

【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25年 5 月16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	http://www.smam-jp.com

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

（５）【申込手数料】

無手数料です。

(6) 【申込単位】

1円以上1円単位

(7) 【申込期間】

平成25年5月17日から平成26年5月15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。

二 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、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
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	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	グローバル (日本を含む)			
一般大型株	年 2 回	日本			日経225
中小型株	年 4 回	北米	ファミリーファンド	あり	
債券	年6回(隔月)	欧州			
一般社債	年12回(毎月)	アジア			
その他債券 (クレジット属性)	日 々	オセアニア			TOPIX
不動産投信	その他	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	なし	
その他資産 (投資信託以外(資産複合(株式、債券)資産配分固定型))		アフリカ			
資産複合 (資産配分固定型 資産配分変更型)		中近東(中東) エマージング			その他 (合成指数)

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

属性区分の「為替ヘッジ」は、対円での為替変動リスクに対するヘッジの有無を記載しています。

商品分類、属性区分は、一般社団法人投資信託協会「商品分類に関する指針」に基づき記載しています。商品分類、属性区分の全体的な定義等は一般社団法人投資信託協会のホームページ

(<http://www.toushin.or.jp/>) をご覧ください。

(2) 【ファンドの沿革】

平成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。

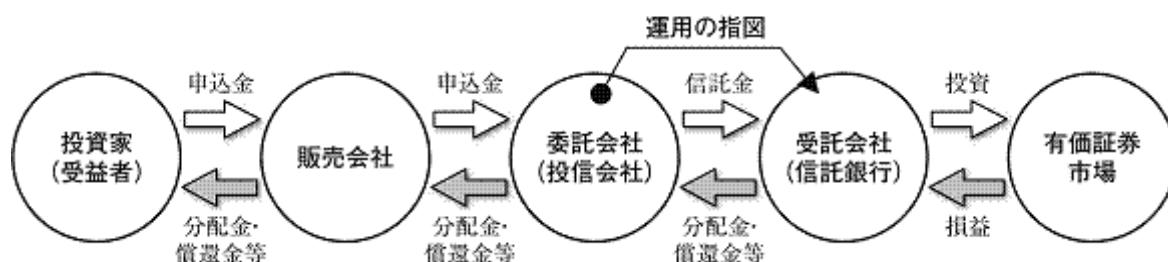
(ロ) 受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

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

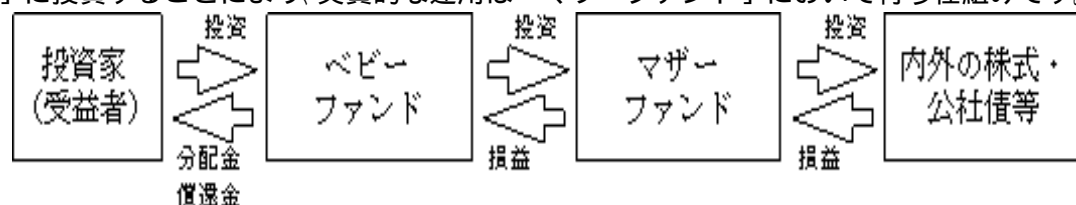
委託会社との間で締結される販売契約（名称の如何を問いません。）に基づき、当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書（目論見書）の提供、受益者からの一部解約実行請求の受付、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を行います。

運営の仕組み



当ファンドの運用は、「ファミリーファンド方式」で行われます。

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



ロ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

2,000百万円（平成25年3月29日現在）

(ロ) 会社の沿革

昭和60年7月15日 三生投資顧問株式会社設立

昭和62年2月20日 証券投資顧問業の登録

昭和62年6月10日 投資一任契約にかかる業務の認可

平成11年1月1日 三井生命保険相互会社の特別勘定運用部門と統合

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

平成12年1月27日 証券投資信託委託業の認可取得

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

平成25年4月1日 トヨタアセットマネジメント株式会社と合併

(八) 大株主の状況

(平成25年3月29日現在)

名称	住所	所有株式数	比率(%)
株式会社三井住友銀行	東京都千代田区丸の内一丁目1番2号	7,056	40.0
住友生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区城見一丁目4番35号	4,851	27.5
三井住友海上火災保険株式会社	東京都中央区新川二丁目27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 - B P I (総合)	55%	35%	15%
M S C I - K O K U S A I 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、原則として対円での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。

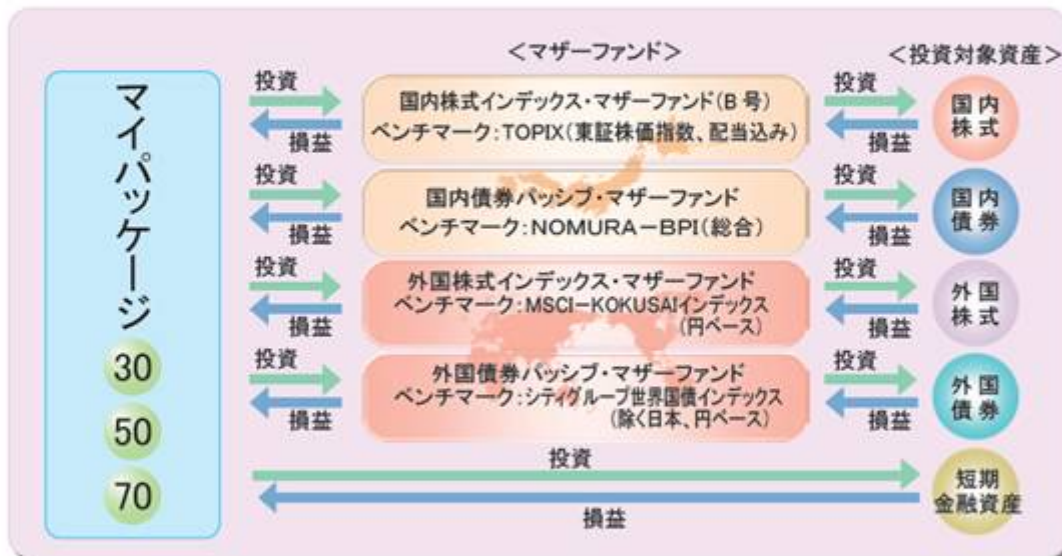
(ホ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

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。

ファンドのしくみ



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 Inc.、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。

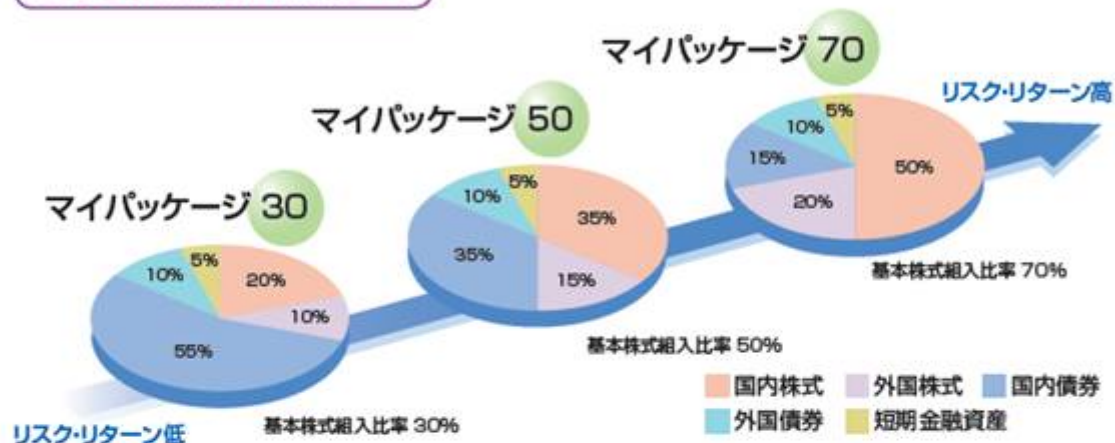
●指数を公表する各社は当ファンドの運用と何ら関係ありません。

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



※上図はイメージであり、実際とは異なる場合があります。

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。

各ファンドのベンチマークの資産別合成比率

	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、原則として対円での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。

各資産の投資元本成長比較（期間1993年3月末～2013年3月末）



(注1) 「国内株式」としてTOPIX（東証株価指数、配当込み）、「国内債券」としてNOMURA-BPI（総合）、「外国株式」としてMSCI-KOKUSAIインデックス（円ベース）、「外国債券」として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）の各指数と「短期金融資産」として無担保コール（翌日物）を用いて、三井住友アセットマネジメントが計算したものです。また、投資にかかるコストは考慮されておりません。

(注2) 上記各指数に関する著作権、知的財産権その他の一切の権利はその指数を算出、公表しているそれぞれの主体に帰属します（TOPIX：東京証券取引所、NOMURA-BPI（総合）：野村證券株式会社、MSCI-KOKUSAI：MSCI Inc.、シティグループ世界国債インデックス：シティグループ・グローバル・マーケット・インク）。また各作成主体は、その内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

(出所) 野村総合研究所、Bloomberg、MSCI Inc.、日銀HPを基に三井住友アセットマネジメント作成

※グラフ・データは、参考情報として記載した上記指数等の過去の実績であり、当ファンドの将来の運用成果等を示唆あるいは保証するものではありません。

各マザーファンドの運用プロセス

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

ポートフォリオの作成にあたっては、東証1部銘柄の中から、原則として投資不適格銘柄および低流動性銘柄を除外した上で、マルチファクターモデルを活用した最適化法により、推定トラッキングエラーの低減のみならず制約条件を加えることで、実績トラッキングエラーを抑えることを目指してポートフォリオを構築します。

TOPIX（東証株価指数、配当込み）との連動性を随時チェックし、必要に応じてマルチファクターモデルを使用してポートフォリオのリバランスを行います。

国内債券バッシブ・マザーファンド

わが国の公社債および短期金融資産を主要投資対象とし、NOMURA-BPI（総合）と連動する投資成果を目指して運用を行います。

ポートフォリオの作成にあたっては、マルチファクターモデルおよび委託会社独自のリスクモデルを併用して、ファンド規模に応じデュレーション、満期構成、セクター（債券種別）配分、事業債の格付け構成および業種を可能な限りNOMURA-BPI（総合）に近づけたポートフォリオを構築します。なお事業債の銘柄選択については、委託会社クレジットアナリストの調査結果に基づき、将来的に格下げによりNOMURA-BPI（総合）から外れる可能性が高い銘柄については、組入対象から除外することがあります。

NOMURA-BPI（総合）との連動性を随時チェックし、必要に応じてマルチファクターモデルおよび委託会社独自のリスクモデルを使用してポートフォリオのリバランスを行います。

外国株式インデックス・マザーファンド

主として日本を除く世界各国の株式に投資し、MSCI-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。

ポートフォリオの作成にあたっては、原則として投資不適格銘柄および低流動性銘柄を除外した上で、マルチファクターモデルを活用した最適化法により推定トラッキングエラーの低減のみならず、制約条件を加えることで実績トラッキングエラーを抑えることを目指してポートフォリオを構築します。

MSCI-KOKUSA 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。

外国債券バッシブ・マザーファンド

主として日本を除く世界各国の債券に投資し、シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）と連動する投資成果を目指した運用を行います。

ポートフォリオの作成にあたっては、マルチファクターモデルおよび委託会社独自のリスクモデルを併用して、通貨配分、国別配分、デュレーション、満期構成等を可能な限りシティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）に近づけたポートフォリオを構築します。

シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）との連動性を随時チェックし、必要に応じてマルチファクターモデルおよび委託会社独自のリスクモデルを使用してポートフォリオのリバランスを行います。

（2）【投資対象】

イ 投資対象とする資産の種類

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

- 1．有価証券
- 2．デリバティブ取引にかかる権利
- 3．金銭債権

4. 約束手形

(口) 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。

ハ 投資対象とする金融商品

委託会社は、信託金を、上記ロに掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取

引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

(3) 【運用体制】

イ 運用体制

当ファンドの運用は、次のプロセスに基づいて行われます。

(イ) 計画 (Plan)

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

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

(ロ) 実行 (Do)

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

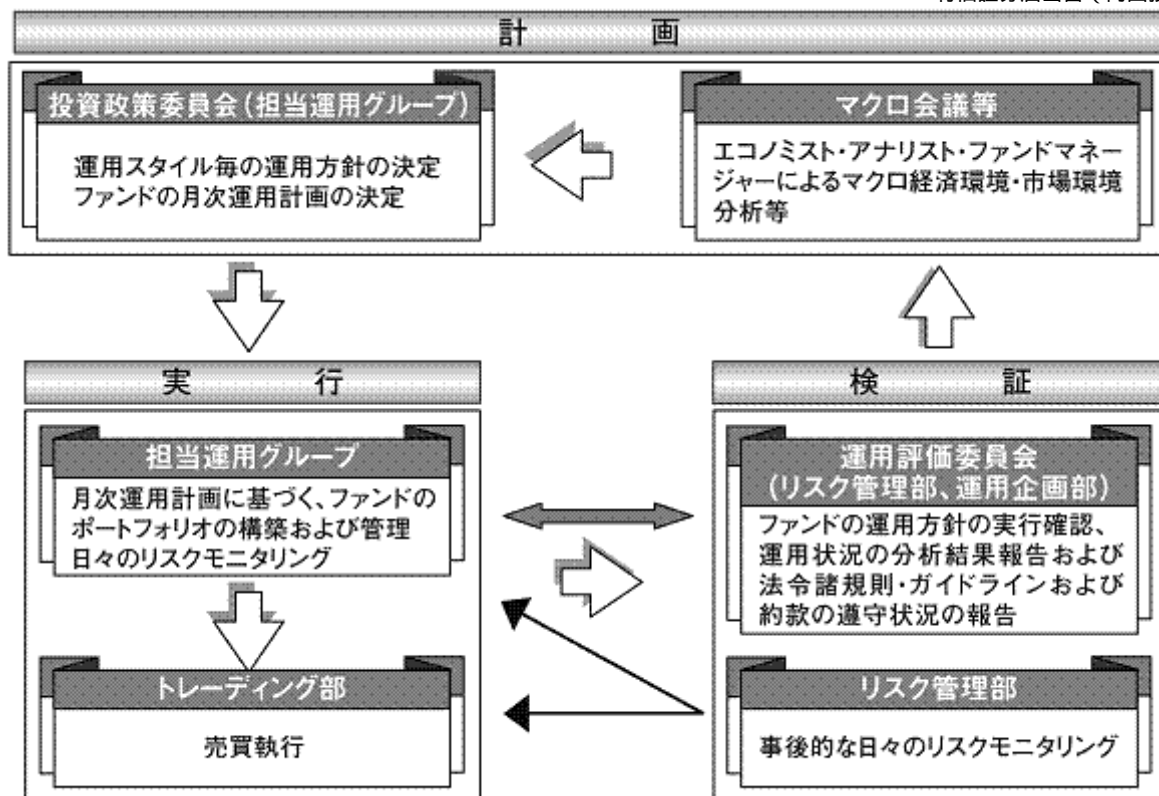
売買執行については、組織的に分離されたトレーディング部が、最良と思われる手法をもって売買を執行します。

(ハ) 検証 (Check)

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

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

〔ファンドの運用体制〕



リスク管理部は8名程度、運用企画部は8名程度で構成されています。

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

ロ 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

（４）【分配方針】

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

- イ 分配対象額の範囲は、繰越分を含めた利子、配当収益と売買益（評価損益を含みます。）等の全額とします。
- ロ 収益分配金額は、委託会社が基準価額水準等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合等には委託会社の判断により収益分配を行わない場合もあるため、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。）。

- 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。
- (二) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

法令に基づく投資制限

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

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

(1) 投資方針等

- イ 基本方針
主としてわが国の株式に投資し、TOPIX（東証株価指数、配当込み）と連動する投資成果を目指して運用を行います。
- ロ 投資態度
- (イ) 主として東京証券取引所第1部に上場している株式に投資を行い、TOPIX（東証株価指数、配当込み）と連動する投資成果を目指して運用を行います。
- (ロ) 株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。
- (ハ) 株式以外の資産への投資割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。

(2) 投資対象

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

八 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針（2）投資対象 八 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ず。

（国内債券パッシブ・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。

八 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針（2）投資対象 八 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ず。

（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、原則として対円での為替ヘッジを行わないものとします。
- （ハ）株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

（２）投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

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

ハ 投資対象とする金融商品

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

（３）投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

ロ 法令に基づく投資制限

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

（外国債券パッシブ・マザーファンド）

（１）投資方針等

イ 基本方針

シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、ベンチマークと連動する投資成果を目指した運用を行います。

ロ 投資態度

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

る運用を行う場合があります。

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

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

ハ 投資対象とする金融商品

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

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

(イ) 株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

(ロ) 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

(ハ) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

(ニ) 同一発行体の発行する債券への投資割合は、国債を除き、取得時において信託財産の純資産総額の5%以内とします。

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

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

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

ロ 法令に基づく投資制限

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

3【投資リスク】

イ ファンドのもつリスクの特性

当ファンドは、主に内外の株式や債券を投資対象としています（マザーファンドを通じて間接的に投資する場合を含みます。）。当ファンドの基準価額は、組み入れた株式や債券の値動き、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

ファンドの資金流入に伴い、有価証券等を大量に売買しなければならない場合、あるいは市場を取り巻く外部環境に急激な変化があり、市場規模の縮小や市場の混乱が生じた場合等には、必要な取引ができなかったり、通常よりも不利な価格での取引を余儀なくされることがあります。これらはファンドの基準価額が下落する要因となります。

(ト) 収益分配金に関する留意事項

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

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

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

(チ) インデックスに連動しない要因・留意点

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%）以内の率を乗じて得た金額が信託財産の費用として計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。監査費用は、将来、監査法人との契約等により変更となる場合があります。

ロ 信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託会社の立て替えた立替金の利息は、信託財産中から支弁します。

ハ 有価証券の売買時の手数料、デリバティブ取引等に要する費用、および外国における資産の保管等に要する費用等（それらにかかる消費税等相当額を含みます。）は、信託財産中から支弁するものとします。

