	13,860,000
テルモ	192,700	3,855	742,858,500
クリエートメディック	8,000	797	6,376,000
日機装	93,000	719	66,867,000
島津製作所	327,000	685	223,995,000
J M S	49,000	250	12,250,000
長野計器	23,200	761	17,655,200
バイ・テクノロジー	46	302,000	13,892,000

東京計器	118,000	161	18,998,000	
愛知時計電機	39,000	275	10,725,000	
東京精密	50,900	1,666	84,799,400	
ニコン	475,900	2,146	1,021,281,400	
トプコン	71,400	515	36,771,000	
オリンパス	275,700	1,260	347,382,000	
理研計器	27,400	592	16,220,800	
タムロン	24,000	2,347	56,328,000	
HOYA	664,600	1,852	1,230,839,200	
ノーリツ鋼機	31,200	373	11,637,600	
エー・アンド・デイ	28,800	253	7,286,400	
日本電産コパル	24,500	858	21,021,000	
シチズンホールディングス	329,900	489	161,321,100	
リズム時計工業	151,000	143	21,593,000	
大研医器	7,700	795	6,121,500	
セイコーホールディングス	172,000	181	31,132,000	
ニプロ	106,200	650	69,030,000	
パラマウントベッドホールディングス	24,200	2,175	52,635,000	
SHO-BI	6,100	484	2,952,400	
永大産業	40,000	397	15,880,000	
SRIスポーツ	13,700	922	12,631,400	
バンダイナムコホールディングス	292,900	1,101	322,482,900	
共立印刷	44,900	281	12,616,900	
フランスベッドホールディングス	198,000	171	33,858,000	
パイロットコーポレーション	237	151,600	35,929,200	
トッパン・フォームズ	55,500	676	37,518,000	
フジシールインターナショナル	31,100	1,454	45,219,400	
タカラトミー	90,300	577	52,103,100	
タカノ	10,600	443	4,695,800	
プロネクサス	29,500	404	11,918,000	
ホクシン	33,200	166	5,511,200	
ウッドワン	52,000	310	16,120,000	
大建工業	117,000	263	30,771,000	
凸版印刷	820,000	643	527,260,000	
大日本印刷	823,000	820	674,860,000	
図書印刷	56,000	160	8,960,000	
共同印刷	91,000	221	20,111,000	
日本写真印刷	46,700	1,075	50,202,500	
光村印刷	26,000	271	7,046,000	
宝印刷	9,700	598	5,800,600	
アシックス	256,300	977	250,405,100	
ツツミ	14,100	2,013	28,383,300	
ローランド	28,600	786	22,479,600	
小松ウオール工業	9,300	827	7,691,100	
ヤマハ	199,500	761	151,819,500	
河合楽器製作所	113,000	164	18,532,000	

クリナップ	33,800	504	17,035,200
ビジョン	24,600	2,763	67,969,800
兼松日産農林	64,000	186	11,904,000
キングジム	23,100	610	14,091,000
リンテック	51,300	1,628	83,516,400
イトーキ	63,900	251	16,038,900
任天堂	155,700	11,650	1,813,905,000
三菱鉛筆	21,900	1,375	30,112,500
タカラスタンダード	123,000	609	74,907,000
コクヨ	132,300	572	75,675,600
ナカバヤシ	71,000	199	14,129,000
グローブライド	156,000	100	15,600,000
岡村製作所	99,000	571	56,529,000
美津濃	133,000	419	55,727,000
アデランス	36,600	945	34,587,000
東京電力	1,883,900	252	474,742,800
中部電力	901,600	1,565	1,411,004,000
関西電力	1,114,200	1,433	1,596,648,600
中国電力	376,700	1,540	580,118,000
北陸電力	268,500	1,618	434,433,000
東北電力	687,400	952	654,404,800
四国電力	251,300	2,327	584,775,100
九州電力	604,500	1,244	751,998,000
北海道電力	254,700	1,279	325,761,300
沖縄電力	16,700	3,435	57,364,500
電源開発	171,400	2,131	365,253,400
東京瓦斯	3,298,000	366	1,207,068,000
大阪瓦斯	2,642,000	312	824,304,000
東邦瓦斯	698,000	492	343,416,000
北海道瓦斯	66,000	277	18,282,000
西部瓦斯	325,000	221	71,825,000
静岡瓦斯	80,000	523	41,840,000
東武鉄道	1,549,000	395	611,855,000
相鉄ホールディングス	421,000	255	107,355,000
東京急行電鉄	1,602,000	386	618,372,000
京浜急行電鉄	701,000	701	491,401,000
小田急電鉄	865,000	759	656,535,000
京王電鉄	758,000	570	432,060,000
京成電鉄	432,000	584	252,288,000
富士急行	79,000	490	38,710,000
新京成電鉄	34,000	350	11,900,000
東日本旅客鉄道	474,000	5,220	2,474,280,000
西日本旅客鉄道	237,600	3,220	765,072,000
東海旅客鉄道	2,366	662,000	1,566,292,000
西日本鉄道	343,000	381	130,683,000
ハマキョウレックス	8,400	2,371	19,916,400

サカイ引越センター	4,700	1,717	8,069,900
近畿日本鉄道	2,473,000	300	741,900,000
阪急阪神ホールディングス	1,817,000	342	621,414,000
南海電気鉄道	565,000	355	200,575,000
京阪電気鉄道	608,000	399	242,592,000
名糖運輸	10,600	625	6,625,000
名古屋鉄道	930,000	220	204,600,000
日本通運	1,075,000	316	339,700,000
ヤマトホールディングス	553,200	1,266	700,351,200
山九	334,000	310	103,540,000
丸運	17,800	208	3,702,400
丸全昭和運輸	90,000	268	24,120,000
センコー	114,000	310	35,340,000
トナミホールディングス	64,000	190	12,160,000
日本梱包運輸倉庫	83,200	895	74,464,000
日本石油輸送	39,000	199	7,761,000
福山通運	165,000	436	71,940,000
セイノーホールディングス	207,000	590	122,130,000
神奈川中央交通	36,000	429	15,444,000
日立物流	57,900	1,314	76,080,600
日本郵船	2,158,000	242	522,236,000
商船三井	1,436,000	368	528,448,000
川崎汽船	852,000	184	156,768,000
N S ユナイテッド海運	141,000	144	20,304,000
乾汽船	43,300	350	15,155,000
飯野海運	140,900	397	55,937,300
共栄タンカー	40,000	234	9,360,000
第一中央汽船	68,000	138	9,384,000
全日本空輸	3,636,000	248	901,728,000
パスコ	30,000	294	8,820,000
日新	102,000	215	21,930,000
三菱倉庫	192,000	917	176,064,000
三井倉庫	131,000	307	40,217,000
住友倉庫	203,000	386	78,358,000
澁澤倉庫	72,000	244	17,568,000
東陽倉庫	46,000	185	8,510,000
日本トランスシティ	61,000	273	16,653,000
ケイヒン	79,000	115	9,085,000
安田倉庫	23,500	510	11,985,000
東洋埠頭	85,000	152	12,920,000
宇徳	30,300	286	8,665,800
上組	293,000	685	200,705,000
サンリツ	9,300	543	5,049,900
キューソー流通システム	8,300	857	7,113,100
郵船ロジスティクス	23,100	1,190	27,489,000
近鉄エクスプレス	25,000	2,632	65,800,000

東海運	18,400	257	4,728,800
NEC ネットエスアイ	26,200	1,094	28,662,800
システナ	347	57,700	20,021,900
新日鉄ソリューションズ	18,800	1,559	29,309,200
コア	10,000	699	6,990,000
ソフトクリエイト	4,100	1,129	4,628,900
デジタルハーツ	22	138,500	3,047,000
ITホールディングス	84,600	907	76,732,200
グリー	139,000	2,228	309,692,000
コーエーテクモホールディングス	57,100	623	35,573,300
三菱総合研究所	11,400	1,578	17,989,200
ボルテージ	3,900	1,092	4,258,800
ネクソン	136,800	1,101	150,616,800
ドワンゴ	145	127,200	18,444,000
マクロミル	22,400	783	17,539,200
ティーガイア	183	141,500	25,894,500
GMO ペイメントゲートウェイ	69	332,500	22,942,500
ザッパラス	170	90,500	15,385,000
インターネットイニシアティブ	167	232,500	38,827,500
ソネットエンタテインメント	155	308,500	47,817,500
SRAホールディングス	11,100	850	9,435,000
朝日ネット	17,000	362	6,154,000
パナソニック電工インフォメーションシステムズ	6,000	2,097	12,582,000
フェイス	917	9,350	8,573,950
野村総合研究所	153,400	1,810	277,654,000
インテージ	8,100	1,509	12,222,900
シンプレクス・ホールディングス	509	24,910	12,679,190
クレスコ	8,700	619	5,385,300
フジ・メディア・ホールディングス	2,802	116,100	325,312,200
オービック	8,530	14,960	127,608,800
ティーディーシーソフトウェアエンジニアリング	6,400	774	4,953,600
ヤフー	19,640	24,930	489,625,200
トレンドマイクロ	119,900	2,317	277,808,300
日本オラクル	54,200	2,706	146,665,200
アルファシステムズ	8,300	1,201	9,968,300
フューチャーアーキテクト	325	32,450	10,546,250
シーエーシー	18,200	680	12,376,000
ソフトバンク・テクノロジー	7,300	705	5,146,500
トーセ	7,700	546	4,204,200
オービックビジネスコンサルタント	7,250	3,585	25,991,250
伊藤忠テクノソリューションズ	32,600	3,410	111,166,000
アイティフォー	36,500	289	10,548,500
大塚商会	21,100	5,690	120,059,000
サイボウズ	653	28,400	18,545,200
電通国際情報サービス	18,200	620	11,284,000
ウェザーニューズ	8,300	2,036	16,898,800

C I J	27,100	305	8,265,500	
WOWOW	82	198,200	16,252,400	
ネットワンシステムズ	623	182,000	113,386,000	
アルゴグラフィックス	8,900	1,079	9,603,100	
エイベックス・グループ・ホールディングス	52,600	964	50,706,400	
日本ユニシス	67,600	553	37,382,800	
兼松エレクトロニクス	12,900	823	10,616,700	
東京放送ホールディングス	161,200	1,083	174,579,600	
日本テレビ放送網	23,570	11,520	271,526,400	
テレビ朝日	671	133,700	89,712,700	
スカパーJ S A Tホールディングス	2,117	37,550	79,493,350	
テレビ東京ホールディングス	17,300	1,077	18,632,100	
アイ・ティー・シーネットワーク	15,700	522	8,195,400	
イー・アクセス	2,216	18,950	41,993,200	
N E C モバイルリング	8,700	2,699	23,481,300	
日本電信電話	1,236,200	3,770	4,660,474,000	
K D D I	4,173	519,000	2,165,787,000	
光通信	25,800	2,171	56,011,800	
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	22,101	136,900	3,025,626,900	
G M O インターネット	33,300	379	12,620,700	
学研ホールディングス	89,000	164	14,596,000	
ゼンリン	39,800	794	31,601,200	
昭文社	15,600	617	9,625,200	
角川グループホールディングス	26,500	2,423	64,209,500	
インプレスホールディングス	43,400	111	4,817,400	
アイネット	14,200	462	6,560,400	
松竹	179,000	801	143,379,000	
東宝	188,500	1,382	260,507,000	
東映	115,000	389	44,735,000	
葵プロモーション	14,500	460	6,670,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	1,661	261,800	434,849,800	
D T S	28,500	1,000	28,500,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	88,100	1,511	133,119,100	
シーイーシー	16,300	374	6,096,200	
カプコン	53,800	1,628	87,586,400	
ジャステック	18,000	485	8,730,000	
S C S K	57,500	1,233	70,897,500	
日本システムウエア	10,200	320	3,264,000	
アイネス	34,600	585	20,241,000	
T K C	19,600	1,614	31,634,400	
富士ソフト	34,400	1,515	52,116,000	
N S D	50,000	673	33,650,000	
コナミ	122,000	2,048	249,856,000	
福井コンピュータ	8,200	407	3,337,400	
J B C C ホールディングス	20,600	548	11,288,800	
ソフトバンク	1,216,800	2,442	2,971,425,600	



ハウスイ	45,000	121	5,445,000	
インターニックス	14,500	364	5,278,000	
高千穂交易	9,400	895	8,413,000	
伊藤忠食品	5,300	2,893	15,332,900	
エレマテック	23,000	1,382	31,786,000	
JALUX	9,200	792	7,286,400	
トーマンデバイス	3,500	1,947	6,814,500	
双日	1,798,100	146	262,522,600	
アルフレッサ ホールディングス	70,100	3,460	242,546,000	
横浜冷凍	50,400	611	30,794,400	
山下医科器械	2,200	953	2,096,600	
ラサ商事	13,100	387	5,069,700	
アルコニックス	7,800	1,858	14,492,400	
あい ホールディングス	42,600	357	15,208,200	
ダイワボウホールディングス	264,000	181	47,784,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	52,500	661	34,702,500	
U K Cホールディングス	16,700	989	16,516,300	
T O K A Iホールディングス	136,700	388	53,039,600	
ミタチ産業	8,800	383	3,370,400	
J F E 商事ホールディングス	182,000	388	70,616,000	
シップヘルスケアホールディングス	36,200	1,552	56,182,400	
富士興産	126,000	83	10,458,000	
協栄産業	42,000	150	6,300,000	
小野建	22,500	678	15,255,000	
佐島電機	21,000	504	10,584,000	
エコートレーディング	3,400	761	2,587,400	
伯東	14,800	787	11,647,600	
コンドーテック	18,400	518	9,531,200	
ナガイレーベン	36,300	1,169	42,434,700	
三菱食品	25,400	2,110	53,594,000	
松田産業	20,300	1,296	26,308,800	
メディパルホールディングス	290,900	957	278,391,300	
アドヴァン	17,300	750	12,975,000	
S P K	5,900	1,386	8,177,400	
アズワン	17,300	1,684	29,133,200	
スズデン	6,200	527	3,267,400	
尾家産業	9,700	835	8,099,500	
シモジマ	17,200	1,100	18,920,000	
ドウシシャ	12,800	2,256	28,876,800	
高速	15,900	661	10,509,900	
黒田電気	33,100	842	27,870,200	
丸文	22,400	367	8,220,800	
ハピネット	15,600	715	11,154,000	
トーマンエレクトロニクス	12,700	1,032	13,106,400	
エクセル	12,000	785	9,420,000	
マルカキカイ	9,100	794	7,225,400	

ガリバーインターナショナル	8,510	3,155	26,849,050
日本エム・ディ・エム	30,400	269	8,177,600
進和	17,400	951	16,547,400
ダイトエレクトロン	15,600	410	6,396,000
シークス	18,200	1,039	18,909,800
田中商事	12,900	433	5,585,700
オーハシテクニカ	17,500	594	10,395,000
マクニカ	14,700	1,861	27,356,700
白銅	9,600	771	7,401,600
伊藤忠商事	2,142,400	899	1,926,017,600
丸紅	2,350,000	557	1,308,950,000
高島	63,000	204	12,852,000
F & A アクアホールディングス	21,200	803	17,023,600
長瀬産業	150,800	929	140,093,200
蝶理	174,000	102	17,748,000
豊田通商	296,000	1,599	473,304,000
三共生興	44,800	297	13,305,600
兼松	574,000	87	49,938,000
ツカモトコーポレーション	66,000	163	10,758,000
三井物産	2,318,900	1,373	3,183,849,700
日本紙パルプ商事	136,000	284	38,624,000
日立ハイテクノロジーズ	83,100	1,821	151,325,100
カメイ	37,000	931	34,447,000
東都水産	60,000	160	9,600,000
スターゼン	85,000	252	21,420,000
山善	107,000	618	66,126,000
椿本興業	28,000	238	6,664,000
住友商事	1,584,500	1,183	1,874,463,500
内田洋行	69,000	270	18,630,000
三菱商事	1,955,900	1,970	3,853,123,000
第一実業	58,000	379	21,982,000
キヤノンマーケティングジャパン	91,200	983	89,649,600
西華産業	99,000	229	22,671,000
佐藤商事	23,600	513	12,106,800
菱洋エレクトロ	28,900	874	25,258,600
東京産業	20,500	285	5,842,500
ユアサ商事	291,000	133	38,703,000
神鋼商事	62,000	191	11,842,000
阪和興業	268,000	365	97,820,000
カナデン	28,000	550	15,400,000
菱電商事	34,000	475	16,150,000
フルサト工業	16,700	760	12,692,000
岩谷産業	292,000	272	79,424,000
すてきナイスグループ	125,000	230	28,750,000
昭光通商	107,000	133	14,231,000
二チモウ	48,000	198	9,504,000

極東貿易	45,000	182	8,190,000
イワキ	42,000	204	8,568,000
三愛石油	61,000	357	21,777,000
稲畑産業	69,300	516	35,758,800
東邦ホールディングス	88,200	1,252	110,426,400
サンゲツ	47,800	2,098	100,284,400
ミツウロコグループホールディングス	44,500	503	22,383,500
シナネン	51,000	366	18,666,000
伊藤忠エネクス	57,000	465	26,505,000
サンリオ	68,300	3,445	235,293,500
サンワテクノス	15,200	790	12,008,000
リョーサン	43,600	1,772	77,259,200
新光商事	29,000	691	20,039,000
トーヨー	52,000	310	16,120,000
三信電気	38,600	697	26,904,200
東陽テクニカ	38,600	853	32,925,800
モスフードサービス	31,500	1,563	49,234,500
加賀電子	29,100	855	24,880,500
ソーダニッカ	24,000	360	8,640,000
立花エレテック	16,800	702	11,793,600
P a l t a c	30,300	1,055	31,966,500
太平洋興発	115,000	82	9,430,000
ヤマタネ	157,000	124	19,468,000
丸紅建材リース	43,000	182	7,826,000
日鐵商事	56,000	220	12,320,000
トラスコ中山	33,900	1,651	55,968,900
オートバックスセブン	32,200	3,725	119,945,000
加藤産業	39,000	1,533	59,787,000
イノテック	19,100	531	10,142,100
イエローハット	27,100	1,142	30,948,200
富士エレクトロニクス	14,700	1,249	18,360,300
J Kホールディングス	25,200	390	9,828,000
日伝	10,600	2,242	23,765,200
北沢産業	32,000	184	5,888,000
杉本商事	14,600	738	10,774,800
因幡電機産業	30,400	2,326	70,710,400
住金物産	126,000	219	27,594,000
ミスミグループ本社	100,800	1,963	197,870,400
タキヒヨー	43,000	472	20,296,000
スズケン	104,000	2,361	245,544,000
ジェコス	20,800	369	7,675,200
ローソン	84,600	4,775	403,965,000
サンエー	8,000	3,120	24,960,000
キリン堂	12,900	521	6,720,900
カワチ薬品	18,800	1,656	31,132,800
エービーシー・マート	39,100	2,784	108,854,400

ハードオフコーポレーション	11,700	612	7,160,400
アスクル	18,400	1,237	22,760,800
ゲオホールディングス	471	88,200	41,542,200
ポイント	22,830	3,145	71,800,350
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	27,000	144	3,888,000
くらコーポレーション	14,900	1,183	17,626,700
キャンドウ	142	86,000	12,212,000
パル	8,350	3,320	27,722,000
エディオン	110,400	563	62,155,200
サーラコーポレーション	25,000	504	12,600,000
あみやき亭	34	199,200	6,772,800
ひらまつ	120	69,300	8,316,000
ゲンキー	2,800	1,775	4,970,000
ハニーズ	23,810	1,247	29,691,070
アルペン	17,600	1,468	25,836,800
ビックカメラ	1,015	44,800	45,472,000
D C Mホールディングス	140,000	590	82,600,000
MonotaRO	17,200	911	15,669,200
J . フロント リテイリング	636,000	375	238,500,000
ドトール・日レスホールディングス	40,000	1,062	42,480,000
マツモトキヨシホールディングス	49,600	1,674	83,030,400
物語コーポレーション	3,000	1,291	3,873,000
ココカラファイン	27,600	2,238	61,768,800
三越伊勢丹ホールディングス	533,600	880	469,568,000
クリエイトSDホールディングス	9,600	1,834	17,606,400
丸善C H Iホールディングス	19,100	205	3,915,500
ブックオフコーポレーション	18,300	707	12,938,100
あさひ	16,100	1,520	24,472,000
サークルKサンクス	57,100	1,775	101,352,500
日本調剤	3,880	2,518	9,769,840
コスモス薬品	11,100	3,520	39,072,000
セブン&アイ・ホールディングス	1,124,800	2,238	2,517,302,400
ツルハホールディングス	22,100	3,990	88,179,000
サンマルクホールディングス	7,300	3,020	22,046,000
フェリシモ	8,100	1,098	8,893,800
トリドール	25,500	820	20,910,000
クスリのアオキ	4,900	1,678	8,222,200
メディカルシステムネットワーク	6,200	971	6,020,200
総合メディカル	6,700	2,493	16,703,100
はるやま商事	13,800	401	5,533,800
カッパ・クリエイト	19,050	1,808	34,442,400
ライトオン	23,800	559	13,304,200
良品計画	28,700	3,835	110,064,500
三城ホールディングス	36,200	615	22,263,000
コナカ	33,300	705	23,476,500
イオン北海道	18,000	362	6,516,000

コジマ	39,200	492	19,286,400
コーナン商事	28,900	1,203	34,766,700
エコス	10,000	504	5,040,000
ワタミ	32,600	1,749	57,017,400
ドン・キホーテ	72,400	2,703	195,697,200
メガネトップ	40,200	820	32,964,000
西松屋チェーン	61,100	630	38,493,000
ゼンショーホールディングス	102,900	989	101,768,100
幸楽苑	14,000	1,241	17,374,000
ハークスレイ	5,900	503	2,967,700
サイゼリヤ	40,600	1,278	51,886,800
ポプラ	7,100	496	3,521,600
ユナイテッドアローズ	28,300	1,624	45,959,200
ハイデイ日高	10,400	1,552	16,140,800
京都きもの友禅	18,500	948	17,538,000
コロワイド	86,500	607	52,505,500
荳番屋	10,200	2,308	23,541,600
トップカルチャー	9,200	385	3,542,000
スギホールディングス	48,600	2,170	105,462,000
スクロール	37,700	310	11,687,000
ファミリーマート	82,900	3,115	258,233,500
木曽路	30,100	1,529	46,022,900
千趣会	49,500	521	25,789,500
タカキュー	32,000	173	5,536,000
ケーヨー	48,500	524	25,414,000
上新電機	56,000	851	47,656,000
日本瓦斯	27,000	1,255	33,885,000
ベスト電器	91,000	194	17,654,000
マルエツ	52,000	313	16,276,000
ロイヤルホールディングス	44,300	911	40,357,300
東天紅	27,000	166	4,482,000
いなげや	28,800	932	26,841,600
島忠	59,600	1,821	108,531,600
チヨダ	34,800	1,410	49,068,000
ライフコーポレーション	17,900	1,395	24,970,500
カスミ	44,500	533	23,718,500
リンガーハット	25,400	1,100	27,940,000
さが美	40,000	98	3,920,000
テンアライド	23,500	284	6,674,000
A O K Iホールディングス	23,900	1,251	29,898,900
オークワ	39,000	1,094	42,666,000
コメリ	37,000	2,343	86,691,000
青山商事	74,200	1,448	107,441,600
しまむら	31,200	8,320	259,584,000
C F Sコーポレーション	20,500	398	8,159,000
高島屋	365,000	599	218,635,000

松屋	53,900	502	27,057,800
エイチ・ツー・オー リテイリング	144,000	582	83,808,000
ニッセンホールディングス	59,700	361	21,551,700
パルコ	51,200	629	32,204,800
丸井グループ	354,200	614	217,478,800
原信ナルスホールディングス	14,900	1,344	20,025,600
ダイエー	164,350	290	47,661,500
イズミヤ	96,000	409	39,264,000
イオン	947,100	1,052	996,349,200
ユニー	200,900	759	152,483,100
イズミ	82,600	1,388	114,648,800
東武ストア	29,000	287	8,323,000
平和堂	46,900	1,020	47,838,000
フジ	30,800	1,843	56,764,400
ヤオコー	11,700	2,581	30,197,700
ゼビオ	33,500	1,868	62,578,000
ケーズホールディングス	67,800	2,798	189,704,400
O l y m p i c	17,900	865	15,483,500
日産東京販売ホールディングス	53,000	205	10,865,000
アインファーマシーズ	15,200	3,640	55,328,000
元気寿司	9,700	1,017	9,864,900
ヤマダ電機	131,260	5,320	698,303,200
アークランドサカモト	18,700	1,376	25,731,200
ニトリホールディングス	53,350	6,850	365,447,500
グルメ杵屋	22,000	460	10,120,000
愛眼	24,600	369	9,077,400
吉野家ホールディングス	737	109,000	80,333,000
松屋フーズ	11,400	1,645	18,753,000
サガミチェーン	34,000	551	18,734,000
プレナス	27,100	1,332	36,097,200
ミニストップ	16,600	1,452	24,103,200
アークス	34,700	1,465	50,835,500
パロー	54,800	1,193	65,376,400
ベルク	12,100	1,209	14,628,900
大庄	13,000	1,058	13,754,000
ファーストリテイリング	63,000	16,450	1,036,350,000
サンドラッグ	51,000	2,268	115,668,000
ヤマザワ	6,400	1,448	9,267,200
やまや	6,300	1,055	6,646,500
ベルーナ	36,250	605	21,931,250
新生銀行	2,107,000	99	208,593,000
あおぞら銀行	838,000	235	196,930,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	20,334,800	411	8,357,602,800
りそなホールディングス	2,336,200	376	878,411,200
三井住友トラスト・ホールディングス	5,272,000	279	1,470,888,000
三井住友フィナンシャルグループ	2,031,900	2,707	5,500,353,300

第四銀行	335,000	270	90,450,000
北越銀行	272,000	165	44,880,000
西日本シティ銀行	944,000	228	215,232,000
札幌北洋ホールディングス	410,200	296	121,419,200
千葉銀行	1,061,000	498	528,378,000
横浜銀行	1,723,000	382	658,186,000
常陽銀行	1,029,000	357	367,353,000
群馬銀行	609,000	437	266,133,000
武蔵野銀行	42,900	2,654	113,856,600
千葉興業銀行	55,100	425	23,417,500
筑波銀行	119,800	285	34,143,000
東京都民銀行	53,300	966	51,487,800
七十七銀行	428,000	372	159,216,000
青森銀行	205,000	250	51,250,000
秋田銀行	185,000	248	45,880,000
山形銀行	165,000	386	63,690,000
岩手銀行	18,800	3,580	67,304,000
東邦銀行	236,000	276	65,136,000
東北銀行	156,000	148	23,088,000
みちのく銀行	145,000	160	23,200,000
ふくおかフィナンシャルグループ	1,087,000	341	370,667,000
静岡銀行	809,000	800	647,200,000
十六銀行	334,000	269	89,846,000
スルガ銀行	264,000	726	191,664,000
八十二銀行	488,000	458	223,504,000
山梨中央銀行	165,000	367	60,555,000
大垣共立銀行	345,000	278	95,910,000
福井銀行	233,000	246	57,318,000
北國銀行	322,000	309	99,498,000
清水銀行	9,200	3,390	31,188,000
滋賀銀行	247,000	508	125,476,000
南都銀行	255,000	393	100,215,000
百五銀行	233,000	348	81,084,000
京都銀行	477,000	673	321,021,000
三重銀行	102,000	189	19,278,000
ほくほくフィナンシャルグループ	1,876,000	157	294,532,000
広島銀行	789,000	363	286,407,000
山陰合同銀行	155,000	600	93,000,000
中国銀行	217,000	1,057	229,369,000
鳥取銀行	88,000	156	13,728,000
伊予銀行	284,000	739	209,876,000
百十四銀行	298,000	374	111,452,000
四国銀行	200,000	303	60,600,000
阿波銀行	234,000	526	123,084,000
鹿児島銀行	169,000	539	91,091,000
大分銀行	173,000	237	41,001,000