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

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

（５）【課税上の取扱い】

イ 個別元本について

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

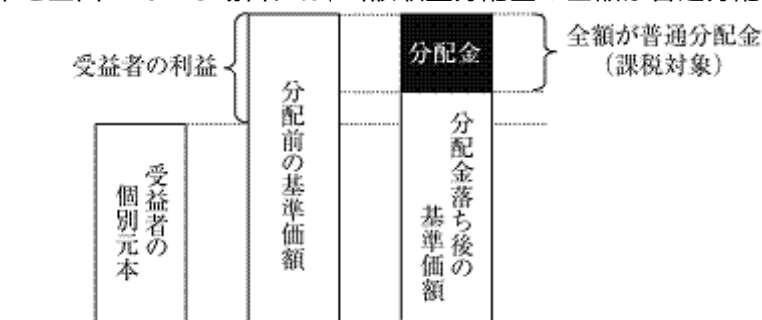
ロ 一部解約時および償還時の課税について

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。

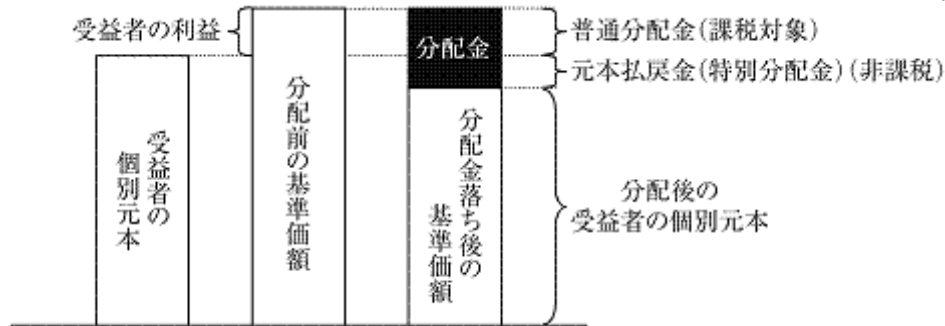
ハ 収益分配金の課税について

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（課税対象）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25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25年3月29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	638,362,995	20.07
国内債券パッシブ・マザーファンド受益証券	日本	1,755,386,759	55.20
外国株式インデックス・マザーファンド受益証券	日本	323,180,928	10.16
外国債券パッシブ・マザーファンド受益証券	日本	320,905,339	10.09
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		142,159,870	4.47
合計（純資産総額）		3,179,995,891	100.00

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

b. 三井住友・DC年金バランス50（標準型）

平成25年3月29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	3,187,365,626	35.12
国内債券パッシブ・マザーファンド受益証券	日本	3,198,043,984	35.24
外国株式インデックス・マザーファンド受益証券	日本	1,374,057,390	15.14
外国債券パッシブ・マザーファンド受益証券	日本	911,046,537	10.04
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		405,575,260	4.47
合計（純資産総額）		9,076,088,797	100.00

c. 三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）

平成25年3月29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	2,289,723,035	50.16
国内債券パッシブ・マザーファンド受益証券	日本	692,830,369	15.18
外国株式インデックス・マザーファンド受益証券	日本	920,350,106	20.16
外国債券パッシブ・マザーファンド受益証券	日本	457,883,436	10.03
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		203,928,713	4.47
合計（純資産総額）		4,564,715,659	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25年3月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託 受益証券	国内債券パッシブ・マ ザーファンド	1,516,008,947	1.1390	1,726,802,542	1.1579	1,755,386,759	55.20
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）	444,202,210	1.3254	588,768,254	1.4371	638,362,995	20.07
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	183,615,095	1.7276	317,215,438	1.7601	323,180,928	10.16
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	230,535,445	1.4002	322,817,002	1.3920	320,905,339	10.09

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25年3月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託 受益証券	国内債券パッシブ・マ ザーファンド	2,761,934,523	1.1392	3,146,427,903	1.1579	3,198,043,984	35.24
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）	2,217,914,986	1.3248	2,938,293,774	1.4371	3,187,365,626	35.12
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	780,670,070	1.7269	1,348,153,474	1.7601	1,374,057,390	15.14
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	654,487,455	1.4005	916,623,967	1.3920	911,046,537	10.04

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25年3月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託 受益証券	国内株式インデックス・ マザーファンド（B号）	1,593,294,159	1.3249	2,111,076,570	1.4371	2,289,723,035	50.16
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	522,896,487	1.7259	902,515,848	1.7601	920,350,106	20.16
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	598,350,781	1.1393	681,729,232	1.1579	692,830,369	15.18
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	328,939,250	1.4000	460,517,913	1.3920	457,883,436	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25年3月29日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	95.53
合計	95.53

b．三井住友・DC年金バランス50（標準型）

平成25年3月29日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	95.53
合計	95.53

c．三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）

平成25年3月29日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	95.53
合計	95.53

【投資不動産物件】

a．三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）

該当事項はありません。

b．三井住友・DC年金バランス50（標準型）

該当事項はありません。

c．三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

a．三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）

該当事項はありません。

b．三井住友・DC年金バランス50（標準型）

該当事項はありません。

c．三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）

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
	(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
	(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
	(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
	(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
	(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
	(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
	(分配付)	2,456,937,455	9,914
第8期(平成25年 2月18日)	(分配落)	3,050,834,550	10,966
	(分配付)	3,050,834,550	10,966
平成24年 3月末日		2,571,617,156	10,111
4月末日		2,534,245,053	9,990
5月末日		2,484,672,326	9,649
6月末日		2,542,446,206	9,809
7月末日		2,572,123,159	9,774
8月末日		2,612,535,295	9,794
9月末日		2,635,004,541	9,881
10月末日		2,690,832,905	9,934
11月末日		2,768,523,175	10,133
12月末日		2,872,129,696	10,458
平成25年 1月末日		3,014,769,689	10,848
2月末日		3,087,184,202	10,988
3月末日		3,179,995,891	11,263

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
	(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
	(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
	(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
	(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
	(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
	(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
	(分配付)	6,937,357,284	9,064
第8期(平成25年 2月18日)	(分配落)	8,682,766,317	10,415
	(分配付)	8,682,766,317	10,415
平成24年 3月末日		7,310,109,363	9,341
4月末日		7,133,407,119	9,128
5月末日		6,839,357,237	8,613

6月末日	7,082,885,074	8,858
7月末日	7,103,245,226	8,774
8月末日	7,160,623,707	8,796
9月末日	7,269,274,597	8,906
10月末日	7,395,208,446	8,970
11月末日	7,661,952,228	9,235
12月末日	8,075,668,519	9,710
平成25年 1月末日	8,581,202,676	10,256
2月末日	8,763,612,022	10,435
3月末日	9,076,088,797	10,804

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
（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
（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
（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
（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
（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
（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
（分配付）	3,235,878,337	8,153
第8期（平成25年 2月18日）（分配落）	4,273,161,707	9,718
（分配付）	4,273,161,707	9,718
平成24年 3月末日	3,434,792,537	8,489
4月末日	3,318,023,736	8,204
5月末日	3,139,175,080	7,560
6月末日	3,275,718,211	7,865
7月末日	3,278,947,836	7,747
8月末日	3,304,358,680	7,770
9月末日	3,356,537,748	7,896
10月末日	3,426,577,291	7,965
11月末日	3,584,559,435	8,276
12月末日	3,843,712,339	8,862
平成25年 1月末日	4,173,470,780	9,526
2月末日	4,327,936,926	9,737
3月末日	4,564,715,659	10,185

【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
第8期(平成24年 2月21日～平成25年 2月18日)	0

b. 三井住友・DC年金バランス50(標準型)

計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期(平成17年 9月30日～平成18年 2月20日)	0
第2期(平成18年 2月21日～平成19年 2月19日)	0
第3期(平成19年 2月20日～平成20年 2月18日)	0
第4期(平成20年 2月19日～平成21年 2月18日)	0
第5期(平成21年 2月19日～平成22年 2月18日)	0
第6期(平成22年 2月19日～平成23年 2月18日)	0
第7期(平成23年 2月19日～平成24年 2月20日)	0
第8期(平成24年 2月21日～平成25年 2月18日)	0

c. 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)

計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期(平成17年 9月30日～平成18年 2月20日)	0
第2期(平成18年 2月21日～平成19年 2月19日)	0
第3期(平成19年 2月20日～平成20年 2月18日)	0
第4期(平成20年 2月19日～平成21年 2月18日)	0
第5期(平成21年 2月19日～平成22年 2月18日)	0
第6期(平成22年 2月19日～平成23年 2月18日)	0
第7期(平成23年 2月19日～平成24年 2月20日)	0
第8期(平成24年 2月21日～平成25年 2月18日)	0

【収益率の推移】

a. 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)

計算期間	収益率(%)
第1期	3.6
第2期	6.1
第3期	4.4
第4期	16.4
第5期	10.4
第6期	3.5
第7期	1.3
第8期	10.6

(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。

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
第8期	14.9

(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。

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
第8期	19.2

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

(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
第8期	506,925,623	202,932,959

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

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
第8期	1,152,916,388	470,633,628

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

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
第8期	707,190,254	278,967,034

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。

〔参考情報〕

〔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25年3月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	314,404,382,080	97.65
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,578,837,657	2.35
合計(純資産総額)		321,983,219,737	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	国/地域	買建/ 売建	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	日本	買建	2.02
		買建合計	2.02

(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25年3月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	2,820,300	3,535.00	9,969,760,500	4,860.00	13,706,658,000	4.26
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	16,405,700	377.00	6,184,948,900	558.00	9,154,380,600	2.84
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,851,900	2,732.00	5,059,390,800	3,555.00	6,583,504,500	2.04
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,638,700	2,654.00	4,349,109,800	3,775.00	6,186,092,500	1.92
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	27,977,800	132.00	3,693,069,600	199.00	5,567,582,200	1.73
日本	株式	キヤノン	電気機器	1,363,100	2,883.00	3,929,817,300	3,400.00	4,634,540,000	1.44

日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	1,043,000	3,086.99	3,219,730,570	4,340.00	4,526,620,000	1.41
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	861,100	3,770.00	3,246,347,000	5,030.00	4,331,333,000	1.35
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	1,368,000	2,585.61	3,537,114,480	3,000.00	4,104,000,000	1.27
日本	株式	三菱地所	不動産業	1,518,000	1,589.00	2,412,102,000	2,596.00	3,940,728,000	1.22
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	911,400	3,685.00	3,358,509,000	4,105.00	3,741,297,000	1.16
日本	株式	ファナック	電気機器	228,700	13,900.00	3,178,930,000	14,490.00	3,313,863,000	1.03
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	405,000	5,410.00	2,191,050,000	7,720.00	3,126,600,000	0.97
日本	株式	三菱商事	卸売業	1,689,700	1,561.00	2,637,621,700	1,743.00	2,945,147,100	0.91
日本	株式	日立製作所	電気機器	5,267,000	476.56	2,510,041,520	543.00	2,859,981,000	0.89
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	906,500	2,402.00	2,177,413,000	3,115.00	2,823,747,500	0.88
日本	株式	三井不動産	不動産業	1,023,000	1,719.00	1,758,537,000	2,639.00	2,699,697,000	0.84
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	510,500	4,170.00	2,128,785,000	5,060.00	2,583,130,000	0.80
日本	株式	信越化学工業	化学	412,600	4,850.00	2,001,110,000	6,250.00	2,578,750,000	0.80
日本	株式	野村ホールディングス	証券・商品先物取引業	4,432,700	341.00	1,511,550,700	577.00	2,557,667,900	0.79
日本	株式	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	情報・通信業	17,858	118,900.00	2,123,316,200	142,100.00	2,537,621,800	0.79
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	2,772,100	799.00	2,214,907,900	905.00	2,508,750,500	0.78
日本	株式	三井物産	卸売業	1,869,500	1,139.00	2,129,360,500	1,313.00	2,454,653,500	0.76
日本	株式	小松製作所	機械	1,072,400	1,847.00	1,980,722,800	2,249.00	2,411,827,600	0.75
日本	株式	KDDI	情報・通信業	611,400	3,050.00	1,864,770,000	3,870.00	2,366,118,000	0.73
日本	株式	新日鐵住金	鉄鋼	9,737,000	189.00	1,840,293,000	235.00	2,288,195,000	0.71
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	720,000	1,989.00	1,432,080,000	3,170.00	2,282,400,000	0.71
日本	株式	ソニー	電気機器	1,380,500	801.00	1,105,780,500	1,642.00	2,266,781,000	0.70
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	838,800	2,114.00	1,773,223,200	2,650.00	2,222,820,000	0.69
日本	株式	デンソー	輸送用機器	542,000	2,709.00	1,468,278,000	3,985.00	2,159,870,000	0.67

□ 種類別・業種別の投資比率

平成25年3月29日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式(国内)	水産・農林業	0.07
	鉱業	0.54
	建設業	2.29
	食料品	4.07
	繊維製品	0.79
	パルプ・紙	0.26
	化学	5.50
	医薬品	5.03
	石油・石炭製品	0.69
	ゴム製品	0.96
	ガラス・土石製品	0.86
	鉄鋼	1.53
	非鉄金属	0.99
	金属製品	0.64
	機械	4.97
	電気機器	11.18
	輸送用機器	10.88
	精密機器	1.23
	その他製品	1.34
	電気・ガス業	2.21
陸運業	4.31	
海運業	0.33	
空運業	0.51	

倉庫・運輸関連業	0.28
情報・通信業	5.99
卸売業	4.78
小売業	4.32
銀行業	10.52
証券、商品先物取引業	1.61
保険業	2.21
その他金融業	1.13
不動産業	3.51
サービス業	2.11
合計	97.65

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25年3月29日現在

種類	取引所等	名称	買建/ 売建	数量	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	東証株価指数先 物	買建	625	6,500,491,250	6,490,625,000	2.02
			買建 合計	625	6,500,491,250	6,490,625,000	2.02

(注) 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。

〔国内債券パッシブ・マザーファンド〕

(1) 投資状況

平成25年3月29日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	389,882,027,120	78.30
地方債証券	日本	30,783,735,248	6.18
特殊債券	日本	45,357,202,222	9.11
社債券	日本	26,773,673,500	5.38
	アメリカ	1,541,560,000	0.31
	オーストラリア	613,065,000	0.12
	オランダ	605,982,000	0.12
	イギリス	503,663,000	0.10
	小計		30,037,943,500
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		1,900,879,929	0.38
合計（純資産総額）		497,961,788,019	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25年3月29日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価(円)	帳簿価額(円)	評価額単価(円)	評価額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
日本	国債証券	第265回利付国債(10年)	16,490,000,000	103.33	17,040,612,800	102.49	16,901,755,300	1.500	2014/12/20	3.39
日本	国債証券	第268回利付国債(10年)	13,745,000,000	103.92	14,283,804,000	102.85	14,137,419,750	1.500	2015/03/20	2.84
日本	国債証券	第270回利付国債(10年)	12,367,000,000	103.39	12,787,392,700	102.75	12,707,834,520	1.300	2015/06/20	2.55
日本	国債証券	第285回利付国債(10年)	10,663,000,000	106.79	11,388,024,100	106.31	11,336,581,710	1.700	2017/03/20	2.28
日本	国債証券	第284回利付国債(10年)	10,007,000,000	106.71	10,679,435,600	105.96	10,603,917,550	1.700	2016/12/20	2.13
日本	国債証券	第272回利付国債(10年)	9,895,000,000	104.22	10,312,619,500	103.30	10,221,732,900	1.400	2015/09/20	2.05
日本	国債証券	第282回利付国債(10年)	9,370,000,000	106.45	9,974,501,000	105.60	9,895,001,100	1.700	2016/09/20	1.99
日本	国債証券	第289回利付国債(10年)	9,069,000,000	106.55	9,663,878,300	106.47	9,656,036,370	1.500	2017/12/20	1.94
日本	国債証券	第280回利付国債(10年)	8,797,000,000	106.96	9,409,889,900	105.85	9,312,064,350	1.900	2016/06/20	1.87
日本	国債証券	第286回利付国債(10年)	8,500,000,000	107.77	9,160,875,000	107.07	9,100,950,000	1.800	2017/06/20	1.83
日本	国債証券	第288回利付国債(10年)	8,065,000,000	107.35	8,658,043,500	107.02	8,631,324,300	1.700	2017/09/20	1.73
日本	国債証券	第274回利付国債(10年)	8,215,000,000	104.85	8,613,427,500	103.90	8,535,960,050	1.500	2015/12/20	1.71
日本	国債証券	第277回利付国債(10年)	7,520,000,000	105.45	7,929,840,000	104.54	7,861,483,200	1.600	2016/03/20	1.58
日本	国債証券	第325回利付国債(10年)	6,350,000,000	100.57	6,386,453,500	102.52	6,510,401,000	0.800	2022/09/20	1.31
日本	国債証券	第310回利付国債(10年)	6,090,000,000	102.51	6,242,859,000	104.88	6,387,374,700	1.000	2020/09/20	1.28
日本	国債証券	第313回利付国債(10年)	5,900,000,000	104.58	6,170,220,000	107.11	6,319,549,000	1.300	2021/03/20	1.27
日本	国債証券	第315回利付国債(10年)	5,630,000,000	103.51	5,827,613,000	106.32	5,985,872,300	1.200	2021/06/20	1.20
日本	国債証券	第306回利付国債(10年)	5,550,000,000	106.00	5,883,000,000	107.72	5,978,682,000	1.400	2020/03/20	1.20
日本	国債証券	第305回利付国債(10年)	5,425,000,000	105.33	5,714,488,000	106.97	5,803,231,000	1.300	2019/12/20	1.17
日本	国債証券	第312回利付国債(10年)	5,420,000,000	103.95	5,634,306,800	106.30	5,761,839,400	1.200	2020/12/20	1.16
日本	国債証券	第290回利付国債(10年)	5,367,000,000	106.13	5,696,139,500	106.29	5,704,584,300	1.400	2018/03/20	1.15
日本	国債証券	第324回利付国債(10年)	4,900,000,000	100.33	4,916,370,500	102.64	5,029,507,000	0.800	2022/06/20	1.01
日本	国債証券	第327回利付国債(10年)	4,650,000,000	101.07	4,699,792,000	102.40	4,761,600,000	0.800	2022/12/20	0.96
日本	国債証券	第320回利付国債(10年)	4,280,000,000	101.32	4,336,496,000	104.56	4,475,553,200	1.000	2021/12/20	0.90
日本	国債証券	第303回利付国債(10年)	3,695,000,000	106.31	3,928,494,000	107.49	3,971,792,450	1.400	2019/09/20	0.80
日本	国債証券	第297回利付国債(10年)	3,643,000,000	106.12	3,865,951,600	107.02	3,898,920,750	1.400	2018/12/20	0.78
日本	国債証券	第322回利付国債(10年)	3,640,000,000	100.74	3,666,936,000	103.60	3,771,367,600	0.900	2022/03/20	0.76
日本	国債証券	第308回利付国債(10年)	3,450,000,000	105.09	3,625,605,000	107.13	3,696,295,500	1.300	2020/06/20	0.74
日本	国債証券	第296回利付国債(10年)	3,363,000,000	106.73	3,589,329,900	107.35	3,610,214,130	1.500	2018/09/20	0.72
日本	国債証券	第264回利付国債(10年)	3,300,000,000	102.45	3,381,048,000	102.13	3,370,455,000	1.500	2014/09/20	0.68

□ 種類別の投資比率

平成25年3月29日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	78.30
地方債証券	6.18
特殊債券	9.11
社債券	6.03

合 計	99.62
-----	-------

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25年3月29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	129,984,265,906	54.34
	イギリス	22,577,557,757	9.44
	カナダ	11,612,597,063	4.85
	スイス	10,731,708,479	4.49
	フランス	9,288,559,443	3.88
	ドイツ	8,958,419,598	3.75
	オーストラリア	8,925,109,750	3.73
	スウェーデン	3,471,218,328	1.45
	オランダ	3,052,073,842	1.28
	スペイン	2,943,876,712	1.23
	香港	2,879,385,225	1.20
	イタリア	2,001,076,530	0.84
	シンガポール	1,818,711,609	0.76
	アイルランド	1,813,581,354	0.76
	ベルギー	1,290,477,661	0.54
	デンマーク	1,232,471,333	0.52
	ジャージー	1,096,709,607	0.46
	アンティル	932,166,411	0.39
	ノルウェー	884,130,155	0.37
	フィンランド	825,681,089	0.35
	バミューダ	732,600,166	0.31
	イスラエル	580,480,600	0.24
	ルクセンブルク	406,662,797	0.17
	オーストリア	287,988,122	0.12
	ケイマン諸島	232,340,662	0.10
	ポルトガル	181,437,793	0.08
	ニュージーランド	139,309,996	0.06
	マン島	69,116,690	0.03
	ギリシャ	68,954,584	0.03
	ガーンジー	52,067,334	0.02
リベリア	43,025,299	0.02	
モーリシャス	29,742,118	0.01	
小計	229,143,504,013	95.79	
投資証券	アメリカ	3,601,106,447	1.51
	オーストラリア	896,703,745	0.37
	フランス	305,977,511	0.13

	イギリス	273,071,851	0.11
	香港	142,227,594	0.06
	シンガポール	138,498,580	0.06
	カナダ	61,236,577	0.03
	オランダ	30,608,383	0.01
	小計	5,449,430,688	2.28
現金・預金・その他の資産（負債控除後）		4,613,968,597	1.93
合計（純資産総額）		239,206,903,298	100.00

その他以下の取引を行っております。

種類	国/地域	買建/ 売建	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	買建	1.14
株価指数先物取引	ドイツ	買建	0.37
株価指数先物取引	イギリス	買建	0.19
		買建合計	1.70

（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25年3月29日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
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	93,834	55,375.69	5,196,123,386	41,629.35	3,906,248,568	1.63
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION	エネルギー	454,689	8,287.68	3,768,319,659	8,474.84	3,853,419,025	1.61
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	1,046,045	1,987.27	2,078,780,646	2,174.43	2,274,557,905	0.95
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED	食品・飲料・タバコ	321,665	6,051.20	1,946,459,248	6,810.07	2,190,564,383	0.92
アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION	エネルギー	195,235	9,949.54	1,942,500,296	11,175.02	2,181,755,224	0.91
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	107,066	18,013.39	1,928,622,309	20,060.86	2,147,836,572	0.90
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	276,364	6,512.96	1,799,948,368	7,667.89	2,119,130,548	0.89
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	755,265	2,534.64	1,914,330,544	2,690.77	2,032,244,781	0.85
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	734,501	2,337.14	1,716,633,503	2,714.28	1,993,643,577	0.83
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル用品	272,645	6,536.47	1,782,137,226	7,247.49	1,975,992,728	0.83
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	26,431	65,198.28	1,723,255,778	74,678.52	1,973,828,001	0.83
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	566,424	3,191.11	1,807,524,972	3,450.69	1,954,556,181	0.82
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	1,836,231	903.33	1,658,740,177	1,005.69	1,846,695,679	0.77
アメリカ	株式	WELLS FARGO & COMPANY	銀行	498,829	3,118.69	1,555,697,004	3,478.90	1,735,380,946	0.73
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	379,049	3,876.74	1,469,474,799	4,463.61	1,691,928,044	0.71
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	70,065	18,074.23	1,266,371,625	21,923.20	1,536,049,008	0.64

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	229,258	5,718.87	1,311,098,991	6,691.03	1,533,974,448	0.64
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	402,474	3,571.07	1,437,266,248	3,803.38	1,530,762,367	0.64
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	食品・飲料・タバコ	166,650	8,495.53	1,415,781,157	8,719.37	1,453,083,927	0.61
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	284,717	4,140.08	1,178,751,442	4,622.55	1,316,120,703	0.55
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	4,901,697	229.05	1,122,763,108	267.13	1,309,422,474	0.55
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	303,122	4,204.97	1,274,620,583	4,159.83	1,260,936,443	0.53
イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	1,900,750	617.01	1,172,800,004	658.39	1,251,440,190	0.52
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	各種金融	1,075,218	924.51	994,051,406	1,145.52	1,231,693,400	0.51
アメリカ	株式	CITIGROUP INC	各種金融	292,381	3,311.50	968,219,827	4,160.77	1,216,530,678	0.51
アメリカ	株式	WAL-MART STORES INC	食品・生活必需品小売り	166,758	6,661.56	1,110,868,672	7,037.76	1,173,603,032	0.49
アメリカ	株式	ORACLE CORPORATION	ソフトウェア・サービス	384,547	2,994.55	1,151,545,987	3,041.57	1,169,629,310	0.49
アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	154,297	6,612.65	1,020,312,905	7,440.29	1,148,015,274	0.48
イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	372,913	2,987.74	1,114,170,517	3,047.87	1,136,592,731	0.48
フランス	株式	SANOFI	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	118,690	8,387.11	995,466,453	9,570.26	1,135,895,002	0.47

ロ 種類別・業種別の投資比率

平成25年3月29日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式(外国)	医薬品	0.05
	エネルギー	10.57
	素材	6.21
	資本財	7.31
	商業・専門サービス	0.99
	運輸	1.78
	自動車・自動車部品	1.39
	耐久消費財・アパレル	1.48
	消費者サービス	1.55
	メディア	2.86
	小売	2.97
	食品・生活必需品小売り	2.31
	食品・飲料・タバコ	6.93
	家庭用品・パーソナル用品	1.88
	ヘルスケア機器・サービス	2.76
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.39
	銀行	7.59
	各種金融	4.99
	保険	4.38
	不動産	0.70
ソフトウェア・サービス	6.17	

	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.10
	電気通信サービス	3.65
	公益事業	3.49
	半導体・半導体製造装置	1.29
投資証券	-	2.28
合計		98.07

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25年3月29日現在

種類	取引所等	名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
株価指数 先物取引	シカゴ商業取引所	SP500 13/06	買建	74	2,693,136,515	2,718,980,797	1.14
株価指数 先物取引	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	DJ EUR 13/06	買建	286	909,627,146	881,865,041	0.37
株価指数 先物取引	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FTSE 13/06	買建	50	457,885,091	454,604,580	0.19
			買建 合計	410	4,060,648,752	4,055,450,418	1.70

(注) 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。

平成25年3月29日現在

種類	取引所等	資産の名称	買建 / 売建	数量	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約 取引	市場外取引	カナダドル	買建	193,698.00	17,963,552	17,928,686	0.01
為替予約 取引	市場外取引	英ポンド	買建	49,234.31	7,051,756	7,047,891	0.00
			買建 合計	242,932.31	25,015,308	24,976,577	0.01
為替予約 取引	市場外取引	カナダドル	売建	363,823.74	33,741,013	33,675,525	0.01
			売建 合計	363,823.74	33,741,013	33,675,525	0.01

(注) わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

〔外国債券パッシブ・マザーファンド〕

(1) 投資状況

平成25年3月29日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	107,984,644,194	40.87
	フランス	25,078,819,605	9.49

イタリア	23,854,704,163	9.03
ドイツ	23,594,326,966	8.93
イギリス	19,371,877,630	7.33
スペイン	11,411,711,795	4.32
カナダ	7,101,666,368	2.69
ベルギー	7,084,818,017	2.68
オランダ	6,918,636,556	2.62
オーストリア	4,571,312,626	1.73
オーストラリア	4,076,904,681	1.54
メキシコ	2,780,032,183	1.05
アイルランド	2,196,195,444	0.83
デンマーク	2,100,754,203	0.80
ポーランド	1,950,312,904	0.74
スウェーデン	1,637,280,947	0.62
フィンランド	1,635,178,101	0.62
南アフリカ	1,546,666,800	0.59
マレーシア	1,484,444,533	0.56
シンガポール	1,083,391,907	0.41
スイス	1,018,645,120	0.39
ノルウェー	792,599,810	0.30
小計	259,274,924,553	98.14
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	4,909,242,089	1.86
合計（純資産総額）	264,184,166,642	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25年3月29日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿単価 (円)	帳簿価額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.625	13,500,000	10,336.09	1,395,372,825	10,264.67	1,385,731,229	2.625	2020/11/15	0.52
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.25	14,000,000	9,389.56	1,314,539,795	9,398.38	1,315,774,201	0.250	2015/07/15	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.25	14,000,000	9,385.89	1,314,025,453	9,392.50	1,314,951,264	0.250	2015/09/15	0.50
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.25	13,000,000	9,403.53	1,222,458,960	9,412.34	1,223,605,195	0.250	2015/01/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.25	13,000,000	9,393.24	1,221,121,687	9,399.85	1,221,981,369	0.250	2015/05/15	0.46
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.625	13,000,000	9,169.89	1,192,085,868	9,246.29	1,202,017,781	1.625	2022/11/15	0.45
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.125	11,000,000	10,695.24	1,176,477,328	10,596.05	1,165,566,063	3.125	2021/05/15	0.44
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	13,000,000	8,661.81	1,126,036,197	8,735.62	1,135,631,713	2.750	2042/11/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.375	12,000,000	9,411.61	1,129,393,546	9,410.87	1,129,305,375	0.375	2016/03/15	0.43
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	10,000,000	11,070.62	1,107,062,550	10,964.90	1,096,490,746	3.625	2021/02/15	0.42
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	11,000,000	9,912.72	1,090,399,540	9,834.10	1,081,751,343	2.125	2021/08/15	0.41
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.25	7,400,000	14,430.85	1,067,883,410	14,312.54	1,059,128,071	4.250	2019/04/25	0.40

フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3	8,000,000	13,249.51	1,059,961,108	13,170.19	1,053,615,539	3.000	2022/04/25	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1	11,000,000	9,507.86	1,045,865,390	9,490.23	1,043,925,609	1.000	2014/05/15	0.40
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.125	10,500,000	9,748.87	1,023,631,382	9,698.90	1,018,385,156	2.125	2014/11/30	0.39
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.25	7,000,000	14,572.71	1,020,090,025	14,399.82	1,007,988,050	4.250	2023/10/25	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.875	10,000,000	9,942.84	994,284,843	9,913.45	991,345,781	1.875	2017/09/30	0.38
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	9,000,000	11,007.61	990,685,080	10,939.19	984,527,156	3.625	2020/02/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.5	10,000,000	9,895.08	989,508,871	9,839.24	983,924,653	2.500	2015/04/30	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.625	9,000,000	10,971.52	987,436,828	10,900.98	981,088,453	3.625	2019/08/15	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.25	10,000,000	9,800.30	980,030,390	9,751.80	975,180,937	2.250	2015/01/31	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.375	10,000,000	9,762.83	976,283,090	9,708.45	970,845,825	2.375	2014/09/30	0.37
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.375	9,000,000	10,831.91	974,872,335	10,774.60	969,714,281	3.375	2019/11/15	0.37
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.25	7,000,000	13,560.15	949,210,649	13,496.16	944,731,566	3.250	2021/10/25	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.5	10,000,000	9,448.71	944,871,857	9,443.94	944,394,262	0.500	2014/10/15	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 0.625	10,000,000	9,395.44	939,544,809	9,398.38	939,838,715	0.625	2017/08/31	0.36
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2.75	9,000,000	10,427.05	938,435,312	10,376.36	933,872,414	2.750	2019/02/15	0.35
フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3	7,200,000	13,050.91	939,665,736	12,918.47	930,129,997	3.000	2015/10/25	0.35
フランス	国債証券	BTAN 2.5	7,200,000	12,687.27	913,483,745	12,584.29	906,068,991	2.500	2015/01/15	0.34
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.5	8,500,000	10,726.10	911,719,229	10,654.10	905,598,632	3.500	2018/02/15	0.34

□ 種類別の投資比率

平成25年3月29日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	98.14
合計	98.14

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25年3月29日現在

種類	取引所等	資産の名称	買建/売建	数量	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	28,112,154.94	2,645,587,110	2,643,667,050	1.00
為替予約取引	市場外取引	ユーロ	買建	7,619,674.34	916,745,639	919,923,282	0.35
為替予約取引	市場外取引	スウェーデンクローナ	買建	14,631,225.00	210,974,948	211,274,889	0.08
為替予約取引	市場外取引	スイスフラン	買建	919,880.00	90,721,445	91,252,095	0.03

為替予約取引	市場外取引	英ポンド	買建	2,269.87	323,588	324,931	0.00
			買建合計	51,285,204.15	3,864,352,730	3,866,442,247	1.46
為替予約取引	市場外取引	米ドル	売建	30,600,291.88	2,879,868,910	2,877,651,448	1.09
為替予約取引	市場外取引	英ポンド	売建	6,179,014.00	882,229,114	884,525,854	0.33
為替予約取引	市場外取引	ユーロ	売建	3,609,009.66	433,478,150	435,715,736	0.16
為替予約取引	市場外取引	スウェーデン ンクローナ	売建	15,152,320.00	218,506,347	218,799,500	0.08
為替予約取引	市場外取引	スイスフラン	売建	834,071.11	82,239,828	82,739,854	0.03
			売建合計	56,374,706.65	4,496,322,349	4,499,432,392	1.70

(注) わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。

〔参考情報〕

基準日 2013年3月29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

マイパッケージ30



基準価額	11,263円
純資産総額	32億円

分配の推移

決算期	分配金
2013年2月	0円
2012年2月	0円
2011年2月	0円
2010年2月	0円
2009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。

マイパッケージ50



基準価額	10,804円
純資産総額	91億円

分配の推移

決算期	分配金
2013年2月	0円
2012年2月	0円
2011年2月	0円
2010年2月	0円
2009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。

マイパッケージ70



基準価額	10,185円
純資産総額	46億円

分配の推移

決算期	分配金
2013年2月	0円
2012年2月	0円
2011年2月	0円
2010年2月	0円
2009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。

※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

年間収益率の推移（暦年ベース）

マイパッケージ30



マイパッケージ50



マイパッケージ70



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。
2013年の収益率は、年初から2013年3月29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	http://www.smam-jp.com

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

ヘ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

ト 払込期日

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

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

2【換金（解約）手続等】

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

お買付けの販売会社にお申し出ください。

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

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

一部解約金は、解約請求受付日から起算して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。)を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額(「純資産総額」といいます。)を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます(基準価額は、便宜上1万口単位で表示される場合があります。)

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。

□ 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	http://www.smam-jp.com

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

(2) 【保管】

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

(3) 【信託期間】

平成17年9月30日から下記「(5) その他 イ 信託の終了」に記載された各事由が生じた場合における信託終了の日までとなります。

(4) 【計算期間】

毎年2月19日から翌年2月18日までとすることを原則としますが、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始するものとします。なお、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

(5) 【その他】

イ 信託の終了

(イ) 信託契約の解約

- 委託会社は、当ファンドの信託契約を解約することが受益者にとって有利であると認めるとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- 委託会社は、上記aの事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を当ファンドの知られたる受益者に対して交付します。ただし、当ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- 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。
- 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。
- (二) 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い
- a. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。また、受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。
 - b. 上記により受託会社が辞任し、または解任された場合は、委託会社は新受託会社を選任します。
 - c. 委託会社が新受託会社を選任できないとき、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。
- ロ 収益分配金、償還金の支払い
- (イ) 収益分配金
- a. 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。分配対象額が少額の場合等には委託会社の判断により分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
 - b. 当ファンドは、分配金自動再投資専用ですので、分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日の翌営業日に再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。
- (ロ) 償還金
- 償還金は、信託終了後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日から起算して5営業日目まで）から、販売会社において、原則として、償還日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として）に支払われます。
- 八 信託約款の変更
- (イ) 委託会社は、当ファンドの信託約款を変更することが受益者の利益のため必要と認めるとき、監督官庁より変更の命令を受けたとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨および内容を監督官庁に届け出ます。
- (ロ) 委託会社は、上記(イ)の変更事項のうち、その内容が重大なものについては、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を当ファンドの知られたる受益者に交付します。ただし、当ファンドのすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- (ハ) 上記(ロ)の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- (二) 上記(ハ)の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2

分の1を超えるときは、(イ)の信託約款の変更をしません。

(ホ) 委託会社は、信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、すべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

二 反対者の買取請求権

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

ホ 販売会社との契約の更改等

委託会社と販売会社との間で締結される販売契約（名称の如何を問わず、ファンドの募集・販売の取扱い、受益者からの一部解約実行請求の受付け、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を規定するもの）は、期間満了の3ヵ月前に当事者のいずれから、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。

二 信託約款変更等に対する異議申立権および受益権の買取請求権

委託会社が、当ファンドの解約(監督官庁の命令による解約等の場合を除きます。)または重大な信託約款の変更を行おうとする場合において、当該解約または信託約款変更に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8期(平成24年2月21日から平成25年2月18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7期 （平成24年2月20日現在）	第8期 （平成25年2月18日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	107,686,906	162,888,314
親投資信託受益証券	2,351,953,757	2,892,255,120
未収入金	38,000	2,030,000
未収利息	147	223
流動資産合計	2,459,678,810	3,057,173,657
資産合計	2,459,678,810	3,057,173,657
負債の部		
流動負債		
未払解約金	37,947	3,091,392
未払受託者報酬	360,465	433,047
未払委託者報酬	2,282,925	2,742,558
その他未払費用	60,018	72,110
流動負債合計	2,741,355	6,339,107
負債合計	2,741,355	6,339,107
純資産の部		
元本等		
元本	2,478,210,957	2,782,203,621
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	21,273,502	268,630,929
元本等合計	2,456,937,455	3,050,834,550
純資産合計	2,456,937,455	3,050,834,550
負債純資産合計	2,459,678,810	3,057,173,657

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第7期	第8期
	自 平成23年 2月19日 至 平成24年 2月20日	自 平成24年 2月21日 至 平成25年 2月18日
営業収益		
受取利息	49,318	61,553
有価証券売買等損益	8,794,116	294,898,363
営業収益合計	8,744,798	294,959,916
営業費用		
受託者報酬	681,150	829,460
委託者報酬	4,313,833	5,253,090
その他費用	113,402	138,112
営業費用合計	5,108,385	6,220,662
営業利益又は営業損失（ ）	13,853,183	288,739,254
経常利益又は経常損失（ ）	13,853,183	288,739,254
当期純利益又は当期純損失（ ）	13,853,183	288,739,254
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（ ）	3,462,871	3,282,125
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	8,448,753	21,273,502
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	4,447,302
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	1,668,024
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	2,779,278
剰余金減少額又は欠損金増加額	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	19,278,136	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	21,273,502	268,630,929

(3) 【注記表】
(重要な会計方針の注記)

項目	第8期	
	自 平成24年 2月21日 至 平成25年 2月18日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>計算期間の取扱い 当計算期間は前期末が休日のため、平成24年 2月21日から平成25年 2月18日までとなっております。</p>	

(追加情報)

第8期	
自 平成24年 2月21日 至 平成25年 2月18日	
<p>当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更およ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）および「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>	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第7期	第8期
	(平成24年 2月20日現在)	(平成25年 2月18日現在)
1. 受益権総数	当計算期間の末日における受益権の総数 2,478,210,957口	当計算期間の末日における受益権の総数 2,782,203,621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	0.9914円 (1 万口 = 9,914円)	1.0966円 (1 万口 = 10,966円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第7期	第8期
	自 平成23年 2月19日 至 平成24年 2月20日	自 平成24年 2月21日 至 平成25年 2月18日