宮崎銀行	185,000	203	37,555,000	
肥後銀行	207,000	467	96,669,000	
佐賀銀行	165,000	202	33,330,000	
十八銀行	178,000	240	42,720,000	
沖縄銀行	20,800	3,350	69,680,000	
琉球銀行	57,200	986	56,399,200	
八千代銀行	15,100	1,998	30,169,800	
セブン銀行	764,200	169	129,149,800	
みずほフィナンシャルグループ	34,529,400	128	4,419,763,200	
紀陽ホールディングス	1,051,000	122	128,222,000	
山口フィナンシャルグループ	265,000	744	197,160,000	
長野銀行	96,000	169	16,224,000	
名古屋銀行	252,000	269	67,788,000	
愛知銀行	9,900	4,645	45,985,500	
第三銀行	160,000	173	27,680,000	
中京銀行	116,000	214	24,824,000	
東日本銀行	129,000	176	22,704,000	
大光銀行	102,000	257	26,214,000	
愛媛銀行	172,000	231	39,732,000	
トマト銀行	112,000	145	16,240,000	
みなと銀行	255,000	158	40,290,000	
京葉銀行	214,000	382	81,748,000	
関西アーバン銀行	395,000	132	52,140,000	
栃木銀行	130,000	283	36,790,000	
北日本銀行	9,500	2,078	19,741,000	
東和銀行	293,000	91	26,663,000	
大東銀行	204,000	78	15,912,000	
トモニホールディングス	214,600	362	77,685,200	
フィデアホールディングス	165,500	211	34,920,500	
池田泉州ホールディングス	1,154,400	118	136,219,200	
SBIホールディングス	28,255	7,090	200,327,950	
ジャフコ	32,100	1,760	56,496,000	
大和証券グループ本社	2,658,000	318	845,244,000	
野村ホールディングス	5,820,700	353	2,054,707,100	
岡三証券グループ	235,000	305	71,675,000	
丸三証券	94,900	316	29,988,400	
東洋証券	110,000	145	15,950,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	313,000	283	88,579,000	
光世証券	85,000	79	6,715,000	
水戸証券	93,000	133	12,369,000	
いちよし証券	64,200	447	28,697,400	
松井証券	162,100	468	75,862,800	
だいこう証券ビジネス	19,500	293	5,713,500	
マネックスグループ	2,242	16,090	36,073,780	
カブドットコム証券	110,000	286	31,460,000	
極東証券	37,300	642	23,946,600	



岩井コスモホールディングス	28,800	321	9,244,800
N K S Jホールディングス	562,400	1,886	1,060,686,400
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	801,400	1,763	1,412,868,200
ソニーフィナンシャルホールディングス	260,000	1,448	376,480,000
第一生命保険	14,379	101,300	1,456,592,700
東京海上ホールディングス	1,018,400	2,239	2,280,197,600
T & Dホールディングス	979,200	913	894,009,600
クレディセゾン	223,400	1,459	325,940,600
芙蓉総合リース	26,900	2,939	79,059,100
興銀リース	39,700	1,955	77,613,500
東京センチュリーリース	74,800	1,581	118,258,800
日本証券金融	124,800	439	54,787,200
大阪証券金融	61,800	184	11,371,200
ポケットカード	39,500	289	11,415,500
リコーリース	20,500	1,953	40,036,500
イオンクレジットサービス	125,700	1,110	139,527,000
アコム	44,140	1,580	69,741,200
ジャックス	185,000	261	48,285,000
オリエントコーポレーション	445,000	85	37,825,000
日立キャピタル	57,500	1,168	67,160,000
オリックス	140,440	7,810	1,096,836,400
三菱UFJリース	69,720	3,570	248,900,400
NECキャピタルソリューション	12,000	1,251	15,012,000
日本駐車場開発	2,945	3,525	10,381,125
昭栄	60,400	378	22,831,200
野村不動産ホールディングス	130,500	1,375	179,437,500
常和ホールディングス	6,400	1,415	9,056,000
ヒューリック	87,500	1,104	96,600,000
パーク24	143,100	974	139,379,400
三井不動産	1,196,000	1,501	1,795,196,000
三菱地所	1,885,000	1,434	2,703,090,000
平和不動産	267,500	203	54,302,500
東京建物	528,000	312	164,736,000
ダイビル	82,700	581	48,048,700
東急不動産	544,000	379	206,176,000
京阪神ビルディング	37,200	387	14,396,400
住友不動産	646,000	1,799	1,162,154,000
東宝不動産	31,800	511	16,249,800
大京	432,000	199	85,968,000
テーオーシー	109,700	427	46,841,900
東京楽天地	48,000	286	13,728,000
レオパレス21	123,000	204	25,092,000
フジ住宅	38,200	408	15,585,600
空港施設	34,600	396	13,701,600
住友不動産販売	10,330	3,555	36,723,150
ゴールドクレスト	25,770	1,554	40,046,580

東栄住宅	20,400	814	16,605,600
リロ・ホールディング	10,000	2,130	21,300,000
日本エスリード	13,300	741	9,855,300
東急リパブル	27,600	748	20,644,800
飯田産業	30,400	679	20,641,600
日神不動産	18,800	530	9,964,000
アーネストワン	46,400	924	42,873,600
タカラレーベン	30,000	538	16,140,000
サンヨーハウジング名古屋	113	78,300	8,847,900
イオンモール	124,400	1,841	229,020,400
タクトホーム	171	68,700	11,747,700
エヌ・ティ・ティ都市開発	1,735	64,800	112,428,000
日本空港ビルデング	89,200	1,111	99,101,200
日本工営	98,000	290	28,420,000
ネクスト	15,900	373	5,930,700
日本M & Aセンター	61	398,000	24,278,000
ノバレーゼ	55	51,000	2,805,000
アコーディア・ゴルフ	1,210	62,400	75,504,000
パソナグループ	282	71,800	20,247,600
テンブホールディングス	40,000	780	31,200,000
学情	14,000	267	3,738,000
スタジオアリス	14,500	1,176	17,052,000
シミックホールディングス	10,400	1,151	11,970,400
NECフィールディング	22,400	983	22,019,200
総合警備保障	99,600	940	93,624,000
カカクコム	44,800	2,082	93,273,600
ルネサンス	20,300	445	9,033,500
新日本科学	29,100	260	7,566,000
エムスリー	232	299,300	69,437,600
ベストプライダル	63	77,000	4,851,000
ディー・エヌ・エー	128,000	2,381	304,768,000
博報堂DYホールディングス	35,630	4,765	169,776,950
ぐるなび	21,800	965	21,037,000
ジェイコムホールディングス	7,100	698	4,955,800
PGMホールディングス	384	51,700	19,852,800
イーピーエス	157	169,000	26,533,000
アミューズ	6,800	1,093	7,432,400
TAC	12,700	195	2,476,500
ケネディクス	3,305	13,530	44,716,650
電通	258,400	2,440	630,496,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	1,506	7,110	10,707,660
びあ	10,200	859	8,761,800
イオンファンタジー	10,200	1,273	12,984,600
みらかホールディングス	74,600	2,905	216,713,000
アルプス技研	12,700	626	7,950,200
サニックス	55,800	226	12,610,800

オリエンタルランド	76,700	8,220	630,474,000
ダスキン	85,000	1,649	140,165,000
明光ネットワークジャパン	27,300	747	20,393,100
ファルコSDホールディングス	16,800	918	15,422,400
田谷	3,500	689	2,411,500
ラウンドワン	94,900	516	48,968,400
リゾートトラスト	45,800	1,220	55,876,000
ビー・エム・エル	18,500	1,945	35,982,500
ワタベウェディング	10,000	718	7,180,000
もしもしホットライン	48,800	808	39,430,400
東急コミュニティー	7,000	2,490	17,430,000
リソー教育	3,317	5,430	18,011,310
ウェアハウス	11,200	236	2,643,200
ユー・エス・エス	37,270	7,750	288,842,500
東京個別指導学院	22,200	176	3,907,200
テー・オー・ダブリュー	9,400	479	4,502,600
セントラルスポーツ	8,900	1,054	9,380,600
リゾートソリューション	34,000	163	5,542,000
エイチ・アイ・エス	29,700	2,136	63,439,200
共立メンテナンス	12,800	1,580	20,224,000
イチネンホールディングス	21,900	429	9,395,100
建設技術研究所	16,600	527	8,748,200
燦ホールディングス	3,200	1,550	4,960,000
東京テアトル	148,000	114	16,872,000
よみうりランド	61,000	257	15,677,000
東京都競馬	233,000	119	27,727,000
常磐興産	126,000	101	12,726,000
カナモト	38,000	840	31,920,000
東京ドーム	240,000	210	50,400,000
トランス・コスモス	38,900	997	38,783,300
乃村工藝社	59,000	282	16,638,000
藤田観光	77,000	263	20,251,000
日本管財	10,700	1,485	15,889,500
トーカイ	11,900	1,611	19,170,900
白洋舎	32,000	214	6,848,000
セコム	275,700	3,730	1,028,361,000
セントラル警備保障	12,200	806	9,833,200
丹青社	38,000	220	8,360,000
メイテック	46,500	1,675	77,887,500
アサツー ディ・ケイ	50,700	2,228	112,959,600
応用地質	30,600	940	28,764,000
船井総合研究所	28,300	536	15,168,800
進学会	10,600	323	3,423,800
ベネッセホールディングス	88,800	3,580	317,904,000
イオンディライト	32,800	1,600	52,480,000
ナック	7,800	1,490	11,622,000

ニチイ学館	55,900	935	52,266,500	
ダイセキ	47,000	1,430	67,210,000	
合計	415,621,459		304,191,724,375	

1 差入委託証拠金代用有価証券 1,800,000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)」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23年2月18日現在)	(平成24年2月20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	1,014,519,204	1,011,568,439
国債証券	373,011,668,280	361,628,836,480
地方債証券	33,443,524,195	31,284,270,027
特殊債券	53,763,853,957	50,347,412,738
社債券	41,817,168,400	33,190,025,700
未収利息	2,207,792,927	2,171,856,634
前払費用	62,533,852	64,221,438
流動資産合計	505,321,060,815	479,698,191,456
資産合計	505,321,060,815	479,698,191,456
負債の部		
流動負債		
未払金	150,517,500	-
未払解約金	180,100,599	-
流動負債合計	330,618,099	-
負債合計	330,618,099	-
純資産の部		
元本等		
元本		
元本	467,396,225,367	429,837,460,158
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	37,594,217,349	49,860,731,298
元本等合計	504,990,442,716	479,698,191,456
純資産合計	504,990,442,716	479,698,191,456
負債純資産合計	505,321,060,815	479,698,191,456

(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23年2月18日ならびに平成24年2月20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22年2月19日 至平成23年2月18日	自平成23年2月19日 至平成24年2月20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証券（売買目的有価証券） 個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。	国債証券、地方債証券、特殊債券および社債証券（売買目的有価証券） 同左

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成23年2月18日現在)	(平成24年2月20日現在)
1. 受益権総数	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	平成24年2月20日現在における受益権の総数 429,837,460,158口
2. 1単位当たり純資産額	1.0804円 (1万口 = 10,804円)	1.1160円 (1万口 = 11,160円)

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	自平成22年2月19日 至平成23年2月18日	自平成23年2月19日 至平成24年2月20日
	(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。	
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。	同左
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証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。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	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 同左 2) デリバティブ取引 同左 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。	(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 同 左
3 . 金融商品に係るリス ク管理体制	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。 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 値（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。	同 左
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。	同 左

## 金融商品の時価等に関する事項

項 目	(平成23年2月18日現在)	(平成24年2月20日現在)
1 . 貸借対照表計上額、 時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計 上されているため、貸借対照表計上額と時 価との差額はありませぬ。	同 左

2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(国債証券、地方債証券、特殊債証券および社債証券) 「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。</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>	<p>(1) 有価証券(国債証券、地方債証券、特殊債証券および社債証券) 同左</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) 同左</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 同左</p>
------------	--	---

(デリバティブ取引に関する注記)

(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。

(平成24年2月20日現在)

平成24年2月20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。

(自平成23年2月19日 至 平成24年2月20日)

該当事項はありません。



(その他の注記)

(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

(平成24年2月20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	467,396,225,367円
同期中における追加設定元本額	23,986,539,602円
同期中における一部解約元本額	61,545,304,811円
平成24年2月20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)	1,185,791,282円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,095,710,135円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	418,193,740円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	82,922,526円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	13,433,344円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	9,665,291円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	5,099,882円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	4,655,596円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	1,003,496円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	2,247,856円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	9,977,696,904円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	42,628,287,342円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	10,657,989,170円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	24,172,987,060円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	522,594,796円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	702,933,633円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	151,107,806円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	318,189,929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>	118,158,937円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	2,599,078,481円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	3,007,149,608円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	6,902,929,756円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	17,793,307,327円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,234,149,472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)	10,000,290,735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)	61,099,583,891円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	847,651,195円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	10,895,936,706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)	193,714,562,690円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	1,304,319,405円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	306,359,244円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	53,120,442円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	3,903,247,806円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	4,612,271,574円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	3,887,432,534円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	1,521,584,180円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	304,368,925円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	30,390,205円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	775,791,105円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	11,046,496,055円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	898,079,738円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定>	19,067,757円
SMAM・FGグローバルバランス25VA<適格機関投資家限定>	11,622,602円
合計	429,837,460,158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)	590,000,000	642,816,800	
	第2回利付国債(40年)	752,000,000	777,395,040	
	第3回利付国債(40年)	790,000,000	811,859,300	
	第4回利付国債(40年)	850,000,000	869,167,500	
	第247回利付国債(10年)	285,000,000	287,111,850	
	第250回利付国債(10年)	10,715,000,000	10,771,468,050	
	第253回利付国債(10年)	10,390,000,000	10,633,853,300	
	第256回利付国債(10年)	7,480,000,000	7,656,827,200	
	第258回利付国債(10年)	11,793,000,000	12,085,112,610	
	第260回利付国債(10年)	10,685,000,000	11,054,701,000	
	第263回利付国債(10年)	11,072,000,000	11,492,182,400	
	第265回利付国債(10年)	11,040,000,000	11,465,150,400	
	第268回利付国債(10年)	9,795,000,000	10,197,280,650	
	第270回利付国債(10年)	8,807,000,000	9,134,091,980	
	第272回利付国債(10年)	9,515,000,000	9,919,958,400	
	第274回利付国債(10年)	10,755,000,000	11,276,725,050	
	第277回利付国債(10年)	10,375,000,000	10,943,446,250	
	第280回利付国債(10年)	8,267,000,000	8,846,186,020	
	第282回利付国債(10年)	10,060,000,000	10,709,775,400	
	第284回利付国債(10年)	5,487,000,000	5,854,903,350	
	第285回利付国債(10年)	3,988,000,000	4,264,607,680	
	第286回利付国債(10年)	3,480,000,000	3,747,472,800	
	第288回利付国債(10年)	3,655,000,000	3,922,546,000	
	第289回利付国債(10年)	3,994,000,000	4,246,340,920	
	第290回利付国債(10年)	4,047,000,000	4,281,685,530	
	第293回利付国債(10年)	2,820,000,000	3,055,836,600	
	第296回利付国債(10年)	3,513,000,000	3,741,309,870	
	第297回利付国債(10年)	4,203,000,000	4,449,590,010	
	第299回利付国債(10年)	1,650,000,000	1,735,371,000	
	第300回利付国債(10年)	2,000,000,000	2,131,440,000	
	第301回利付国債(10年)	2,595,000,000	2,765,543,400	
	第303回利付国債(10年)	4,455,000,000	4,713,122,700	
	第305回利付国債(10年)	5,920,000,000	6,208,718,400	
	第306回利付国債(10年)	5,850,000,000	6,172,159,500	
	第308回利付国債(10年)	4,770,000,000	4,985,222,400	
	第309回利付国債(10年)	2,200,000,000	2,263,844,000	
	第310回利付国債(10年)	6,600,000,000	6,722,034,000	
	第312回利付国債(10年)	6,220,000,000	6,425,011,200	

第313回利付国債(10年)	6,270,000,000	6,515,784,000
第315回利付国債(10年)	6,330,000,000	6,507,240,000
第317回利付国債(10年)	2,630,000,000	2,673,999,900
第318回利付国債(10年)	2,500,000,000	2,518,700,000
第319回利付国債(10年)	1,750,000,000	1,775,165,000
第320回利付国債(10年)	1,250,000,000	1,256,175,000
第2回利付国債(30年)	570,000,000	634,586,700
第4回利付国債(30年)	300,000,000	358,032,000
第5回利付国債(30年)	290,000,000	313,057,900
第7回利付国債(30年)	549,000,000	601,764,390
第9回利付国債(30年)	100,000,000	93,870,000
第10回利付国債(30年)	585,000,000	517,701,600
第11回利付国債(30年)	270,000,000	267,073,200
第12回利付国債(30年)	540,000,000	571,833,000
第14回利付国債(30年)	1,000,000,000	1,114,120,000
第16回利付国債(30年)	745,000,000	844,286,150
第18回利付国債(30年)	820,000,000	898,539,600
第19回利付国債(30年)	715,000,000	783,368,300
第21回利付国債(30年)	605,000,000	662,057,550
第22回利付国債(30年)	665,000,000	753,930,450
第23回利付国債(30年)	529,000,000	599,753,750
第24回利付国債(30年)	660,000,000	748,268,400
第25回利付国債(30年)	790,000,000	862,948,600
第26回利付国債(30年)	803,000,000	893,160,840
第27回利付国債(30年)	1,110,000,000	1,258,173,900
第28回利付国債(30年)	1,216,000,000	1,379,260,160
第29回利付国債(30年)	1,212,000,000	1,349,986,200
第30回利付国債(30年)	1,470,000,000	1,606,695,300
第31回利付国債(30年)	1,780,000,000	1,905,917,200
第32回利付国債(30年)	1,600,000,000	1,745,920,000
第33回利付国債(30年)	1,880,000,000	1,925,496,000
第34回利付国債(30年)	2,140,000,000	2,283,722,400
第35回利付国債(30年)	1,520,000,000	1,551,707,200
第32回利付国債(20年)	70,000,000	79,781,100
第35回利付国債(20年)	170,000,000	195,656,400
第37回利付国債(20年)	302,000,000	347,487,240
第39回利付国債(20年)	458,000,000	517,695,720
第40回利付国債(20年)	390,000,000	435,224,400
第42回利付国債(20年)	480,000,000	548,630,400
第43回利付国債(20年)	1,370,000,000	1,601,721,800
第46回利付国債(20年)	775,000,000	865,775,750
第48回利付国債(20年)	955,000,000	1,091,517,250
第50回利付国債(20年)	918,000,000	1,002,153,060
第52回利付国債(20年)	720,000,000	797,918,400
第54回利付国債(20年)	965,000,000	1,078,686,650
第56回利付国債(20年)	1,308,000,000	1,437,073,440

第59回利付国債(20年)	1,335,000,000	1,423,470,450	
第61回利付国債(20年)	1,255,000,000	1,245,687,900	
第64回利付国債(20年)	1,525,000,000	1,652,779,750	
第65回利付国債(20年)	1,650,000,000	1,786,207,500	
第70回利付国債(20年)	1,540,000,000	1,749,624,800	
第72回利付国債(20年)	1,453,000,000	1,598,474,360	
第74回利付国債(20年)	1,834,000,000	2,014,043,780	
第75回利付国債(20年)	1,370,000,000	1,502,492,700	
第78回利付国債(20年)	1,360,000,000	1,457,607,200	
第82回利付国債(20年)	1,390,000,000	1,521,799,800	
第84回利付国債(20年)	1,820,000,000	1,966,965,000	
第85回利付国債(20年)	1,920,000,000	2,096,428,800	
第88回利付国債(20年)	1,797,000,000	2,004,265,980	
第90回利付国債(20年)	1,810,000,000	1,992,484,200	
第92回利付国債(20年)	1,759,000,000	1,910,133,280	
第93回利付国債(20年)	1,807,000,000	1,934,682,620	
第95回利付国債(20年)	1,760,000,000	1,953,652,800	
第97回利付国債(20年)	1,767,000,000	1,935,359,760	
第99回利付国債(20年)	1,818,000,000	1,962,494,640	
第100回利付国債(20年)	1,387,000,000	1,514,659,480	
第101回利付国債(20年)	635,000,000	711,295,250	
第102回利付国債(20年)	1,982,000,000	2,218,769,720	
第105回利付国債(20年)	1,510,000,000	1,622,706,400	
第107回利付国債(20年)	2,168,000,000	2,327,087,840	
第109回利付国債(20年)	2,270,000,000	2,366,043,700	
第111回利付国債(20年)	2,346,000,000	2,547,263,340	
第113回利付国債(20年)	2,802,000,000	2,996,206,620	
第114回利付国債(20年)	2,383,000,000	2,544,686,550	
第116回利付国債(20年)	2,810,000,000	3,039,914,200	
第118回利付国債(20年)	350,000,000	367,489,500	
第119回利付国債(20年)	860,000,000	875,677,800	
第120回利付国債(20年)	1,080,000,000	1,065,646,800	
第121回利付国債(20年)	2,100,000,000	2,168,460,000	
第122回利付国債(20年)	1,250,000,000	1,271,225,000	
第123回利付国債(20年)	1,240,000,000	1,319,186,400	
第124回利付国債(20年)	1,150,000,000	1,204,337,500	
第125回利付国債(20年)	1,790,000,000	1,931,392,100	
第126回利付国債(20年)	80,000,000	83,696,800	
第127回利付国債(20年)	1,340,000,000	1,380,575,200	
第128回利付国債(20年)	580,000,000	596,866,400	
第129回利付国債(20年)	1,500,000,000	1,519,605,000	
第130回利付国債(20年)	820,000,000	830,209,000	
第131回利付国債(20年)	1,660,000,000	1,652,712,600	
第132回利付国債(20年)	450,000,000	447,673,500	
第133回利付国債(20年)	280,000,000	283,309,600	
国債証券 小計	343,331,000,000	361,628,836,480	

地方債証券	第1回東京都公募公債(20年)	100,000,000	103,752,000	
	第1回東京都公募公債(30年)	100,000,000	104,776,000	
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	107,522,000	
	第7回東京都公募公債(20年)	100,000,000	109,169,000	
	第8回東京都公募公債(20年)	100,000,000	111,352,000	
	第8回東京都公募公債(30年)	400,000,000	416,716,000	
	第583回東京都公募公債	48,500,000	48,557,230	
	第584回東京都公募公債	100,000,000	100,221,000	
	第588回東京都公募公債	100,000,000	100,583,000	
	第596回東京都公募公債	100,000,000	100,639,000	
	第598回東京都公募公債	200,000,000	200,922,000	
	第602回東京都公募公債	200,000,000	204,148,000	
	第603回東京都公募公債	200,000,000	204,710,000	
	第604回東京都公募公債	100,000,000	102,465,000	
	第608回東京都公募公債	600,000,000	617,640,000	
	第610回東京都公募公債	100,000,000	103,839,000	
	第613回東京都公募公債	100,000,000	103,554,000	
	第623回東京都公募公債	200,000,000	207,094,000	
	第628回東京都公募公債	100,000,000	104,978,000	
	第629回東京都公募公債	100,000,000	104,448,000	
	第634回東京都公募公債	106,000,000	113,017,200	
	第642回東京都公募公債	200,000,000	214,256,000	
	第643回東京都公募公債	100,000,000	106,670,000	
	第646回東京都公募公債	100,000,000	108,380,000	
	第652回東京都公募公債	200,000,000	214,148,000	
	第653回東京都公募公債	200,000,000	212,444,000	
	第660回東京都公募公債	700,000,000	746,375,000	
	第662回東京都公募公債	100,000,000	107,249,000	
	第668回東京都公募公債	200,000,000	212,834,000	
	平成16年度第3回北海道公募公債	100,000,000	103,150,000	
	平成17年度第4回北海道公募公債	100,000,000	103,237,000	
	平成17年度第9回北海道公募公債	100,000,000	104,314,000	
	平成19年度第2回北海道公募公債	100,000,000	107,078,000	
	平成19年度第7回北海道公募公債	100,000,000	107,075,000	
	平成20年度第4回北海道公募公債	100,000,000	108,449,000	
	平成20年度第9回北海道公募公債(5年)	300,000,000	307,389,000	
	平成20年度第12回北海道公募公債	100,000,000	107,048,000	
	平成20年度第15回北海道公募公債(5年)	200,000,000	203,920,000	
	第1回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	114,192,000	
	第3回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	108,523,000	
	第7回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	108,682,000	
	第26回神奈川県公募公債(5年)	100,000,000	100,661,000	
	第27回神奈川県公募公債(5年)	100,000,000	100,591,000	
	第122回神奈川県公募公債	200,000,000	204,604,000	
	第129回神奈川県公募公債	100,000,000	103,758,000	

第143回神奈川県公募公債	100,000,000	106,744,000	
第144回神奈川県公募公債	300,000,000	321,087,000	
第147回神奈川県公募公債	100,000,000	108,272,000	
第149回神奈川県公募公債	100,000,000	107,768,000	
第157回神奈川県公募公債	115,600,000	123,310,520	
第3回大阪府公募公債(7年)	200,000,000	206,986,000	
第31回大阪府公募公債(5年)	100,000,000	100,586,000	
第52回大阪府公募公債(5年)	400,000,000	406,504,000	
第261回大阪府公募公債(10年)	105,000,000	107,449,650	
第262回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,251,000	
第267回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,175,000	
第277回大阪府公募公債(10年)	600,000,000	620,892,000	
第299回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	214,444,000	
第303回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	107,676,000	
第306回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	214,606,000	
第313回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	106,603,000	
平成14年度第2回京都府公募公債	300,000,000	302,061,000	
平成19年度第1回京都府公募公債	130,260,000	140,123,287	
平成14年度第5回兵庫県公募公債	100,000,000	100,600,000	
平成15年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	101,261,000	
平成16年度第12回兵庫県公募公債	100,000,000	103,310,000	
平成17年度第2回兵庫県公募公債	200,000,000	207,028,000	
平成17年度第6回兵庫県公募公債	101,000,000	104,393,600	
平成19年度第8回兵庫県公募公債(5年)	100,000,000	100,629,000	
平成20年度第5回兵庫県公募公債	100,000,000	108,373,000	
平成21年度第3回兵庫県公募公債	200,000,000	213,066,000	
平成21年度第11回兵庫県公募公債	200,000,000	213,684,000	
平成21年度第23回兵庫県公募公債	200,000,000	209,130,000	
平成18年度第2回静岡県公募公債	100,000,000	107,204,000	
平成18年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	106,955,000	
平成19年度第7回静岡県公募公債	100,000,000	107,678,000	
平成20年度第1回静岡県公募公債	200,000,000	218,546,000	
平成20年度第7回静岡県公募公債	100,000,000	107,463,000	
平成21年度第5回静岡県公募公債	300,000,000	314,514,000	
平成14年度第2回愛知県公募公債(10年)	110,000,000	110,822,800	
平成17年度第2回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,431,000	
平成18年度第4回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	106,690,000	
平成19年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	107,914,000	
平成20年度第5回愛知県公募公債(5年)	500,000,000	507,905,000	
平成21年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	106,851,000	
平成21年度第7回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	212,598,000	
平成19年度第3回広島県公募公債	200,000,000	213,320,000	
平成20年度第1回広島県公募公債	100,000,000	107,815,000	
平成15年度第3回埼玉県公募公債	205,670,000	210,373,672	
平成16年度第3回埼玉県公募公債	100,000,000	104,293,000	
平成16年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	103,482,000	

平成17年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	104,915,000	
平成18年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	107,319,000	
平成19年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	108,015,000	
平成21年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	106,284,000	
平成21年度第4回埼玉県公募公債	200,000,000	211,494,000	
平成18年度第1回福岡県公募公債	100,000,000	107,888,000	
平成19年度第2回福岡県公募公債	100,000,000	108,428,000	
平成20年度第9回福岡県公募公債	200,000,000	202,674,000	
平成16年度第9回千葉県公募公債	100,000,000	103,913,000	
平成18年度第1回千葉県公募公債	200,000,000	214,158,000	
平成18年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	106,721,000	
平成19年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	107,109,000	
平成21年度第2回千葉県公募公債	345,000,000	367,763,100	
平成14年度第1回新潟県公募公債	240,000,000	241,653,600	
平成17年度第1回新潟県公募公債	200,000,000	207,012,000	
平成19年度第1回岐阜県公募公債(10年)	200,000,000	215,726,000	
第1回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,627,000	
第2回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,544,000	
第4回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,329,000	
第6回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,550,000	
第7回共同発行市場公募地方債	319,400,000	325,970,058	
第12回共同発行市場公募地方債	437,000,000	448,200,310	
第15回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,324,000	
第20回共同発行市場公募地方債	300,000,000	310,740,000	
第21回共同発行市場公募地方債	300,000,000	310,176,000	
第22回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,932,000	
第23回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,252,000	
第27回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,497,000	
第29回共同発行市場公募地方債	300,000,000	311,898,000	
第30回共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,336,000	
第31回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,453,000	
第32回共同発行市場公募地方債	300,000,000	314,745,000	
第33回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,981,000	
第35回共同発行市場公募地方債	400,000,000	420,624,000	
第36回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,210,000	
第38回共同発行市場公募地方債	200,000,000	214,158,000	
第40回共同発行市場公募地方債	300,000,000	323,226,000	
第46回共同発行市場公募地方債	200,000,000	213,946,000	
第55回共同発行市場公募地方債	200,000,000	215,676,000	
第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,159,000	
第57回共同発行市場公募地方債	300,000,000	320,406,000	
第62回共同発行市場公募地方債	200,000,000	215,046,000	
第64回共同発行市場公募地方債	300,000,000	323,598,000	
第65回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,856,000	
第73回共同発行市場公募地方債	300,000,000	320,103,000	
第75回共同発行市場公募地方債	900,000,000	963,819,000	