分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(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)ですが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(49,425,373円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(123,213,741円)、収益調整金(357,740,176円)、および分配準備積立金(104,165,815円)より、分配対象収益は634,545,105円(1万口当たり2,280.72円)ですが、分配を行っておりません。
----------	---	--

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	第8期 自 平成24年 2月21日 至 平成25年 2月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第8期 (平成25年 2月18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。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)
売買目的有価証券

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

第8期(自平成24年2月21日 至 平成25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	275,197,963円
合計	275,197,963円

(デリバティブ取引に関する注記)

第7期(平成24年2月20日現在)

該当事項はありません。

第8期(平成25年2月18日現在)

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)

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。

第8期(自平成24年2月21日 至 平成25年2月18日)

該当事項はありません。

(その他の注記)

項目	第7期 (平成24年 2月20日現在)	第8期 (平成25年 2月18日現在)
期首元本額	1,952,365,458円	2,478,210,957円
期中追加設定元本額	624,991,852円	506,925,623円
期中一部解約元本額	99,146,353円	202,932,959円

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
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)	464,379,009	615,209,311	
	外国株式インデックス・マザー ファンド	178,575,058	308,256,265	
	外国債券パッシブ・マザーファ ンド	219,533,740	307,457,002	
	国内債券パッシブ・マザーファ ンド	1,458,972,989	1,661,332,542	
	親投資信託受益証券 小計	2,321,460,796	2,892,255,120	
合計		2,321,460,796	2,892,255,120	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

【三井住友・DC年金バランス50(標準型)】
(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第7期 (平成24年2月20日現在)	第8期 (平成25年2月18日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	305,851,942	479,814,903
親投資信託受益証券	6,639,444,951	8,214,057,053
未収入金	460,000	8,480,000
未収利息	418	657
流動資産合計	6,945,757,311	8,702,352,613
資産合計	6,945,757,311	8,702,352,613
負債の部		
流動負債		
未払解約金	463,965	10,144,451
未払受託者報酬	1,013,132	1,205,359
未払委託者報酬	6,754,138	8,035,656
その他未払費用	168,792	200,830
流動負債合計	8,400,027	19,586,296
負債合計	8,400,027	19,586,296
純資産の部		
元本等		
元本	7,654,128,143	8,336,410,903
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	716,770,859	346,355,414
元本等合計	6,937,357,284	8,682,766,317
純資産合計	6,937,357,284	8,682,766,317
負債純資産合計	6,945,757,311	8,702,352,613

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第7期	第8期
	自 平成23年 2月19日 至 平成24年 2月20日	自 平成24年 2月21日 至 平成25年 2月18日
営業収益		
受取利息	147,559	171,742
有価証券売買等損益	217,594,087	1,145,736,102
営業収益合計	217,446,528	1,145,907,844
営業費用		
受託者報酬	1,968,668	2,311,711
委託者報酬	13,124,309	15,411,270
その他費用	327,985	385,160
営業費用合計	15,420,962	18,108,141
営業利益又は営業損失（ ）	232,867,490	1,127,799,703
経常利益又は経常損失（ ）	232,867,490	1,127,799,703
当期純利益又は当期純損失（ ）	232,867,490	1,127,799,703
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（ ）	21,918,023	9,151,599
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	340,669,603	716,770,859
剰余金増加額又は欠損金減少額	21,471,445	44,174,386
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	21,471,445	44,174,386
剰余金減少額又は欠損金増加額	186,623,234	99,696,217
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	186,623,234	99,696,217
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	716,770,859	346,355,414

(3) 【注記表】
(重要な会計方針の注記)

項目	第8期	
	自 平成24年 2月21日 至 平成25年 2月18日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適切ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>計算期間の取扱い 当計算期間は前期末が休日のため、平成24年 2月21日から平成25年 2月18日までとなっております。</p>	

(追加情報)

第8期	
自 平成24年 2月21日 至 平成25年 2月18日	
<p>当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更およ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）および「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>	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第7期	第8期
	(平成24年 2月20日現在)	(平成25年 2月18日現在)
1. 受益権総数	当計算期間の末日における受益権の総数 7,654,128,143口	当計算期間の末日における受益権の総数 8,336,410,903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 716,770,859円	
3. 1単位当たり純資産額	0.9064円 (1万口 = 9,064円)	1.0415円 (1万口 = 10,415円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第7期	第8期
	自 平成23年 2月19日 至 平成24年 2月20日	自 平成24年 2月21日 至 平成25年 2月18日

分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(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)ですが、分配を行っておりません。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(151,123,882円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(202,218,054円)、収益調整金(1,429,729,520円)、および分配準備積立金(391,295,262円)より、分配対象収益は2,174,366,718円(1万口当たり2,608.27円)ですが、分配を行っておりません。
----------	---	---

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	第8期 自 平成24年 2月21日 至 平成25年 2月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第8期 (平成25年 2月18日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)
売買目的有価証券

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

第8期(自平成24年2月21日 至 平成25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	1,086,612,010円
合計	1,086,612,010円

(デリバティブ取引に関する注記)

第7期(平成24年2月20日現在)

該当事項はありません。

第8期(平成25年2月18日現在)

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)

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。

第8期(自平成24年2月21日 至 平成25年2月18日)

該当事項はありません。

(その他の注記)

項目	第7期 (平成24年 2月20日現在)	第8期 (平成25年 2月18日現在)
期首元本額	6,422,758,338円	7,654,128,143円
期中追加設定元本額	1,598,782,670円	1,152,916,388円
期中一部解約元本額	367,412,865円	470,633,628円

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
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)	2,305,208,256	3,053,939,897	
	外国株式インデックス・マザー ファンド	761,699,274	1,314,845,286	
	外国債券パッシブ・マザーファ ンド	619,710,080	867,903,967	
	国内債券パッシブ・マザーファ ンド	2,614,707,916	2,977,367,903	
	親投資信託受益証券 小計	6,301,325,526	8,214,057,053	
合計		6,301,325,526	8,214,057,053	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

【三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）】
（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第7期 （平成24年2月20日現在）	第8期 （平成25年2月18日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	140,653,259	209,986,554
親投資信託受益証券	3,099,785,596	4,068,522,867
未収入金	-	240,000
未収利息	192	287
流動資産合計	3,240,439,047	4,278,749,708
資産合計	3,240,439,047	4,278,749,708
負債の部		
流動負債		
未払解約金	765,479	954,639
未払受託者報酬	464,736	567,368
未払委託者報酬	3,253,098	3,971,495
その他未払費用	77,397	94,499
流動負債合計	4,560,710	5,588,001
負債合計	4,560,710	5,588,001
純資産の部		
元本等		
元本	3,968,741,515	4,396,964,735
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	732,863,178	123,803,028
元本等合計	3,235,878,337	4,273,161,707
純資産合計	3,235,878,337	4,273,161,707
負債純資産合計	3,240,439,047	4,278,749,708

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第7期	第8期
	自 平成23年 2月19日 至 平成24年 2月20日	自 平成24年 2月21日 至 平成25年 2月18日
営業収益		
受取利息	66,987	80,118
有価証券売買等損益	192,546,045	693,187,271
営業収益合計	192,479,058	693,267,389
営業費用		
受託者報酬	912,393	1,080,169
委託者報酬	6,386,614	7,561,054
その他費用	151,946	179,906
営業費用合計	7,450,953	8,821,129
営業利益又は営業損失()	199,930,011	684,446,260
経常利益又は経常損失()	199,930,011	684,446,260
当期純利益又は当期純損失()	199,930,011	684,446,260
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()	13,466,867	2,334,953
期首剰余金又は期首欠損金()	395,568,273	732,863,178
剰余金増加額又は欠損金減少額	20,056,233	51,737,693
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	20,056,233	51,737,693
剰余金減少額又は欠損金増加額	170,887,994	124,788,850
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	170,887,994	124,788,850
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金()	732,863,178	123,803,028

(3) 【注記表】
(重要な会計方針の注記)

項目	第8期	
	自 平成24年 2月21日 至 平成25年 2月18日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>計算期間の取扱い 当計算期間は前期末が休日のため、平成24年 2月21日から平成25年 2月18日までとなっております。</p>	

(追加情報)

第8期	
自 平成24年 2月21日 至 平成25年 2月18日	
<p>当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更およ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）および「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>	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第7期	第8期
	(平成24年 2月20日現在)	(平成25年 2月18日現在)
1. 受益権総数	当計算期間の末日における受益権の総数 3,968,741,515口	当計算期間の末日における受益権の総数 4,396,964,735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 732,863,178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 123,803,028円
3. 1単位当たり純資産額	0.8153円 (1万口 = 8,153円)	0.9718円 (1万口 = 9,718円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第7期	第8期
	自 平成23年 2月19日 至 平成24年 2月20日	自 平成24年 2月21日 至 平成25年 2月18日

分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益(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。	計算期間末における費用控除後の配当等収益(76,807,707円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(99,983,443円)、収益調整金(989,103,886円)、および分配準備積立金(193,257,365円)より、分配対象収益は1,359,152,401円(1万口当たり3,091.11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8期 自 平成24年 2月21日 至 平成25年 2月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第8期 (平成25年 2月18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。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)
売買目的有価証券

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

第8期(自平成24年2月21日 至 平成25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	678,515,698円
合計	678,515,698円

(デリバティブ取引に関する注記)

第7期(平成24年2月20日現在)

該当事項はありません。

第8期(平成25年2月18日現在)

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)

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。

第8期(自平成24年2月21日 至 平成25年2月18日)

該当事項はありません。

(その他の注記)

項目	第7期 (平成24年 2月20日現在)	第8期 (平成25年 2月18日現在)
期首元本額	3,301,833,283円	3,968,741,515円
期中追加設定元本額	823,696,243円	707,190,254円
期中一部解約元本額	156,788,011円	278,967,034円

(4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
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)	1,630,400,207	2,159,954,194	
	外国株式インデックス・マザー ファンド	493,014,441	851,041,528	
	外国債券パッシブ・マザーファ ンド	301,583,658	422,367,913	
	国内債券パッシブ・マザーファ ンド	557,793,302	635,159,232	
	親投資信託受益証券 小計	2,982,791,608	4,068,522,867	
合計		2,982,791,608	4,068,522,867	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

（参考情報）

「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）」および「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）」の状況へ](#)

[「国内債券パッシブ・マザーファンド」の状況へ](#)

[「外国株式インデックス・マザーファンド」の状況へ](#)

[「外国債券パッシブ・マザーファンド」の状況へ](#)

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25年3月29日現在
資産総額	3,183,258,391円
負債総額	3,262,500円
純資産総額（ - ）	3,179,995,891円
発行済口数	2,823,325,702口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1263円
（1万口当たり純資産額	11,263円）

b．三井住友・DC年金バランス50（標準型）

	平成25年3月29日現在
資産総額	9,085,963,828円
負債総額	9,875,031円
純資産総額（ - ）	9,076,088,797円
発行済口数	8,400,549,602口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0804円
（1万口当たり純資産額	10,804円）

c．三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）

	平成25年3月29日現在
資産総額	4,568,068,821円
負債総額	3,353,162円

純資産総額（ - ）	4,564,715,659 円
発行済口数	4,481,933,465 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0185 円
（ 1万口当たり純資産額	10,185 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25年3月29日現在
資本金の額	2,000百万円
会社が発行する株式の総数	60,000株
発行済株式総数	17,640株

ロ 最近5年間における資本金の額の増減

該当ありません。

ハ 会社の機構

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

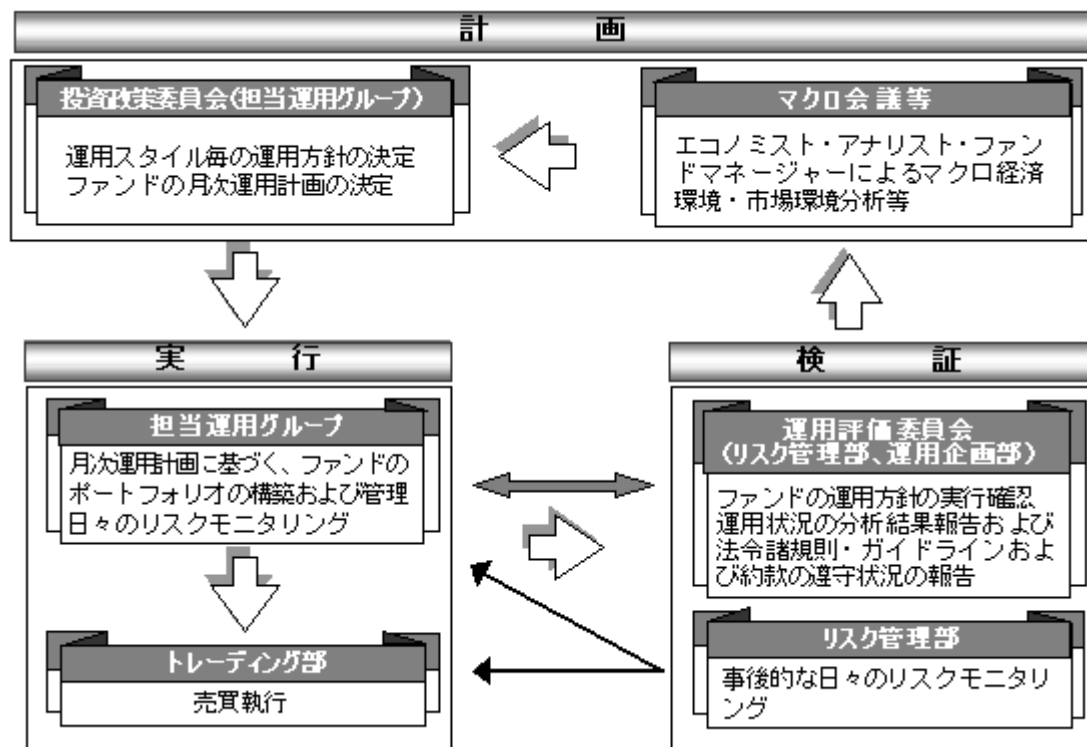
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役を若干名を選定します。

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

ニ 投資信託の運用の流れ



2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成25年3月29日現在、三井住友アセットマネジメント株式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25年3月29日現在、単位：百万円）

		本数	純資産総額
株式投資信託	単位型	15 (4)	41,084 (18,457)
	追加型	321 (137)	5,262,847 (3,343,307)
	計	336 (141)	5,303,932 (3,361,764)
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		336 (141)	5,303,932 (3,361,764)

（ ）内は、私募投資信託分であり、内書き表記しております。

（ご参考）

平成25年3月29日現在、トヨタアセットマネジメント株式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25年3月29日現在、単位：百万円）

		本数	純資産総額
株式投資信託	単位型	1 (1)	10,194 (10,194)
	追加型	30 (13)	292,801 (112,113)
	計	31 (14)	302,995 (122,307)
公社債投資信託	単位型	0 (0)	0 (0)
	追加型	4 (1)	258,197 (177,654)
	計	4 (1)	258,197 (177,654)
合計		35 (15)	561,192 (299,961)

（ ）内は、私募投資信託分であり、内書き表記しております。

3【委託会社等の経理状況】

1 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。

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

2 当社は、第26期（平成22年4月1日から平成23年3月31日まで）及び第27期（平成23年4月1日から平成24年3月31日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の監査を受けており、第28期中間会計期間（平成24年4月1日から平成24年9月30日まで）の中間財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

		第 26 期 (平成23年3月31日)	第 27 期 (平成24年3月31日)
(資産の部)			
流動資産			
現金及び預金	2	17,127,600	15,970,870
有価証券		3,999,722	3,999,305
前払費用		264,910	259,411
未収入金		607,623	32,426
未収委託者報酬		3,712,698	3,392,765
未収運用受託報酬		326,523	305,910
未収投資助言報酬	2	412,606	452,618
未収収益		27,051	14,092
繰延税金資産		241,975	155,946
その他の流動資産		1,299	9,011
流動資産計		26,722,012	24,592,358
固定資産			
有形固定資産			
有形固定資産	1		
建物		148,698	130,525
器具備品		232,209	201,264
有形固定資産合計		380,907	331,789
無形固定資産			
無形固定資産	1		
ソフトウェア		-	241,251
ソフトウェア仮勘定		-	32,852
電話加入権		138	126
商標権		4,216	2,271
無形固定資産合計		4,354	276,502
投資その他の資産			
投資有価証券		4,980,828	6,720,330
関係会社株式		234,921	234,921
長期差入保証金		681,432	681,196
長期前払費用		10,561	16,958
会員権		20,113	9,480
繰延税金資産		606,449	589,332
投資その他の資産合計		6,534,307	8,252,219
固定資産計		6,919,569	8,860,511
資産合計		33,641,581	33,452,870

	第 26 期 (平成23年3月31日)	第 27 期 (平成24年3月31日)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	47,190	47,840
未払金		
未払収益分配金	681	403
未払償還金	21,638	106,771
未払手数料	2 1,971,626	1,893,658
その他未払金	64,551	86,141
未払費用	824,240	930,998
未払消費税等	126,666	35,683
未払法人税等	1,004,164	264,114
賞与引当金	327,914	279,981
その他の流動負債	-	10
流動負債計	4,388,674	3,645,603
固定負債		
退職給付引当金	1,310,821	1,489,315
固定負債計	1,310,821	1,489,315
負債合計	5,699,496	5,134,919
(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	15,381,398	15,791,435
利益剰余金合計	17,202,602	17,612,639
株主資本計	27,831,586	28,241,623
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	110,498	76,327
評価・換算差額等計	110,498	76,327
純資産合計	27,942,085	28,317,951
負債・純資産合計	33,641,581	33,452,870

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

	第 26 期 （自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日）	第 27 期 （自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日）
営業収益		
委託者報酬	27,350,519	25,467,198
運用受託報酬	2,113,027	2,001,039
投資助言報酬	1,828,087	1,743,437
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	35,635	31,647
サービス支援手数料	234,885	99,134
その他	26,930	48,776
営業収益計	31,594,086	29,396,234
営業費用		
支払手数料	14,161,927	13,259,090
広告宣伝費	482,728	475,028
公告費	4,634	4,092
調査費		
調査費	537,254	503,839
委託調査費	2,115,042	2,285,064
営業雑経費		
通信費	34,433	35,155
印刷費	266,803	199,733
協会費	23,235	28,233
諸会費	11,346	12,025
情報機器関連費	2,066,205	1,855,475
販売促進費	27,670	28,021
その他	79,571	123,714
営業費用計	19,810,852	18,809,475
一般管理費		
給料		
役員報酬	155,867	154,738
給料・手当	4,342,937	4,427,312
賞与	983,434	937,970
賞与引当金繰入額	327,914	279,981
交際費	21,460	20,938
寄付金	31	10,026
事務委託費	220,738	245,311
旅費交通費	219,278	230,691
租税公課	87,674	80,136
不動産賃借料	677,468	683,098
退職給付費用	199,545	205,957
固定資産減価償却費	100,356	170,410
諸経費	250,817	268,760
一般管理費計	7,587,526	7,715,334