	第77回共同発行市場公募地方債	200,000,000	212,662,000	
	平成14年度第11回大阪市公募公債	100,000,000	100,610,000	
	平成18年度第2回大阪市公募公債	200,000,000	213,678,000	
	平成18年度第3回大阪市公募公債	100,000,000	107,400,000	
	平成18年度第6回大阪市公募公債	300,000,000	321,825,000	
	平成19年度第5回大阪市公募公債	100,000,000	107,988,000	
	平成19年度第10回大阪市公募公債	100,000,000	106,870,000	
	平成21年度第4回大阪市公募公債	300,000,000	318,978,000	
	第1回名古屋市公募公債(20年)	200,000,000	216,244,000	
	第3回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	107,560,000	
	第11回名古屋市公募公債(5年)	300,000,000	305,397,000	
	第12回ひ号名古屋市公募公債	100,000,000	103,537,000	
	第455回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	106,746,000	
	第1回京都市公募公債(30年)	100,000,000	110,393,000	
	第7回京都市公募公債(20年)	100,000,000	109,719,000	
	平成18年度第3回京都市公募公債	200,000,000	214,866,000	
	平成15年度第1回神戸市公募公債	100,000,000	100,517,000	
	平成19年度第10回神戸市公募公債	100,000,000	106,719,000	
	第4回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	107,796,000	
	第9回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	110,939,000	
	第14回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	109,483,000	
	平成17年度第4回横浜市公募公債	200,000,000	209,366,000	
	平成17年度第3回横浜市公募公債	100,000,000	104,744,000	
	平成18年度第4回横浜市公募公債	300,000,000	322,317,000	
	平成18年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	106,494,000	
	平成18年度第3回横浜市公募公債	200,000,000	214,438,000	
	平成20年度第6回横浜市公募公債	200,000,000	212,274,000	
	第22回横浜市公募公債	100,000,000	100,462,000	
	平成18年度第4回札幌市公募公債	200,000,000	213,122,000	
	第2回川崎市15年公募公債	100,000,000	106,568,000	
	第4回川崎市15年公募公債	100,000,000	110,082,000	
	第19回川崎市公募公債(5年)	100,000,000	101,636,000	
	平成15年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	102,424,000	
	平成19年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	106,528,000	
	平成18年度第4回福岡市公募公債	100,000,000	106,655,000	
	平成20年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	106,429,000	
	平成21年度第7回福岡市公募公債	200,000,000	202,116,000	
	平成19年度第1回広島市公募公債	100,000,000	107,048,000	
	平成21年度第1回千葉市公募公債	200,000,000	213,188,000	
	地方債証券 小計	29,763,430,000	31,284,270,027	
特殊債券	第27回韓国産業銀行円貨債券(2007)	100,000,000	100,340,000	
	第1回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	106,898,000	
	第2回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	211,108,000	
	第3回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	219,194,000	
	第5回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	105,520,000	

第9回日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,111,000	
第10回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,041,000	
第15回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	109,297,000	
第16回日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,213,000	
第20回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	108,971,000	
第20回日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,453,000	
第23回政府保証日本政策投資銀行債券	400,000,000	427,412,000	
第24回日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,629,000	
第27回日本政策投資銀行債券	100,000,000	107,059,000	
第30回日本政策投資銀行債券	100,000,000	108,513,000	
第36回日本政策投資銀行債券	100,000,000	107,278,000	
第51回日本政策投資銀行債券	100,000,000	107,691,000	
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	150,768,000	
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	216,082,000	
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	302,724,000	
第5回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	158,000,000	166,315,540	
第7回道路債券	100,000,000	114,733,000	
第8回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,313,000	
第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,590,000	
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	108,771,000	
第9回道路債券	100,000,000	114,126,000	
第12回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,219,000	
第13回道路債券	300,000,000	331,977,000	
第16回道路債券	200,000,000	201,588,000	
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	109,718,340	
第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,994,000	
第21回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,617,000	
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	304,125,000	
第23回道路債券	200,000,000	204,410,000	
第23回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	217,830,000	
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	321,378,000	
第26回道路債券	300,000,000	307,875,000	
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	536,040,000	
第27回道路債券	100,000,000	111,516,000	
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	102,732,000	
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	213,524,000	
第30回道路債券	100,000,000	103,131,000	
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	106,890,000	
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	165,232,350	
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	324,222,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,785,000	
第39回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,968,000	
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	324,417,000	
第40回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,776,000	
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	428,376,000	
第42回道路債券	200,000,000	217,288,000	

第44回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	212,686,000	
第45回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	213,440,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	216,564,000	
第48回日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	427,960,000	
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	106,110,000	
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	213,484,000	
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	211,138,000	
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	537,300,000	
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	108,105,000	
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	107,521,000	
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	213,832,000	
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	106,923,000	
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	212,098,000	
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	107,428,000	
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	317,547,000	
第313回政府保証道路債券	200,000,000	201,352,000	
第325回政府保証道路債券	100,000,000	102,306,000	
第327回政府保証道路債券	552,000,000	568,223,280	
第329回政府保証道路債券	300,000,000	310,140,000	
第330回政府保証道路債券	100,000,000	103,991,000	
第335回政府保証道路債券	100,000,000	103,462,000	
第336回政府保証道路債券	200,000,000	207,114,000	
第337回政府保証道路債券	100,000,000	103,335,000	
第338回政府保証道路債券	200,000,000	208,030,000	
第339回政府保証道路債券	100,000,000	103,779,000	
第340回政府保証道路債券	100,000,000	107,493,000	
第341回政府保証道路債券	100,000,000	103,521,000	
第346回政府保証道路債券	301,000,000	313,217,590	
第1回政府保証地方公営企業等金融機構債券	300,000,000	320,727,000	
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券	300,000,000	318,810,000	
第1回公営企業債券(5年)	500,000,000	503,905,000	
第2回地方公営企業等金融機構債券(20年)	100,000,000	107,845,000	
第3回公営企業債券(20年)	100,000,000	98,192,000	
第3回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,273,000	
第5回公営企業債券(20年)	100,000,000	109,086,000	
第6回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	104,885,000	
第6回公営企業債券	100,000,000	100,475,000	
第6回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,755,000	
第7回政府保証地方公営企業等金融機構債券	500,000,000	527,780,000	
第7回公営企業債券	400,000,000	407,100,000	
第10回公営企業債券	100,000,000	103,615,000	
第11回公営企業債券(20年)	100,000,000	108,212,000	
第11回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,150,000	
第12回公営企業債券	100,000,000	103,376,000	
第15回公営企業債券	100,000,000	103,460,000	
第16回公営企業債券(20年)	100,000,000	107,741,000	

第17回公営企業債券	100,000,000	104,514,000	
第17回公営企業債券(20年)	100,000,000	111,061,000	
第18回公営企業債券(20年)	100,000,000	113,337,000	
第20回公営企業債券	100,000,000	107,226,000	
第22回公営企業債券(20年)	100,000,000	109,268,000	
第24回公営企業債券	100,000,000	107,373,000	
第24回公営企業債券(20年)	200,000,000	216,758,000	
第30回公営企業債券	100,000,000	108,751,000	
第813回政府保証公営企業債券	1,000,000	1,001,060	
第815回政府保証公営企業債券	100,000,000	100,319,000	
第818回政府保証公営企業債券	102,000,000	102,596,700	
第821回政府保証公営企業債券	100,000,000	100,729,000	
第823回政府保証公営企業債券	200,000,000	201,252,000	
第824回政府保証公営企業債券	600,000,000	604,056,000	
第825回政府保証公営企業債券	500,000,000	503,625,000	
第826回政府保証公営企業債券	300,000,000	301,944,000	
第827回政府保証公営企業債券	200,000,000	201,146,000	
第829回政府保証公営企業債券	500,000,000	506,775,000	
第833回政府保証公営企業債券	200,000,000	204,752,000	
第834回政府保証公営企業債券	200,000,000	204,998,000	
第836回政府保証公営企業債券	300,000,000	306,969,000	
第838回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,927,000	
第840回政府保証公営企業債券	200,000,000	206,706,000	
第841回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,973,000	
第843回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,464,000	
第844回政府保証公営企業債券	400,000,000	415,308,000	
第846回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,470,000	
第847回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,554,000	
第849回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,991,000	
第851回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,509,000	
第852回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,578,000	
第858回政府保証公営企業債券	200,000,000	209,400,000	
第861回政府保証公営企業債券	300,000,000	315,927,000	
第863回政府保証公営企業債券	100,000,000	107,178,000	
第865回政府保証公営企業債券	300,000,000	322,200,000	
第866回政府保証公営企業債券	200,000,000	215,016,000	
第875回政府保証公営企業債券	200,000,000	213,752,000	
第883回政府保証公営企業債券	100,000,000	105,554,000	
第884回政府保証公営企業債券	300,000,000	316,683,000	
第885回政府保証公営企業債券	200,000,000	214,868,000	
第886回政府保証公営企業債券	200,000,000	216,208,000	
第3回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	101,528,000	
第187回政府保証首都高速道路債券	193,000,000	197,751,660	
第195回政府保証首都高速道路債券	400,000,000	414,144,000	
第197回政府保証首都高速道路債券	300,000,000	311,955,000	
第199回政府保証首都高速道路債券	200,000,000	208,094,000	

第4回阪神高速道路債券	200,000,000	201,478,000	
第23回中小企業債券	100,000,000	101,210,000	
第2回日本鉄道建設債券	100,000,000	100,477,000	
第6回国際協力銀行債券	100,000,000	100,559,000	
第10回国際協力銀行債券	300,000,000	306,783,000	
第15回国際協力銀行債券	200,000,000	206,946,000	
第21回国際協力銀行債券	100,000,000	104,418,000	
第27回国際協力銀行債券	100,000,000	106,646,000	
第8回都市再生債券	200,000,000	207,818,000	
第18回政府保証都市再生債券	400,000,000	400,488,000	
第19回都市再生債券	100,000,000	108,442,000	
第27回都市再生債券	300,000,000	304,320,000	
第3回本州四国連絡橋債券	100,000,000	104,005,000	
第7回本州四国連絡橋債券	100,000,000	108,987,000	
第332回東京交通債券	100,000,000	113,954,000	
第342回東京交通債券	100,000,000	112,060,000	
第13回関西国際空港株式会社債	100,000,000	106,149,000	
第16回関西国際空港株式会社債	100,000,000	107,008,000	
第38回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	100,473,000	
第51回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	110,056,000	
第14回独立行政法人福祉医療機構債券	200,000,000	215,690,000	
第17回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	108,574,000	
第143回政府保証預金保険機構債券	100,000,000	100,365,000	
第153回政府保証預金保険機構債券	100,000,000	100,787,000	
第1回貸付債権担保住宅金融公庫債券	46,048,000	47,969,122	
第1回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	70,130,000	72,062,782	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	94,760,000	99,911,153	
第2回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	72,430,000	74,729,652	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	147,279,000	156,093,648	
第3回貸付債権担保住宅金融公庫債券	25,154,000	26,310,077	
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	36,247,000	37,794,384	
第4回貸付債権担保住宅金融公庫債券	26,336,000	27,412,352	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,962,000	67,852,168	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	164,022,000	171,612,938	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	38,220,000	39,771,349	
第6回貸付債権担保住宅金融公庫債券	64,078,000	66,905,121	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	40,623,000	43,200,529	
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	124,368,000	132,022,850	
第7回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	57,113,000	59,645,961	
第8回貸付債権担保住宅金融公庫債券	33,724,000	34,865,894	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	126,411,000	133,592,408	
第8回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,678,000	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	84,370,000	89,519,944	
第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	61,475,000	64,938,501	
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券	35,370,000	36,113,477	
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	130,557,000	138,321,224	

第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	66,349,000	69,586,831
第11回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	66,904,000	70,322,125
第12回貸付債権担保住宅金融公庫債券	41,143,000	42,436,535
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	66,757,000	69,662,932
第14回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	215,342,000
第16回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	138,292,000	143,766,980
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	142,812,000	149,145,712
第19回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,662,000	79,847,621
第21回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,288,000
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	153,926,000	164,625,396
第25回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	213,410,000
第26回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	228,210,000	241,284,150
第27回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	77,131,000	81,023,801
第28回貸付債権担保住宅金融公庫債券	53,827,000	55,668,421
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,348,000	85,062,349
第29回貸付債権担保住宅金融公庫債券	58,064,000	60,143,852
第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,010,000	85,744,735
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,377,000	87,300,721
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券	61,463,000	63,222,071
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	62,920,000	64,740,275
第32回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	171,482,000	177,615,911
第33回貸付債権担保住宅金融公庫債券	62,889,000	64,646,747
第34回貸付債権担保住宅金融公庫債券	129,394,000	134,186,753
第35回貸付債権担保住宅金融公庫債券	63,697,000	65,884,991
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,734,000	93,349,382
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	61,480,000	63,952,110
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,450,000	93,772,228
第38回貸付債権担保住宅金融公庫債券	122,794,000	127,858,024
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	61,724,000	63,998,529
第40回貸付債権担保住宅金融公庫債券	123,374,000	128,503,890
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	63,328,000	66,588,125
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	121,964,000	130,197,789
第43回貸付債権担保住宅金融公庫債券	120,748,000	128,480,701
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,832,000	96,849,076
第44回貸付債権担保住宅金融公庫債券	58,324,000	62,144,222
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	190,742,000	197,620,156
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,702,000	99,544,435
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	192,952,000	201,546,082
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,136,000	100,377,428
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	62,135,000	65,651,219
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	293,868,000	301,029,563
第52回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,196,000
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	63,588,000	66,662,479
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	198,934,000	199,311,974
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,343,000
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	127,816,000	134,384,464

第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	128,832,000	135,930,643	
第3回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	49,782,000	52,315,405	
第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	63,498,000	66,858,949	
第5回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	111,562,000	116,302,269	
第15回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	134,960,000	140,718,743	
第36回国民生活債券	100,000,000	100,964,000	
第6回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	102,987,000	
第10回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	107,940,000	
第3回新東京国際空港債券	100,000,000	100,751,000	
第4回政府保証新東京国際空港債券	100,000,000	101,361,000	
第5回新東京国際空港債券	100,000,000	102,632,000	
第3回沖縄振興開発金融公庫債券	200,000,000	205,644,000	
第5回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	103,278,000	
い第687号商工債	200,000,000	201,474,000	
い第703号商工債	200,000,000	204,534,000	
い第711号商工債	100,000,000	101,899,000	
い第712号商工債	100,000,000	101,562,000	
い第722号商工債	100,000,000	100,628,000	
い第723号商工債	100,000,000	100,626,000	
い第725号商工債	200,000,000	200,112,000	
い第727号商工債	200,000,000	202,316,000	
い第687号農林債	100,000,000	100,706,000	
い第690号農林債	400,000,000	403,228,000	
い第695号農林債	200,000,000	202,112,000	
い第696号農林債	500,000,000	507,235,000	
い第697号農林債	200,000,000	203,356,000	
い第698号農林債	100,000,000	101,785,000	
い第704号農林債	200,000,000	204,024,000	
い第707号農林債	100,000,000	102,358,000	
い第708号農林債	300,000,000	306,006,000	
い第712号農林債	300,000,000	304,836,000	
い第713号農林債	100,000,000	101,389,000	
い第714号農林債	400,000,000	406,792,000	
い第723号農林債	200,000,000	201,390,000	
第597回あおぞら債	100,000,000	100,619,000	
第240回信金中金債(5年)	200,000,000	203,508,000	
第243回信金中金債(5年)	100,000,000	101,245,000	
第215回信金中金債(5年)	200,000,000	201,722,000	
第216回信金中金債(5年)	200,000,000	201,644,000	
第218回信金中金債(5年)	300,000,000	302,691,000	
第221回信金中金債(5年)	100,000,000	101,080,000	
第225回信金中金債(5年)	500,000,000	508,080,000	
第227回信金中金債(5年)	100,000,000	101,947,000	
第228回信金中金債(5年)	400,000,000	408,592,000	
第229回信金中金債(5年)	300,000,000	306,468,000	
第230回信金中金債(5年)	100,000,000	101,955,000	

	第231回信中金債(5年)	100,000,000	102,241,000	
	第233回信中金債(5年)	500,000,000	512,010,000	
	第236回信中金債(5年)	200,000,000	203,156,000	
	第1回政府保証東日本高速道路債券	137,000,000	143,840,410	
	第3回政府保証東日本高速道路債券	100,000,000	107,159,000	
	第1回政府保証中日本高速道路債券	250,000,000	262,482,500	
	第1回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,675,000	
	第3回政府保証中日本高速道路債券	163,000,000	171,500,450	
	第5回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	215,544,000	
	第6回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	106,958,000	
	第10回政府保証中日本高速道路債券	100,000,000	106,889,000	
	第12回政府保証中日本高速道路債券	103,000,000	110,281,070	
	第14回政府保証中日本高速道路債券	100,000,000	107,951,000	
	第19回政府保証中日本高速道路債券	124,000,000	131,511,920	
	第21回政府保証中日本高速道路債券	200,000,000	214,798,000	
	第25回政府保証中日本高速道路債券	200,000,000	212,466,000	
	第8回政府保証西日本高速道路債券	233,000,000	248,932,540	
	第15回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	108,057,000	
	第19回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	105,522,000	
	第5回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	207,110,000	
	第1回緑資源債券	100,000,000	100,536,000	
	第3回東京地下鉄株式会社社債	200,000,000	213,398,000	
	特殊債券 小計	48,246,593,000	50,347,412,738	
社債券	第9回株式会社ポスコ円貨社債(2006)	200,000,000	200,914,000	
	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	200,490,000	
	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	100,058,000	
	第18回ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポレーション	100,000,000	101,685,000	
	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	99,728,000	
	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	99,352,000	
	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	296,307,000	
	第9回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク	100,000,000	99,015,000	
	第11回シティグループ・インク円貨社債(2003)	200,000,000	198,740,000	
	第17回シティグループ・インク円貨債券	100,000,000	94,550,000	
	第22回シティグループ・インク円貨債券	300,000,000	302,904,000	
	第3回バンク・オブ・アメリカ・コーポレーション	100,000,000	95,540,000	
	第5回バンク・オブ・アメリカ・コーポレーション	100,000,000	99,169,000	
	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	296,886,000	
	第5回オーストラリア・コモンウェルス銀行円貨社債(2011)	300,000,000	296,052,000	
	第8回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	300,000,000	297,237,000	
	第10回コーペラティブ・セントラル・ライフアイゼン・ボエレン	300,000,000	292,656,000	
	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	100,906,000	
	H S B C 銀行 P L C 第1回円貨社債	200,000,000	199,332,000	
	H S B C 銀行 P L C 第2回円貨社債	200,000,000	195,532,000	
	第7回キリンホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	212,028,000	
	第2回サントリーホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,025,000	



第19回味の素株式会社無担保社債	100,000,000	102,810,000	
第4回日本たばこ産業株式会社社債	200,000,000	201,226,000	
第38回住友化学株式会社無担保社債	100,000,000	106,325,000	
第33回三菱化学株式会社無担保社債	200,000,000	212,254,000	
第35回三菱化学株式会社無担保社債	100,000,000	107,126,000	
第35回三井化学株式会社無担保社債	100,000,000	107,174,000	
第26回新日本石油株式会社無担保社債	200,000,000	214,890,000	
第16回住友ゴム工業株式会社無担保社債	100,000,000	108,330,000	
第12回旭硝子株式会社無担保社債	200,000,000	216,524,000	
第30回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	114,340,000	
第55回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	106,152,000	
第62回住友金属工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,790,000	
第46回株式会社神戸製鋼所無担保社債	100,000,000	107,265,000	
第15回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	104,627,000	
第18回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	109,463,000	
第7回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	102,137,000	
第45回株式会社東芝無担保社債	200,000,000	212,846,000	
第50回株式会社東芝無担保社債	100,000,000	100,875,000	
第45回日本電気株式会社無担保社債	100,000,000	100,144,000	
第7回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	204,578,000	
第8回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	107,974,000	
第10回パナソニック株式会社無担保社債	300,000,000	302,718,000	
第11回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	101,954,000	
第24回シャープ株式会社無担保社債	200,000,000	202,268,000	
第26回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	107,885,000	
第20回三洋電機株式会社無担保社債	200,000,000	208,136,000	
第22回三菱重工工業株式会社無担保社債	200,000,000	215,966,000	
第1回日本生命2011基金特定目的会社特定社債第1回-B	200,000,000	201,090,000	
第1回住友生命第4回基金流動化特定目的会社特定社債	100,000,000	100,171,000	
第9回トヨタ自動車株式会社無担保社債	300,000,000	305,715,000	
第5回アイシン精機株式会社無担保社債	100,000,000	103,065,000	
第43回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	107,661,000	
第56回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,610,000	
第63回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	100,344,000	
第70回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	102,889,000	
第61回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	106,340,000	
第63回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	108,493,000	
第25回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,000,000	
第30回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	105,088,000	
第33回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	106,548,000	
第67回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	106,442,000	
第69回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	108,177,000	
第32回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	100,209,000	
第38回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	100,431,000	
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	103,597,000	
第3回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	106,769,000	

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	201,200,000	
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	217,048,000	
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	109,351,000	
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	204,094,000	
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	408,384,000	
株式会社東京三菱銀行第8回無担保社債	100,000,000	103,465,000	
第9回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	114,245,000	
第11回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	200,000,000	213,824,000	
株式会社三菱東京UFJ銀行第12回無担保社債	200,000,000	213,828,000	
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	300,000,000	299,763,000	
第56回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	100,746,000	
第72回株式会社東京三菱銀行無担保社債	100,000,000	102,130,000	
第90回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	100,608,000	
第92回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	400,000,000	403,308,000	
第95回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	100,851,000	
第100回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	200,000,000	203,180,000	
第104回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	102,354,000	
第105回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	100,172,000	
第110回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	105,128,000	
第4回株式会社りそな銀行無担保社債	200,000,000	218,160,000	
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	101,962,000	
第11回株式会社静岡銀行無担保社債	100,000,000	103,231,000	
第9回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債	200,000,000	204,318,000	
第7回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	104,973,000	
第8回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	102,971,000	
第11回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	101,162,000	
中央三井信託銀行第3回無担保社債	100,000,000	103,753,000	
第5回株式会社三井住友銀行無担保社債	300,000,000	302,154,000	
第7回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	102,889,000	
第8回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	103,682,000	
第9回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	103,823,000	
第20回株式会社三井住友銀行無担保社債	300,000,000	322,851,000	
第24回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	101,481,000	
第42回株式会社三井住友銀行無担保社債	200,000,000	201,574,000	
第43回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	101,086,000	
第45回株式会社三井住友銀行無担保社債	200,000,000	203,754,000	
第8回株式会社みずほ銀行無担保社債	200,000,000	210,224,000	
第9回株式会社みずほ銀行無担保社債	100,000,000	103,482,000	
第10回株式会社みずほ銀行無担保社債	100,000,000	105,641,000	
第15回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	100,000,000	100,235,000	
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	201,372,000	
第17回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	107,911,000	
第21回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	107,037,000	
第41回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,699,000	
第113回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	104,632,000	
第115回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,321,000	

第118回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	103,202,000	
第130回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	104,648,000	
第6回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,301,000	
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	100,442,000	
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	100,507,000	
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	501,830,000	
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	308,685,000	
第21回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	203,792,000	
第28回三井不動産株式会社無担保社債	300,000,000	307,836,000	
第58回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	114,369,000	
第65回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	99,853,000	
第87回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	106,873,000	
第63回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	109,192,000	
第28回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	103,680,000	
第41回小田急電鉄株式会社無担保社債	200,000,000	215,666,000	
第42回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	107,049,000	
第2回東日本旅客鉄道株式会社社債	200,000,000	227,554,000	
第7回東日本旅客鉄道株式会社社債	200,000,000	230,212,000	
第9回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	114,765,000	
第15回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	114,148,000	
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	200,000,000	223,234,000	
第34回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	113,130,000	
第52回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	106,218,000	
第3回西日本旅客鉄道株式会社社債	200,000,000	228,688,000	
第5回西日本旅客鉄道株式会社社債	200,000,000	228,430,000	
第3回東海旅客鉄道株式会社普通社債	100,000,000	112,801,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	110,102,000	
第11回東海旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	99,377,000	
第21回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	105,229,000	
第28回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	106,835,000	
第41回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	105,711,000	
第42回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	215,410,000	
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	102,389,000	
第48回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	103,444,000	
第51回日本電信電話株式会社電信電話債券	300,000,000	321,258,000	
第53回日本電信電話株式会社電信電話債券	300,000,000	317,133,000	
第15回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	108,253,000	
第15回株式会社エヌ・ティ・ティ・ドコモ無担保社債	200,000,000	216,782,000	
第425回東京電力株式会社社債	100,000,000	97,718,000	
第514回東京電力株式会社社債	100,000,000	89,068,000	
第515回東京電力株式会社社債	200,000,000	175,228,000	
第516回東京電力株式会社社債	100,000,000	86,733,000	
第522回東京電力株式会社社債	300,000,000	250,821,000	
第524回東京電力株式会社社債	100,000,000	81,063,000	
第526回東京電力株式会社社債	300,000,000	240,690,000	
第527回東京電力株式会社社債	100,000,000	90,551,000	

第528回東京電力株式会社社債	100,000,000	74,179,000	
第532回東京電力株式会社社債	200,000,000	158,600,000	
第533回東京電力株式会社社債	200,000,000	178,068,000	
第535回東京電力株式会社社債	200,000,000	157,576,000	
第537回東京電力株式会社社債	100,000,000	72,667,000	
第544回東京電力株式会社社債	200,000,000	155,688,000	
第545回東京電力株式会社社債	100,000,000	76,914,000	
第547回東京電力株式会社社債	200,000,000	145,380,000	
第552回東京電力株式会社社債	100,000,000	91,804,000	
第406回中部電力株式会社社債	200,000,000	220,426,000	
第408回中部電力株式会社社債	100,000,000	111,334,000	
第409回中部電力株式会社社債	200,000,000	226,764,000	
第469回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,505,000	
第471回中部電力株式会社社債	300,000,000	306,678,000	
第474回中部電力株式会社社債	100,000,000	103,854,000	
第475回中部電力株式会社社債	200,000,000	210,692,000	
第486回中部電力株式会社社債	200,000,000	208,952,000	
第433回関西電力株式会社社債	100,000,000	102,022,000	
第440回関西電力株式会社社債	100,000,000	103,468,000	
第449回関西電力株式会社社債	100,000,000	106,081,000	
第451回関西電力株式会社社債	100,000,000	104,801,000	
第453回関西電力株式会社社債	100,000,000	104,936,000	
第465回関西電力株式会社社債	200,000,000	205,554,000	
第467回関西電力株式会社社債	100,000,000	104,169,000	
第472回関西電力株式会社社債	100,000,000	104,898,000	
第306回中国電力株式会社社債	200,000,000	226,008,000	
第310回中国電力株式会社社債	100,000,000	112,637,000	
第349回中国電力株式会社社債	200,000,000	210,956,000	
第279回北陸電力株式会社社債	30,000,000	30,977,700	
第286回北陸電力株式会社社債	100,000,000	106,375,000	
第368回東北電力株式会社社債	450,000,000	490,482,000	
第372回東北電力株式会社社債	200,000,000	224,722,000	
第376回東北電力株式会社社債	100,000,000	110,834,000	
第408回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,240,000	
第431回東北電力株式会社社債	100,000,000	106,114,000	
第445回東北電力株式会社社債	100,000,000	104,514,000	
第229回四国電力株式会社社債	100,000,000	113,230,000	
第245回四国電力株式会社社債	100,000,000	105,130,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	93,568,000	
第268回四国電力株式会社社債	100,000,000	104,060,000	
第346回九州電力株式会社社債	100,000,000	106,425,000	
第380回九州電力株式会社社債	100,000,000	103,045,000	
第384回九州電力株式会社社債	100,000,000	103,376,000	
第394回九州電力株式会社社債	100,000,000	105,478,000	
第400回九州電力株式会社社債	100,000,000	104,530,000	
第405回九州電力株式会社社債	100,000,000	105,043,000	

第408回九州電力株式会社社債	100,000,000	104,137,000	
第258回北海道電力株式会社社債	200,000,000	227,232,000	
第300回北海道電力株式会社社債	100,000,000	104,426,000	
第11回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,533,000	
第14回電源開発株式会社無担保社債	200,000,000	206,072,000	
第19回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	105,264,000	
第21回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	104,007,000	
第23回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	104,758,000	
第17回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	224,942,000	
第25回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	103,015,000	
第18回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	205,174,000	
第22回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	106,460,000	
第27回東邦瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	98,735,000	
第30回東邦瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	107,037,000	
社債券 小計	32,380,000,000	33,190,025,700	
合計		476,450,544,945	