営業利益		4,195,707	2,871,423
営業外収益			
受取配当金		34,115	29,042
有価証券利息		3,603	3,731
受取利息	1	7,877	5,916
為替差益		4,753	-
時効成立分配金・償還金		3,076	3,563
原稿・講演料		3,485	2,745
還付加算金		1,645	-
雑収入		7,033	5,096
営業外収益計		65,590	50,095
営業外費用			
為替差損		-	15,834
時効成立後支払分配金・償還金		659	-
営業外費用計		659	15,834
経常利益		4,260,638	2,905,684
特別利益			
投資有価証券償還益		7	-
投資有価証券売却益		71,400	13,806
受取和解金		-	108,451
特別利益計		71,407	122,258
特別損失			
固定資産除却損	2	17,318	12,873
投資有価証券償還損		2,679	3,180
投資有価証券評価損		-	301
投資有価証券売却損		20,822	6,578
関係会社株式評価損		1,256	-
ゴルフ会員権評価損		-	10,633
特別損失計		42,077	33,566
税引前当期純利益		4,289,968	2,994,376
法人税、住民税及び事業税		1,852,053	1,195,768
法人税等調整額		93,549	136,130
法人税等合計		1,758,503	1,331,898
当期純利益		2,531,465	1,662,477

（ 3 ） 【 株主資本等変動計算書 】

（ 単位：千円 ）

	第 26 期 （ 自 平成22年 4 月 1 日 至 平成23年 3 月31日 ）	第 27 期 （ 自 平成23年 4 月 1 日 至 平成24年 3 月31日 ）
株主資本		
資本金		
当期首残高	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		
当期首残高	8,628,984	8,628,984
当期末残高	8,628,984	8,628,984
資本剰余金合計		
当期首残高	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		
当期首残高	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		
当期首残高	60,000	60,000
当期末残高	60,000	60,000
別途積立金		
当期首残高	1,476,959	1,476,959
当期末残高	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金		
当期首残高	14,172,932	15,381,398
当期変動額		
剰余金の配当	1,323,000	1,252,440
当期純利益	2,531,465	1,662,477
当期変動額合計	1,208,465	410,037
当期末残高	15,381,398	15,791,435
利益剰余金合計		
当期首残高	15,994,137	17,202,602
当期変動額		
剰余金の配当	1,323,000	1,252,440
当期純利益	2,531,465	1,662,477
当期変動額合計	1,208,465	410,037
当期末残高	17,202,602	17,612,639
株主資本合計		
当期首残高	26,623,121	27,831,586
当期変動額		
剰余金の配当	1,323,000	1,252,440
当期純利益	2,531,465	1,662,477

当期変動額合計	1,208,465	410,037
当期末残高	27,831,586	28,241,623
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	82,556	110,498
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	27,941	34,170
当期変動額合計	27,941	34,170
当期末残高	110,498	76,327
評価・換算差額合計		
当期首残高	82,556	110,498
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	27,941	34,170
当期変動額合計	27,941	34,170
当期末残高	110,498	76,327
純資産合計		
当期首残高	26,705,677	27,942,085
当期変動額		
剰余金の配当	1,323,000	1,252,440
当期純利益	2,531,465	1,662,477
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	27,941	34,170
当期変動額合計	1,236,407	375,866
当期末残高	27,942,085	28,317,951

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 満期保有目的の債券

償却原価法

(2) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

(3) その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

時価のないもの

移動平均法による原価法

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 3～50年

器具備品 3～20年

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

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

過去勤務債務については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

追加情報

当事業年度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。

注 記 事 項

(貸借対照表関係)

第26期 (平成23年3月31日)	第27期 (平成24年3月31日)
<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建 物 191,415千円</p> <p>器具備品 774,482千円</p> <p>無形固定資産の減価償却累計額</p> <p>電話加入権 95千円</p> <p>商標権 15,226千円</p>	<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建 物 210,710千円</p> <p>器具備品 624,552千円</p> <p>無形固定資産の減価償却累計額</p> <p>ソフトウェア 127,910千円</p> <p>電話加入権 107千円</p> <p>商標権 17,170千円</p>
<p>2 関係会社に対する債権債務</p> <p>現金及び預金 11,201,422千円</p> <p>未収投資助言報酬 293,061千円</p> <p>未払手数料 469,104千円</p>	<p>2 関係会社に対する債権債務</p> <p>現金及び預金 10,360,214千円</p> <p>未収投資助言報酬 283,244千円</p> <p>未払手数料 436,830千円</p>
<p>3 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座貸越契約を締結しております。</p> <p>当事業年度末における当座貸越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。</p> <p>当座貸越極度額の総額 10,000,000千円</p> <p>借入実行残高 - 千円</p> <p>差引額 10,000,000千円</p>	<p>3 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座貸越契約を締結しております。</p> <p>当事業年度末における当座貸越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。</p> <p>当座貸越極度額の総額 10,000,000千円</p> <p>借入実行残高 - 千円</p> <p>差引額 10,000,000千円</p>
<p>4 当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York)Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成27年6月までの賃借料総額74,617千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56,653千円の支払保証を行っております。</p>

(損益計算書関係)

第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
<p>1 関係会社との取引に係るもの</p> <p>受取利息 3,867千円</p>	<p>1 関係会社との取引に係るもの</p> <p>受取利息 2,455千円</p>
<p>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。</p>	<p>2 固定資産除却損は、器具備品12,873千円でありませす。</p>

(株主資本等変動計算書関係)

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

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額等

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成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

第27期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

1. 発行済株式数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額等

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成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

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

平成24年6月25日開催の第27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24年6月25日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	829,080	47,000	平成24年 3月31日	平成24年 6月26日

(リース取引関係)

第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24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 672,700 1年超 958,593 合計 1,631,293	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 672,641 1年超 286,301 合計 958,942

(金融商品関係)

1.金融商品の状況に関する事項

(1)金融商品に対する取組方針

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

(2)金融商品の内容及びそのリスク

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

有価証券及び投資有価証券については、主に満期保有目的の債券及び事業推進目的のために保有する当社が設定する投資信託等であり、市場価格の変動リスク及び発行体の信用リスクに晒されています。関係会社株式については、全額出資の海外子会社の株式であり、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

第26期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

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	-	-

第27期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

平成24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	15,970,870	15,970,870	-
(2)未収委託者報酬	3,392,765	3,392,765	-
(3)未収運用受託報酬	305,910	305,910	-
(4)未収投資助言報酬	452,618	452,618	-
(5)有価証券及び投資有価証券			
満期保有目的の債券	3,999,305	3,999,200	105
その他有価証券	6,671,589	6,671,589	-
(6)長期差入保証金	681,196	681,196	-
資産計	31,474,256	31,474,150	105
(1)未払金			
未払手数料	1,893,658	1,893,658	-
負債計	1,893,658	1,893,658	-

(注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資産

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

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

(5)有価証券及び投資有価証券

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

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

(6)長期差入保証金

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

負債

(1)未払金

未払手数料

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

(注2)時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

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

(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	15,970,870	-	-	-
未収委託者報酬	3,392,765	-	-	-
未収運用受託報酬	305,910	-	-	-
未収投資助言報酬	452,618	-	-	-
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	13,877	667,318	-	-
合計	24,136,043	667,318	-	-

(有価証券関係)

第26期(平成23年3月31日)

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

第27期(平成24年3月31日)

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	3,999,305	3,999,200	105
小計	3,999,305	3,999,200	105
合計	3,999,305	3,999,200	105

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。

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	4,635,097	4,387,713	247,384
小計	4,635,097	4,387,713	247,384
(2)貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	2,036,491	2,170,148	133,657
小計	2,036,491	2,170,148	133,657
合計	6,671,589	6,557,862	113,727

(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。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、301千円です。

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
1,012,727	13,806	6,578

(デリバティブ取引関係)

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

(退職給付関係)

第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)																				
<p>1. 採用している退職給付制度の概要 当社は、確定給付型の制度として、退職一時金制度を設けております。</p>	<p>1. 採用している退職給付制度の概要 当社は、確定給付型の制度として、退職一時金制度を設けております。</p>																				
<p>2. 退職給付債務の額 (単位：千円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 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; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">1,310,821</td> </tr> </table>	退職給付債務	1,310,821	退職給付引当金	1,310,821	<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;">1,489,315</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">1,489,315</td> </tr> </table>	退職給付債務	1,489,315	退職給付引当金	1,489,315												
退職給付債務	1,310,821																				
退職給付引当金	1,310,821																				
退職給付債務	1,489,315																				
退職給付引当金	1,489,315																				
<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: 80%;">勤務費用</td> <td style="text-align: right;">160,751</td> </tr> <tr> <td>利息費用</td> <td style="text-align: right;">17,066</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> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">15,287</td> </tr> <tr> <td>退職給付費用</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">199,545</td> </tr> </table> <p>(注)その他は、その他の関係会社からの出向者の年金掛金負担分と退職給付引当額相当額負担分になります。</p>	勤務費用	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	15,287	退職給付費用	199,545	<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: 80%;">勤務費用</td> <td style="text-align: right;">167,222</td> </tr> <tr> <td>利息費用</td> <td style="text-align: right;">19,662</td> </tr> <tr> <td>数理計算上の差異の費用処理額</td> <td style="text-align: right;">5,053</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">14,018</td> </tr> <tr> <td>退職給付費用</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">205,957</td> </tr> </table> <p>(注)その他は、その他の関係会社からの出向者の年金掛金負担分と退職給付引当額相当額負担分になります。</p>	勤務費用	167,222	利息費用	19,662	数理計算上の差異の費用処理額	5,053	その他	14,018	退職給付費用	205,957
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	15,287																				
退職給付費用	199,545																				
勤務費用	167,222																				
利息費用	19,662																				
数理計算上の差異の費用処理額	5,053																				
その他	14,018																				
退職給付費用	205,957																				
<p>4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項</p> <p>退職給付見込額の期間配分方法 勤務期間を基準とする方法</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">割引率</td> <td style="text-align: right;">1.5%</td> </tr> </table> <p>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）</p> <p>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>	割引率	1.5%	<p>4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項</p> <p>退職給付見込額の期間配分方法 勤務期間を基準とする方法</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">割引率</td> <td style="text-align: right;">1.5%</td> </tr> </table> <p>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）</p> <p>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>	割引率	1.5%																
割引率	1.5%																				
割引率	1.5%																				

(税効果会計関係)

第26期 (平成23年3月31日)	第27期 (平成24年3月31日)
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	1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳
(単位：千円)	(単位：千円)
(1) 流動の部	(1) 流動の部
繰延税金資産	繰延税金資産
賞与引当金	賞与引当金
133,428	106,421
未払社会保険料	未払社会保険料
14,807	12,691
未払事業税	未払事業税
83,126	27,381
未払事業所税	未払事業所税
6,378	5,808
その他	その他
4,235	3,644
繰延税金資産計	繰延税金資産計
241,975	155,946
評価性引当額	評価性引当額
-	-
繰延税金資産合計	繰延税金資産合計
241,975	155,946
繰延税金資産の純額	繰延税金資産の純額
241,975	155,946
(2) 固定の部	(2) 固定の部
繰延税金資産	繰延税金資産
退職給付引当金	退職給付引当金
533,373	530,792
ソフトウェア償却	ソフトウェア償却
141,119	95,129
投資有価証券評価損	投資有価証券評価損
71,023	61,204
特定外国子会社留保金額	特定外国子会社留保金額
247,489	222,604
その他	その他
4,925	7,328
繰延税金資産計	繰延税金資産計
997,931	917,059
評価性引当額	評価性引当額
321,097	290,326
繰延税金資産合計	繰延税金資産合計
676,833	626,732
繰延税金負債	繰延税金負債
その他有価証券評価差額金	その他有価証券評価差額金
70,383	37,399
繰延税金負債合計	繰延税金負債合計
70,383	37,399
繰延税金資産の純額	繰延税金資産の純額
606,449	589,332
2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳	2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳
	(%)
法定実効税率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。	法定実効税率
	40.6
	(調整)
	評価性引当額の増減
	1.0
	交際費等永久に損金に算入されない項目
	0.3
	住民税均等割等
	0.2
	外国税額控除
	0.5
	税率変更による期末繰延税金資産の減額修正
	4.5
	その他
	0.2
	税効果会計適用後の法人税等の負担率
	44.4

3. 法定実効税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の修正

平成23年12月2日に「経済社会の構造の変化に対応した税制の構築を図るための所得税法等の一部を改正する法律」(平成23年法律第114号)及び「東日本大震災からの復興のための施策を実施するために必要な財源の確保に関する特別措置法」(平成23年法律第117号)が公布され、平成24年4月1日以降開始する事業年度より法人税率が変更されることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用される法定実効税率は、前事業年度の40.6%から、一時差異等に係る解消時期に応じて以下のとおりとなります。

平成24年4月1日から平成27年3月31日 38.0%

平成27年4月1日以降 35.6%

この税率の変更により繰延税金資産の純額が88,362千円減少し、当事業年度に計上された法人税等調整額の金額が93,662千円、その他有価証券評価差額金が5,299千円、それぞれ増加しております。

(資産除去債務関係)

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。

第27期(自 平成23年 4月 1日 至 平成24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	25,467,198	2,001,039	1,743,437	184,558	29,396,234

(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。

(関連当事者情報)

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	日興コーポリアル証券(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。

第27期(自平成23年4月1日至平成24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	220,000,000	生命保険業	(被所有) % 直接 40	当社の 主要顧客	投資助言 報酬	1,082,284	未収投資 助言報酬	283,244
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	4,294,733	未払手数料	345,061

(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	S M B C 日興証券(株)	東京都 千代田区	10,000,000	証券業	- %	投信の 販売委託	委託販売 手数料	1,765,986	未払手数料	264,970

(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26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
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	1株当たり純資産額 1,605,326円06銭 1株当たり当期純利益 94,244円73銭
なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。
(1株当たり純資産額の算定上の基礎) 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 28,317,951千円 普通株式に係る純資産額 28,317,951千円 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 2,531,465千円 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	(1株当たり当期純利益の算定上の基礎) 損益計算書上の当期純利益 1,662,477千円 普通株式に係る当期純利益 1,662,477千円 普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。 普通株式の期中平均株式数 17,640株

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

[次へ](#)

中間財務諸表

(1)中間貸借対照表

(単位：千円)

		第28期中間会計期間 (平成24年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		16,703,596
有価証券		3,999,207
前払費用		257,951
未収委託者報酬		3,221,255
未収運用受託報酬		414,813
未収投資助言報酬		455,610
未収収益		18,523
繰延税金資産		166,931
その他		2,597
流動資産合計		25,240,487
固定資産		
有形固定資産	1	278,883
無形固定資産		387,892
投資その他の資産		
投資有価証券		5,955,910
その他		1,603,125
投資その他の資産合計		7,559,035
固定資産合計		8,225,811
資産合計		33,466,298
負債の部		
流動負債		
預り金		46,700
未払金		1,967,237
未払費用		962,591
未払法人税等		527,043
前受収益		7,481
賞与引当金		264,855
その他	2	80,694
流動負債合計		3,856,605
固定負債		
退職給付引当金		1,583,169
固定負債合計		1,583,169
負債合計		5,439,775
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	15,729,295
利益剰余金合計	17,550,500
株主資本合計	28,179,484
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	152,960
評価・換算差額等合計	152,960
純資産合計	28,026,523
負債純資産合計	33,466,298

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

		第28期中間会計期間 (自 平成24年 4月 1日 至 平成24年 9月30日)
営業収益		
委託者報酬		12,101,664
運用受託報酬		947,312
投資助言報酬		834,061
その他の営業収益		62,525
営業収益計		13,945,563
営業費用		8,998,609
一般管理費	1	3,693,404
営業利益		1,253,548
営業外収益	2	24,695
営業外費用	3	5,196
経常利益		1,273,048
特別利益		336
特別損失	4	57,288
税引前中間純利益		1,216,096
法人税、住民税及び事業税		497,151
法人税等調整額		47,995
法人税等合計		449,155
中間純利益		766,940

(3)中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

		第28期中間会計期間 (自 平成24年 4月 1日 至 平成24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	15,791,435
当中間期変動額	
剰余金の配当	829,080
中間純利益	766,940
当中間期変動額合計	62,139
当中間期末残高	15,729,295
利益剰余金合計	
当期首残高	17,612,639
当中間期変動額	
剰余金の配当	829,080
中間純利益	766,940
当中間期変動額合計	62,139
当中間期末残高	17,550,500
株主資本合計	
当期首残高	28,241,623
当中間期変動額	
剰余金の配当	829,080
中間純利益	766,940
当中間期変動額合計	62,139
当中間期末残高	28,179,484
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
当期首残高	76,327
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）	229,288
当中間期変動額合計	229,288
当中間期末残高	152,960

評価・換算差額等合計	
当期首残高	76,327
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）	229,288
当中間期変動額合計	229,288
当中間期末残高	152,960
純資産合計	
当期首残高	28,317,951
当中間期変動額	
剰余金の配当	829,080
中間純利益	766,940
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	229,288
当中間期変動額合計	291,428
当中間期末残高	28,026,523

重要な会計方針

1. 資産の評価基準及び評価方法

(1) 有価証券

満期保有目的の債券

償却原価法

子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

その他有価証券

時価のあるもの

中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

時価のないもの

移動平均法による原価法

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 3～50年

器具備品 3～20年

（会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更）

当社は、法人税法の改正に伴い、当中間会計期間より、平成24年4月1日以後に取得した有形固定資産については、改正後の法人税法に基づく減価償却の方法に変更しております。これによる当中間会計期間の営業利益、経常利益及び税引前中間純利益に与える影響は軽微であります。

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、将来の支給見込額のうち当中間会計期間の負担額を計上しております。

(2) 退職給付引当金

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

過去勤務債務については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

第28期中間会計期間 (平成24年9月30日)	
1. 有形固定資産の減価償却累計額	885,491千円
2. 消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債のその他に含めて表示しております。
3. 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座借越契約を締結しております。	当中間会計期間末における当座借越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。
	当座借越極度額の総額 10,000,000千円
	借入実行残高 <u> -</u>
	差引額 10,000,000千円
4. 当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York)Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成27年6月までの賃借料総額45,460千円の支払保証を行っております。	

(中間損益計算書関係)

第28期中間会計期間 (自平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)	
1. 減価償却実施額	
有形固定資産	54,001千円
無形固定資産	34,225千円
2. 営業外収益のうち主要なもの	
受取利息	3,069千円

受取配当金	15,103千円
3．営業外費用のうち主要なもの 為替差損	5,196千円
4．特別損失のうち主要なもの 投資有価証券売却損	36,226千円
投資有価証券評価損	17,803千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第28期中間会計期間（自 平成24年 4月 1日 至 平成24年 9月30日）

1．発行済株式数に関する事項

	当事業年度期首 株式数	当中間会計期間 増加株式数	当中間会計期間 減少株式数	当中間会計期間末 株式数
普通株式	17,640株	-	-	17,640株

2．剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成24年6月25日 定時株主総会	普通株式	829,080	47,000	平成24年 3月31日	平成24年 6月26日

（リース取引関係）

第28期中間会計期間 (自 平成24年 4月 1日 至 平成24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	583,720千円
1年超	1,469,547千円
合計	2,053,268千円

（金融商品関係）

1．金融商品の時価等に関する事項

第28期中間会計期間（平成24年 9月30日）

平成24年 9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次の通りです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません（（注2）参照）。

（単位：千円）

区分	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	16,703,596	16,703,596	-
(2)未収委託者報酬	3,221,255	3,221,255	-
(3)未収運用受託報酬	414,813	414,813	-
(4)未収投資助言報酬	455,610	455,610	-
(5)有価証券及び投資有価証券 満期保有目的の債券	3,999,207	3,998,800	407

その他有価証券	5,922,072	5,922,072	-
(6)投資その他の資産			
長期差入保証金	680,513	680,513	-
資産計	31,397,067	31,396,660	407
(1)未払金			
未払手数料	1,768,995	1,768,995	-
負債計	1,768,995	1,768,995	-

(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)

	中間貸借対照表計上額
その他有価証券	
非上場株式	298
投資証券	33,540
合計	33,838
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。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、14,903千円です。

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。

(有価証券関係)

第28期中間会計期間(平成24年9月30日)

1. 満期保有目的の債券

(単位：千円)

区分	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)中間貸借対照表日の時価が中間貸借対照表計上額を超えるもの	-	-	-
小計	-	-	-
(2)中間貸借対照表日の時価が中間貸借対照表計上額を超えないもの	3,999,207	3,998,800	407
小計	3,999,207	3,998,800	407
合計	3,999,207	3,998,800	407

2. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式(中間貸借対照表計上額 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。

3. その他有価証券

(単位：千円)

区分	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
(1)中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	2,793,142	2,705,290	87,851
小計	2,793,142	2,705,290	87,851
(2)中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 投資信託等	3,128,929	3,369,742	240,812
小計	3,128,929	3,369,742	240,812
合計	5,922,072	6,075,033	152,960

(注)非上場株式等(中間貸借対照表計上額 33,838千円)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、2,900千円です。

(デリバティブ取引関係)

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

(資産除去債務等)

該当事項はありません。

（セグメント情報等）

第28期中間会計期間（自 平成24年 4 月 1 日 至 平成24年 9 月30日）

1．セグメント情報

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

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

2．関連情報

(1)製品及びサービスごとの情報

（単位：千円）

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への売上高	12,101,664	947,312	834,061	62,525	13,945,563

(2)地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

（1株当たり情報）

第28期中間会計期間 （自 平成24年 4 月 1 日 至 平成24年 9 月30日）	
1株当たり純資産額	1,588,805円19銭
1株当たり中間純利益	43,477円35銭
<p>なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、潜在株式が存在しないため記載して おりません。</p>	
(注) 1株当たり純資産額の算定上の基礎	
中間貸借対照表の純資産の部の合計額	28,026,523千円
普通株式に係る純資産額	28,026,523千円
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	766,940千円

普通株式に係る中間純利益	766,940千円
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

（追加情報）

第28期中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

1. トヨタアセットマネジメント株式会社との経営統合

当社は、平成24年9月28日に、トヨタアセットマネジメント株式会社、トヨタファイナンシャルサービス株式会社、あいおいニッセイ同和損害保険株式会社、三井住友海上火災保険株式会社と、平成25年4月1日を効力発生日としてトヨタアセットマネジメント株式会社と経営統合する旨の合意書を締結致しました。

(1)目的

当社とトヨタアセットマネジメント株式会社の経営統合により、地域性や商品性などの相互補完関係を活かすことで、国内における事業基盤の飛躍的な拡大と運用・商品開発力の強化、更に、経営におけるシナジー発揮などを通じ、お客様サービスのより一層の向上が行えるとの判断に至り、この度合意いたしました。

(2)合併する相手会社の名称

トヨタアセットマネジメント株式会社

(3)合併の方法、合併後の会社名

当該合併は、当社がトヨタアセットマネジメント株式会社の全株式を取得した後に行い、当社を存続会社とする吸収合併方式であり、トヨタアセットマネジメント株式会社は解散いたします。合併後の名称に変更はありません。

(4)合併比率、合併交付金の額、合併により発行する株式の種類及び数

当社は、トヨタアセットマネジメント株式会社の発行済株式の全てを所有する予定となっているため、合併に際しては新株の発行及び金銭等の交付はいたしません。

(5)相手会社の主な事業の内容、規模（平成24年3月期）

名称	トヨタアセットマネジメント株式会社
事業の内容	投資運用業等
資本金	600,000千円
純資産	1,385,963千円
総資産	1,833,325千円
営業収益	1,980,544千円
当期純利益	5,635千円

(6)合併の時期

平成25年4月1日（予定）

[次へ](#)

（参考情報）

トヨタアセットマネジメント株式会社の経理状況

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条及び第57条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を四捨五入して表示しております。
2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第23期事業年度（平成23年4月1日から平成24年3月31日まで）の財務諸表について、あらた監査法人により監査を受けております。
また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第24期中間会計期間（平成24年4月1日から平成24年9月30日まで）の中間財務諸表について、あらた監査法人により中間監査を受けております。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成24年6月15日

トヨタアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 荒川 進 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」に掲げられているトヨタ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23期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、トヨタアセットマネジメント株式会社の平成24年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

(注) 上記は、独立監査人の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。

[次へ](#)

(1)貸借対照表

(単位：千円)

	前事業年度 (平成23年3月31日)		当事業年度 (平成24年3月31日)	
資産の部				
流動資産				
現金及び預金		364,242		501,562
有価証券		772,833		643,270
前払費用		25,258		21,817
未収委託者報酬		453,107		372,005
未収運用受託報酬		94,575		92,258
繰延税金資産		27,806		19,857
流動資産合計		1,737,821		1,650,770
固定資産				
有形固定資産				
建物	*1	20,177	*1	17,684
器具備品	*1	16,143	*1	8,726
有形固定資産合計		36,320		26,411
無形固定資産				
ソフトウェア		8,911		7,672
電話加入権		1,207		1,207
無形固定資産合計		10,119		8,879
投資その他の資産				
投資有価証券		555		40,477
長期前払費用		16		-
長期差入保証金		70,343		70,406
長期預け金		602		574
繰延税金資産		33,002		35,810
投資その他の資産合計		104,518		147,266
固定資産合計		150,957		182,555
資産合計		1,888,777		1,833,325

(単位：千円)

	前事業年度 (平成23年3月31日)		当事業年度 (平成24年3月31日)	
負債の部				
流動負債				
預り金		6,067		8,489
未払代行手数料		247,745		202,085
未払金		566		606
未払費用		89,782		93,163
未払法人税等		11,207		6,403

未払消費税等	8,802	9,154
賞与引当金	48,000	27,000
流動負債合計	412,169	346,901
固定負債		
退職給付引当金	80,919	100,461
固定負債合計	80,919	100,461
負債合計	493,088	447,362
純資産の部		
株主資本		
資本金	600,000	600,000
利益剰余金		
利益準備金	27,760	29,284
その他利益剰余金		
別途積立金	109,000	109,000
繰越利益剰余金	658,818	647,689
利益剰余金合計	795,578	785,973
株主資本合計	1,395,578	1,385,973
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	111	10
評価・換算差額等合計	111	10
純資産合計	1,395,689	1,385,963
負債・純資産合計	1,888,777	1,833,325

(2)損益計算書

(単位：千円)

	前事業年度 (自平成22年4月 1日 至平成23年3月31日)	当事業年度 (自平成23年4月 1日 至平成24年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	1,379,563	1,177,306
運用受託報酬	252,648	273,573
投資助言報酬	*1 536,073	*1 529,665
営業収益合計	2,168,284	1,980,544
営業費用		
支払手数料	675,328	550,329
広告宣伝費	-	6,366
調査費	142,527	147,633
委託調査費	108,516	114,623
委託計算費	43,825	42,128
営業雑経費		

通信費		6,338		5,816
印刷費		30,271		21,775
協会費		4,081		4,239
諸会費		667		874
その他営業雑経費		1,880		3,651
営業費用合計		1,013,432		897,433
一般管理費				
給料				
役員報酬		75,740		83,127
給料・手当	*1	489,172	*1	488,251
賞与	*1	139,887	*1	99,845
賞与引当金繰入		48,000		27,000
福利厚生費		92,418		93,480
交際費		1,881		6,181
旅費交通費		13,360		16,469
租税公課		6,718		9,114
不動産賃借料		99,501		89,783
退職給付費用	*1	28,575	*1	32,884
固定資産減価償却費		22,238		13,584
業務委託費		44,641		49,845
諸経費		34,537		40,787
一般管理費合計		1,096,666		1,050,351
営業利益		58,187		32,760
営業外収益				
受取利息		30		36
有価証券利息		628		547
受取配当金		-		529
その他営業外収益		364		1,203
営業外収益合計		1,022		2,315
営業外費用				
雑損失		151		336
営業外費用合計		151		336
経常利益		59,057		34,739
特別利益				
投資有価証券売却益		-		71
特別利益合計		-		71
特別損失				
役員退職慰労金		20,880		7,750
固定資産除却損	*2	1,012	*2	1,020
資産除去債務会計基準の適用に伴う影響額		3,405		-
特別損失合計		25,297		8,770

税引前当期純利益	33,761	26,040
法人税、住民税及び事業税	21,000	15,259
法人税等調整額	4,094	5,146
法人税等合計	16,906	20,405
当期純利益	16,854	5,635

(3)株主資本等変動計算書

(単位：千円)

	前事業年度 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	当事業年度 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
株主資本		
資本金		
当期首残高	600,000	600,000
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	600,000	600,000
利益剰余金		
利益準備金		
当期首残高	25,876	27,760
当期変動額		
利益準備金の積立	1,884	1,524
当期変動額合計	1,884	1,524
当期末残高	27,760	29,284
その他利益剰余金		
別途積立金		
当期首残高	109,000	109,000
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	109,000	109,000
繰越利益剰余金		
当期首残高	662,688	658,818
当期変動額		
利益準備金の積立	1,884	1,524
剰余金の配当	18,840	15,240
当期純利益	16,854	5,635
当期変動額合計	3,870	11,129
当期末残高	658,818	647,689
利益剰余金合計		
当期首残高	797,564	795,578
当期変動額		
利益準備金の積立	-	-
剰余金の配当	18,840	15,240
当期純利益	16,854	5,635
当期変動額合計	1,986	9,605

当期末残高	795,578	785,973
株主資本合計		
当期首残高	1,397,564	1,395,578
当期変動額		
剰余金の配当	18,840	15,240
当期純利益	16,854	5,635
当期変動額合計	1,986	9,605
当期末残高	1,395,578	1,385,973
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
当期首残高	86	111
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	25	121
当期変動額合計	25	121
当期末残高	111	10
評価・換算差額等合計		
当期首残高	86	111
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	25	121
当期変動額合計	25	121
当期末残高	111	10
純資産合計		
当期首残高	1,397,650	1,395,689
当期変動額		
剰余金の配当	18,840	15,240
当期純利益	16,854	5,635
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	25	121
当期変動額合計	1,961	9,726
当期末残高	1,395,689	1,385,963

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

決算日の市場価格等による時価法(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)を採用しております。なお、預金と同様の性格を有する有価証券については、移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定率法を採用しております。但し、平成10年4月1日以降に取得した建物(建物附属設備を除く)については定額法を採用しております。

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における見込み利用可能期間(5年)による定額法を採用しております。

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員に対して支給する賞与の支出に備えて、支給見込額の当事業年度負担額を計上しております。

(2) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職金規程に基づく自己都合要支給額の全額を計上しております。

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は、税抜方式によっております。

追加情報

会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準等の適用

当事業年度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より、「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。

注記事項

(貸借対照表関係)

前事業年度 (平成23年3月31日)	当事業年度 (平成24年3月31日)
*1 有形固定資産の減価償却累計額	*1 有形固定資産の減価償却累計額
建物 61,485千円	建物 63,978千円
器具備品 71,812千円	器具備品 57,853千円
計 133,297千円	計 121,831千円

(損益計算書関係)

前事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)	当事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)
*1 関係会社との取引額	*1 関係会社との取引額
投資助言報酬 536,073千円	投資助言報酬 529,665千円
給料・手当 99,318千円	給料・手当 107,355千円
賞与 31,293千円	賞与 31,907千円
退職給付費用 4,632千円	退職給付費用 4,200千円
*2 固定資産除却損は、器具備品936千円及び電話加入権76千円であります。	*2 固定資産除却損は、器具備品1,020千円であります。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数 (株)	当事業年度 増加株式数 (株)	当事業年度 減少株式数 (株)	当事業年度末 株式数 (株)
発行済株式				
普通株式	12,000	-	-	12,000
合計	12,000	-	-	12,000

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成22年6月28日 定時株主総会	普通株式	18,840	1,570	平成22年 3月31日	平成22年 6月29日

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

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の 総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成23年6月28日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	15,240	1,270	平成23年 3月31日	平成23年 6月29日

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数 (株)	当事業年度 増加株式数 (株)	当事業年度 減少株式数 (株)	当事業年度末 株式数 (株)
発行済株式				
普通株式	12,000	-	-	12,000
合計	12,000	-	-	12,000

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり 配当額 (円)	基準日	効力発生日
平成23年6月28日 定時株主総会	普通株式	15,240	1,270	平成23年 3月31日	平成23年 6月29日

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

決議予定	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (千円)	1株当たり配 当額 (円)	基準日	効力発生日
平成24年6月27日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	5,040	420	平成24年 3月31日	平成24年 6月28日

(リース取引関係)

該当事項はありません。

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、資金運用については、合理的な理由がある場合を除いて、銀行預金及び安全性の高い有価証券に限定しており、投機的な取引は行わない方針であります。また、資金調達については、運転資金及び設備投資資金に関しては、原則として自己資金で賄う方針であります。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

営業債権である未収運用受託報酬には、顧客の信用リスクが存在します。資産管理部門及び営業部門において、日常の営業活動により、顧客等の信用状況を把握するとともに、債権回収の期日管理を行い、経理部門でその回収を確認することで、回収懸念の軽減ないしは早期把握に努めています。

また、未収委託者報酬には、運用を委託されている投資信託の運用資産が悪化した場合に回収できず、当社が損失を被るリスクが存在しますが、過去の回収実績等からリスクは非常に低いものと考えております。

有価証券及び投資有価証券は、当社設定・運用の短期公社債投資信託並びに株式投資信託であり、組入れ有価証券について市場価格の変動リスク及び信用リスク等が存在します。当該リスクに対しては、日々、時価を把握し、組入れ有価証券の発行体の財務状況等の把握等により、リスク管理を実施するとともに、定期的に保有継続について検討を行っています。

長期差入保証金は、建物賃貸借契約に係る敷金であり、差し入れ先の信用リスクに晒されています。差し入れ先の信用状況を定期的に把握することを通じて、リスクの軽減を図っています。

営業債務である未払費用は、全て1年以内に支払期日が到来します。これらには、流動性リスクが存在します。当社は、現状、自己資金が充分であります。キャッシュ・フローの管理等を通じて、リスクの軽減を図っています。

2. 金融商品の時価等に関する事項

前事業年度(平成23年3月31日)

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりとなっております。なお、時価を把握するのが極めて困難と認められる金融商品はありません。

(単位：千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	364,242	364,242	
(2)有価証券	772,833	772,833	
(3)未収委託者報酬	453,107	453,107	
(4)未収運用受託報酬	94,575	94,575	
(5)投資有価証券	555	555	
(6)長期差入保証金	70,343	68,690	1,653
資産計	1,755,655	1,754,003	1,653
(1)未払代行手数料	247,745	247,745	
(2)未払費用	89,782	89,782	
負債計	337,527	337,527	

(注1)金融商品の時価の算定方法

資産

(1)現金及び預金

預金はすべて短期間で決済されるものであり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(2)有価証券及び(5)投資有価証券

有価証券及び投資有価証券は、すべて投資信託であり、その時価については、基準価額によっております。

(3)未収委託者報酬及び(4)未収運用受託報酬

これらはすべて短期間で決済されるものであり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(6)長期差入保証金

長期差入保証金(敷金)の時価の算定は、合理的に見積りした長期差入保証金(敷金)の返還予定時期に基づき、国債の利率で割引いた現在価値によっております。

負債

(1)未払代行手数料及び(2)未払費用

これらはすべて短期間で決済されるものであり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(注2)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれます。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

(注3)金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：千円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	364,242			
未収委託者報酬	453,107			
未収運用受託報酬	94,575			
長期差入保証金		56,274	14,069	
合計	911,924	56,274	14,069	

当事業年度(平成24年3月31日)

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりとなっております。なお、時価を把握するのが極めて困難と認められる金融商品はありません。

(単位：千円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	501,562	501,562	
(2)有価証券	643,270	643,270	
(3)未収委託者報酬	372,005	372,005	
(4)未収運用受託報酬	92,258	92,258	
(5)投資有価証券	40,477	40,477	
(6)長期差入保証金	70,406	69,389	1,016
資産計	1,719,978	1,718,962	1,016

(1)未払代行手数料	202,085	202,085	
(2)未払費用	93,163	93,163	
負債計	295,248	295,248	

(注1)金融商品の時価の算定方法

資産

(1)現金及び預金

預金はすべて短期間で決済されるものであり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(2)有価証券及び(5)投資有価証券

有価証券及び投資有価証券は、すべて投資信託であり、その時価については、基準価額によっております。

(3)未収委託者報酬及び(4)未収運用受託報酬

これらはすべて短期間で決済されるものであり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(6)長期差入保証金

長期差入保証金（敷金）の時価の算定は、合理的に見積りした長期差入保証金（敷金）の返還予定時期に基づき、国債の利率で割引いた現在価値によっております。

負債

(1)未払代行手数料及び(2)未払費用

これらはすべて短期間で決済されるものであり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(注2)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれます。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

(注3)金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：千円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	501,562	-	-	-
未収委託者報酬	372,005	-	-	-
未収運用受託報酬	92,258	-	-	-
長期差入保証金	-	-	70,406	-
合計	965,825	-	70,406	-

(有価証券関係)

その他有価証券

前事業年度(平成23年3月31日)

(単位：千円)

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
--	----	----------	------	----

貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	投資信託	555	444	111
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	772,833	772,833	
合計		773,388	773,277	111

当事業年度（平成24年3月31日）

（単位：千円）

	種類	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	投資信託	683,747	683,762	15
合計		683,747	683,762	15