「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23年2月18日現在)	(平成24年2月20日現在)
科目	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	730,510,210	1,215,979,564
コール・ローン	405,797,597	116,848,821
株式	242,196,727,337	222,660,583,298
投資証券	3,938,342,659	4,526,595,370
派生商品評価勘定	43,217,265	104,468,528
未収入金	9,174,377	2,051,859,409
未収配当金	389,408,578	365,623,265
未収利息	555	160
差入委託証拠金	1,391,194,614	869,508,461
流動資産合計	249,104,373,192	231,911,466,876
資産合計	249,104,373,192	231,911,466,876
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	20,769,164
未払解約金	240,095,516	1,066,150,705
流動負債合計	240,095,516	1,086,919,869
負債合計	240,095,516	1,086,919,869
純資産の部		
元本等		
元本	180,122,951,127	178,000,383,872
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	68,741,326,549	52,824,163,135
元本等合計	248,864,277,676	230,824,547,007
純資産合計	248,864,277,676	230,824,547,007
負債純資産合計	249,104,373,192	231,911,466,876

(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23年2月18日ならびに平成24年2月20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22年2月19日 至平成23年2月18日	自平成23年2月19日 至平成24年2月20日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式、新株予約権証券および投資証券（売買目的有価証券）</p> <p>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。</p> <p>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。</p>	<p>株式および投資証券（売買目的有価証券）</p> <p>同左</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>(1)先物取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>	<p>(1)先物取引</p> <p>同左</p> <p>(2)為替予約取引</p> <p>同左</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、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。</p>	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>同左</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>	<p>外貨建資産等の会計処理</p> <p>同左</p>

## （貸借対照表に関する注記）

項目	（平成23年2月18日現在）	（平成24年2月20日現在）
1. 受益権総数	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	平成24年2月20日現在における受益権の 総数 178,000,383,872口
2. 1単位当たり純資産額	1.3816円 （1万円 = 13,816円）	1.2968円 （1万円 = 12,968円）

## （金融商品に関する注記）

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自平成22年2月19日 至平成23年2月18日	自平成23年2月19日 至平成24年2月20日
	（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。	
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。	同左
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。</p> <p>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>	<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 同左</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 同左</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>	同左
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>	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成23年2月18日現在）	（平成24年2月20日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（株式および投資証券） 「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。</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>	<p>(1) 有価証券（株式および投資証券） 同左</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） 同左</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 同左</p>

（デリバティブ取引に関する注記）

（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				
	S P 5 0 0	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)
	D J E U R	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)
	F T S E	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ぬ。

## 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ぬ。

(平成24年2月20日現在)

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 株式関連

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	SP500	2,345,808,163 (29,466,250米ドル)	( )	2,408,467,203 (30,253,325米ドル)	62,659,040 (787,075米ドル)
	DJ EUR	785,245,356 (7,463,600ユーロ)	( )	808,644,060 (7,686,000ユーロ)	23,398,704 (222,400ユーロ)
	FTSE	434,235,361 (3,435,950英ポンド)	( )	445,982,382 (3,528,900英ポンド)	11,747,021 (92,950英ポンド)
	買建 合計	3,565,288,880		3,663,093,645	97,804,765

## (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

（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	1,174,441,087	-	1,183,832,927	9,391,840
	カナダドル	111,410,188	-	112,875,773	1,465,585
	ユーロ	265,674,693	-	269,629,429	3,954,736
	英ポンド	217,286,124	-	219,908,600	2,622,476
	スイスフラン	79,834,273	-	80,868,716	1,034,443
	スウェーデンクローナ	28,673,131	-	29,095,405	422,274
	ノルウェークローネ	5,623,818	-	5,727,019	103,201
	デンマーククローネ	5,653,206	-	5,738,780	85,574
	オーストラリアドル	84,789,886	-	85,788,471	998,585
	香港ドル	26,782,576	-	27,019,357	236,781
	シンガポールドル	16,780,539	-	17,048,471	267,932
	イスラエルシェケル	12,279,634	-	12,455,058	175,424
	買建				
	米ドル	473,814,000	-	477,600,000	3,786,000
	ユーロ	82,925,600	-	84,160,000	1,234,400
	英ポンド	62,431,500	-	63,185,000	753,500
	スイスフラン	30,063,950	-	30,453,500	389,550
	オーストラリアドル	33,964,000	-	34,364,000	400,000
香港ドル	10,180,000	-	10,270,000	90,000	
	売建 合計	2,029,229,155	-	2,049,988,006	20,758,851
	買建 合計	693,379,050	-	700,032,500	6,653,450

（注）時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

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

2. 計算期間末日において対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客相場の仲値で評価しています。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

## （関連当事者との取引に関する注記）

（自 平成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。

（自 平成23年2月19日 至 平成24年2月20日）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

（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

(平成24年2月20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	180,122,951,127円
同期中における追加設定元本額	28,920,060,614円
同期中における一部解約元本額	31,042,627,869円
平成24年2月20日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	4,236,473,092円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	201,735,484円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	839,882,052円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	510,736,718円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	14,199,336円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	2,063,674円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	2,704,768円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	3,114,633円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	3,793,588円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	1,054,550円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	2,756,625円
外国株式指数ファンド	230,560,619円
三井住友・DC全海外株式インデックスファンド	613,025円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	35,736,141,528円
バランスファンドVA(安定運用型)<適格機関投資家限定>	313,495,983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>	21,963,652,194円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	9,895,864,895円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	5,706,696,885円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	22,373,014,180円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	80,400,469円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	322,781,100円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	59,822,343円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	2,406,318,318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>	163,924,351円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	611,095,849円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,770,113,671円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	4,249,612,127円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	6,974,175,299円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,132,219,174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)	3,086,255,584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)	9,424,835,931円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	589,564,292円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	2,529,697,065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)	40,084,210,891円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	95,428,507円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	57,200,153円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	21,219,854円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	244,682,281円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	542,121,588円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	487,904,056円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定>	17,626,643円
SMAM・FGグローバルバランス25VA<適格機関投資家限定>	10,620,497円
合計	178,000,383,872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	29,580	20.11	594,853.80	
ANADARKO PETROLEUM CORP	63,883	88.05	5,624,898.15	
APACHE CORPORATION	49,054	109.45	5,368,960.30	
ARCH COAL INC	29,777	14.19	422,535.63	
BAKER HUGHES INC	56,352	50.06	2,820,981.12	
CABOT OIL & GAS CORPORATION	27,200	36.64	996,608.00	
CAMERON INTERNATIONAL CORP	30,853	56.09	1,730,544.77	
CHESAPEAKE ENERGY CORPORATION	83,523	24.71	2,063,853.33	
CHEVRON CORPORATION	255,935	106.66	27,298,027.10	
CIMAREX ENERGY CO	10,950	82.78	906,441.00	
CONCHO RESOURCES INC	12,800	114.75	1,468,800.00	
CONOCOPHILLIPS	166,590	73.36	12,221,042.40	
CONSOL ENERGY INC	29,962	37.26	1,116,384.12	
CONTINENTAL RESOURCES, INC.	6,000	89.47	536,820.00	
DENBURY RESOURCES INC	51,246	19.56	1,002,371.76	
DEVON ENERGY CORPORATION	50,834	74.95	3,810,008.30	
DIAMOND OFFSHORE DRILLING, INC.	9,256	64.78	599,603.68	
EL PASO CORPORATION	98,718	27.16	2,681,180.88	
EOG RESOURCES INC	34,155	114.35	3,905,624.25	
EXXON MOBIL CORPORATION	621,346	85.62	53,199,644.52	
FMC TECHNOLOGIES INC	31,090	51.38	1,597,404.20	
HALLIBURTON CO	117,238	36.29	4,254,567.02	
HELMERICH & PAYNE INC	13,700	63.28	866,936.00	
HESS CORPORATION	38,715	65.15	2,522,282.25	
HOLLYFRONTIER CORP	25,700	33.21	853,497.00	
KINDER MORGAN INC	15,000	32.23	483,450.00	
KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	11,293	79.91	902,423.63	
MARATHON OIL CORP	90,181	33.77	3,045,412.37	
MARATHON PETROLEUM CORPORATION	46,189	43.44	2,006,450.16	
MURPHY OIL CORPORATION	23,097	62.69	1,447,950.93	
NABORS INDUSTRIES LTD	36,184	20.80	752,627.20	
NATIONAL-OILWELL VARCO INC.	54,095	83.80	4,533,161.00	
NEWFIELD EXPLORATION CO	17,287	42.00	726,054.00	
NOBLE CORPORATION	33,018	38.36	1,266,570.48	
NOBLE ENERGY INC	22,859	104.01	2,377,564.59	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	103,793	103.92	10,786,168.56	
PEABODY ENERGY CORP	34,953	36.14	1,263,201.42	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	13,575	113.67	1,543,070.25	
PLAINS EXPLORATION & PRODUCTION COMPANY	17,700	44.51	787,827.00	

RANGE RESOURCES CORPORATION	19,982	65.72	1,313,217.04	
ROWAN COMPANIES INC	15,345	37.27	571,908.15	
SCHLUMBERGER LTD	172,441	77.74	13,405,563.34	
SOUTHWESTERN ENERGY COMPANY	44,861	35.54	1,594,359.94	
SPECTRA ENERGY CORPORATION	82,063	30.95	2,539,849.85	
SUNOCO INC	14,694	39.94	586,878.36	
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	20,000	29.04	580,800.00	
ULTRA PETROLEUM CORP	19,748	23.92	472,372.16	
VALERO ENERGY CORP	74,221	24.99	1,854,782.79	
WEATHERFORD INTL LTD	98,286	17.79	1,748,507.94	
WHITING PETROLEUM CORP	14,600	55.16	805,336.00	
WILLIAMS COS INC	75,347	29.11	2,193,351.17	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	27,249	92.06	2,508,542.94	
AIRGAS INC	8,900	80.65	717,785.00	
ALCOA INC	138,599	10.15	1,406,779.85	
ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	13,580	45.39	616,396.20	
BALL CORPORATION	20,906	40.11	838,539.66	
CELANESE CORPORATION	19,423	51.93	1,008,636.39	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	9,158	178.84	1,637,816.72	
CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	18,955	66.72	1,264,677.60	
CROWN HOLDINGS INC	19,100	36.82	703,262.00	
DOW CHEMICAL	149,756	35.00	5,241,460.00	
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	119,060	51.48	6,129,208.80	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	17,854	54.61	975,006.94	
ECOLAB INC	38,141	61.85	2,359,020.85	
FMC CORPORATION	9,300	96.62	898,566.00	
FREEMPORT-MCMORAN COPPER-B	121,746	43.04	5,239,947.84	
INTERNATIONAL PAPER CO	53,938	33.46	1,804,765.48	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	10,692	56.66	605,808.72	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	36,400	43.98	1,600,872.00	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,943	89.37	531,125.91	
MEADWESTVACO CORP	21,015	30.70	645,160.50	
MONSANTO CO	68,526	79.34	5,436,852.84	
MOSAIC CO/THE	38,364	55.63	2,134,189.32	
NEWMONT MINING CORP	62,523	59.45	3,716,992.35	
NUCOR CORP	41,009	43.91	1,800,705.19	
OWENS-ILLINOIS INC	19,739	24.05	474,722.95	
PPG INDUSTRIES INC	20,458	92.12	1,884,590.96	
PRAXAIR INC	38,648	110.00	4,251,280.00	
ROCK-TENN COMPANY CL A	8,500	67.86	576,810.00	
SEALED AIR CORP	21,938	21.04	461,575.52	
SIGMA-ALDRICH	15,756	71.96	1,133,801.76	
UNITED STATES STEEL CORPORATION	17,409	28.41	494,589.69	
VULCAN MATERIALS CO	17,253	47.68	822,623.04	
WALTER ENERGY INC	8,300	65.51	543,733.00	
WEYERHAEUSER CO	67,393	20.65	1,391,665.45	



3M COMPANY	86,058	87.56	7,535,238.48	
AGCO CORP	11,954	51.37	614,076.98	
AMETEK INC	20,740	48.73	1,010,660.20	
BOEING CO	89,763	75.35	6,763,642.05	
CATERPILLAR INC	82,510	113.95	9,402,014.50	
COOPER INDUSTRIES PLC-CL-A	21,657	60.63	1,313,063.91	
CUMMINS INC	23,628	122.07	2,884,269.96	
DANAHER CORP	74,125	52.43	3,886,373.75	
DEERE & CO	53,233	83.87	4,464,651.71	
DOVER CORP	23,474	66.09	1,551,396.66	
EATON CORP	42,078	50.82	2,138,403.96	
EMERSON ELECTRIC CO	95,007	51.50	4,892,860.50	
FASTENAL COMPANY	35,036	50.73	1,777,376.28	
FIRST SOLAR,INC.	7,420	42.59	316,017.80	
FLOWERVE CORPORATION	6,969	118.56	826,244.64	
FLUOR CORP	22,201	61.00	1,354,261.00	
GENERAL DYNAMICS CORP	39,817	70.88	2,822,228.96	
GENERAL ELECTRIC CO	1,354,845	19.28	26,121,411.60	
GOODRICH CORPORATION	15,756	125.70	1,980,529.20	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	95,244	60.10	5,724,164.40	
ILLINOIS TOOL WORKS	55,948	56.19	3,143,718.12	
INGERSOLL-RAND PLC	41,779	40.92	1,709,596.68	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	16,090	45.55	732,899.50	
JOY GLOBAL INC	13,780	88.22	1,215,671.60	
KBR,INC.	18,685	33.16	619,594.60	
L-3 COMMUNICATIONS HLDGS INC	13,910	70.95	986,914.50	
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	36,113	87.99	3,177,582.87	
MASCO CORP	44,766	12.10	541,668.60	
NORTHROP GRUMMAN CORP	33,413	60.08	2,007,453.04	
PACCAR INC	42,824	46.18	1,977,612.32	
PALL CORPORATION	14,776	63.66	940,640.16	
PARKER HANNIFIN CORPORATIOM	20,040	88.57	1,774,942.80	
PENTAIR INC	11,850	39.13	463,690.50	
PRECISION CASTPARTS CORP	18,167	167.51	3,043,154.17	
QUANTA SERVICES INC	26,059	21.74	566,522.66	
RAYTHEON COMPANY	45,077	49.86	2,247,539.22	
ROCKWELL AUTOMATION INC	18,698	82.30	1,538,845.40	
ROCKWELL COLLINS INC.	19,844	59.45	1,179,725.80	
ROPER INDUSTRIES INC	12,400	94.66	1,173,784.00	
SPX CORP	6,068	77.23	468,631.64	
TEXTRON INC	34,818	27.95	973,163.10	
TYCO INTERNATIONAL LTD	60,610	49.95	3,027,469.50	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	110,407	83.78	9,249,898.46	
URS CORPORATION	9,300	42.91	399,063.00	
WW GRAINGER INC	7,530	208.88	1,572,866.40	
XYLEM INC	21,566	27.59	595,005.94	

AVERY DENNISON CORP	13,362	30.24	404,066.88	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3,960	384.70	1,523,412.00	
CINTAS CORP	14,713	38.60	567,921.80	
DUN & BRADSTREET CORP	6,001	78.71	472,338.71	
EQUIFAX INC	15,742	42.63	671,081.46	
IHS INC-CLASS A	5,400	91.04	491,616.00	
IRON MOUNTAIN INC	24,522	30.93	758,465.46	
MANPOWERGROUP	10,992	45.13	496,068.96	
NETFLIX INC	6,598	121.85	803,966.30	
NIELSEN HOLDINGS NV	12,400	28.28	350,672.00	
PITNEY BOWES INC	25,773	17.80	458,759.40	
REPUBLIC SERVICES INC	38,294	29.60	1,133,502.40	
ROBERT HALF INTL INC	17,591	29.17	513,129.47	
RR DONNELLEY & SONS CO	25,698	13.23	339,984.54	
STERICYCLE,INC.	10,121	88.05	891,154.05	
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	16,100	41.28	664,608.00	
WASTE MANAGEMENT INC	56,428	34.61	1,952,973.08	
C.H.ROBINSON WORLDWIDE,INC.	21,522	66.11	1,422,819.42	
CSX CORPORATION	139,436	21.59	3,010,423.24	
DELTA AIR LINES INC	29,020	10.83	314,286.60	
EXPEDITORS INTL WASH INC	26,978	44.32	1,195,664.96	
FEDEX CORP	38,104	92.99	3,543,290.96	
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	35,175	13.85	487,173.75	
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	12,900	51.76	667,704.00	
KANSAS CITY SOUTHERN	14,500	66.24	960,480.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	44,857	68.81	3,086,610.17	
SOUTHWEST AIRLINES	24,000	9.43	226,320.00	
UNION PACIFIC CORP	62,391	110.99	6,924,777.09	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	11,000	23.37	257,070.00	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	94,038	76.76	7,218,356.88	
AUTOLIV INC	11,200	67.69	758,128.00	
BORGWARNER INC	13,900	81.21	1,128,819.00	
FORD MOTOR COMPANY	449,619	12.75	5,732,642.25	
GENERAL MOTORS CO	99,673	27.34	2,725,059.82	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	31,234	13.42	419,160.28	
HARLEY-DAVIDSON INC	29,586	46.05	1,362,435.30	
JOHNSON CONTROLS INC	87,558	35.16	3,078,539.28	
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	14,000	48.56	679,840.00	
BEAM INC	17,302	56.02	969,258.04	
COACH INC	37,105	75.03	2,783,988.15	
D.R.HORTON INC	35,448	14.33	507,969.84	
FOSSIL INC	6,970	118.19	823,784.30	
GARMIN LTD	15,016	44.18	663,406.88	
HASBRO INC	14,714	36.18	532,352.52	
LEGGETT & PLATT INC	17,715	21.95	388,844.25	
LULULEMON ATHLETICA INC	12,480	65.01	811,324.80	

MATTEL INC	45,193	32.44	1,466,060.92
MOHAWK INDUSTRIES INC	7,383	66.79	493,110.57
NEWELL RUBBERMAID INC	39,644	19.26	763,543.44
NIKE INC -CL B	45,907	106.68	4,897,358.76
RALPH LAUREN CORPORATION	7,958	174.47	1,388,432.26
STANLEY BLACK & DECKER INC	20,761	75.36	1,564,548.96
TOLL BROTHERS INC	20,739	23.96	496,906.44
VF CORP	11,025	147.05	1,621,226.25
WHIRLPOOL CORP	9,084	71.03	645,236.52
APOLLO GROUP INC-CL A	15,823	52.75	834,663.25
CARNIVAL CORP	59,188	30.97	1,833,052.36
DARDEN RESTAURANTS INC	16,540	50.90	841,886.00
DEVRY INC	8,300	37.67	312,661.00
H&R BLOCK INC	37,392	16.20	605,750.40
INTL GAME TECHNOLOGY	38,160	14.78	564,004.80
LAS VEGAS SANDS CORP	47,313	52.79	2,497,653.27
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	35,947	34.93	1,255,628.71
MCDONALD'S CORPORATION	131,860	99.99	13,184,681.40
MGM MIRAGE	43,400	14.66	636,244.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	18,071	30.81	556,767.51
STARBUCKS CORP	95,046	48.45	4,604,978.70
STARWOOD HOTELS & RESORTS	24,280	55.06	1,336,856.80
WYNN RESORTS LTD	10,764	112.69	1,212,995.16
YUM! BRANDS INC	58,742	65.25	3,832,915.50
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	23,920	15.37	367,650.40
CBS CORP-CL B	78,693	29.59	2,328,525.87
COMCAST CORP-CL A	266,755	29.17	7,781,243.35
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	84,091	28.39	2,387,343.49
DIRECTV-CLASS A	94,955	44.98	4,271,075.90
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-A	18,430	45.22	833,404.60
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-C	16,530	41.53	686,490.90
DISH NETWORK CORP.	25,664	29.02	744,769.28
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	63,525	10.83	687,975.75
LIBERTY GLOBAL INC-A	17,640	49.32	870,004.80
LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	14,963	46.76	699,669.88
LIBERTY MEDIA CORP-CAPITAL	13,600	87.37	1,188,232.00
MCGRAW-HILL COMPANIES INC	38,227	45.97	1,757,295.19
NEWS CORP-CL A	232,405	19.60	4,555,138.00
NEWS CORPORATION-CLASS B	55,931	20.25	1,132,602.75
OMNICOM GROUP	35,769	48.42	1,731,934.98
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	11,100	43.99	488,289.00
SIRIUS XM RADIO INC	495,000	2.14	1,061,775.00
THE WALT DISNEY CO.	225,138	41.75	9,399,511.50
TIME WARNER CABLE,INC.	41,977	77.66	3,259,933.82
TIME WARNER INC	133,247	37.70	5,023,411.90
VIACOM INC-CLASS B	67,259	48.69	3,274,840.71

VIRGIN MEDIA INC	37,177	25.44	945,782.88	
WASHINGTON POST CO B	667	395.39	263,725.13	
ABERCROMBIE & FITCH CO -CL A	11,471	48.48	556,114.08	
ADVANCE AUTO PARTS	9,088	85.57	777,660.16	
AMAZON.COM INC	46,367	182.50	8,461,977.50	
AUTOZONE INC	3,248	360.21	1,169,962.08	
BED BATH & BEYOND INC	32,307	59.47	1,921,297.29	
BEST BUY COMPANY INC	39,516	25.71	1,015,956.36	
CARMAX INC	28,422	30.18	857,775.96	
DOLLAR GENERAL CORP	20,600	42.38	873,028.00	
DOLLAR TREE INC	15,750	89.35	1,407,262.50	
EXPEDIA INC	13,091	33.07	432,919.37	
FAMILY DOLLAR STORES	15,636	54.88	858,103.68	
GAMESTOP CORP-CL A	18,347	23.18	425,283.46	
GAP INC/THE	49,905	22.72	1,133,841.60	
GENUINE PARTS CO	20,084	65.58	1,317,108.72	
HOME DEPOT INC	199,973	46.71	9,340,738.83	
J.C.PENNEY CO INC (HLDG CO)	21,097	42.68	900,419.96	
KOHL'S CORP	33,425	51.80	1,731,415.00	
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION	74,772	18.03	1,348,139.16	
LIMITED BRANDS	32,673	46.50	1,519,294.50	
LOWE'S COMPANIES INC	161,437	27.68	4,468,576.16	
MACY'S INC	55,376	36.25	2,007,380.00	
NORDSTROM INC	21,935	51.14	1,121,755.90	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC NEW	17,040	84.55	1,440,732.00	
PETSMART INC	15,091	54.90	828,495.90	
PRICELINE.COM INC	6,414	582.52	3,736,283.28	
ROSS STORES INC	30,672	51.83	1,589,729.76	
SEARS HOLDINGS CORP	5,310	54.53	289,554.30	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	11,360	100.32	1,139,635.20	
STAPLES INC	91,876	15.15	1,391,921.40	
TARGET CORP	81,838	52.64	4,307,952.32	
TIFFANY & CO	15,007	66.28	994,663.96	
TJX COMPANIES INC	96,450	34.87	3,363,211.50	
URBAN OUTFITTERS,INC.	16,700	28.48	475,616.00	
COSTCO WHOLESALE CORP	55,507	84.47	4,688,676.29	
CVS CAREMARK CORPORATION	171,231	44.27	7,580,396.37	
KROGER CO	71,987	23.92	1,721,929.04	
SAFEWAY INC	45,149	22.95	1,036,169.55	
SYSCO CORP	76,699	29.47	2,260,319.53	
WAL-MART STORES INC	242,228	62.48	15,134,405.44	
WALGREEN CO	114,482	34.71	3,973,670.22	
WHOLE FOODS MARKET INC	19,400	81.20	1,575,280.00	
ALTRIA GROUP INC	263,793	29.65	7,821,462.45	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	86,703	31.35	2,718,139.05	
BROWN-FORMAN CORPORATION	11,115	81.22	902,760.30	

BUNGE LIMITED	19,010	66.56	1,265,305.60	
CAMPBELL SOUP CO	25,679	32.90	844,839.10	
COCA-COLA CO/THE	263,987	69.05	18,228,302.35	
COCA-COLA ENTERPRISES INC	41,304	29.00	1,197,816.00	
CONAGRA FOODS INC	51,933	26.48	1,375,185.84	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	24,323	22.22	540,457.06	
DR.PEPPER SNAPPLE GROUP,INC	27,987	39.55	1,106,885.85	
GENERAL MILLS INC	81,676	38.34	3,131,457.84	
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTERS, INC.	16,550	69.01	1,142,115.50	
HJ HEINZ CO	41,053	54.47	2,236,156.91	
HORMEL FOODS CORPORATION	19,800	29.18	577,764.00	
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	14,500	73.07	1,059,515.00	
KELLOGG CO	33,028	52.53	1,734,960.84	
KRAFT FOODS INC-A	214,116	38.01	8,138,549.16	
LORILLARD INC	17,635	127.05	2,240,526.75	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	14,830	50.78	753,067.40	
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	25,852	75.51	1,952,084.52	
MOLSON COORS BREWING COMPANY	20,025	45.43	909,735.75	
MONSTER BEVERAGE CORPORATION	9,700	53.20	516,040.00	
MONSTER BEVERAGE CORPORATION-NEW	9,700	53.20	516,040.00	
PEPSICO INC	202,367	62.68	12,684,363.56	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	224,515	81.74	18,351,856.10	
RALCORP HOLDINGS INC	7,350	74.79	549,706.50	
REYNOLDS AMERICAN INC	45,263	40.89	1,850,804.07	
SARA LEE CORP	70,911	20.29	1,438,784.19	
THE HERSHEY COMPANY	21,810	60.86	1,327,356.60	
TYSON FOODS INC-CL A	36,800	18.99	698,832.00	
AVON PRODUCTS INC	54,190	19.19	1,039,906.10	
CHURCH & DWIGHT CO INC	18,470	47.28	873,261.60	
CLOROX COMPANY	17,061	68.49	1,168,507.89	
COLGATE-PALMOLIVE CO	62,454	93.25	5,823,835.50	
ENERGIZER HOLDINGS INC	9,227	78.15	721,090.05	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	30,528	56.04	1,710,789.12	
HERBALIFE LTD	15,500	60.61	939,455.00	
KIMBERLY-CLARK CORP	50,455	71.57	3,611,064.35	
PROCTER & GAMBLE CO	351,125	64.91	22,791,523.75	
AETNA INC	46,762	47.08	2,201,554.96	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	23,964	81.00	1,941,084.00	
AMERISOURCEBERGEN CORP	35,218	36.68	1,291,796.24	
BARD(C.R.) INC	10,740	95.53	1,025,992.20	
BAXTER INTERNATIONAL INC	72,916	56.97	4,154,024.52	
BECTON DICKINSON & CO	28,158	77.40	2,179,429.20	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	194,125	6.09	1,182,221.25	
CARDINAL HEALTH INC	43,997	41.52	1,826,755.44	
CAREFUSION CORPORATION	29,745	26.05	774,857.25	
CERNER CORP	18,460	70.99	1,310,475.40	

CIGNA CORP	36,852	44.93	1,655,760.36	
COVENTRY HEALTH CARE INC	17,913	32.91	589,516.83	
COVIDIEN PLC	62,917	52.30	3,290,559.10	
DAVITA INC	11,978	85.72	1,026,754.16	
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	18,359	39.05	716,918.95	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	14,210	75.61	1,074,418.10	
EXPRESS SCRIPTS INC	58,547	52.18	3,054,982.46	
HCA HOLDINGS, INC.	21,300	25.08	534,204.00	
HENRY SCHEIN INC	12,250	74.79	916,177.50	
HOLOGIC INC	35,380	21.45	758,901.00	
HOSPIRA INC	21,533	37.15	799,950.95	
HUMANA INC.	21,093	88.61	1,869,050.73	
INTUITIVE SURGICAL INC	5,055	505.99	2,557,779.45	
LABORATORY CRP OF AMR HLDGS	12,783	87.94	1,124,137.02	
MCKESSON CORP	31,454	82.57	2,597,156.78	
MEDCO HEALTH SOLUTIONS INC	48,598	64.01	3,110,757.98	
MEDTRONIC INC	135,940	39.94	5,429,443.60	
OMNICARE INC	14,795	34.74	513,978.30	
PATTERSON COS INC	12,732	33.04	420,665.28	
QUEST DIAGNOSTICS	19,666	57.29	1,126,665.14	
ST JUDE MEDICAL INC	41,877	43.08	1,804,061.16	
STRYKER CORP	37,621	53.60	2,016,485.60	
UNITEDHEALTH GROUP INC	137,261	54.68	7,505,431.48	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	15,067	66.44	1,001,051.48	
WELLPOINT INC	45,479	66.05	3,003,887.95	
ZIMMER HOLDINGS INC	24,203	61.53	1,489,210.59	
ABBOTT LABORATORIES	198,982	56.36	11,214,625.52	
ALLERGAN INC	39,370	87.91	3,461,016.70	
AMGEN INC	101,369	67.78	6,870,790.82	
BIOGEN IDEC INC	29,244	116.45	3,405,463.80	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	217,753	33.12	7,211,979.36	
CELGENE CORP	58,462	74.66	4,364,772.92	
COVANCE INC	8,460	48.10	406,926.00	
ELI LILLY & CO	132,878	39.26	5,216,790.28	
FOREST LABORATORIES,INC.	35,330	32.03	1,131,619.90	
GILEAD SCIENCES INC	99,138	47.00	4,659,486.00	
ILLUMINA INC	15,289	51.82	792,275.98	
JOHNSON & JOHNSON	350,298	64.99	22,765,867.02	
LIFE TECHNOLOGIES CORPORATION	23,277	45.92	1,068,879.84	
MERCK & CO. INC.	393,622	38.56	15,178,064.32	
MYLAN INC	56,000	23.42	1,311,520.00	
PERRIGO CO	11,000	94.90	1,043,900.00	
PFIZER INC	996,601	21.19	21,117,975.19	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	49,212	56.38	2,774,572.56	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	25,608	39.24	1,004,857.92	
WARNER CHILCOTT PLC	20,000	17.00	340,000.00	