その他有価証券の当事業年度中の売却額は515千円であり、売却益は71千円であります。

（デリバティブ取引関係）

該当事項はありません。

（退職給付関係）

前事業年度 （自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日）	当事業年度 （自 平成23年 4月 1日 至 平成24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、退職一時金制度を採用しております。</p> <p>2．退職給付債務に関する事項 (1)退職給付債務 80,919千円 (2)退職給付引当金 80,919千円</p> <p>3．退職給付費用に関する事項 (1)勤務費用(注) 28,575千円 (2)退職給付費用 28,575千円 (注)確定拠出年金への掛金支払額を含んでおります。</p>	<p>1．採用している退職給付制度の概要 同左</p> <p>2．退職給付債務に関する事項 (1)退職給付債務 100,461千円 (2)退職給付引当金 100,461千円</p> <p>3．退職給付費用に関する事項 (1)勤務費用(注) 32,884千円 (2)退職給付費用 32,884千円 (注)確定拠出年金への掛金支払額を含んでおります。</p>

（税効果会計関係）

前事業年度 （平成23年3月31日）	当事業年度 （平成24年3月31日）
<p>1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生 of 主な原因別の内訳</p> <p style="text-align: right;">（単位：千円）</p> <p>繰延税金資産</p>	<p>1．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生 of 主な原因別の内訳</p> <p style="text-align: right;">（単位：千円）</p> <p>繰延税金資産</p>

未払事業税	1,542	未払事業税	1,023
少額固定資産	285	少額固定資産	71
賞与引当金超過額	19,531	賞与引当金超過額	10,263
未払費用	6,287	未払費用	8,270
退職給付引当金超過額	32,926	退職給付引当金超過額	35,804
資産除去債務	1,535	資産除去債務	1,476
その他	463	その他	235
繰延税金資産小計	62,569	繰延税金資産小計	57,142
評価性引当額	1,762	評価性引当額	1,475
繰延税金資産の純額	60,808	繰延税金資産の純額	55,667
2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳		2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳	
法定実効税率 (調整)	40.7%	法定実効税率 (調整)	40.7%
交際費等永久に損金に算入 されない項目	2.7%	交際費等永久に損金に算入 されない項目	10.6%
住民税均等割	2.4%	住民税均等割	3.2%
評価性引当額	5.2%	評価性引当額	0.2%
その他	1.0%	税率変更による期末繰延税 金資産の減額修正	24.9%
税効果会計適用後の法人税 等の負担率	50.1%	その他	0.7%
		税効果会計適用後の法人税 等の負担率	78.4%

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産の金額の修正

「経済社会の構造の変化に対応した税制の構築を図るための所得税法等の一部を改正する法律」（平成23年法律第114号）及び「東日本大震災からの復興のための施策を実施するために必要な財源の確保に関する特別措置法」（平成23年法律第117号）が平成23年12月2日に公布され、平成24年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率の引下げ及び復興特別法人税の課税が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産の計算に使用する法定実効税率は従来の40.7%から、平成24年4月1日に開始する事業年度から平成26年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については38.0%に、平成27年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については35.6%になります。

この税率変更により、繰延税金資産の金額が6,474千円、その他有価証券評価差額金が1千円、それぞれ減少し、法人税等調整額が6,473千円増加しております。

（セグメント情報等）

〔セグメント情報〕

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

当社は、投資運用業及び投資助言・代理業にこれらの附帯業務を集約した単一セグメントを報告セグメントとしております。従いまして、開示対象となるセグメントはありませんので、記載を省略しております。

前事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

〔関連情報〕

1. 製品及びサービスごとの情報

単一のサービス区分の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

本邦の外部顧客への営業収益のみであるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産のみであるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

顧客の名称又は氏名	営業収益(千円)	関連するセグメント名
あいおいニッセイ同和損害 保険株式会社	536,073	-

当事業年度(自平成23年4月1日至平成24年3月31日)

〔関連情報〕

1. 製品及びサービスごとの情報

単一のサービス区分の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

本邦の外部顧客への営業収益のみであるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産のみであるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

顧客の名称又は氏名	営業収益(千円)	関連するセグメント名
あいおいニッセイ同和損害 保険株式会社	529,665	-

(関連当事者情報)

前事業年度(自平成22年4月1日至平成23年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主(会社等の場合に限る。)等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
その他の関係会社	あいおいニッセイ同和損害保険株式会社(注3)	東京都 渋谷区	100,005 百万円	損害保険業	(被所有) 直接50%	投資顧問契約	投資助言報酬(注1)	536,073		
						役員の兼任等	出向者人件費(注2)	108,809		

(1) 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておりません。

(2) 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 投資助言報酬は、投資資産額に一定料率を乗じる方法等により算定しており、他の投資顧問契約の料率を勘案して決定しております。

(注2) 出向者人件費は、出向元の給与規程を基に計算した人件費相当額を支払っております。

(注3) 平成22年10月1日付けにて、あいおい損害保険株式会社はニッセイ同和損害保険株式会社と合併し、あいおいニッセイ同和損害保険株式会社となりました。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

1．関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主(会社等の場合に限る。)等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
その他の関係会社	あいおいニッセイ同和損害保険株式会社	東京都渋谷区	100,005 百万円	損害保険業	(被所有)直接50%	投資顧問契約	投資助言報酬 (注1)	529,665		
						役員の兼任等	出向者人件費(注2)	112,755		

(1) 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておりません。

(2) 取引条件及び取引条件の決定方針等

(注1) 投資助言報酬は、投資資産額に一定料率を乗じる方法等により算定しており、他の投資顧問契約の料率を勘案して決定しております。

(注2) 出向者人件費は、出向元の給与規程を基に計算した人件費相当額を支払っております。

2．親会社又は重要な関連会社に関する注記

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

前事業年度 (自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日)	当事業年度 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)
1株当たり純資産額 116,307.42円	1株当たり純資産額 115,496.94円
1株当たり当期純利益 1,404.52円	1株当たり当期純利益 469.62円
なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。
1株当たり当期純利益の算定上の基礎 損益計算書上の当期純利益 16,854千円 普通株式に係る当期純利益 16,854千円 普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。	1株当たり当期純利益の算定上の基礎 損益計算書上の当期純利益 5,635千円 普通株式に係る当期純利益 5,635千円 普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。
普通株式の期中平均株式数 12,000株	普通株式の期中平均株式数 12,000株

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成24年12月10日

トヨタアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 荒川 進 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」に掲げられているトヨタアセットマネジメント株式会社の平成24年4月1日から平成25年3月31日までの第24期事業年度の中間会計期間（平成24年4月1日から平成24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、トヨタアセットマネジメント株式会社の平成24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24年4月1日から平成24年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

（注）上記は、独立監査人の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。

[次へ](#)

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位:千円)

		当中間会計期間末 (平成24年9月30日)
資産の部		
流動資産		
現金及び預金		485,159
有価証券		643,449
前払費用		33,527
未収委託者報酬		379,229
未収運用受託報酬		97,197
繰延税金資産		25,376
流動資産合計		1,663,937
固定資産		
有形固定資産		
建物	*1	16,611
器具備品	*1	8,470
有形固定資産合計		25,080
無形固定資産		
ソフトウェア		6,951
その他		38
無形固定資産合計		6,989
投資その他の資産		
投資有価証券		41,809
長期差入保証金		70,130
長期預け金		565
繰延税金資産		38,909
投資その他の資産合計		151,413
固定資産合計		183,482
資産合計		1,847,419

(単位:千円)

		当中間会計期間末 (平成24年9月30日)
負債の部		
流動負債		
預り金		8,747

未払代行手数料		205,926
未払金		598
未払費用		96,394
未払法人税等		6,278
未払消費税等	*2	7,723
賞与引当金		45,000
流動負債合計		370,666
固定負債		
退職給付引当金		110,046
役員退職慰労引当金		7,637
固定負債合計		117,683
負債合計		488,349
純資産の部		
株主資本		
資本金		600,000
利益剰余金		
利益準備金		29,788
その他利益剰余金		
別途積立金		109,000
繰越利益剰余金		619,719
利益剰余金合計		758,507
株主資本合計		1,358,507
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		563
評価・換算差額等合計		563
純資産合計		1,359,070
負債・純資産合計		1,847,419

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

	当中間会計期間 (自平成24年4月 1日 至平成24年9月30日)
営業収益	
委託者報酬	580,297
運用受託報酬	148,019
投資助言報酬	223,536
営業収益合計	951,852
営業費用	

支払手数料		273,681
調査費		71,117
委託調査費		58,360
委託計算費		20,686
営業雑経費		
通信費		2,559
印刷費		9,566
協会費		2,212
諸会費		729
その他営業雑経費		1,116
営業費用合計		440,026
一般管理費		
給料		
役員報酬		37,057
給料・手当		241,179
賞与		33,277
賞与引当金繰入		45,000
福利厚生費		44,450
交際費		4,771
旅費交通費		8,608
租税公課		2,927
不動産賃借料		38,239
退職給付費用		16,058
役員退職慰労引当金繰入		7,637
固定資産減価償却費	*1	4,881
業務委託費		29,227
諸経費		25,840
一般管理費合計		539,150
営業損失		27,324
営業外収益		
受取利息		27
有価証券利息		223
受取配当金		475
その他営業外収益		735
営業外収益合計		1,460
営業外費用		
雑損失		1,170
営業外費用合計		1,170
経常損失		27,035
税引前中間純損失		27,035
法人税、住民税及び事業税		4,327
法人税等調整額		8,935
法人税等合計		4,608
中間純損失		22,426

(3) 中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

	当中間会計期間 (自平成24年4月 1日 至平成24年9月30日)
株主資本	
資本金	
当期首残高	600,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	600,000
利益剰余金	
利益準備金	
当期首残高	29,284
当中間期変動額	
利益準備金の積立	504
当中間期変動額合計	504
当中間期末残高	29,788
その他利益剰余金	
別途積立金	
当期首残高	109,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	-
当中間期末残高	109,000
繰越利益剰余金	
当期首残高	647,689
当中間期変動額	
利益準備金の積立	504
剰余金の配当	5,040
中間純損失	22,426
当中間期変動額合計	27,970
当中間期末残高	619,719
利益剰余金合計	
当期首残高	785,973
当中間期変動額	
剰余金の配当	5,040
中間純損失	22,426
当中間期変動額合計	27,466
当中間期末残高	758,507
株主資本合計	
当期首残高	1,385,973

当中間期変動額	
剰余金の配当	5,040
中間純損失	22,426
当中間期変動額合計	27,466
当中間期末残高	1,358,507
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
当期首残高	10
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)	573
当中間期変動額合計	573
当中間期末残高	563
評価・換算差額等合計	
当期首残高	10
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)	573
当中間期変動額合計	573
当中間期末残高	563
純資産合計	
当期首残高	1,385,963
当中間期変動額	
剰余金の配当	5,040
中間純損失	22,426
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	573
当中間期変動額合計	26,893
当中間期末残高	1,359,070

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

中間決算日の市場価格等による時価法（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）を採用しております。なお、預金と同様の性格を有する有価証券については、移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定率法を採用しております。但し、平成10年4月1日以降に取得した建物(建物附属設備を除く)については定額法を採用しております。

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における見込み利用可能期間（5年）による定額法を採用しております。

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員に対して支給する賞与の支出に備えて、支給見込額の中間会計期間負担額を計上しております。

(2) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職金規程に基づく自己都合要支給額に基づき、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。

(3) 役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支出に備えるため、内規に基づく中間期末要支給額を計上しております。

追加情報

役員退職慰労引当金の適用

当社の役員に対する慰労金は、従来は支出時の費用として処理しておりましたが、当中間会計期間より、内規に基づく期末要支給額を役員退職慰労引当金として計上する方法に変更しております。

これにより、営業損失、経常損失及び税引前中間純損失が7,637千円増加しております。

4. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は、税抜方式によっております。

会計方針の変更

減価償却方法の変更

当社は法人税法の改正に伴い、当中間会計期間より、平成24年4月1日以後に取得した有形固定資産について、改正後の法人税法に基づく減価償却方法に変更しております。なお、この変更による当中間会計期間の損益に与える影響は軽微であります。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

当中間会計期間末 (平成24年9月30日)	
*1 有形固定資産の減価償却累計額	
建物	65,052千円
器具備品	59,980千円
計	125,032千円
*2 消費税等の取扱い	
仮受消費税等と控除対象の仮払消費税等は相殺し、流動負債に表示しております。	

(中間損益計算書関係)

当中間会計期間 (自平成24年4月1日 至平成24年9月30日)	
*1 減価償却実施額	
有形固定資産	3,201千円

無形固定資産

1,680千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間(自平成24年4月1日至平成24年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数(株)	当中間会計期間 増加株式数(株)	当中間会計期間 減少株式数(株)	当中間会計期間末 株式数(株)
発行済株式				
普通株式	12,000	-	-	12,000
合計	12,000	-	-	12,000

2. 配当に関する事項

配当金支払額

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	1株当たり配 当額(円)	基準日	効力発効日
平成24年6月27日 定時株主総会	普通株式	5,040	420	平成24年 3月31日	平成24年 6月28日

(リース取引関係)

該当事項はありません。

(金融商品関係)

当中間会計期間(平成24年9月30日)

金融商品の時価等に関する事項

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、次のとおりとなっております。なお、時価を把握するのが極めて困難と認められる金融商品はありません。

(単位：千円)

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金及び預金	485,159	485,159	
(2)有価証券	643,449	643,449	
(3)未収委託者報酬	379,229	379,229	
(4)未収運用受託報酬	97,197	97,197	
(5)投資有価証券	41,809	41,809	
(6)長期差入保証金	70,130	69,769	361
資産計	1,716,973	1,716,612	361
(1)未払代行手数料	205,926	205,926	
(2)未払費用	96,394	96,394	
負債計	302,320	302,320	

(注1)金融商品の時価の算定方法

資産

(1)現金及び預金

預金はすべて短期間で決済されるものであり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(2)有価証券及び(5)投資有価証券

有価証券及び投資有価証券は、すべて投資信託であり、その時価については、基準価額によっております。

(3)未収委託者報酬及び(4)未収運用受託報酬

これらはすべて短期間で決済されるものであり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(6)長期差入保証金

長期差入保証金（敷金）の時価の算定は、合理的に見積りした長期差入保証金（敷金）の返還予定時期に基づき、国債の利率で割引いた現在価値によっております。

負債

(1)未払代行手数料及び(2)未払費用

これらはすべて短期間で決済されるものであり、時価は帳簿価額と近似していることから、当該帳簿価額によっております。

(注2)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれます。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

(有価証券関係)

その他有価証券

当中間会計期間末（平成24年 9月30日）

(単位：千円)

	種類	中間貸借対照表計上額	取得原価	差額
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	41,809	40,934	875
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	643,449	643,449	
合計		685,258	684,383	875

(デリバティブ取引関係)

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当社は「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社であり証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っております。また「金融商品取引法」に定める投資助言・代理業を行っております。

当社は、投資運用業及び投資助言・代理業にこれらの附帯業務を集約した単一セグメントを報告セグメントとしております。従いまして、開示対象となるセグメントはありませんので、記載を省略しております。

当中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

[関連情報]

1. 製品及びサービスごとの情報

単一のサービス区分の外部顧客への営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

本邦の外部顧客への営業収益のみであるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産のみであるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

顧客の名称又は氏名	営業収益(千円)	関連するセグメント名
あいおいニッセイ同和損害保険株式会社	223,536	

(1 株当たり情報)

当中間会計期間 (自 平成24年 4月 1日 至 平成24年 9月30日)	
1 株当たり純資産額	113,255.85円
1 株当たり中間純損失	1,868.85円
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益については、1株当たり中間純損失であり、また潜在株式を発行していないため記載しておりません。	
1 株当たり中間純損失の算定上の基礎	
中間損益計算書上の中間純損失	22,426千円
普通株式に係る中間純損失	22,426千円
普通株主に帰属しない金額の主な内訳	該当事項はありません
普通株式の期中平均株式数	12,000株

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

イ 定款の変更、その他の重要事項

委託会社は、平成25年4月1日にトヨタアセットマネジメント株式会社と合併しました。

- 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9月末現在）
- (ハ) 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

【参考情報：再信託受託会社の概要】

- ・ 名称 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社
- ・ 資本金の額 51,000百万円（平成24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	639,000百万円	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24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24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】

販売会社である株式会社三井住友銀行は、委託会社株式を7,056株（持株比率40.0%）保有しています。
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。

「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

(単位：円)

	(平成24年 2月20日現在)	(平成25年 2月18日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	5,042,969,514	4,828,023,416
株式	304,191,724,375	316,216,058,890
派生商品評価勘定	82,871,850	4,255,600
未収入金	64,371,700	217,900
未収配当金	332,423,447	382,786,273
未収利息	6,908	6,613
前払金		6,090,000
差入委託証拠金		101,390,000
流動資産合計	309,714,367,794	321,538,828,692
資産合計	309,714,367,794	321,538,828,692
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		10,375,000
前受金	82,875,000	
未払金	39,980,000	
未払解約金	2,259,702,291	805,503,037
流動負債合計	2,382,557,291	815,878,037
負債合計	2,382,557,291	815,878,037
純資産の部		
元本等		
元本	279,179,562,739	242,083,683,887
剰余金		
剰余金又は欠損金()	28,152,247,764	78,639,266,768
元本等合計	307,331,810,503	320,722,950,655
純資産合計	307,331,810,503	320,722,950,655
負債純資産合計	309,714,367,794	321,538,828,692

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成24年 2月21日 至平成25年 2月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。

	<p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

(追加情報)

<p>自 平成24年 2月21日 至 平成25年 2月18日</p>
<p>当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更およ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）および「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>

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成24年 2月20日現在)	(平成25年 2月18日現在)
1. 担保資産	<p>代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p style="text-align: center;">担保資産 金額 株式 6,030,000,000円</p>	<p>代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <p style="text-align: center;">担保資産 金額 株式 8,613,000,000円</p>
2. 受益権総数	<p>平成24年 2月20日における受益権の総数 279,179,562,739口</p>	<p>平成25年 2月18日における受益権の総数 242,083,683,887口</p>
3. 1単位当たり純資産額	<p style="text-align: center;">1.1008円 (1万口 = 11,008円)</p>	<p style="text-align: center;">1.3248円 (1万口 = 13,248円)</p>

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成24年 2月21日 至 平成25年 2月18日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<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、株式を組み入れております。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成25年 2月18日現在)
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p>	<p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。</p>
<p>2. 時価の算定方法</p>	<p>(1) 有価証券（株式） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</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>

	(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。
--	---

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成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				
	東証株価指数先物	1,708,548,150		1,791,420,000	82,871,850
	小計	1,708,548,150		1,791,420,000	82,871,850
合計		1,708,548,150		1,791,420,000	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。

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25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				
	東証株価指数先物	4,476,759,400		4,470,640,000	6,119,400
	小計	4,476,759,400		4,470,640,000	6,119,400
合計		4,476,759,400		4,470,640,000	6,119,400

(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。

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。

（自 平成24年2月21日 至 平成25年2月18日）

該当事項はありません。

（その他の注記）

（平成24年 2月20日現在）

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	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日現在の元本の内訳	
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