WATERS CORP	11,421	88.63	1,012,243.23	
WATSON PHARMACEUTICALS INC	17,200	60.18	1,035,096.00	
BB & T CORPORATION	90,107	30.33	2,732,945.31	
COMERICA INC	25,750	31.15	802,112.50	
FIFTH THIRD BANCORP	117,338	13.80	1,619,264.40	
HUDSON CITY BANCORP INC	59,969	7.01	420,382.69	
KEYCORP	124,915	8.12	1,014,309.80	
M & T BANK CORP	14,578	82.92	1,208,807.76	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	58,068	12.95	751,980.60	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	45,000	12.78	575,100.00	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	66,705	61.14	4,078,343.70	
REGIONS FINANCIAL CORPORATION	159,522	6.00	957,132.00	
SUNTRUST BANKS INC	67,837	22.69	1,539,221.53	
US BANCORP	245,212	29.35	7,196,972.20	
WELLS FARGO & COMPANY	641,019	31.09	19,929,280.71	
AMERICAN EXPRESS COMPANY	137,018	52.86	7,242,771.48	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	30,857	56.54	1,744,654.78	
BANK OF AMERICA CORP	1,295,118	8.02	10,386,846.36	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP(THE)	155,997	22.01	3,433,493.97	
BLACKROCK INC	12,125	196.19	2,378,803.75	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	59,022	48.83	2,882,044.26	
CIT GROUP INC	23,700	41.33	979,521.00	
CITIGROUP INC	372,641	32.92	12,267,341.72	
CME GROUP INC.	8,067	293.98	2,371,536.66	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	70,181	29.54	2,073,146.74	
EATON VANCE CORP	15,000	27.96	419,400.00	
FRANKLIN RESOURCES INC	19,794	117.04	2,316,689.76	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	61,288	115.91	7,103,892.08	
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	9,678	134.47	1,301,400.66	
INVESCO LIMITED	58,439	24.70	1,443,443.30	
JPMORGAN CHASE & CO	497,985	38.47	19,157,482.95	
LEGG MASON INC	18,803	27.32	513,697.96	
LEUCADIA NATIONAL CORPORATION	27,584	29.36	809,866.24	
MOODY'S CORP	27,468	38.53	1,058,342.04	
MORGAN STANLEY	184,194	19.16	3,529,157.04	
NASDAQ STOCK MARKET INC	16,080	26.81	431,104.80	
NORTHERN TRUST CORP	27,605	43.88	1,211,307.40	
NYSE EURONEXT	34,729	29.46	1,023,116.34	
SCHWAB (CHARLES) CORP	135,590	12.87	1,745,043.30	
SEI INVESTMENTS COMPANY	17,324	19.79	342,841.96	
SLM CORPORATION	67,361	16.14	1,087,206.54	
STATE STREET CORP	63,521	40.25	2,556,720.25	
T ROWE PRICE GROUP INC	32,916	62.91	2,070,745.56	
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	28,894	17.53	506,511.82	
ACE LIMITED	43,426	73.58	3,195,285.08	
AFLAC INC	60,014	48.01	2,881,272.14	

ALLSTATE CORP	64,894	31.39	2,037,022.66	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	60,257	27.23	1,640,798.11	
AON CORPORATION	36,799	47.62	1,752,368.38	
ARCH CAPITAL GROUP LTD.	17,100	37.56	642,276.00	
ASSURANT INC	13,289	44.03	585,114.67	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	14,503	32.66	473,667.98	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	115,803	79.42	9,197,074.26	
CHUBB CORP	36,917	69.09	2,550,595.53	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	20,026	35.72	715,328.72	
EVEREST RE GROUP LTD	7,003	90.00	630,270.00	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL INC-CL A	28,761	17.55	504,755.55	
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	60,800	9.22	560,576.00	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	55,186	21.65	1,194,776.90	
LINCOLN NATIONAL CORP	39,427	25.56	1,007,754.12	
LOEWS CORPORATION	41,588	38.30	1,592,820.40	
MARSH & MCLENNAN COS	68,792	32.22	2,216,478.24	
METLIFE INC	135,297	38.86	5,257,641.42	
PARTNERRE LTD	8,143	65.90	536,623.70	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	40,428	27.40	1,107,727.20	
PROGRESSIVE CORP	76,283	21.44	1,635,507.52	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	62,349	61.39	3,827,605.11	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	6,763	72.93	493,225.59	
TORCHMARK CORPORATION	13,308	48.72	648,365.76	
TRAVELERS COS INC(THE)	52,906	59.85	3,166,424.10	
UNUM GROUP	38,570	23.08	890,195.60	
W.R.BERKLEY CORPORATION	14,384	36.45	524,296.80	
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	20,098	34.10	685,341.80	
XL GROUP PLC	38,800	19.94	773,672.00	
CBRE GROUP INC-A	36,200	19.07	690,334.00	
ACCENTURE PLC-CL A	82,474	58.43	4,818,955.82	
ACTIVISION BLIZZARD INC	63,020	12.23	770,734.60	
ADOBE SYSTEMS INC	63,196	32.75	2,069,669.00	
AKAMAI TECHNOLOGIES	24,306	37.80	918,766.80	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	6,660	119.62	796,669.20	
AUTODESK INC	28,534	38.91	1,110,257.94	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	62,360	54.25	3,383,030.00	
BMC SOFTWARE INC	21,678	39.27	851,295.06	
CA INC	51,513	26.98	1,389,820.74	
CITRIX SYSTEMS INC	24,318	74.77	1,818,256.86	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATION	39,001	71.08	2,772,191.08	
COMPUTER SCIENCES CORP	20,262	33.08	670,266.96	
EBAY INC	148,564	35.06	5,208,653.84	
ELECTRONIC ARTS INC	42,481	17.47	742,143.07	
F5 NETWORKS INC	10,431	124.92	1,303,040.52	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	31,212	30.70	958,208.40	
FISERV INC	18,385	65.11	1,197,047.35	



GOOGLE INC-CL A	32,477	604.64	19,636,893.28	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	152,556	193.42	29,507,381.52	
INTUIT INC	36,241	57.38	2,079,508.58	
MASTERCARD INC-CL A	13,849	396.00	5,484,204.00	
MICROSOFT CORP	963,565	31.25	30,111,406.25	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	31,300	26.51	829,763.00	
ORACLE CORPORATION	516,957	28.79	14,883,192.03	
PAYCHEX INC	41,544	31.48	1,307,805.12	
RED HAT INC	24,100	48.61	1,171,501.00	
SAIC INC	37,400	12.97	485,078.00	
SALESFORCE.COM,INC.	16,061	129.17	2,074,599.37	
SYMANTEC CORPORATION	93,414	17.95	1,676,781.30	
SYNOPSYS INC	19,084	30.35	579,199.40	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	21,919	21.64	474,327.16	
VERISIGN INC	20,118	37.18	747,987.24	
VISA INC	67,020	115.01	7,707,970.20	
VMWARE INC	10,900	99.11	1,080,299.00	
WESTERN UNION COMPANY	81,813	17.97	1,470,179.61	
YAHOO! INC	153,808	15.01	2,308,658.08	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	44,636	43.14	1,925,597.04	
AMPHENOL CORPORATION -CL A	21,478	56.31	1,209,426.18	
APPLE INC	118,454	502.12	59,478,122.48	
ARROW ELECTRONICS INC	14,290	40.14	573,600.60	
AVAGO TECHNOLOGIES LTD.	29,100	35.24	1,025,484.00	
AVNET INC	18,900	35.77	676,053.00	
CISCO SYSTEMS INC	702,595	20.29	14,255,652.55	
CORNING INC	199,750	13.84	2,764,540.00	
DELL INC	209,151	18.16	3,798,182.16	
DOLBY LABORATORIES INC-CL A	5,800	39.32	228,056.00	
EMC CORP/MASS	263,067	27.10	7,129,115.70	
FLEXTRONICS INTL LTD	89,331	6.93	619,063.83	
FLIR SYSTEMS INC	21,640	25.60	553,984.00	
HARRIS CORP	15,050	42.66	642,033.00	
HEWLETT-PACKARD CO	264,534	29.59	7,827,561.06	
JUNIPER NETWORKS INC	69,327	24.20	1,677,713.40	
MOTOROLA MOBILITY HOLDINGS INC	35,697	39.70	1,417,170.90	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	39,350	50.63	1,992,290.50	
NETAPP INC	46,883	42.20	1,978,462.60	
QUALCOMM INC	214,365	62.52	13,402,099.80	
SANDISK CORP	30,077	47.79	1,437,379.83	
SEAGATE TECHNOLOGY	52,968	26.88	1,423,779.84	
TE CONNECTIVITY LTD	56,268	36.01	2,026,210.68	
TERADATA CORP	21,177	62.63	1,326,315.51	
WESTERN DIGITAL CORP	29,423	40.45	1,190,160.35	
XEROX CORP	179,149	8.30	1,486,936.70	
AT&T INC	757,224	30.01	22,724,292.24	

CENTURYLINK INC	79,755	39.26	3,131,181.30	
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	36,267	51.37	1,863,035.79	
FRONTIER COMMUNICATIONS CORPORATION	133,153	4.78	636,471.34	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	20,666	21.25	439,152.50	
METROPCS COMMUNICATIONS INC.	31,031	10.34	320,860.54	
NII HOLDINGS INC	20,689	24.02	496,949.78	
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	15,000	46.27	694,050.00	
SPRINT NEXTEL CORP	366,323	2.30	842,542.90	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	361,617	38.46	13,907,789.82	
WINDSTREAM CORPORATION	72,600	12.47	905,685.00	
AES CORPORATION	82,766	13.70	1,133,894.20	
ALLIANT ENERGY CORP	14,548	43.13	627,455.24	
AMEREN CORPORATION	31,924	31.90	1,018,375.60	
AMERICAN ELECTRIC POWER	61,851	39.73	2,457,340.23	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	22,000	33.82	744,040.00	
CALPINE CORP	43,100	15.35	661,585.00	
CENTERPOINT ENERGY INC	53,209	18.98	1,009,906.82	
CONSOLIDATED EDISON INC	37,632	57.87	2,177,763.84	
CONSTELLATION ENERGY GROUP	23,823	36.40	867,157.20	
DOMINION RESOURCES INC/VA	72,436	50.57	3,663,088.52	
DTE ENERGY COMPANY	21,373	54.30	1,160,553.90	
DUKE ENERGY CORP	171,659	20.90	3,587,673.10	
EDISON INTERNATIONAL	38,785	41.16	1,596,390.60	
ENERGEN CORPORATION	8,800	53.82	473,616.00	
ENTERGY CORP	22,491	67.78	1,524,439.98	
EQT CORPORATION	17,980	52.65	946,647.00	
EXELON CORP	85,362	39.27	3,352,165.74	
FIRSTENERGY CORP	52,876	43.38	2,293,760.88	
INTEGRYS ENERGY GROUP,INC.	9,400	54.58	513,052.00	
MDU RESOURCES GROUP INC	23,500	21.65	508,775.00	
NEXTERA ENERGY INC	51,215	60.22	3,084,167.30	
NISOURCE INC	37,192	23.79	884,797.68	
NORTHEAST UTILITIES	21,900	36.10	790,590.00	
NRG ENERGY INC	32,925	17.50	576,187.50	
NSTAR	13,500	47.10	635,850.00	
ONEOK INC	12,600	82.09	1,034,334.00	
P G & E CORPORATION	50,934	42.34	2,156,545.56	
PEPCO HOLDINGS INC	28,234	20.14	568,632.76	
PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	13,344	47.86	638,643.84	
PPL CORPORATION	73,962	28.47	2,105,698.14	
PROGRESS ENERGY INC	38,718	53.01	2,052,441.18	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	63,597	31.33	1,992,494.01	
QEP RESOURCES INC	22,366	32.53	727,565.98	
SCANA CORP	14,963	44.85	671,090.55	
SEMPRA ENERGY	29,054	58.32	1,694,429.28	
SOUTHERN CO	109,703	44.38	4,868,619.14	

WISCONSIN ENERGY CORP	30,232	34.38	1,039,376.16	
XCEL ENERGY INC	61,635	26.36	1,624,698.60	
ADVANCED MICRO DEVICES	73,485	7.42	545,258.70	
ALTERA CORPORATION	41,308	40.07	1,655,211.56	
ANALOG DEVICES	37,501	40.42	1,515,790.42	
APPLIED MATERIALS INC	171,965	12.99	2,233,825.35	
BROADCOM CORP-CL A	62,536	37.66	2,355,105.76	
CREE INC	14,800	30.17	446,516.00	
INTEL CORP	671,039	27.37	18,366,337.43	
KLA-TENCOR CORPORATION	21,524	50.17	1,079,859.08	
LAM RESEARCH CORP	16,564	41.98	695,356.72	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	29,254	34.02	995,221.08	
LSI CORPORATION	68,857	8.28	570,135.96	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	67,474	16.37	1,104,549.38	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	39,400	28.23	1,112,262.00	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	24,708	37.17	918,396.36	
MICRON TECHNOLOGY INC	115,682	8.43	975,199.26	
NVIDIA CORP	75,494	15.85	1,196,579.90	
TEXAS INSTRUMENTS INC	147,921	33.59	4,968,666.39	
XILINX INC	34,153	37.27	1,273,053.07	
米ドル 小計	38,667,573		1,606,631,687.11	
(邦貨換算額)			(127,903,948,610)	(単位：円)
カナダドル				
ARC RESOURCES LTD	37,900	24.79	939,541.00	
ATHABASCA OIL SANDS CORP	35,800	11.90	426,020.00	
BAYTEX ENERGY CORPORATION	15,707	58.01	911,163.07	
BONAVISTA ENERGY CORPORATION	17,500	22.83	399,525.00	
CAMECO CORP	49,343	23.93	1,180,777.99	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	139,219	37.38	5,204,006.22	
CANADIAN OIL SANDS LTD	63,742	23.05	1,469,253.10	
CENOVUS ENERGY INC	97,133	38.73	3,761,961.09	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	32,345	45.59	1,474,608.55	
ENBRIDGE INC	93,962	37.58	3,531,091.96	
ENCANA CORP	93,644	19.97	1,870,070.68	
ENERPLUS CORP	24,590	24.11	592,864.90	
HUSKY ENERGY INC	41,542	25.67	1,066,383.14	
IMPERIAL OIL LTD	37,498	48.02	1,800,653.96	
MEG ENERGY CORPORATION	16,400	43.85	719,140.00	
NEXEN INC	67,108	20.20	1,355,581.60	
NIKO RESOURCES LTD	5,880	44.79	263,365.20	
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORPORATION	33,700	27.17	915,629.00	
PEMBINA PIPELINE CORP	22,000	28.79	633,380.00	
PENGROWTH ENERGY CORPORATION	50,200	10.05	504,510.00	
PENN WEST PETROLEUM LTD	58,753	21.44	1,259,664.32	
PRECISION DRILLING CORP	26,300	11.73	308,499.00	

PROGRESS ENERGY RESOURCES CORP	20,400	10.89	222,156.00	
SUNCOR ENERGY INC	201,001	34.14	6,862,174.14	
TALISMAN ENERGY INC	131,207	13.60	1,784,415.20	
TOURMALINE OIL CORP	14,700	24.75	363,825.00	
TRANSCANADA CORP	90,592	41.99	3,803,958.08	
VERMILION ENERGY INC	11,400	48.50	552,900.00	
AGNICO-EAGLE MINES	20,950	35.27	738,906.50	
AGRIUM INC	20,073	82.66	1,659,234.18	
BARRICK GOLD CORP	128,108	46.83	5,999,297.64	
CENTERRA GOLD INC	21,000	19.63	412,230.00	
ELDORADO GOLD CORPORATION	71,431	13.49	963,604.19	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	61,210	22.24	1,361,310.40	
FRANCO-NEVADA CORPORATION	17,400	42.07	732,018.00	
GOLDCORP INC	103,411	46.81	4,840,668.91	
IAMGOLD CORP	45,500	16.26	739,830.00	
INMET MINING CORPORATION	6,322	63.92	404,102.24	
IVANHOE MINES LTD	38,466	16.45	632,765.70	
KINROSS GOLD CORP	141,527	10.87	1,538,398.49	
NEW GOLD INC	54,000	11.45	618,300.00	
OSISKO MINING CORPORATION	41,100	11.96	491,556.00	
PAN AMERICAN SILVER CORP	14,272	23.81	339,816.32	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	109,543	45.95	5,033,500.85	
SILVER WHEATON CORPORATION	45,445	35.85	1,629,203.25	
SINO-FOREST CORPORATION-CL A	30,871	0.01	308.71	3
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	74,105	38.30	2,838,221.50	
YAMANA GOLD INC	96,090	16.40	1,575,876.00	
BOMBARDIER INC 'B'	184,759	4.58	846,196.22	
CAE INC	32,614	10.46	341,142.44	
FINNING INTERNATIONAL INC	22,295	28.63	638,305.85	
SNC-LAVALIN GROUP INC	18,681	49.72	928,819.32	
RITCHIE BROS. AUCTIONEERS	12,400	25.31	313,844.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	57,604	76.48	4,405,553.92	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	21,451	73.86	1,584,370.86	
MAGNA INTERNATIONAL INC	28,186	44.49	1,253,995.14	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	16,000	25.31	404,960.00	
TIM HORTONS INC	20,250	50.36	1,019,790.00	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	47,271	20.00	945,420.00	
THOMSON REUTERS CORP	47,978	26.99	1,294,926.22	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	10,078	65.05	655,573.90	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B	16,200	30.31	491,022.00	
EMPIRE CO LTD A	3,300	56.25	185,625.00	
LOBLAW COMPANIES LTD	14,553	36.59	532,494.27	
METRO INC	12,650	52.08	658,812.00	
SHOPPERS DRUG MART CORP	27,260	40.50	1,104,030.00	
WESTON (GEORGE) LTD	6,480	64.36	417,052.80	
SAPUTO INC	18,840	40.90	770,556.00	

VITERRA INC	45,700	10.17	464,769.00	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	36,314	47.13	1,711,478.82	
BANK OF MONTREAL	81,433	58.15	4,735,328.95	
BANK OF NOVA SCOTIA	138,510	53.57	7,419,980.70	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	50,803	76.75	3,899,130.25	
NATIONAL BANK OF CANADA	20,937	76.39	1,599,377.43	
ROYAL BANK OF CANADA	183,629	53.14	9,758,045.06	
TORONTO-DOMINION BANK	113,408	78.54	8,907,064.32	
CI FINANCIAL CORP	20,100	21.89	439,989.00	
IGM FINANCIAL INC	14,301	45.64	652,697.64	
ONEX CORPORATION	12,723	36.88	469,224.24	
TMX GROUP INC	9,421	42.03	395,964.63	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,522	400.00	1,008,800.00	
GREAT-WEST LIFECO INC	38,204	23.33	891,299.32	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANC	11,000	26.12	287,320.00	
INTACT FINANCIAL CORPORATION	17,000	59.98	1,019,660.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	226,297	12.64	2,860,394.08	
POWER CORP OF CANADA	45,760	25.14	1,150,406.40	
POWER FINANCIAL CORP	30,830	27.42	845,358.60	
SUN LIFE FINANCIAL INC	72,533	20.75	1,505,059.75	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	71,490	31.63	2,261,228.70	
BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES	31,763	17.97	570,781.11	
CGI GROUP INC - CL A	27,687	20.83	576,720.21	
OPEN TEXT CORPORATION	7,600	60.20	457,520.00	
RESEARCH IN MOTION	59,855	15.02	899,022.10	
BCE INC	33,720	39.74	1,340,032.80	
BELL ALIANT INC.	9,950	27.06	269,247.00	
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	53,450	37.92	2,026,824.00	
TELUS CORPORATION	4,400	56.02	246,488.00	
TELUS CORPORATION -NON VOTE	21,197	53.75	1,139,338.75	
CANADIAN UTILITIES LIMITED	10,980	62.74	688,885.20	
FORTIS INC	25,140	32.85	825,849.00	
TRANSALTA CORP	27,068	20.77	562,202.36	
カナダドル 小計	4,844,965		157,404,244.44	
( 邦貨換算額 )			(12,634,838,701)	( 単位 : 円 )
ユ-ロ				
COMPAGNIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE-VERITA	17,750	22.74	403,635.00	
ENI SPA	306,248	17.34	5,310,340.32	
FUGRO NV-CVA	8,595	53.56	460,348.20	
GALP ENERGIA SGPS S.A	30,100	12.76	384,076.00	
NESTE OIL OYJ	16,085	9.76	157,070.02	
OMV AG	20,229	27.43	554,881.47	
REPSOL YPF SA	101,918	20.69	2,109,193.01	
SAIPEM	33,415	37.71	1,260,079.65	
SBM OFFSHORE NV	23,687	13.30	315,037.10	

TECHNIP S.A.	12,649	79.41	1,004,457.09
TENARIS S.A.	61,674	15.37	947,929.38
TOTAL SA	271,227	41.68	11,304,741.36
ACERINOX SA	13,536	10.64	144,090.72
AIR LIQUIDE	36,400	95.75	3,485,300.00
AKZO NOBEL	29,845	44.56	1,329,893.20
ARCELOR MITTAL	110,077	16.34	1,799,208.56
ARKEMA	6,980	68.29	476,664.20
BASF SE	117,424	62.98	7,395,363.52
CIMPOR-CIMENTOS DE PORTUGAL	30,160	5.07	153,182.64
CRH PLC	93,080	16.12	1,500,449.60
HEIDELBERGCEMENT AG	18,000	39.80	716,400.00
IMERYS SA	4,515	44.78	202,204.27
K+S AG	21,420	39.83	853,265.70
KONINKLIJKE DSM NV	19,731	41.89	826,630.24
LAFARGE SA	24,861	34.46	856,710.06
LANXESS	11,200	57.00	638,400.00
LINDE AG	21,816	124.55	2,717,182.80
SALZGITTER AG	4,539	45.54	206,706.06
SOLVAY SA	7,425	86.49	642,188.25
STORA ENSO OYJ-R SHS	70,712	5.66	400,229.92
THYSSENKRUPP AG	49,426	20.55	1,015,704.30
UMICORE	14,850	37.85	562,146.75
UPM-KYMMENE OYJ	70,316	10.48	736,911.68
VOESTALPINE AG	13,953	27.47	383,358.67
WACKER CHEMIE AG	2,140	80.00	171,200.00
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	18,435	23.42	431,747.70
ALSTOM RGPT	25,613	30.09	770,695.17
BEKAERT NV	5,000	29.67	148,375.00
BOSKALIS WESTMINSTER NV	8,900	28.50	253,650.00
BOUYGUES SA	25,331	25.10	635,934.75
BRENNTAG AG	4,320	85.48	369,273.60
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	52,224	36.70	1,916,620.80
EIFFAGE SA	5,600	26.66	149,324.00
EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	51,456	27.12	1,395,486.72
FINMECCANICA SPA	59,089	4.04	238,719.56
FOMENTO DE CONSTRUC Y CONTRA	5,733	18.09	103,738.63
GEA GROUP AG	22,600	25.40	574,040.00
HOCHTIEF AG	5,337	53.60	286,063.20
KONE OYJ-B	19,700	44.86	883,742.00
LEGRAND SA	28,051	26.78	751,346.03
MAN SE	7,888	85.27	672,609.76
METSO OYJ	16,595	35.13	582,982.35
PHILIPS ELECTRONICS NV	130,341	16.07	2,095,231.57
PRYSMIAN SPA	25,400	13.30	337,820.00
SAFRAN SA	20,019	24.91	498,773.38

SCHNEIDER ELECTRIC SA	62,892	47.95	3,015,671.40	
SIEMENS AG-REG	105,151	74.40	7,823,234.40	
THALES SA	12,675	27.40	347,295.00	
VALLOUREC	14,500	57.32	831,140.00	
VINCI S.A.	57,961	38.15	2,211,501.95	
WARTSILA OYJ-B SHARES	22,402	26.53	594,325.06	
WENDEL	3,900	62.99	245,661.00	
ZARDOYA OTIS SA	20,700	10.29	213,003.00	
BIC	3,350	74.74	250,379.00	
BUREAU VERITAS SA	7,450	58.64	436,868.00	
EDENRED	19,767	18.62	368,061.54	
RANDSTAD HOLDING NV	14,498	27.49	398,622.51	
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	49,410	13.07	646,035.75	
AEROPORTS DE PARIS (ADP)	4,600	57.80	265,880.00	
ATLANTIA SPA	38,867	12.74	495,165.58	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	26,979	10.82	292,047.67	
DEUTSCHE POST AG-REG	108,084	13.51	1,460,755.26	
FERROVIAL SA	47,368	9.36	443,459.21	
FRAPORT AG	5,220	45.65	238,293.00	
GROUPE EUROTUNNEL SA	74,000	6.35	470,566.00	
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP	116,344	2.06	240,250.36	
RYANAIR HOLDINGS PLC	1,656	4.32	7,153.92	
TNT EXPRESS NV	46,593	6.34	295,539.39	
VOPAK	8,700	41.67	362,572.50	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	42,297	71.98	3,044,538.06	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE(BMW)AG-PFD	6,640	46.31	307,498.40	
CONTINENTAL AG	10,678	68.31	729,414.18	
DAIMLER AG	115,519	47.78	5,520,075.41	
FIAT INDUSTRIAL SPA	98,004	8.03	787,462.14	
FIAT SPA	99,416	4.75	472,226.00	
MICHELIN (CGDE)-B	22,825	54.68	1,248,071.00	
NOKIAN RENKAAT OYJ	13,483	34.15	460,444.45	
PEUGEOT SA	19,455	14.52	282,583.87	
PIRELLI & C.	32,902	8.16	268,480.32	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PREF	19,365	47.50	919,837.50	
RENAULT SA	24,225	39.79	964,033.87	
VOLKSWAGEN AG	3,804	129.40	492,237.60	
VOLKSWAGEN AG PFD	18,518	142.50	2,638,815.00	
ADIDAS AG	26,899	59.85	1,609,905.15	
CHRISTIAN DIOR SA	7,010	115.10	806,851.00	
LUXOTTICA GROUP SPA	15,130	25.82	390,656.60	
LVMH MOET HENNESSY LOUI V SA	32,468	125.30	4,068,240.40	
ACCOR SA	20,367	25.65	522,413.55	
AUTOGRILL SPA	12,900	8.01	103,393.50	
OPAP SA	31,906	6.80	216,960.80	
SODEXO	11,906	57.92	689,595.52	

AXEL SPRINGER AG	5,400	35.69	192,726.00
EUTELSAT COMMUNICATIONS	13,600	28.79	391,544.00
JC DECAUX S.A.	7,300	20.12	146,876.00
KABEL DEUTSCHLAND HOLDINGS AG	11,100	42.00	466,255.50
LAGARDERE S.C.A.	14,271	21.97	313,533.87
MEDIASET SPA	80,634	2.42	195,779.35
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-PFD	10,000	18.62	186,250.00
PUBLICIS GROUPE	17,950	41.36	742,501.75
REED ELSEVIER NV	87,246	9.43	823,427.74
SANOMA OYJ	10,500	10.37	108,885.00
SES	39,996	17.90	715,928.40
TELEVISION FRANCAISE (T.F.1)	13,876	9.24	128,214.24
WOLTERS KLUWER-CVA	39,815	14.11	561,789.65
INDITEX	27,573	68.21	1,880,754.33
PPR	9,629	120.45	1,159,813.05
CARREFOUR SA	73,633	17.95	1,321,712.35
CASINO GUICHARD PERRACHON	6,860	73.00	500,780.00
COLRUYT NV	10,445	29.23	305,359.57
DELHAIZE GROUP	12,898	43.29	558,354.42
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	71,633	3.44	246,560.78
JERONIMO MARTINS SGPS S.A.	26,900	12.88	346,472.00
KESKO OYJ-B SHS	8,334	25.63	213,600.42
KONINKLIJKE AHOLD NV	148,833	10.98	1,634,930.50
METRO AG	16,048	29.30	470,286.64
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	101,994	49.75	5,074,201.50
COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	29,629	15.19	450,064.51
DANONE	74,385	49.74	3,699,909.90
HEINEKEN HOLDING NV	13,839	32.40	448,452.79
HEINEKEN NV	33,900	38.48	1,304,641.50
KERRY GROUP PLC-A	19,698	30.67	604,236.15
PERNOD-RICARD SA	25,574	74.57	1,907,053.18
SUEDZUCKER AG	8,500	22.26	189,210.00
UNILEVER NV-CVA	207,834	25.62	5,324,707.08
BEIERSDORF AG	12,490	48.08	600,581.65
HENKEL AG & CO KGAA	17,400	40.79	709,833.00
HENKEL AG & CO KGAA	22,683	48.70	1,104,662.10
L'OREAL	30,353	85.75	2,602,769.75
CELESIO AG	11,704	14.52	170,000.60
ESSILOR INTERNATIONAL	25,903	58.00	1,502,374.00
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	27,090	54.30	1,470,987.00
FRESENIUS SE & CO KGAA	14,750	78.37	1,155,957.50
BAYER AG	105,508	56.17	5,926,384.36
ELAN CORPORATION PLC	66,166	9.57	633,539.45
GRIFOLS S.A.	15,950	15.10	240,845.00
MERCK KGAA	8,169	81.44	665,283.36
ORION OYJ	10,798	16.10	173,847.80



QIAGEN N.V.	27,800	11.92	331,376.00	
SANOFI	146,320	56.40	8,252,448.00	
UCB SA	12,847	30.74	394,916.78	
BANCA CARIGE S.P.A	84,000	1.42	119,280.00	
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	553,414	0.35	193,805.58	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	589,315	6.90	4,066,273.50	
BANCO DE SABADELL SA	188,475	2.58	487,961.77	
BANCO ESPIRITO SANTO,S.A(BES)	72,900	1.72	125,388.00	
BANCO POPOLARE SPA	249,182	1.42	355,582.71	
BANCO POPULAR ESPANOL	125,047	3.21	401,525.91	
BANCO SANTANDER SA	1,080,113	6.41	6,926,764.66	
BANKIA SAU	111,000	3.07	341,325.00	
BANKINTER,S.A.	29,000	5.00	145,000.00	
BNP PARIBAS	124,322	36.88	4,584,995.36	
COMMERZBANK AG	476,990	2.07	991,185.22	
CREDIT AGRICOLE SA	126,158	5.11	644,667.38	
ERSTE GROUP BANK AG	25,083	18.70	469,052.10	
INTESA SANPAOLO	1,313,240	1.54	2,023,702.84	
INTESA SANPAOLO-RSP	108,503	1.30	141,704.91	
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	96,000	0.00	96.00	3
KBC GROUPE SA	20,101	17.22	346,239.72	
NATIXIS	120,051	2.34	280,919.34	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	5,550	26.20	145,410.00	
SOCIETE GENERALE	85,548	24.02	2,055,290.70	
UNICREDIT SPA	523,112	4.22	2,207,532.64	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	102,494	3.74	383,737.53	
AGEAS	303,000	1.71	519,342.00	
CAIXABANK	103,507	3.76	389,393.33	
DEUTSCHE BANK AG -REG	118,683	33.82	4,014,452.47	
DEUTSCHE BOERSE AG	25,117	50.72	1,273,934.24	
EURAZEO	3,570	35.00	124,950.00	
EXOR SPA	7,897	19.04	150,358.88	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	10,155	55.50	563,602.50	
ING GROEP NV-CVA	489,281	6.86	3,360,871.18	
MEDIOBANCA SPA	62,143	4.71	293,066.38	
POHJOLA BANK PLC	17,903	8.68	155,398.04	
AEGON NV	218,288	3.98	870,750.83	
ALLIANZ SE-REG	57,965	89.66	5,197,141.90	
ASSICURAZIONI GENERALI	148,673	11.88	1,766,235.24	
AXA SA	220,673	12.30	2,715,381.26	
CNP ASSURANCES	19,484	10.92	212,765.28	
DELTA LLOYD NV	12,600	14.35	180,873.00	
HANNOVER RUECKVERSICHERUNGS AG	7,300	42.43	309,775.50	
MAPFRE SA	93,649	2.53	237,587.51	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	23,211	109.75	2,547,407.25	
SAMPO OYJ-A SHS	53,854	20.84	1,122,317.36	

SCOR SE	21,658	19.97	432,618.55	
VIENNA INSURANCE GROUP AG WIENER VERSICH	4,800	34.70	166,560.00	
IMMOFINANZ AG	127,200	2.66	338,988.00	
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	40,350	14.37	580,031.25	
ATOS	5,781	42.48	245,605.78	
CAP GEMINI SA	18,704	32.88	615,081.04	
DASSAULT SYSTEMES SA	8,083	62.19	502,681.77	
INDRA SISTEMAS SA	11,428	10.88	124,336.64	
SAP AG	117,353	48.99	5,749,123.47	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	12,300	14.53	178,780.50	
ALCATEL-LUCENT	300,385	1.86	560,218.02	
NEOPOST SA	4,518	52.47	237,059.46	
NOKIA OYJ	481,280	4.08	1,963,622.40	
BELGACOM SA	19,931	23.57	469,873.32	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	358,660	8.95	3,210,365.66	
ELISA OYJ	17,422	17.03	296,696.66	
FRANCE TELECOM SA	237,101	11.41	2,706,507.91	
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	57,349	2.71	155,415.79	
ILIAD SA	2,500	95.25	238,125.00	
KONINKLIJKE KPN NV	190,458	8.00	1,523,664.00	
MOBISTAR SA	4,149	36.05	149,571.45	
PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	89,052	4.20	374,552.71	
TELECOM ITALIA SPA	1,157,901	0.82	959,899.92	
TELECOM ITALIA-RNC	776,811	0.68	531,727.12	
TELEFONICA S.A.	524,494	13.05	6,844,646.70	
TELEKOM AUSTRIA AG	43,354	8.71	377,916.81	
VIVENDI SA	158,475	16.51	2,616,422.25	
A2A S.P.A.	131,000	0.75	99,494.50	
ACCIONA S.A.	3,430	61.79	211,939.70	
E.ON AG	230,515	16.71	3,853,058.22	
EDP RENOVAVEIS SA	27,000	4.27	115,290.00	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	256,624	2.23	573,811.26	
ELECTRICITE DE FRANCE(EDF)	29,749	18.89	561,958.61	
ENAGAS	21,200	14.74	312,594.00	
ENEL GREEN POWER SPA	213,000	1.48	315,240.00	
ENEL SPA	834,395	3.03	2,533,223.22	
FORTUM OYJ	57,011	18.41	1,049,572.51	
GAS NATURAL SDG SA	43,546	12.92	562,614.32	
GDF SUEZ	159,498	19.78	3,155,667.93	
IBERDROLA SA	493,807	4.65	2,300,646.81	
RED ELECTRICA CORPORATION S.A.	14,500	35.67	517,287.50	
RWE AG	62,430	33.33	2,080,791.90	
RWE AG-NON VTG PFD	4,413	31.39	138,524.07	
SNAM SPA	211,376	3.63	767,294.88	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	33,900	10.46	354,763.50	
TERNA SPA	155,846	2.80	436,992.18	

VEOLIA ENVIRONNEMENT	45,030	9.58	431,657.58	
VERBUND AG	7,470	22.00	164,340.00	
ASML HOLDING NV	54,852	35.49	1,946,971.74	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	139,349	7.57	1,055,011.27	
STMICROELECTRONICS NV	81,901	5.36	438,989.36	
ユーロ 小計	21,938,047		281,140,060.56	
(邦貨換算額)			(29,578,745,771)	(単位：円)
英ポンド				
AMEC PLC	44,435	10.96	487,007.60	
BG GROUP PLC	432,586	14.82	6,413,087.45	
BP PLC	2,420,950	4.88	11,837,235.02	
CAIRN ENERGY PLC-B-SHS	188,286	1.60	301,257.60	
ESSAR ENERGY PLC	42,000	1.22	51,366.00	
PETROFAC LIMITED	31,900	15.42	491,898.00	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	462,313	22.93	10,600,837.09	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	343,066	23.27	7,983,145.82	
TULLOW OIL PLC	115,794	15.66	1,813,334.04	
ANGLO AMERICAN PLC	168,900	26.74	4,516,386.00	
ANTOFAGASTA PLC	50,170	13.04	654,216.80	
BHP BILLITON PLC	270,044	20.23	5,462,990.12	
EURASIAN NATURAL RESOURCES CORPORATION	34,987	7.03	246,133.54	
FRESNILLO PLC	22,000	17.20	378,400.00	
GLENCORE INTERNATIONAL PLC	112,500	4.30	483,750.00	
JOHNSON MATTHEY PLC	26,901	23.19	623,834.19	
KAZAKHMYS PLC	25,600	11.24	287,744.00	
LONMIN PLC	22,856	10.17	232,445.52	
RANDGOLD RESOURCES LTD	11,542	70.60	814,865.20	
REXAM PLC	117,549	3.82	449,154.72	
RIO TINTO PLC	178,822	36.22	6,476,932.84	
VEDANTA RESOURCES PLC	14,200	13.12	186,304.00	
XSTRATA PLC	263,637	11.96	3,153,098.52	
BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	48,600	7.44	361,827.00	
BAE SYSTEMS PLC	428,673	3.24	1,390,615.21	
BALFOUR BEATTY PLC	86,839	2.83	245,754.37	
BUNZL PLC	41,608	9.22	383,833.80	
COBHAM PLC	145,074	1.91	277,091.34	
INVENSYS PLC	99,258	2.17	215,489.11	
MEGGITT PLC	100,000	3.86	386,300.00	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	242,603	7.98	1,935,971.94	
SMITHS GROUP PLC	50,466	10.55	532,416.30	
WEIR GROUP PLC/THE	25,900	20.51	531,209.00	
WOLSELEY PLC	36,807	24.07	885,944.49	
AGGREKO PLC	33,993	21.72	738,327.96	
CAPITA PLC	82,099	6.54	537,337.95	
EXPERIAN PLC	126,694	9.45	1,197,891.77	

G4S PLC	179,927	2.80	503,975.52
INTERTEK GROUP PLC	19,600	22.39	438,844.00
SERCO GROUP PLC	59,528	5.38	320,558.28
GKN PLC	199,000	2.23	443,969.00
BURBERRY GROUP PLC	55,837	14.24	795,118.88
CARNIVAL PLC	23,847	19.39	462,393.33
COMPASS GROUP PLC	246,045	6.41	1,577,148.45
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	36,249	14.10	511,110.90
TUI TRAVEL PLC	62,000	2.05	127,658.00
WHITBREAD PLC	21,656	17.26	373,782.56
BRITISH SKY BROADCASTING PLC	144,321	6.86	990,042.06
ITV PLC	488,592	0.77	377,681.61
PEARSON PLC	103,353	12.24	1,265,040.72
REED ELSEVIER PLC	153,648	5.60	860,428.80
WPP PLC	158,050	8.11	1,281,785.50
KINGFISHER PLC	309,225	2.80	866,448.45
MARKS & SPENCER GROUP PLC	204,699	3.52	721,768.67
NEXT PLC	22,494	27.84	626,232.96
SAINSBURY (J) PLC	163,638	3.01	493,368.57
TESCO PLC	1,028,101	3.17	3,268,333.07
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	271,042	2.97	805,807.86
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	47,500	12.26	582,350.00
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	252,491	31.15	7,865,094.65
DIAGEO PLC	319,357	14.98	4,785,564.64
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	129,876	25.19	3,271,576.44
SABMILLER PLC	120,914	25.40	3,071,820.17
TATE & LYLE PLC	58,000	7.07	410,350.00
UNILEVER PLC	164,607	20.63	3,395,842.41
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	78,424	35.93	2,817,774.32
SMITH & NEPHEW PLC	111,283	6.33	704,421.39
ASTRAZENECA PLC	171,691	28.52	4,897,485.77
GLAXOSMITHKLINE PLC	648,353	14.14	9,167,711.42
SHIRE PLC	72,837	22.78	1,659,226.86
BARCLAYS PLC	1,479,018	2.48	3,673,141.20
HSBC HOLDINGS PLC	2,280,561	5.77	13,174,800.89
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,205,412	0.35	1,845,578.82
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	2,260,673	0.27	623,945.74
STANDARD CHARTERED PLC	303,782	16.36	4,969,873.52
3I GROUP PLC	118,000	1.96	231,280.00
ICAP PLC	71,716	3.82	274,313.70
INVESTEC PLC	65,000	3.92	254,865.00
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	18,902	9.34	176,639.19
MAN GROUP PLC	255,744	1.33	341,418.24
SCHRODERS PLC	14,200	15.59	221,378.00
ADMIRAL GROUP PLC	27,800	9.97	277,166.00
AVIVA PLC	367,709	3.70	1,360,523.30

LEGAL & GENERAL GROUP PLC	738,945	1.21	899,296.06	
OLD MUTUAL PLC	718,351	1.59	1,146,488.19	
PRUDENTIAL PLC	327,561	7.21	2,361,714.81	
RESOLUTION LTD	181,068	2.61	473,854.95	
RSA INSURANCE GROUP PLC	471,885	1.13	536,061.36	
STANDARD LIFE PLC	290,048	2.33	678,422.27	
SAGE GROUP PLC (THE)	167,463	3.07	514,613.79	
ARM HOLDINGS PLC	176,500	5.84	1,030,760.00	
BT GROUP PLC	990,771	2.14	2,127,185.33	
INMARSAT PLC	53,800	4.82	259,638.80	
VODAFONE GROUP PLC	6,495,697	1.74	11,341,486.96	
CENTRICA PLC	652,081	2.93	1,916,466.05	
INTERNATIONAL POWER PLC	191,253	3.35	642,227.57	
NATIONAL GRID PLC	458,867	6.45	2,959,692.15	
SEVERN TRENT PLC	30,994	15.51	480,716.94	
SSE PLC	119,608	12.95	1,548,923.60	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	89,091	6.08	542,118.73	
英ポンド 小計	37,698,337		190,190,740.73	
(邦貨換算額)			(24,036,305,813)	(単位：円)
スイスフラン				
TRANSOCEAN LTD	44,655	45.92	2,050,557.60	
GIVAUDAN-REG	1,057	890.00	940,730.00	
HOLCIM LTD-REG	31,655	58.60	1,854,983.00	
SIKA AG	242	1,941.00	469,722.00	
SYNGENTA AG	12,100	291.40	3,525,940.00	
ABB LTD	279,919	19.32	5,408,035.08	
GEBERIT AG-REG	5,110	196.10	1,002,071.00	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,540	107.50	273,050.00	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	6,270	107.70	675,279.00	
SULZER AG	3,350	121.50	407,025.00	
ADECCO SA-REG	16,534	46.56	769,823.04	
SGS SA	694	1,705.00	1,183,270.00	
KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	7,152	122.50	876,120.00	
CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-BR A	67,148	54.50	3,659,566.00	
THE SWATCH GROUP AG-B	3,996	408.20	1,631,167.20	
THE SWATCH GROUP AG-REG	5,400	70.80	382,320.00	
ARYZTA AG	11,100	44.20	490,620.00	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	230	886.50	203,895.00	
LINDT & SPRUENGLI AG	116	2,789.00	323,524.00	
LINDT & SPRUENGLI AG-REG	13	32,605.00	423,865.00	
NESTLE SA-REGISTERED	421,790	55.85	23,556,971.50	
SONOVA HOLDING AG	6,192	102.70	635,918.40	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	970	159.30	154,521.00	
SYNTHES INC	8,534	157.40	1,343,251.60	
ACTELION LTD	13,316	34.89	464,595.24	

LONZA GROUP AG-REG	6,687	50.85	340,033.95	
NOVARTIS AG-REG SHS	298,240	52.00	15,508,480.00	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	89,740	161.80	14,519,932.00	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	146,055	24.55	3,585,650.25	
GAM HOLDING LTD	23,073	12.35	284,951.55	
JULIUS BAER GROUP LTD	25,969	37.30	968,643.70	
PARGESA HOLDING SA-BR	3,100	67.15	208,165.00	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,700	170.60	290,020.00	
UBS AG-REGISTERED	468,408	13.09	6,131,460.72	
BALOISE HOLDING AG	6,250	74.15	463,437.50	
SWISS LIFE HOLDING AG	4,220	102.30	431,706.00	
SWISS RE LTD	43,997	53.80	2,367,038.60	
ZURICH FINANCIAL SERVICES AG	18,553	232.50	4,313,572.50	
SWISSCOM AG-REG	2,906	363.40	1,056,040.40	
スイスフラン 小計	2,088,981		103,175,952.83	
(邦貨換算額)			(8,977,339,655)	(単位：円)
スウェーデンクローナ				
LUNDIN PETROLEUM AB	29,000	160.90	4,666,100.00	
BOLIDEN AB	34,500	117.30	4,046,850.00	
HOLMEN AB-B SHARES	6,133	193.00	1,183,669.00	
SSAB AB-A SHARES	18,042	70.05	1,263,842.10	
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	74,067	112.30	8,317,724.10	
ALFA LAVAL AB	42,252	134.60	5,687,119.20	
ASSA ABLOY AB-B	39,416	199.50	7,863,492.00	
ATLAS COPCO AB-A SHS	85,809	170.10	14,596,110.90	
ATLAS COPCO AB-B SHS	49,896	151.30	7,549,264.80	
HEXAGON AB-B SHS	31,700	135.10	4,282,670.00	
SANDVIK AB	131,154	104.90	13,758,054.60	
SCANIA AB-B SHS	41,632	129.70	5,399,670.40	
SKANSKA AB-B SHS	49,890	120.60	6,016,734.00	
SKF AB-B SHARES	51,438	169.90	8,739,316.20	
VOLVO AB-B SHS	177,394	97.80	17,349,133.20	
SECURITAS AB-B SHS	37,257	61.20	2,280,128.40	
ELECTROLUX AB-SER B	30,383	146.70	4,457,186.10	
HUSQVARNA AB-B SHS	51,983	39.26	2,040,852.58	
MODERN TIMES GROUP-B SHS	6,400	336.30	2,152,320.00	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	130,844	236.50	30,944,606.00	
SWEDISH MATCH AB	27,271	243.10	6,629,580.10	
GETINGE AB-B SHS	26,138	188.60	4,929,626.80	
NORDEA BANK AB	338,550	63.75	21,582,562.50	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A	180,423	49.87	8,997,695.01	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	64,253	220.10	14,142,085.30	
SWEDBANK AB - A SHARES	101,864	112.40	11,449,513.60	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	12,800	101.00	1,292,800.00	
INVESTOR AB-B SHS	58,949	145.70	8,588,869.30	

KINNEVIK INVESTMENT AB-B	27,000	144.70	3,906,900.00	
RATOS AB-B SHS	24,400	86.60	2,113,040.00	
ERICSSON LM-B SHS	385,769	66.20	25,537,907.80	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	10,050	737.50	7,411,875.00	
TELE2 AB -B SHS	39,798	130.10	5,177,719.80	
TELIASONERA AB	277,171	47.68	13,215,513.28	
スウェーデンクローナ 小計	2,693,626		287,570,532.07	
(邦貨換算額)			(3,430,716,447)	(単位：円)
ノルウェークローネ				
AKER SOLUTIONS ASA	20,600	96.00	1,977,600.00	
SEADRILL LID	41,245	222.70	9,185,261.50	
STATOIL ASA	142,206	154.00	21,899,724.00	
SUBSEA 7 SA	37,600	127.30	4,786,480.00	
NORSK HYDRO ASA	120,597	32.51	3,920,608.47	
YARA INTERNATIONAL ASA	24,212	257.20	6,227,326.40	
ORKLA ASA	94,550	46.47	4,393,738.50	
DNB ASA	128,619	70.00	9,003,330.00	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	24,200	64.95	1,571,790.00	
TELENOR ASA	94,292	101.00	9,523,492.00	
ノルウェークローネ 小計	728,121		72,489,350.87	
(邦貨換算額)			(1,018,475,379)	(単位：円)
デンマーククローネ				
NOVOZYMES A/S-B SHARES	28,515	165.30	4,713,529.50	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	27,962	55.05	1,539,308.10	
A P MOLLER - MAERSK A/S	175	47,480.00	8,309,000.00	
A P MOLLER-MAERSK A/S-A	67	45,480.00	3,047,160.00	
DSV A/S	26,180	126.00	3,298,680.00	
CARLSBERG AS-B	13,866	429.00	5,948,514.00	
COLOPLAST-B	2,961	871.00	2,579,031.00	
WILLIAM DEMANT HOLDING	2,860	503.00	1,438,580.00	
NOVO NORDISK A/S-B	54,273	777.50	42,197,257.50	
DANSKE BANK A/S	84,338	95.10	8,020,543.80	
TRYG A/S	3,368	299.70	1,009,389.60	
TDC A/S	43,300	43.49	1,883,117.00	
デンマーククローネ 小計	287,865		83,984,110.50	
(邦貨換算額)			(1,188,375,163)	(単位：円)
オーストラリアドル				
CALTEX AUSTRALIA LIMITED	18,000	12.84	231,120.00	
ORIGIN ENERGY LIMITED	137,159	13.23	1,814,613.57	
SANTOS LTD	121,811	13.56	1,651,757.16	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	80,788	34.93	2,821,924.84	
WORLEY PARSONS LIMITED	23,500	28.16	661,760.00	
ALUMINA LTD	333,977	1.17	390,753.09	

AMCOR LIMITED	154,377	6.88	1,062,113.76
BHP BILLITON LTD	410,357	35.20	14,444,566.40
BORAL LIMITED	94,596	4.20	397,303.20
FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	156,000	5.29	825,240.00
ILUKA RESOURCES LIMITED	54,900	16.60	911,340.00
INCITEC PIVOT LTD	198,000	3.30	653,400.00
JAMES HARDIE INDUSTRIES SE	56,003	7.26	406,581.78
LYNAS CORPORATION LIMITED	235,000	1.21	285,525.00
NEWCREST MINING LIMITED	97,279	33.77	3,285,111.83
ONESTEEL LIMITED	132,695	0.74	98,857.77
ORICA LIMITED	47,923	25.41	1,217,723.43
OZ MINERALS LIMITED	38,746	11.07	428,918.22
RIO TINTO LIMITED	55,891	66.57	3,720,663.87
SIMS METAL MANAGEMENT LTD	22,995	14.03	322,619.85
LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	19,905	23.42	466,175.10
BRAMBLES LIMITED	186,632	7.00	1,306,424.00
CAMPBELL BROTHERS LTD	8,300	54.70	454,010.00
ASCIANO LTD	123,666	4.52	558,970.32
QANTAS AIRWAYS LIMITED	133,138	1.63	217,680.63
QR NATIONAL LTD	224,000	3.68	824,320.00
TOLL HOLDINGS LIMITED	83,620	5.07	423,953.40
CROWN LTD	62,965	8.23	518,201.95
ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD	79,545	3.60	286,362.00
TABCORP HOLDINGS LIMITED	77,545	2.77	214,799.65
TATTS GROUP LTD	174,000	2.46	428,040.00
FAIRFAX MEDIA LTD	265,729	0.77	204,611.33
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	87,850	2.01	176,578.50
METCASH LTD	107,000	4.07	435,490.00
WESFARMERS LIMITED	129,746	29.44	3,819,722.24
WOOLWORTHS LIMITED	153,948	24.86	3,827,147.28
COCA-COLA AMATIL LIMITED	70,617	11.81	833,986.77
COCHLEAR LIMITED	7,113	59.50	423,223.50
RAMSAY HEALTH CARE LTD	15,000	18.67	280,050.00
SONIC HEALTHCARE LTD	48,626	11.00	534,886.00
CSL LIMITED	68,014	30.37	2,065,585.18
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	335,753	21.55	7,235,477.15
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	47,400	8.02	380,148.00
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	199,166	49.68	9,894,566.88
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	279,623	22.72	6,353,034.56
WESTPAC BANKING CORPORATION	386,984	20.15	7,797,727.60
ASX LTD	21,610	30.58	660,833.80
MACQUARIE GROUP LTD	44,421	26.36	1,170,937.56
AMP LIMITED	366,825	4.24	1,555,338.00
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	275,006	2.86	786,517.16
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	137,781	11.49	1,583,103.69
SUNCORP GROUP LTD	164,981	8.28	1,366,042.68



COMPUTERSHARE LIMITED	55,229	7.92	437,413.68	
TELSTRA CORPORATION LIMITED	546,987	3.41	1,865,225.67	
AGL ENERGY LIMITED	59,969	14.17	849,760.73	
オーストラリアドル 小計	7,518,691		95,868,238.78	
(邦貨換算額)			(8,236,999,075)	(単位：円)
ニュージーランドドル				
FLETCHER BUILDING LTD	81,457	6.43	523,768.51	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	130,557	2.42	316,600.72	
SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP	82,890	3.66	303,377.40	
TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	249,909	2.14	536,054.80	
CONTACT ENERGY LIMITED	51,256	4.80	246,028.80	
ニュージーランドドル 小計	596,069		1,925,830.23	
(邦貨換算額)			(129,030,625)	(単位：円)
香港ドル				
HUTCHISON WHAMPOA LTD	277,000	77.65	21,509,050.00	
NWS HOLDINGS LTD	160,500	13.10	2,102,550.00	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	170,000	19.12	3,250,400.00	
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	144,000	15.94	2,295,360.00	
MTR CORPORATION	182,500	26.95	4,918,375.00	
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	31,000	52.85	1,638,350.00	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	96,000	24.55	2,356,800.00	
SANDS CHINA LTD	298,000	29.95	8,925,100.00	
SHANGRI-LA ASIA LTD.	162,000	18.10	2,932,200.00	
SJM HOLDINGS LIMITED	213,000	15.28	3,254,640.00	
WYNN MACAU LTD	202,000	20.30	4,100,600.00	
LI & FUNG LTD	733,200	17.78	13,036,296.00	
LIFESTYLE INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED	73,000	21.10	1,540,300.00	
BANK OF EAST ASIA	198,620	30.25	6,008,255.00	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	487,500	21.85	10,651,875.00	
HANG SENG BANK LTD	98,800	102.70	10,146,760.00	
WING HANG BANK LIMITED	22,000	74.45	1,637,900.00	
FIRST PACIFIC COMPANY	280,000	8.72	2,441,600.00	
HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	130,300	145.70	18,984,710.00	
AIA GROUP LTD	1,082,000	26.65	28,835,300.00	
CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	176,000	113.70	20,011,200.00	
HANG LUNG GROUP LTD	110,000	53.55	5,890,500.00	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	324,000	29.80	9,655,200.00	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	125,000	48.70	6,087,500.00	
HOPEWELL HOLDINGS LTD	72,000	22.10	1,591,200.00	
HYSAN DEVELOPMENT CO	74,000	33.65	2,490,100.00	
KERRY PROPERTIES LTD	91,500	35.65	3,261,975.00	
NEW WORLD DEVELOPMENT	449,000	10.20	4,579,800.00	
SINO LAND CO	356,200	13.94	4,965,428.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	183,000	119.90	21,941,700.00	

SWIRE PACIFIC LTD 'A'	91,000	88.85	8,085,350.00	
WHARF HOLDINGS LTD	187,000	49.15	9,191,050.00	
WHEELOCK&COMPANY LTD	107,000	26.55	2,840,850.00	
FOXCONN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	260,000	5.91	1,536,600.00	
PCCW LIMITED	510,000	2.75	1,402,500.00	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	61,000	43.60	2,659,600.00	
CLP HOLDINGS LTD	248,600	65.25	16,221,150.00	
HONG KONG & CHINA GAS	598,741	18.92	11,328,179.72	
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	179,000	55.95	10,015,050.00	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	25,500	108.10	2,756,550.00	
香港ドル 小計	9,269,961		297,077,903.72	
(邦貨換算額)			(3,050,990,071)	(単位：円)
シンガポールドル				
COSCO CORP SINGAPORE LTD	150,000	1.26	189,750.00	
FRASER & NEAVE LTD	118,000	6.47	763,460.00	
KEPPEL CORP LTD	182,400	10.77	1,964,448.00	
NOBLE GROUP LTD	474,400	1.49	706,856.00	
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	123,820	5.10	631,482.00	
SEMBCORP MARINE LTD	103,400	5.26	543,884.00	
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG	212,000	3.03	642,360.00	
YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	245,000	1.29	317,275.00	
COMFORTDELGRO CORP LTD	259,000	1.50	389,795.00	
NEPTUNE ORIENT LINES LTD	98,000	1.44	141,610.00	
SINGAPORE AIRLINES LTD	66,266	10.92	723,624.72	
GENTING SINGAPORE PLC	761,000	1.68	1,282,285.00	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	185,250	3.69	683,572.50	
CYCLE & CARRIAGE LTD	14,000	49.62	694,680.00	
OLAM INTERNATIONAL LTD	176,000	2.47	434,720.00	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	921,600	0.76	705,024.00	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	243,000	5.90	1,433,700.00	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	223,000	13.94	3,108,620.00	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	328,000	8.85	2,902,800.00	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	161,000	17.65	2,841,650.00	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	104,000	7.15	743,600.00	
CAPITALAND LTD	328,000	2.89	947,920.00	
CAPITAMALLS ASIA LTD	190,000	1.56	297,350.00	
CITY DEVELOPMENTS LTD	61,000	10.98	669,780.00	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LIMITED	260,000	2.08	540,800.00	
KEPPEL LAND LTD	90,000	3.13	281,700.00	
UOL GROUP LIMITED	62,000	4.84	300,080.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,013,015	3.08	3,120,086.20	
STARHUB LIMITED	80,000	2.88	230,400.00	
シンガポールドル 小計	7,233,151		28,233,312.42	
(邦貨換算額)			(1,796,768,002)	(単位：円)

イスラエルシュケル				
DELEK GROUP LTD	530	762.80	404,284.00	
ISRAEL CHEMICALS LIMITED	54,000	39.90	2,154,600.00	
ISRAEL CORPORATION LTD/THE	335	2,332.00	781,220.00	
ELBIT SYSTEMS LTD	3,000	144.00	432,000.00	
TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	120,275	167.10	20,097,952.50	
BANK HAPOALIM BM	139,000	13.16	1,829,240.00	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	161,000	12.12	1,951,320.00	
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	113,700	5.31	603,747.00	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	16,000	33.60	537,600.00	
NICE SYSTEMS LTD	8,200	132.50	1,086,500.00	
BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	203,000	6.06	1,230,586.00	
CELLCOM ISRAEL LTD	6,700	54.55	365,485.00	
PARTNER COMMUNICATIONS COMPANY LTD	11,000	31.26	343,860.00	
イスラエルシュケル 小計	836,740		31,818,394.50	
(邦貨換算額)			(678,049,986)	(単位：円)
合計	134,402,127		222,660,583,298	単位：円
(外貨建有価証券邦貨換算額合計)			(222,660,583,298)	(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、565銘柄、信託財産純資産総額に対する比率55.4%、合計に対する比率57.4%です。  
カナダドル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5.5%、合計に対する比率5.7%です。  
ユーロ表示の株式については、244銘柄、信託財産純資産総額に対する比率12.8%、合計に対する比率13.3%です。  
英ポンド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10.4%、合計に対する比率10.8%です。  
スイスフラン表示の株式については、39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、34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1.5%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0.5%です。  
デンマーククローネ表示の株式については、12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、55銘柄、信託財産純資産総額に対する比率3.6%、合計に対する比率3.7%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1.4%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。  
イスラエルシュケル表示の株式については、13銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.3%、合計に対する比率0.3%です。
- 売買停止措置がとられている銘柄であって、委託者としての忠実義務に基づき合理的理由をもって時価と認める評価額としております。

## (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			
	AMERICAN TOWER CORP	50,386	3,149,125.00	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	124,198	2,069,138.68	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	12,217	1,637,444.51	
	BOSTON PROPERTIES INC	18,916	1,983,153.44	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	13,000	909,090.00	
	DUKE REALTY CORP	31,773	443,233.35	
	EQUITY RESIDENTIAL	37,320	2,183,593.20	
	FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	8,004	773,106.36	
	GENERAL GROWTH PROPERTIES	54,120	908,674.80	
	HCP,INC.	51,867	2,094,389.46	
	HEALTH CARE REIT INC	24,000	1,331,040.00	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	91,951	1,507,996.40	
	HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	692,000	515,540.00	
	KIMCO REALTY CORPORATION	53,932	1,012,303.64	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	14,665	499,929.85	
	MACERICH COMPANY/THE	16,339	906,324.33	
	PLUM CREEK TIMBER COMPANY	20,243	787,452.70	
	PROLOGIS INC	58,827	2,000,118.00	
	PUBLIC STORAGE	18,601	2,580,702.74	
	RAYONIER INC	16,200	724,302.00	
	REGENCY CENTERS CORP	11,400	493,050.00	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	37,527	5,169,719.52	
	VENTAS INC	36,620	2,093,565.40	
	VORNADO REALTY TRUST	21,243	1,803,530.70	
	米ドル 小計	1,515,349	37,576,524.08	
	( 邦貨換算額 )		(2,991,467,082)	( 単位 : 円 )
	カナダドル			
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	9,500	223,345.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	17,400	472,410.00	
	カナダドル 小計	26,900	695,755.00	
	( 邦貨換算額 )		(55,848,253)	( 単位 : 円 )
	ユーロ			
	CORIO NV	8,248	297,505.36	
	FONCIERE DES REGIONS	4,050	224,572.50	
	GECINA SA	2,880	213,379.20	
	ICADE	2,770	175,895.00	
	KLEPIERRE	12,332	295,598.04	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	11,919	1,742,557.80	
	ユーロ 小計	42,199	2,949,507.90	
	( 邦貨換算額 )		(310,317,726)	( 単位 : 円 )

	英ポンド			
	BRITISH LAND CO PLC	105,605	507,537.63	
	CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP PLC	64,855	220,377.29	
	HAMMERSON PLC	95,997	380,532.10	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	100,927	690,845.31	
	SEGRO PLC	104,434	241,033.67	
	英ポンド 小計	471,818	2,040,326.00	
	(邦貨換算額)		(257,856,399)	(単位：円)
	オーストラリアドル			
	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	213,612	378,093.24	
	DEXUS PROPERTY GROUP	610,804	537,507.52	
	GOODMAN GROUP	955,000	635,075.00	
	GPT GROUP	228,494	703,761.52	
	LEND LEASE GROUP	73,372	534,881.88	
	MIRVAC GROUP	449,710	530,657.80	
	SP AUSNET	155,000	154,225.00	
	STOCKLAND	299,614	952,772.52	
	SYDNEY AIRPORT	51,000	134,640.00	
	TRANSURBAN GROUP	170,032	965,781.76	
	WESTFIELD GROUP	281,027	2,487,088.95	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	367,993	890,543.06	
	オーストラリアドル 小計	3,855,658	8,905,028.25	
	(邦貨換算額)		(765,120,027)	(単位：円)
	香港ドル			
	HKT TRUST AND HKT LTD NEW	11,086	55,984.30	
	LINK REIT	294,500	8,393,250.00	
	香港ドル 小計	305,586	8,449,234.30	
	(邦貨換算額)		(86,773,636)	(単位：円)
	シンガポールドル			
	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	223,000	440,425.00	
	CAPITAMALL TRUST	280,000	490,000.00	
	シンガポールドル 小計	503,000	930,425.00	
	(邦貨換算額)		(59,212,247)	(単位：円)
	合計		4,526,595,370	単位：円
	(外貨建有価証券邦貨換算額合計)		(4,526,595,370)	(単位：円)

(注)

1. 合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券にかかるもので、内書きであります。
2. 米ドル表示の投資証券については、24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66.1%です。  
カナダ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1.2%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6.9%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5.7%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16.9%です。

香港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1.9%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1.3%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）」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23年2月18日現在)	(平成24年2月20日現在)
科目	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	2,376,894,301	2,349,245,639
コール・ローン	1,700,580,582	1,235,821,883
国債証券	251,531,322,830	250,584,025,767
派生商品評価勘定	46,985	-
未収利息	2,782,609,035	2,616,985,776
前払費用	163,078,168	129,067,259
流動資産合計	258,554,531,901	256,915,146,324
資産合計	258,554,531,901	256,915,146,324
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	100,000	1,270,279
流動負債合計	629,970,439	1,270,279
負債合計	629,970,439	1,270,279
純資産の部		
元本等		
元本		
元本	232,040,596,375	225,450,227,371
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	25,883,965,087	31,463,648,674
元本等合計	257,924,561,462	256,913,876,045
純資産合計	257,924,561,462	256,913,876,045
負債純資産合計	258,554,531,901	256,915,146,324

(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23年2月18日ならびに平成24年2月20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22年2月19日 至平成23年2月18日	自平成23年2月19日 至平成24年2月20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23年2月18日現在)	(平成24年2月20日現在)
1. 受益権総数	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	平成24年2月20日現在における 受益権の総数 225,450,227,371口
2. 1単位当たり純資産額	1.1115円 (1万円 = 11,115円)	1.1396円 (1万円 = 11,396円)



## （金融商品に関する注記）

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自平成22年2月19日 至平成23年2月18日	自平成23年2月19日 至平成24年2月20日
	（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。	
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。	同左
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、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。 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。	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 同左 2) デリバティブ取引 同左 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 同左

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>	同左
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>	同左

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成23年2月18日現在)	(平成24年2月20日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（国債証券） 「重要な会計方針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>(1) 有価証券（国債証券） 同左</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） 同左</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>	<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 同左</p>
---	--

（デリバティブ取引に関する注記）

（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

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

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

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

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

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

（平成24年2月20日現在）

平成24年2月20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。

（自 平成23年2月19日 至 平成24年2月20日）

該当事項はありません。

(その他の注記)

(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

(平成24年2月20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	232,040,596,375円
同期中における追加設定元本額	15,270,587,788円
同期中における一部解約元本額	21,860,956,792円
平成24年2月20日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	2,846,772,946円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	216,374,838円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	604,867,650円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	281,332,662円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	30,459,430円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	4,514,701円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	4,687,896円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	3,508,680円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	3,798,079円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	955,890円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	2,031,216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>	5,459,494,507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>	12,348,074,686円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	37,756,590,919円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	11,698,989,422円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	24,438,875,289円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	88,003,152円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	176,913,226円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	42,852,399円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	1,319,794,607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>	179,857,284円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	2,300,907,928円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	3,058,292,655円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	6,987,630,019円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	15,524,982,169円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,248,652,145円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	23,246,322,516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)	2,158,061,755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)	10,442,358,160円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	430,059,123円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	11,083,820,117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)	44,678,903,824円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	307,445,418円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	91,963,553円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	22,741,113円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	411,802,814円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	1,412,253,931円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	409,123,925円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	358,946,435円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	93,424,787円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	13,193,042円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	3,402,602,540円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	93,603,239円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定>	117,262,859円
SMAM・FGグローバルバランス25VA<適格機関投資家限定>	47,123,825円
合計	225,450,227,371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 0.125% 13/08/31	5,000,000.00	4,988,671.90	
	US T 0.125% 130930	8,500,000.00	8,478,085.98	
	US T 0.25% 13/10/31	9,000,000.00	8,995,078.17	
	US T 0.25% 13/11/30	3,000,000.00	2,997,656.25	
	US T 0.25% 14/09/15	6,000,000.00	5,976,093.78	
	US T 0.25% 14/12/15	7,000,000.00	6,969,921.91	
	US T 0.25% 15/01/15	13,000,000.00	12,940,078.19	
	US T 0.375% 13/07/31	5,000,000.00	5,007,031.25	
	US T 0.375% 130630	8,000,000.00	8,011,250.00	
	US T 0.375% 14/11/15	9,000,000.00	8,992,265.67	
	US T 0.5% 13/10/15	5,000,000.00	5,017,578.15	
	US T 0.5% 13/11/15	7,000,000.00	7,021,875.00	
	US T 0.5% 14/08/15	8,000,000.00	8,023,125.04	
	US T 0.5% 14/10/15	10,000,000.00	10,025,000.00	
	US T 0.625% 12/12/31	7,500,000.00	7,528,710.97	
	US T 0.625% 13/01/31	4,000,000.00	4,016,562.52	
	US T 0.625% 13/02/28	5,000,000.00	5,019,140.65	
	US T 0.625% 140715	7,000,000.00	7,042,109.41	
	US T 0.75% 13/08/15	8,000,000.00	8,050,625.04	
	US T 0.75% 13/09/15	6,000,000.00	6,044,062.50	
	US T 0.75% 13/12/15	7,000,000.00	7,056,875.00	
	US T 0.75% 140615	9,000,000.00	9,080,156.25	
	US T 0.875% 16/12/31	11,000,000.00	11,012,890.68	
	US T 1 14/01/15	3,000,000.00	3,039,375.00	
	US T 1% 13/07/15	8,000,000.00	8,080,625.04	
	US T 1% 14/05/15	11,000,000.00	11,156,406.25	
	US T 1% 16/08/31	8,000,000.00	8,078,750.00	
	US T 1% 16/09/30	5,000,000.00	5,046,093.75	
	US T 1% 16/10/31	4,000,000.00	4,035,000.00	
	US T 1.125% 12/12/15	9,000,000.00	9,068,906.25	
	US T 1.125% 2013/06/15	6,000,000.00	6,066,562.50	
	US T 1.25% 14/02/15	4,000,000.00	4,074,062.52	
	US T 1.25% 14/03/15	6,000,000.00	6,115,312.50	
	US T 1.25% 14/04/15	5,000,000.00	5,098,828.15	
	US T 1.25% 15/08/31	8,000,000.00	8,199,375.04	
	US T 1.25% 15/09/30	7,000,000.00	7,170,625.00	
	US T 1.25% 15/10/31	5,000,000.00	5,119,921.90	
	US T 1.375% 13/02/15	10,000,000.00	10,115,625.00	

US T 1.375% 13/03/15	8,000,000.00	8,096,875.04
US T 1.375% 13/05/15	8,000,000.00	8,108,750.00
US T 1.375% 15/11/30	5,000,000.00	5,142,968.75
US T 1.375% 18/09/30	7,500,000.00	7,517,578.12
US T 1.375% 18/11/30	5,000,000.00	5,000,781.25
US T 1.375% 2013/01/15	10,000,000.00	10,107,031.30
US T 1.5% 13/12/31	7,000,000.00	7,157,500.00
US T 1.5% 16/07/31	8,000,000.00	8,258,750.00
US T 1.5% 160630	7,000,000.00	7,228,046.91
US T 1.5% 18/08/31	2,000,000.00	2,023,750.00
US T 1.75% 13/04/15	10,000,000.00	10,172,656.30
US T 1.75% 14/01/31	6,500,000.00	6,681,289.09
US T 1.75% 14/03/31	8,000,000.00	8,241,250.00
US T 1.75% 15/7/31	5,000,000.00	5,207,812.50
US T 1.75% 160531	3,000,000.00	3,131,015.64
US T 1.75% 18/10/31	6,000,000.00	6,152,812.50
US T 1.875% 14/02/28	6,000,000.00	6,187,968.78
US T 1.875% 14/04/30	8,000,000.00	8,270,000.00
US T 1.875% 17/08/31	3,000,000.00	3,134,531.25
US T 1.875% 17/09/30	6,000,000.00	6,267,187.50
US T 1.875% 17/10/31	6,000,000.00	6,265,312.50
US T 1.875% 2015/06/30	7,000,000.00	7,316,640.66
US T 11.25% 15/02/15	2,000,000.00	2,643,437.50
US T 2% 13/11/30	7,000,000.00	7,215,468.75
US T 2% 16/01/31	7,000,000.00	7,372,968.75
US T 2% 21/11/15	3,000,000.00	3,006,093.75
US T 2.125 15/12/31	3,000,000.00	3,173,437.50
US T 2.125% 14/11/30	10,500,000.00	10,993,828.12
US T 2.125% 16/02/29	5,000,000.00	5,294,140.65
US T 2.125% 2015/05/31	8,000,000.00	8,428,750.00
US T 2.125% 21/08/15	11,000,000.00	11,187,343.75
US T 2.25% 14/05/31	7,000,000.00	7,297,500.00
US T 2.25% 15/01/31	10,000,000.00	10,529,687.50
US T 2.25% 17/11/30	7,000,000.00	7,452,812.50
US T 2.25% 18/07/31	6,000,000.00	6,359,062.50
US T 2.375% 14/08/31	8,000,000.00	8,400,625.04
US T 2.375% 14/09/30	10,000,000.00	10,514,062.50
US T 2.375% 14/10/31	8,000,000.00	8,419,375.04
US T 2.375% 15/02/28	9,000,000.00	9,520,312.50
US T 2.375% 16/03/31	5,500,000.00	5,877,265.62
US T 2.375% 17/7/31	5,000,000.00	5,364,062.50
US T 2.375% 180630	2,000,000.00	2,135,937.50
US T 2.5% 13/03/31	4,500,000.00	4,613,554.71
US T 2.5% 15/03/31	9,000,000.00	9,566,718.75
US T 2.5% 15/04/30	10,000,000.00	10,641,406.30
US T 2.50% 2017/06/30	5,000,000.00	5,396,875.00



US T 2.625% 14/06/30	9,000,000.00	9,478,828.17
US T 2.625% 14/07/31	6,000,000.00	6,331,406.28
US T 2.625% 16/02/29	5,000,000.00	5,389,843.75
US T 2.625% 16/04/30	5,000,000.00	5,395,312.50
US T 2.625% 18/01/31	4,000,000.00	4,341,875.00
US T 2.625% 18/04/30	4,000,000.00	4,341,250.00
US T 2.625% 20/11/15	18,000,000.00	19,237,500.00
US T 2.625% 20/8/15	15,000,000.00	16,073,437.50
US T 2.625% 2014/12/31	8,000,000.00	8,500,000.00
US T 2.75 17/12/31	4,000,000.00	4,371,875.00
US T 2.75% 13/02/28	3,700,000.00	3,796,257.83
US T 2.75% 13/10/31	5,500,000.00	5,729,882.84
US T 2.75% 16/11/30	7,000,000.00	7,622,343.75
US T 2.75% 19/02/15	9,000,000.00	9,804,375.00
US T 2.75% 2017/05/31	7,000,000.00	7,645,312.50
US T 2.875% 13/01/31	4,000,000.00	4,101,250.00
US T 2.875% 18/03/31	4,000,000.00	4,401,250.00
US T 3% 16/08/31	7,000,000.00	7,691,250.00
US T 3% 16/09/30	7,000,000.00	7,698,906.25
US T 3% 17/02/28	7,000,000.00	7,725,156.25
US T 3.125% 13/04/30	4,500,000.00	4,655,390.62
US T 3.125% 13/08/31	5,500,000.00	5,739,335.96
US T 3.125% 13/09/30	6,500,000.00	6,798,085.97
US T 3.125% 16/10/31	6,000,000.00	6,638,437.50
US T 3.125% 17/01/31	7,000,000.00	7,763,437.50
US T 3.125% 17/04/30	7,000,000.00	7,778,750.00
US T 3.125% 19/05/15	12,000,000.00	13,381,875.00
US T 3.125% 21/05/15	11,000,000.00	12,175,625.00
US T 3.125% 41/11/15	2,000,000.00	1,988,437.50
US T 3.25% 16/05/31	4,000,000.00	4,426,250.00
US T 3.25% 16/06/30	6,000,000.00	6,644,062.50
US T 3.25% 16/07/31	5,000,000.00	5,546,093.75
US T 3.25% 17/03/31	4,000,000.00	4,465,625.00
US T 3.25% 2016/12/31	6,000,000.00	6,684,375.00
US T 3.375% 13/06/30	5,000,000.00	5,211,718.75
US T 3.375% 13/07/31	5,500,000.00	5,747,070.34
US T 3.375% 19/11/15	11,000,000.00	12,460,937.50
US T 3.5% 13/05/31	5,000,000.00	5,210,937.50
US T 3.5% 18/02/15	8,500,000.00	9,654,140.62
US T 3.5% 20/05/15	15,000,000.00	17,135,156.25
US T 3.5% 39/02/15	6,000,000.00	6,450,000.00
US T 3.625 12/12/31	3,500,000.00	3,603,359.37
US T 3.625% 13/05/15	3,650,000.00	3,802,843.75
US T 3.625% 19/08/15	9,000,000.00	10,357,031.25
US T 3.625% 20/02/15	15,000,000.00	17,280,468.75
US T 3.625% 21/02/15	13,000,000.00	14,956,093.75

US T 3.75% 18/11/15	7,000,000.00	8,092,656.25
US T 3.75% 41/08/15	5,000,000.00	5,596,875.00
US T 3.875% 13/02/15	3,800,000.00	3,937,156.25
US T 3.875% 18/05/15	6,000,000.00	6,966,562.50
US T 3.875% 40/8/15	11,000,000.00	12,595,000.00
US T 4% 14/02/15	6,500,000.00	6,975,312.50
US T 4% 18/08/15	6,000,000.00	7,034,062.50
US T 4% 2015/02/15	7,700,000.00	8,513,312.50
US T 4.125 15/05/15	4,200,000.00	4,690,875.00
US T 4.25% 13/08/15	7,000,000.00	7,409,062.50
US T 4.25% 13/11/15	6,900,000.00	7,370,062.50
US T 4.25% 14/08/15	5,400,000.00	5,920,593.75
US T 4.25% 14/11/15	6,100,000.00	6,742,406.25
US T 4.25% 15/08/15	7,600,000.00	8,571,375.00
US T 4.25% 17/11/15	5,000,000.00	5,882,031.25
US T 4.25% 39/05/15	7,000,000.00	8,523,593.75
US T 4.25% 40/11/15	11,000,000.00	13,407,968.75
US T 4.375% 38/02/15	4,200,000.00	5,202,750.00
US T 4.375% 39/11/15	9,000,000.00	11,174,062.50
US T 4.375% 40/05/15	11,000,000.00	13,667,500.00
US T 4.375% 41/05/15	6,000,000.00	7,460,625.00
US T 4.5 15/11/15	5,800,000.00	6,637,375.00
US T 4.5% 160215	5,400,000.00	6,223,500.00
US T 4.5% 17/05/15	3,000,000.00	3,545,156.25
US T 4.5% 36/02/15	5,500,000.00	6,914,531.25
US T 4.5% 38/05/15	4,500,000.00	5,684,062.50
US T 4.5% 39/08/15	7,000,000.00	8,858,281.25
US T 4.625% 16/11/15	5,200,000.00	6,116,500.00
US T 4.625% 17/02/15	3,000,000.00	3,547,500.00
US T 4.625% 40/02/15	10,000,000.00	12,907,812.50
US T 4.75% 14/05/15	6,400,000.00	7,028,000.00
US T 4.75% 17/08/15	5,000,000.00	6,000,781.25
US T 4.75% 37/02/15	4,000,000.00	5,214,375.00
US T 4.75% 41/02/15	11,000,000.00	14,492,500.00
US T 4.875% 16/08/15	4,900,000.00	5,785,062.50
US T 5% 37/05/15	2,000,000.00	2,699,687.50
US T 5.125% 16/05/15	5,700,000.00	6,748,265.62
US T 5.25% 28/11/15	2,000,000.00	2,682,812.50
US T 5.25% 29/02/15	2,000,000.00	2,687,187.50
US T 5.375% 31/02/15	3,020,000.00	4,172,790.62
US T 5.5% 28/08/15	2,000,000.00	2,748,437.50
US T 6% 26/02/15	1,000,000.00	1,412,812.50
US T 6.125% 27/11/15	4,000,000.00	5,798,750.00
US T 6.125% 29/08/15	1,100,000.00	1,620,437.50
US T 6.25% 23/08/15	4,500,000.00	6,368,906.25
US T 6.25% 30/05/15	3,000,000.00	4,506,562.50

US T 6.5% 26/11/15	2,000,000.00	2,968,125.00	
US T 6.625% 27/02/15	2,000,000.00	3,007,187.50	
US T 6.75% 26/08/15	1,000,000.00	1,512,187.50	
US T 6.875% 25/08/15	2,000,000.00	3,024,687.50	
US T 7.125% 23/02/15	2,400,000.00	3,592,875.00	
US T 7.25% 16/05/15	4,000,000.00	5,096,250.00	
US T 7.25% 22/08/15	2,500,000.00	3,746,484.37	
US T 7.5% 16/11/15	2,400,000.00	3,145,125.00	
US T 7.5% 24/11/15	1,000,000.00	1,572,343.75	
US T 7.625% 25/02/15	2,000,000.00	3,181,875.00	
US T 7.875% 21/02/15	2,000,000.00	3,025,000.00	
US T 8% 21/11/15	2,800,000.00	4,334,750.00	
US T 8.125% 21/05/15	1,000,000.00	1,542,187.50	
US T 8.75% 17/05/15	3,000,000.00	4,201,406.25	
US T 8.75% 20/08/15	1,000,000.00	1,564,687.50	
US T 8.875% 17/08/15	2,000,000.00	2,848,437.50	
US T 8.875% 190215	2,100,000.00	3,162,468.75	
米ドル 小計	1,186,970,000.00	1,299,730,409.14	
( 邦貨換算額 )		(103,471,537,871)	( 単位 : 円 )
<b>カナダドル</b>			
CAN 1.5% 12/12/01	3,000,000.00	3,010,440.00	
CAN 1.5% 170301	2,000,000.00	2,002,400.00	
CAN 1.75% 2013/03/01	4,000,000.00	4,027,520.00	
CAN 2% 12/09/01	3,000,000.00	3,015,330.00	
CAN 2% 14/03/01	3,000,000.00	3,052,650.00	
CAN 2% 14/12/01	4,000,000.00	4,086,600.00	
CAN 2% 16/06/01	2,000,000.00	2,050,900.00	
CAN 2.5% 13/09/01	2,000,000.00	2,042,400.00	
CAN 2.5% 2015/06/01	2,000,000.00	2,079,480.00	
CAN 2.75% 16/09/01	2,000,000.00	2,116,300.00	
CAN 3% 14/06/01	4,500,000.00	4,687,065.00	
CAN 3% 15/12/01	3,000,000.00	3,185,640.00	
CAN 3.25% 21/06/01	2,000,000.00	2,200,400.00	
CAN 3.5% 13/06/01	4,500,000.00	4,637,205.00	
CAN 3.5% 20/06/01	3,000,000.00	3,356,190.00	
CAN 3.75% 19/06/01	5,000,000.00	5,673,000.00	
CAN 4% 16/06/01	3,000,000.00	3,324,030.00	
CAN 4% 17/06/01	3,000,000.00	3,377,340.00	
CAN 4% 41/06/01	4,000,000.00	5,106,000.00	
CAN 4.25% 18/06/01	2,500,000.00	2,892,250.00	
CAN 4.5% 15/06/01	3,000,000.00	3,311,370.00	
CAN 5% 14/06/01	2,500,000.00	2,715,800.00	
CAN 5% 37/06/01	4,000,000.00	5,699,120.00	
CAN 5.25% 13/06/01	2,000,000.00	2,105,100.00	
CAN 5.75% 29/06/01	2,800,000.00	4,055,492.00	

	CAN 5.75% 33/06/01	3,000,000.00	4,512,150.00	
	CAN 8% 23/06/01	1,400,000.00	2,206,722.00	
	CAN 8% 27/06/01	1,000,000.00	1,711,280.00	
	CAN 9% 25/06/01	1,480,000.00	2,606,235.60	
	カナダドル 小計	82,680,000.00	94,846,409.60	
	(邦貨換算額)		(7,613,321,298)	(単位:円)
	メキシコペソ			
	MEX BONOS 8% 200611	50,000,000.00	56,498,900.00	
	MEX BONOS 8.5% 290531	50,000,000.00	57,292,000.00	
	MEX BONOS 8.5% 381118	65,000,000.00	72,606,300.00	
	MEX BONOS 9% 121220	90,000,000.00	93,318,660.00	
	MEX BONOS 9.5% 141218	80,000,000.00	89,604,160.00	
	メキシコペソ 小計	335,000,000.00	369,320,020.00	
	(邦貨換算額)		(2,311,943,325)	(単位:円)
	ユーロ			
	BGB 2.75% 16/03/28	2,000,000.00	2,045,160.00	
	BGB 3.25% 16/09/28	3,500,000.00	3,636,780.00	
	BGB 3.5% 15/03/28	1,500,000.00	1,572,870.00	
	BGB 3.5% 17/06/28	2,000,000.00	2,080,460.00	
	BGB 3.75% 15/09/28	3,300,000.00	3,497,934.00	
	BGB 3.75% 20/09/28	4,000,000.00	4,112,600.00	
	BGB 4% 13/03/28	2,800,000.00	2,892,624.00	
	BGB 4% 14/03/28	3,200,000.00	3,359,616.00	
	BGB 4% 17/03/28	2,500,000.00	2,668,750.00	
	BGB 4% 18/03/28	2,500,000.00	2,660,625.00	
	BGB 4% 19/03/28	3,000,000.00	3,177,000.00	
	BGB 4% 2022/03/28	3,000,000.00	3,102,300.00	
	BGB 4.25% 13/09/28	3,000,000.00	3,136,200.00	
	BGB 4.25% 14/09/28	2,500,000.00	2,659,325.00	
	BGB 4.25% 2041/03/28	2,000,000.00	2,040,760.00	
	BGB 4.25% 21/09/28	3,000,000.00	3,162,750.00	
	BGB 4.5% 26/03/28	1,000,000.00	1,058,480.00	
	BGB 5% 35/03/28	4,500,000.00	5,075,325.00	
	BGB 5.5% 17/09/28	1,740,000.00	1,986,210.00	
	BGB 5.5% 28/03/28	4,000,000.00	4,706,520.00	
	BGB 8% 12/12/24	1,600,000.00	1,697,680.00	
	BGB 8% 15/03/28	2,000,000.00	2,365,300.00	
	BKO 1.5% 13/03/15	5,000,000.00	5,070,150.00	
	BTNS 2% 13/09/25	2,500,000.00	2,553,325.00	
	BTNS 2% 15/07/12	5,000,000.00	5,108,500.00	
	BTNS 2.25% 16/02/25	4,000,000.00	4,101,520.00	
	BTNS 2.5% 14/01/12	6,500,000.00	6,714,500.00	
	BTNS 2.5% 15/01/15	4,500,000.00	4,674,150.00	
	BTNS 2.5% 16/07/25	3,600,000.00	3,710,880.00	

	BTNS 3% 14/07/12	5,500,000.00	5,767,190.00	
	BTNS 3.75% 13/01/12	2,000,000.00	2,059,460.00	
	BTNS 4.5% 13/07/12	5,500,000.00	5,799,365.00	
	BTPS 2% 12/12/15	5,000,000.00	4,995,650.00	
	BTPS 2% 13/06/01	4,000,000.00	3,965,200.00	
	BTPS 2.25% 13/11/01	3,000,000.00	2,963,100.00	
	BTPS 3 14/04/01	4,000,000.00	3,980,720.00	
	BTPS 3% 15/04/15	5,000,000.00	4,921,750.00	
	BTPS 3% 15/06/15	4,000,000.00	3,925,120.00	
	BTPS 3% 15/11/01	4,000,000.00	3,882,120.00	
	BTPS 3.5% 14/06/01	5,000,000.00	5,024,250.00	
	BTPS 3.75% 13/12/15	5,000,000.00	5,054,900.00	
	BTPS 3.75% 15/08/01	6,200,000.00	6,203,286.00	
	BTPS 3.75% 16/04/15	3,000,000.00	2,965,350.00	
	BTPS 3.75% 16/08/01	6,000,000.00	5,910,900.00	
	BTPS 3.75% 21/03/01	6,000,000.00	5,389,680.00	
	BTPS 3.75% 21/08/01	6,300,000.00	5,594,085.00	
	BTPS 4% 17/02/01	6,000,000.00	5,913,000.00	
	BTPS 4% 20/09/01	5,500,000.00	5,063,465.00	
	BTPS 4% 37/02/01	6,500,000.00	5,072,275.00	
	BTPS 4.25 13/08/01	5,810,000.00	5,918,530.80	
	BTPS 4.25 19/02/01	5,400,000.00	5,234,220.00	
	BTPS 4.25% 13/04/15	4,500,000.00	4,582,485.00	
	BTPS 4.25% 14/07/01	1,300,000.00	1,325,311.00	
	BTPS 4.25% 14/08/01	6,900,000.00	7,041,450.00	
	BTPS 4.25% 15/02/01	5,000,000.00	5,108,250.00	
	BTPS 4.25% 19/09/01	7,000,000.00	6,689,200.00	
	BTPS 4.25% 20/03/01	5,000,000.00	4,735,250.00	
	BTPS 4.5% 18/02/01	6,000,000.00	5,966,400.00	
	BTPS 4.5% 18/08/01	5,000,000.00	4,943,900.00	
	BTPS 4.5% 19/03/01	6,000,000.00	5,864,280.00	
	BTPS 4.5% 20/02/01	5,500,000.00	5,310,965.00	
	BTPS 4.5% 26/03/01	3,000,000.00	2,657,040.00	
	BTPS 4.75% 13/02/01	5,300,000.00	5,418,614.00	
	BTPS 4.75% 16/09/15	4,500,000.00	4,571,325.00	
	BTPS 4.75% 21/09/01	6,000,000.00	5,743,500.00	
	BTPS 4.75% 23/08/01	5,500,000.00	5,118,740.00	
	BTPS 5% 25/03/01	5,000,000.00	4,688,100.00	
	BTPS 5% 34/08/01	4,970,000.00	4,425,536.50	
	BTPS 5% 39/08/01	4,000,000.00	3,526,120.00	
	BTPS 5% 40/09/01	5,000,000.00	4,391,250.00	
	BTPS 5.25 17/08/01	5,000,000.00	5,152,650.00	
	BTPS 5.25% 29/11/01	7,200,000.00	6,723,216.00	
	BTPS 5.75% 33/02/01	3,700,000.00	3,607,500.00	
	BTPS 6% 31/05/01	6,900,000.00	6,935,052.00	
	BTPS 6.5% 27/11/01	5,960,000.00	6,246,080.00	

BTPS 7.25% 26/11/01	2,000,000.00	2,270,560.00
BTPS 9.00% 23/11/01	3,000,000.00	3,732,690.00
BUNDESOLIGA 2% 16/02/26	3,000,000.00	3,160,200.00
BUNDESSCHA 1.75% 130614	3,000,000.00	3,060,450.00
BUNDESSCHATZ 0.75% 130913	1,700,000.00	1,713,736.00
DBR 2.25% 20/09/04	4,000,000.00	4,171,920.00
DBR 2.25% 21/09/04	3,000,000.00	3,097,500.00
DBR 2.5% 21/01/04	4,000,000.00	4,242,600.00
DBR 3% 20/07/04	7,000,000.00	7,725,760.00
DBR 3.25% 15/07/04	5,500,000.00	6,004,350.00
DBR 3.25% 20/01/04	5,500,000.00	6,183,925.00
DBR 3.25% 21/07/04	5,000,000.00	5,603,500.00
DBR 3.25% 42/07/04	2,000,000.00	2,310,200.00
DBR 3.5% 160104	5,200,000.00	5,771,376.00
DBR 3.5% 19/07/04	5,000,000.00	5,708,350.00
DBR 3.75% 13/07/04	5,800,000.00	6,078,980.00
DBR 3.75% 15/01/04	6,000,000.00	6,572,400.00
DBR 3.75% 17/01/04	5,000,000.00	5,682,650.00
DBR 3.75% 19/01/04	6,000,000.00	6,942,300.00
DBR 4% 18/01/04	6,000,000.00	6,976,380.00
DBR 4% 37/01/04	6,200,000.00	7,821,176.00
DBR 4.00% 16/07/04	5,900,000.00	6,719,982.00
DBR 4.25% 14/01/04	5,700,000.00	6,127,101.00
DBR 4.25% 14/07/04	6,500,000.00	7,103,200.00
DBR 4.25% 17/07/04	4,000,000.00	4,676,120.00
DBR 4.25% 18/07/04	5,200,000.00	6,157,580.00
DBR 4.25% 39/07/04	3,500,000.00	4,667,775.00
DBR 4.5% 13/01/04	4,700,000.00	4,877,096.00
DBR 4.75% 28/07/04	3,000,000.00	3,876,900.00
DBR 4.75% 34/07/04	4,600,000.00	6,266,810.00
DBR 4.75% 40/07/04	4,000,000.00	5,774,520.00
DBR 5.5% 31/01/04	4,300,000.00	6,146,420.00
DBR 5.625% 28/01/04	2,980,000.00	4,182,132.00
DBR 6% 16/06/20	890,000.00	1,085,248.20
DBR 6.25% 24/01/04	2,700,000.00	3,845,556.00
DBR 6.25% 300104	2,200,000.00	3,344,506.00
DBR 6.5% 27/07/04	3,000,000.00	4,542,450.00
FINNISH GO 1.75% 160415	2,000,000.00	2,052,300.00
FINNISH GO 3.875% 170915	2,000,000.00	2,237,560.00
FRANCE 3.75% 17/04/25	8,000,000.00	8,690,800.00
FRANCE 3.75% 19/10/25	5,000,000.00	5,371,900.00
FRANCE O.A.T.3.5% 150425	5,600,000.00	5,993,120.00
FRANCE O.A.T.3.5% 200425	7,000,000.00	7,364,210.00
FRANCE O.A.T.4% 600425	2,000,000.00	2,129,460.00
FRANCE OAT4% 141025	5,000,000.00	5,392,250.00
FRTR 2.5% 20/10/25	7,000,000.00	6,802,460.00

	FRTR 3.0% 15/10/25	9,000,000.00	9,489,150.00	
	FRTR 3.25% 16/04/25	6,700,000.00	7,130,475.00	
	FRTR 3.25% 21/10/25	7,000,000.00	7,145,250.00	
	FRTR 3.5% 26/04/25	6,000,000.00	6,053,280.00	
	FRTR 3.75% 21/04/25	7,700,000.00	8,192,415.00	
	FRTR 4% 13/04/25	5,700,000.00	5,932,275.00	
	FRTR 4% 13/10/25	5,060,000.00	5,336,782.00	
	FRTR 4% 14/04/25	5,300,000.00	5,658,704.00	
	FRTR 4% 18/04/25	6,000,000.00	6,594,300.00	
	FRTR 4% 38/10/25	6,700,000.00	7,098,650.00	
	FRTR 4% 55/04/25	3,170,000.00	3,366,952.10	
	FRTR 4.25% 17/10/25	4,500,000.00	5,001,885.00	
	FRTR 4.25% 18/10/25	5,000,000.00	5,560,000.00	
	FRTR 4.25% 19/04/25	6,900,000.00	7,666,590.00	
	FRTR 4.25% 23/10/25	7,000,000.00	7,693,560.00	
	FRTR 4.5% 41/04/25	4,000,000.00	4,596,320.00	
	FRTR 4.75% 35/04/25	4,600,000.00	5,397,088.00	
	FRTR 5% 16/10/25	7,600,000.00	8,670,080.00	
	FRTR 5.5% 29/04/25	6,000,000.00	7,473,900.00	
	FRTR 5.75% 32/10/25	4,700,000.00	6,145,955.00	
	FRTR 6.00% 25/10/25	3,500,000.00	4,500,125.00	
	FRTR 8.5% 19/10/25	2,550,000.00	3,586,651.50	
	FRTR 8.5% 23/04/25	3,200,000.00	4,778,880.00	
	IRISH 4% 14/01/15	2,500,000.00	2,497,500.00	
	IRISH 4.4% 19/06/18	1,500,000.00	1,335,675.00	
	IRISH 4.5% 18/10/18	2,000,000.00	1,820,560.00	
	IRISH 4.5% 20/04/18	2,490,000.00	2,148,123.00	
	IRISH 4.6% 16/04/18	2,800,000.00	2,767,744.00	
	IRISH 5% 13/04/18	2,000,000.00	2,022,000.00	
	IRISH 5% 2020/10/18	2,000,000.00	1,763,400.00	
	IRISH 5.4% 25/03/13	2,000,000.00	1,757,860.00	
	IRISH 5.9% 19/10/18	2,000,000.00	1,902,360.00	
	ITALY 5.75% 16/07/25	1,000,000.00	1,034,030.00	
	NETHER 1% 14/01/15	2,000,000.00	2,020,800.00	
	NETHERLANDS 2.5% 170115	2,000,000.00	2,101,920.00	
	NETHERLANDS 2.75 150115	3,500,000.00	3,701,775.00	
	NETHERLANDS 3.25% 150715	5,100,000.00	5,493,465.00	
	NETHERLANDS 3.25% 210715	4,200,000.00	4,540,956.00	
	NETHERLANDS 3.5% 200715	4,000,000.00	4,412,800.00	
	NETHERLANDS 3.75% 140715	3,400,000.00	3,658,162.00	
	NETHERLANDS 3.75% 230115	2,000,000.00	2,244,160.00	
	NETHERLANDS 3.75% 420115	3,000,000.00	3,686,850.00	
	NETHERLANDS 4% 16/07/15	3,300,000.00	3,689,235.00	
	NETHERLANDS 4% 18/07/15	3,500,000.00	3,965,780.00	
	NETHERLANDS 4% 19/07/15	3,500,000.00	3,979,780.00	
	NETHERLANDS 4.25% 130715	3,400,000.00	3,584,382.00	

	NETHERLANDS 4.5% 170715	3,600,000.00	4,143,420.00	
	NETHERLANDS 5.5% 280115	3,000,000.00	4,077,690.00	
	NETHERLANDS 7.5% 230115	1,000,000.00	1,480,600.00	
	NETHERLANDS GOVT4%370115	3,000,000.00	3,716,940.00	
	OBL 1.75% 15/10/09	4,000,000.00	4,171,200.00	
	OBL 2.25% 14/04/11	4,000,000.00	4,173,600.00	
	OBL 2.25% 15/04/10	4,000,000.00	4,223,200.00	
	OBL 2.5% 14/10/10	4,000,000.00	4,226,000.00	
	OBL 2.5% 15/02/27	4,500,000.00	4,778,550.00	
	OBL 3.5% 13/04/12	4,500,000.00	4,669,560.00	
	OBL 4% 13/10/11	4,000,000.00	4,245,200.00	
	OBL-160 2.75% 16/04/08	4,000,000.00	4,333,520.00	
	OBL-161 1.25% 161014	2,000,000.00	2,039,100.00	
	RAGB 3.2% 17/02/20	2,700,000.00	2,862,675.00	
	RAGB 3.4% 14/10/20	2,000,000.00	2,131,100.00	
	RAGB 3.5% 15/07/15	3,200,000.00	3,432,416.00	
	RAGB 3.5% 21/09/15	4,000,000.00	4,195,120.00	
	RAGB 3.65% 22/04/20	2,000,000.00	2,110,960.00	
	RAGB 3.8% 13/10/20	3,000,000.00	3,153,300.00	
	RAGB 3.9% 20/07/15	4,500,000.00	4,869,000.00	
	RAGB 4% 16/09/15	2,000,000.00	2,196,900.00	
	RAGB 4.15% 37/03/15	2,000,000.00	2,240,760.00	
	RAGB 4.3% 14/07/15	2,400,000.00	2,596,800.00	
	RAGB 4.3% 17/09/15	1,500,000.00	1,668,495.00	
	RAGB 4.35% 19/03/15	2,200,000.00	2,450,514.00	
	RAGB 4.65% 18/01/15	3,000,000.00	3,389,490.00	
	RAGB 4.85% 26/03/15	2,000,000.00	2,343,560.00	
	RAGB 6.25% 27/07/15	2,000,000.00	2,689,300.00	
	RFGB 3.125% 14/09/15	1,500,000.00	1,599,075.00	
	RFGB 3.375% 20/04/15	2,000,000.00	2,166,700.00	
	RFGB 3.5% 21/04/15	1,000,000.00	1,091,020.00	
	RFGB 4% 25/07/04	1,000,000.00	1,136,900.00	
	RFGB 4.25% 15/07/04	1,300,000.00	1,443,624.00	
	RFGB 4.375% 19/07/04	1,000,000.00	1,155,780.00	
	RFGB 5.375% 13/07/04	1,500,000.00	1,602,000.00	
	SPGB 2.3% 2013/04/30	4,500,000.00	4,515,840.00	
	SPGB 2.5% 13/10/31	4,000,000.00	4,000,400.00	
	SPGB 3% 15/04/30	4,000,000.00	3,990,200.00	
	SPGB 3.15% 16/01/31	3,800,000.00	3,764,014.00	
	SPGB 3.25% 16/04/30	5,000,000.00	4,931,150.00	
	SPGB 3.3% 14/10/31	5,000,000.00	5,054,500.00	
	SPGB 3.4% 14/04/30	1,000,000.00	1,012,750.00	
	SPGB 3.8% 17/01/31	3,000,000.00	2,978,940.00	
	SPGB 4% 20/04/30	4,000,000.00	3,815,400.00	
	SPGB 4.1% 18/07/30	4,000,000.00	3,954,800.00	
	SPGB 4.2% 13/07/30	3,500,000.00	3,593,975.00	



SPGB 4.2% 37/01/31	3,250,000.00	2,574,097.50	
SPGB 4.25% 14/01/31	3,500,000.00	3,603,250.00	
SPGB 4.25% 16/10/31	5,000,000.00	5,080,100.00	
SPGB 4.3% 19/10/31	3,000,000.00	2,944,800.00	
SPGB 4.4% 15/01/31	3,800,000.00	3,953,064.00	
SPGB 4.6% 19/07/30	3,500,000.00	3,512,250.00	
SPGB 4.65% 25/07/30	3,500,000.00	3,177,475.00	
SPGB 4.7% 41/07/30	4,000,000.00	3,367,600.00	
SPGB 4.75% 14/07/30	3,500,000.00	3,653,475.00	
SPGB 4.8% 24/01/31	3,300,000.00	3,118,434.00	
SPGB 4.85% 20/10/31	4,000,000.00	3,995,200.00	
SPGB 4.9% 40/07/30	4,000,000.00	3,458,400.00	
SPGB 5.5% 17/07/30	4,280,000.00	4,560,468.40	
SPGB 5.5% 21/04/30	4,000,000.00	4,138,720.00	
SPGB 5.75% 32/07/30	3,700,000.00	3,667,921.00	
SPGB 5.9% 26/07/30	2,500,000.00	2,540,575.00	
SPGB 6% 29/01/31	4,900,000.00	5,002,900.00	
SPGB 6.15% 13/01/31	3,600,000.00	3,744,360.00	
ユーロ 小計	916,950,000.00	970,970,297.00	
(邦貨換算額)		(102,155,784,947)	(単位：円)
英ポンド			
UKT 1.75% 17/01/22	3,000,000.00	3,101,223.00	
UKT 2% 16/01/22	8,000,000.00	8,372,560.00	
UKT 2.25% 14/03/07	6,000,000.00	6,223,140.00	
UKT 2.75% 15/01/22	6,500,000.00	6,912,750.00	
UKT 3.75% 19/09/07	6,000,000.00	6,882,780.00	
UKT 3.75% 20/09/07	5,000,000.00	5,728,650.00	
UKT 3.75% 21/09/07	7,000,000.00	7,979,510.00	
UKT 3.75% 520722	1,300,000.00	1,402,453.00	
UKT 4% 16/09/07	4,800,000.00	5,451,840.00	
UKT 4% 22/03/07	3,000,000.00	3,483,180.00	
UKT 4% 60/01/22	2,000,000.00	2,312,600.00	
UKT 4.25% 27/12/07	3,800,000.00	4,460,820.00	
UKT 4.25% 32/06/07	3,800,000.00	4,406,594.00	
UKT 4.25% 36/03/07	4,800,000.00	5,593,200.00	
UKT 4.25% 39/09/07	3,500,000.00	4,063,150.00	
UKT 4.25% 40/12/07	5,500,000.00	6,385,005.00	
UKT 4.25% 46/12/07	3,900,000.00	4,603,326.00	
UKT 4.25% 49/12/07	3,500,000.00	4,138,750.00	
UKT 4.25% 55/12/07	5,000,000.00	6,002,500.00	
UKT 4.5% 13/03/07	6,700,000.00	6,983,075.00	
UKT 4.5% 19/03/07	4,200,000.00	5,036,346.00	
UKT 4.5% 34/09/07	4,000,000.00	4,806,000.00	
UKT 4.5% 42/12/07	4,000,000.00	4,857,200.00	
UKT 4.75% 15/09/07	4,400,000.00	5,035,096.00	

UKT 4.75% 20/03/07	5,200,000.00	6,355,284.00	
UKT 4.75% 30/12/07	3,800,000.00	4,703,488.00	
UKT 4.75% 38/12/07	3,500,000.00	4,377,625.00	
UKT 5% 14/09/07	5,500,000.00	6,128,650.00	
UKT 5% 18/03/07	3,500,000.00	4,264,050.00	
UKT 5% 25/03/07	3,900,000.00	4,942,080.00	
UKT 6.0% 281207	3,000,000.00	4,255,320.00	
UKT 8% 13/09/27	1,500,000.00	1,680,586.50	
UKT 8% 15/12/07	1,900,000.00	2,422,494.30	
UKT 8% 21/06/07	2,620,000.00	3,953,632.40	
UKT 8.75% 17/08/25	1,300,000.00	1,832,430.60	
英ポンド 小計	145,420,000.00	169,137,388.80	
(邦貨換算額)		(21,375,583,196)	(単位：円)
スイスフラン			
SWITZERLAND 2.5% 160312	2,000,000.00	2,191,200.00	
SWITZERLAND 3% 180108	1,000,000.00	1,154,200.00	
SWITZERLAND 3% 19/05/12	1,500,000.00	1,770,750.00	
SWITZERLAND 4% 13/02/11	1,000,000.00	1,038,300.00	
SWITZERLAND 4% 280408	900,000.00	1,286,100.00	
SWITZERLAND 4% 230211	2,000,000.00	2,663,000.00	
SWITZERLAND 4.25% 140106	800,000.00	863,600.00	
SWITZERLAND 4.25% 170605	2,000,000.00	2,417,400.00	
スイスフラン 小計	11,200,000.00	13,384,550.00	
(邦貨換算額)		(1,164,589,695)	(単位：円)
スウェーデンクローナ			
SGB 3% 16/07/12	17,000,000.00	18,237,600.00	
SGB 3.5% 39/03/30	10,000,000.00	12,240,600.00	
SGB 3.75% 17/08/12	13,200,000.00	14,801,160.00	
SGB 4.25% 19/03/12	20,000,000.00	23,458,200.00	
SGB 4.5% 15/08/12	13,000,000.00	14,459,900.00	
SGB 5% 20/12/01	20,000,000.00	25,178,000.00	
SGB 6.75% 14/05/05	19,100,000.00	21,460,760.00	
スウェーデンクローナ 小計	112,300,000.00	129,836,220.00	
(邦貨換算額)		(1,548,946,104)	(単位：円)
ノルウェークローネ			
NORWAY GOV 3.75% 210525	7,000,000.00	7,815,500.00	
NORWAY GOV 4.25% 170519	10,000,000.00	11,110,000.00	
NORWAY GOV 4.5% 19/05/22	6,000,000.00	6,903,000.00	
NORWAY GOV 5% 150515	10,000,000.00	11,027,000.00	
NORWAY GOV 6.5% 130515	16,000,000.00	16,913,600.00	
ノルウェークローネ 小計	49,000,000.00	53,769,100.00	
(邦貨換算額)		(755,455,855)	(単位：円)

	デンマーククローネ			
	DGB 2% 14/11/15	13,000,000.00	13,562,900.00	
	DGB 3% 21/11/15	6,000,000.00	6,585,000.00	
	DGB 4% 15/11/15	16,000,000.00	18,048,000.00	
	DGB 4% 17/11/15	15,000,000.00	17,368,500.00	
	DGB 4% 19/11/15	21,000,000.00	24,801,000.00	
	DGB 4.5% 39/11/15	27,000,000.00	38,218,500.00	
	DGB 5% 13/11/15	20,820,000.00	22,501,423.20	
	DGB 7% 24/11/10	5,080,000.00	7,813,548.00	
	デンマーククローネ 小計	123,900,000.00	148,898,871.20	
	(邦貨換算額)		(2,106,919,027)	(単位：円)
	ポーランドズロチ			
	POLGB 0% 12/10/25	6,000,000.00	5,821,200.00	
	POLGB 5% 16/04/25	4,000,000.00	4,004,400.00	
	POLGB 5.00% 13/10/24	6,500,000.00	6,555,250.00	
	POLGB 5.25% 13/04/25	5,000,000.00	5,042,500.00	
	POLGB 5.25% 17/10/25	8,000,000.00	8,059,200.00	
	POLGB 5.25% 2020/10/25	5,000,000.00	4,930,000.00	
	POLGB 5.5% 19/10/25	6,000,000.00	6,021,600.00	
	POLGB 5.5% 2015/04/25	8,000,000.00	8,164,800.00	
	POLGB 5.75% 14/04/25	8,000,000.00	8,164,800.00	
	POLGB 5.75% 22/09/23	10,200,000.00	10,271,400.00	
	POLGB 6.25% 15/10/24	7,500,000.00	7,845,000.00	
	ポーランドズロチ 小計	74,200,000.00	74,880,150.00	
	(邦貨換算額)		(1,894,467,795)	(単位：円)
	オーストラリアドル			
	ACGB 4.25% 170721	1,000,000.00	1,020,400.00	
	ACGB 4.5% 14/10/21	2,000,000.00	2,038,000.00	
	ACGB 4.5% 20/04/15	4,000,000.00	4,142,736.00	
	ACGB 4.75% 12/11/15	1,000,000.00	1,005,001.00	
	ACGB 4.75% 15/10/21	1,000,000.00	1,035,000.00	
	ACGB 4.75% 16/06/15	4,000,000.00	4,168,460.00	
	ACGB 5.25% 19/03/15	3,000,000.00	3,250,926.00	
	ACGB 5.5% 13/12/15	2,000,000.00	2,066,920.00	
	ACGB 5.5% 18/01/21	2,000,000.00	2,171,500.00	
	ACGB 5.5% 23/04/21	1,000,000.00	1,107,700.00	
	ACGB 5.75% 21/05/15	5,000,000.00	5,671,500.00	
	ACGB 5.75% 22/07/15	2,000,000.00	2,270,000.00	
	ACGB 6% 17/02/15	3,300,000.00	3,643,655.40	
	ACGB 6.25% 14/06/15	3,000,000.00	3,172,644.00	
	ACGB 6.25% 15/04/15	3,000,000.00	3,231,987.00	
	ACGB 6.5% 13/05/15	3,540,000.00	3,653,995.08	
	オーストラリアドル 小計	40,840,000.00	43,650,424.48	
	(邦貨換算額)		(3,750,444,471)	(単位：円)

	シンガポールドル			
	SIGB 1.625% 130401	3,000,000.00	3,045,732.00	
	SIGB 2.25% 13/07/01	1,000,000.00	1,027,218.00	
	SIGB 2.25% 21/06/01	1,500,000.00	1,599,303.00	
	SIGB 3.125% 22/09/01	1,000,000.00	1,140,364.00	
	SIGB 3.25% 20/09/01	2,000,000.00	2,290,670.00	
	SIGB 3.5% 27/03/01	2,000,000.00	2,303,160.00	
	SIGB 3.625 140701	2,500,000.00	2,696,140.00	
	SIGB 3.75% 160901	1,000,000.00	1,143,078.00	
	SIGB 4% 18/09/01	2,200,000.00	2,632,828.00	
	シンガポールドル 小計	16,200,000.00	17,878,493.00	
	(邦貨換算額)		(1,137,787,294)	(単位：円)
	マレーシアリングット			
	MALAYSIAN 3.502 27/05/31	9,000,000.00	8,776,089.00	
	MALAYSIAN 3.702 13/02/25	8,000,000.00	8,071,952.00	
	MALAYSIAN 3.741 15/02/27	10,000,000.00	10,210,970.00	
	MALAYSIAN 3.814% 17/02/15	2,000,000.00	2,055,580.00	
	MALAYSIAN 4.24 18/02/07	5,000,000.00	5,255,330.00	
	MALAYSIAN 4.262 16/09/15	3,000,000.00	3,139,431.00	
	MALAYSIAN 4.378 19/11/29	5,000,000.00	5,349,850.00	
	MALAYSIAN 5.094 14/04/30	6,000,000.00	6,278,862.00	
	マレーシアリングット 小計	48,000,000.00	49,138,064.00	
	(邦貨換算額)		(1,297,244,889)	(単位：円)
	合計		250,584,025,767	単位：円
	(外貨建有価証券邦貨換算額合計)		(250,584,025,767)	(単位：円)

(注)

- 合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券にかかるもので、内書きであります。
- 米ドル表示の債券については、193銘柄、信託財産純資産総額に対する比率40.3%、合計に対する比率41.3%です。  
カナダドル表示の債券については、29銘柄、信託財産純資産総額に対する比率3.0%、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、231銘柄、信託財産純資産総額に対する比率39.8%、合計に対する比率40.8%です。  
英ポンド表示の債券については、35銘柄、信託財産純資産総額に対する比率8.3%、合計に対する比率8.5%です。  
スイスフラン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0.5%、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、7銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.6%、合計に対する比率0.6%です。  
ノルウェークローネ表示の債券については、5銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.3%、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、11銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.7%、

合計に対する比率0.8%です。

オーストラリアドル表示の債券については、16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1.5%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0.5%です。

マレーシアリングgit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0.5%、

合計に対する比率0.5%です。

## 独立監査人の監査報告書

平成24年4月10日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員  
公認会計士 鈴木 敏夫 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）の平成23年2月19日から平成24年2月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。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24年2月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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24年4月10日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 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23年2月19日から平成24年2月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。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24年2月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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24年4月10日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 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23年2月19日から平成24年2月20日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。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24年2月20日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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  
業務執行社員 公認会計士 鈴木 敏夫 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている三井住友・DC年金バランス50（標準型）の平成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XBRLデータ自体は含まれていません。

---

## 独立監査人の監査報告書

平成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（前期）へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成23年 6月17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  
業務執行社員指定有限責任社員 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23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。

## 独立監査人の中間監査報告書

平成23年12月15日

三井住友アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

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23年4月1日から平成24年3月31日までの第27期事業年度の中間会計期間（平成23年4月1日から平成23年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

### 中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三井住友アセットマネジメント株式会社の平成23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23年4月1日から平成23年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以上

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