(平成25年 2月18日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	279,179,562,739円
同期中における追加設定元本額	19,296,799,071円
同期中における一部解約元本額	56,392,677,923円
平成25年 2月18日現在の元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	9,292,116,276円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	464,379,009円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,305,208,256円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,630,400,207円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	44,966,755円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	5,205,829円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	8,029,562円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	7,415,458円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	8,667,107円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	2,866,573円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	5,553,477円
国内株式指数ファンド(TOPIX)	871,339,575円
三井住友・DC日本株式インデックスファンドS	52,879,048円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	58,467,447,509円
バランスファンドVA(安定運用型)<適格機関投資家限定>	566,874,759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>	44,099,465,924円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	15,445,554,074円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	6,716,787,650円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	23,783,589,554円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	162,342,802円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	524,921,525円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	81,391,568円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	2,438,862,775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>	126,127,052円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	900,721,208円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,830,604,715円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	4,678,005,291円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	9,264,827,976円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,150,034,957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)	9,125,438,745円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	187,333,678円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	2,577,757,103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)	36,926,571,426円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	276,057,753円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	145,688,708円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	55,233,207円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	673,279,192円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	1,252,821,129円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	481,259,280円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	327,272,695円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	150,511,833円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	29,990,588円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	297,709,937円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	3,026,869,638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)	482,884,057円

S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T 2 < 適格機関投資家専用 >	108,563,873円
S M A M ・ F G 新興国重視型バランス20V A < 適格機関投資家限定 >	14,618,541円
S M A M ・ F G グローバルバランス25V A < 適格機関投資家限定 >	6,726,095円
S M A M ・ グローバル・マルチアセット・グロース・ファンド(安定成長型) < 適格機関投資家限定 >	509,938円
合 計	242,083,683,887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	103,000	206.00	21,218,000	
日本水産	298,800	183.00	54,680,400	
マル八二チロホールディングス	516,000	156.00	80,496,000	
サカタのタネ	38,000	1,097.00	41,686,000	
ホクト	27,600	1,711.00	47,223,600	
住石ホールディングス	115,100	87.00	10,013,700	
日鉄鉱業	64,000	462.00	29,568,000	
三井松島産業	185,000	183.00	33,855,000	
国際石油開発帝石	3,245	506,000.00	1,641,970,000	
日本海洋掘削	7,100	3,340.00	23,714,000	
関東天然瓦斯開発	23,000	497.00	11,431,000	
石油資源開発	37,400	3,595.00	134,453,000	
ショーボンドホールディングス	23,900	3,165.00	75,643,500	
ミライト・ホールディングス	74,800	866.00	64,776,800	
ダイセキ環境ソリューション	22	127,200.00	2,798,400	
間組	86,700	235.00	20,374,500	
東急建設	97,220	208.00	20,221,760	
コムシスホールディングス	129,200	1,165.00	150,518,000	
ミサワホーム	32,800	1,179.00	38,671,200	
高松コンストラクショングループ	19,700	1,353.00	26,654,100	
東建コーポレーション	10,010	4,955.00	49,599,550	
ヤマウラ	16,000	263.00	4,208,000	
大成建設	1,352,000	261.00	352,872,000	
大林組	801,000	462.00	370,062,000	
清水建設	812,000	283.00	229,796,000	
長谷工コーポレーション	1,696,000	79.00	133,984,000	
松井建設	33,000	331.00	10,923,000	
鹿島建設	1,173,000	271.00	317,883,000	
不動テトラ	191,000	172.00	32,852,000	
鉄建建設	176,000	113.00	19,888,000	
安藤建設	114,000	124.00	14,136,000	
太平工業	50,000	359.00	17,950,000	
西松建設	334,000	163.00	54,442,000	
三井住友建設	400,900	72.00	28,864,800	
大豊建設	87,000	119.00	10,353,000	
前田建設工業	168,000	344.00	57,792,000	
佐田建設	131,000	77.00	10,087,000	
ナカノフドー建設	29,000	251.00	7,279,000	
奥村組	238,000	379.00	90,202,000	
大和小田急建設	18,000	197.00	3,546,000	
東鉄工業	35,300	1,296.00	45,748,800	
イチケン	41,000	173.00	7,093,000	

戸田建設	306,000	208.00	63,648,000
熊谷組	208,000	99.00	20,592,000
青木あすなろ建設	16,500	502.00	8,283,000
北野建設	63,000	221.00	13,923,000
植木組	42,000	186.00	7,812,000
三井ホーム	32,000	488.00	15,616,000
矢作建設工業	36,500	396.00	14,454,000
ピーエス三菱	21,500	502.00	10,793,000
大東建託	101,500	8,190.00	831,285,000
新日本建設	38,700	238.00	9,210,600
NIPPO	61,000	1,227.00	74,847,000
東亜道路工業	56,000	311.00	17,416,000
前田道路	76,000	1,340.00	101,840,000
日本道路	79,000	394.00	31,126,000
東亜建設工業	238,000	132.00	31,416,000
若築建設	177,000	103.00	18,231,000
東洋建設	88,800	290.00	25,752,000
五洋建設	322,500	226.00	72,885,000
大林道路	36,000	366.00	13,176,000
福田組	46,000	367.00	16,882,000
住友林業	181,600	874.00	158,718,400
日本基礎技術	39,000	310.00	12,090,000
日成ビルド工業	96,000	180.00	17,280,000
エス・バイ・エル	138,000	154.00	21,252,000
巴コーポレーション	40,400	318.00	12,847,200
パナホーム	97,000	582.00	56,454,000
大和ハウス工業	665,000	1,665.00	1,107,225,000
ライト工業	63,400	442.00	28,022,800
積水ハウス	798,000	1,006.00	802,788,000
日特建設	22,700	366.00	8,308,200
北陸電気工事	13,000	272.00	3,536,000
ユアテック	43,000	285.00	12,255,000
西部電気工業	15,000	395.00	5,925,000
四電工	23,000	305.00	7,015,000
中電工	33,000	854.00	28,182,000
関電工	120,000	432.00	51,840,000
きんでん	175,000	604.00	105,700,000
東京エネシス	31,000	440.00	13,640,000
トーエネック	39,000	463.00	18,057,000
住友電設	19,400	1,134.00	21,999,600
日本電設工業	47,000	906.00	42,582,000
協和エクシオ	95,600	981.00	93,783,600
新日本空調	18,800	499.00	9,381,200
NDS	38,000	276.00	10,488,000
九電工	40,000	455.00	18,200,000
三機工業	57,000	480.00	27,360,000
日揮	269,000	2,273.00	611,437,000
中外炉工業	86,000	233.00	20,038,000
ヤマト	26,000	298.00	7,748,000
太平電業	37,000	514.00	19,018,000
高砂熱学工業	70,700	663.00	46,874,100
三晃金属工業	37,000	223.00	8,251,000
朝日工業社	31,000	298.00	9,238,000
大気社	38,200	1,844.00	70,440,800
ダイダン	36,000	498.00	17,928,000
日比谷総合設備	31,300	994.00	31,112,200
東芝プラントシステム	44,000	1,150.00	50,600,000
東洋エンジニアリング	145,000	410.00	59,450,000

千代田化工建設	193,000	1,071.00	206,703,000
新興プランテック	54,800	698.00	38,250,400
日本製粉	151,000	394.00	59,494,000
日清製粉グループ本社	238,000	1,101.00	262,038,000
日東富士製粉	19,000	306.00	5,814,000
昭和産業	92,000	292.00	26,864,000
鳥越製粉	22,700	619.00	14,051,300
協同飼料	126,000	102.00	12,852,000
中部飼料	24,600	534.00	13,136,400
日本配合飼料	110,000	108.00	11,880,000
東洋精糖	67,000	100.00	6,700,000
日本甜菜製糖	132,000	169.00	22,308,000
三井製糖	109,000	311.00	33,899,000
森永製菓	247,000	196.00	48,412,000
中村屋	65,000	408.00	26,520,000
江崎グリコ	95,000	892.00	84,740,000
名糖産業	14,800	966.00	14,296,800
不二家	171,000	193.00	33,003,000
山崎製パン	194,000	1,080.00	209,520,000
モロゾフ	48,000	295.00	14,160,000
亀田製菓	14,900	2,137.00	31,841,300
カルビー	24,500	7,920.00	194,040,000
森永乳業	220,000	279.00	61,380,000
ヤクルト本社	156,900	3,490.00	547,581,000
明治ホールディングス	78,700	3,850.00	302,995,000
雪印メグミルク	51,900	1,409.00	73,127,100
プリマハム	161,000	175.00	28,175,000
日本ハム	204,000	1,376.00	280,704,000
伊藤ハム	149,000	429.00	63,921,000
林兼産業	135,000	74.00	9,990,000
丸大食品	117,000	298.00	34,866,000
米久	25,200	948.00	23,889,600
S Foods	16,000	898.00	14,368,000
サッポロホールディングス	442,000	308.00	136,136,000
アサヒグループホールディングス	538,900	2,206.00	1,188,813,400
キリンホールディングス	1,145,000	1,195.00	1,368,275,000
宝ホールディングス	212,000	794.00	168,328,000
オエノンホールディングス	81,000	228.00	18,468,000
養命酒製造	22,000	783.00	17,226,000
三國コカ・コーラボトリング	20,100	959.00	19,275,900
コカ・コーラウエスト	90,100	1,522.00	137,132,200
コカ・コーラ セントラル ジャパン	33,100	1,235.00	40,878,500
ダイドードリンコ	13,400	3,865.00	51,791,000
伊藤園	72,600	1,817.00	131,914,200
キーコーヒー	20,400	1,606.00	32,762,400
日清オイリオグループ	106,000	326.00	34,556,000
不二製油	65,800	1,342.00	88,303,600
J - オイルミルズ	111,000	288.00	31,968,000
キッコーマン	220,000	1,354.00	297,880,000
味の素	706,000	1,185.00	836,610,000
キューピー	135,300	1,218.00	164,795,400
ハウス食品	90,300	1,423.00	128,496,900
カゴメ	96,100	1,709.00	164,234,900
焼津水産化学工業	12,000	802.00	9,624,000
アリアケジャパン	25,000	1,713.00	42,825,000
ニチレイ	301,000	480.00	144,480,000
東洋水産	124,000	2,658.00	329,592,000
日清食品ホールディングス	103,500	3,545.00	366,907,500

永谷園	23,000	857.00	19,711,000
フジッコ	24,000	1,048.00	25,152,000
ロック・フィールド	12,300	1,533.00	18,855,900
日本たばこ産業	1,185,400	2,952.00	3,499,300,800
ケンコーマヨネーズ	10,200	865.00	8,823,000
わらべや日洋	17,200	1,439.00	24,750,800
なとり	10,900	909.00	9,908,100
ミヨシ油脂	98,000	165.00	16,170,000
片倉工業	30,100	858.00	25,825,800
グンゼ	173,000	236.00	40,828,000
東洋紡	1,068,000	162.00	173,016,000
ユニチカ	685,000	50.00	34,250,000
富士紡ホールディングス	115,000	273.00	31,395,000
日清紡ホールディングス	160,000	679.00	108,640,000
倉敷紡績	241,000	154.00	37,114,000
シキボウ	172,000	106.00	18,232,000
日本毛織	75,000	604.00	45,300,000
トーア紡コーポレーション	145,000	66.00	9,570,000
ダイドーリミテッド	31,900	641.00	20,447,900
帝国繊維	27,000	709.00	19,143,000
帝人	956,000	214.00	204,584,000
東レ	1,932,000	556.00	1,074,192,000
サカイオーベックス	80,000	130.00	10,400,000
住江織物	72,000	203.00	14,616,000
日本フェルト	10,600	421.00	4,462,600
イチカワ	23,000	159.00	3,657,000
日本バイリーン	36,000	409.00	14,724,000
日東製網	32,000	132.00	4,224,000
芦森工業	80,000	126.00	10,080,000
アツギ	206,000	107.00	22,042,000
ダイニック	58,000	172.00	9,976,000
セーレン	65,500	563.00	36,876,500
小松精練	42,000	385.00	16,170,000
ワコールホールディングス	145,000	953.00	138,185,000
ホギメディカル	15,900	4,615.00	73,378,500
レナウン	72,600	137.00	9,946,200
クラウディア	2,300	1,140.00	2,622,000
T S Iホールディングス	130,900	481.00	62,962,900
三陽商会	126,000	251.00	31,626,000
オンワードホールディングス	167,000	729.00	121,743,000
ルック	47,000	343.00	16,121,000
ゴールドウイン	56,000	552.00	30,912,000
デサント	61,000	558.00	34,038,000
ヤマトインターナショナル	13,200	400.00	5,280,000
特種東海製紙	146,000	214.00	31,244,000
王子ホールディングス	1,094,000	313.00	342,422,000
三菱製紙	361,000	90.00	32,490,000
北越紀州製紙	156,000	452.00	70,512,000
中越パルプ工業	100,000	145.00	14,500,000
巴川製紙所	48,000	156.00	7,488,000
大王製紙	106,000	631.00	66,886,000
日本製紙グループ本社	121,000	1,350.00	163,350,000
レンゴー	204,000	457.00	93,228,000
トーモク	72,000	258.00	18,576,000
ザ・バック	16,600	1,525.00	25,315,000
クラレ	424,100	1,187.00	503,406,700
旭化成	1,550,000	557.00	863,350,000
共和レザー	15,500	289.00	4,479,500

コープケミカル	58,000	105.00	6,090,000
昭和電工	1,563,000	130.00	203,190,000
住友化学	1,719,000	275.00	472,725,000
日本化成	67,000	133.00	8,911,000
住友精化	50,000	318.00	15,900,000
日産化学工業	178,700	1,151.00	205,683,700
クレハ	178,000	348.00	61,944,000
テイカ	47,000	257.00	12,079,000
石原産業	478,000	82.00	39,196,000
片倉チッカリン	19,000	215.00	4,085,000
日本曹達	149,000	414.00	61,686,000
東ソー	673,000	238.00	160,174,000
トクヤマ	373,000	212.00	79,076,000
セントラル硝子	224,000	278.00	62,272,000
東亜合成	291,000	376.00	109,416,000
ダイソー	100,000	255.00	25,500,000
関東電化工業	69,000	174.00	12,006,000
電気化学工業	496,000	336.00	166,656,000
信越化学工業	447,400	5,640.00	2,523,336,000
日本カーバイド工業	79,000	392.00	30,968,000
堺化学工業	88,000	254.00	22,352,000
エア・ウォーター	204,000	1,212.00	247,248,000
大陽日酸	331,000	641.00	212,171,000
日本化学工業	106,000	114.00	12,084,000
日本パーカライジング	60,000	1,524.00	91,440,000
高圧ガス工業	39,000	498.00	19,422,000
チタン工業	40,000	226.00	9,040,000
四国化成工業	36,000	634.00	22,824,000
戸田工業	45,000	320.00	14,400,000
ステラ ケミファ	12,500	1,730.00	21,625,000
保土谷化学工業	67,000	168.00	11,256,000
日本触媒	183,000	878.00	160,674,000
大日精化工業	87,000	415.00	36,105,000
カネカ	308,000	495.00	152,460,000
三菱瓦斯化学	396,000	637.00	252,252,000
三井化学	1,065,000	204.00	217,260,000
J S R	246,900	1,860.00	459,234,000
東京応化工業	48,600	1,933.00	93,943,800
三菱ケミカルホールディングス	1,558,000	410.00	638,780,000
日本合成化学工業	53,000	691.00	36,623,000
ダイセル	297,000	675.00	200,475,000
住友ベークライト	199,000	382.00	76,018,000
積水化学工業	512,000	871.00	445,952,000
日本ゼオン	217,000	850.00	184,450,000
アイカ工業	69,400	1,550.00	107,570,000
宇部興産	1,203,000	191.00	229,773,000
積水樹脂	34,000	1,120.00	38,080,000
タキロン	57,000	319.00	18,183,000
旭有機材工業	87,000	208.00	18,096,000
日立化成	107,700	1,304.00	140,440,800
ニチバン	13,000	302.00	3,926,000
リケンテクノス	37,000	258.00	9,546,000
大倉工業	66,000	358.00	23,628,000
積水化成成品工業	69,000	217.00	14,973,000
群栄化学工業	68,000	213.00	14,484,000
タイガースポリマー	17,300	324.00	5,605,200
日本カーリット	17,500	454.00	7,945,000
日本化薬	174,000	1,062.00	184,788,000

日本精化	19,600	580.00	11,368,000
A D E K A	106,700	853.00	91,015,100
日油	189,000	414.00	78,246,000
ハリマ化成グループ	24,200	463.00	11,204,600
花王	662,100	2,910.00	1,926,711,000
第一工業製薬	48,000	232.00	11,136,000
三洋化成工業	76,000	490.00	37,240,000
大日本塗料	154,000	160.00	24,640,000
日本ペイント	217,000	849.00	184,233,000
関西ペイント	283,000	984.00	278,472,000
中国塗料	80,000	477.00	38,160,000
日本特殊塗料	22,900	378.00	8,656,200
藤倉化成	31,700	373.00	11,824,100
太陽ホールディングス	20,500	2,677.00	54,878,500
D I C	894,000	184.00	164,496,000
サカタインクス	48,000	493.00	23,664,000
東洋インキS Cホールディングス	222,000	406.00	90,132,000
富士フイルムホールディングス	531,900	1,790.00	952,101,000
資生堂	446,300	1,217.00	543,147,100
ライオン	280,000	469.00	131,320,000
高砂香料工業	83,000	489.00	40,587,000
マンダム	26,900	2,796.00	75,212,400
ミルボン	11,700	2,948.00	34,491,600
ファンケル	59,800	1,022.00	61,115,600
コーセー	44,300	1,993.00	88,289,900
ドクターシーラボ	182	261,500.00	47,593,000
ポーラ・オルビスホールディングス	29,500	2,741.00	80,859,500
ノエビアホールディングス	15,000	1,382.00	20,730,000
エステー	15,700	984.00	15,448,800
コニシ	18,100	1,694.00	30,661,400
長谷川香料	30,600	1,199.00	36,689,400
小林製薬	37,600	4,430.00	166,568,000
荒川化学工業	20,100	724.00	14,552,400
メック	23,200	477.00	11,066,400
日本高純度化学	67	227,100.00	15,215,700
J C U	4,100	3,610.00	14,801,000
アース製薬	15,800	2,978.00	47,052,400
イハラケミカル工業	42,000	458.00	19,236,000
北興化学工業	28,000	253.00	7,084,000
大成ラミック	5,400	2,445.00	13,203,000
クミアイ化学工業	54,000	490.00	26,460,000
日本農薬	60,000	583.00	34,980,000
アキレス	197,000	130.00	25,610,000
有沢製作所	46,600	326.00	15,191,600
日東電工	206,000	5,370.00	1,106,220,000
レック	9,100	1,218.00	11,083,800
きもと	25,400	845.00	21,463,000
藤森工業	20,000	2,095.00	41,900,000
前澤化成工業	17,600	894.00	15,734,400
J S P	15,400	1,341.00	20,651,400
エフピコ	12,200	5,740.00	70,028,000
天馬	21,400	954.00	20,415,600
信越ポリマー	53,400	365.00	19,491,000
東リ	76,000	209.00	15,884,000
ニフコ	56,300	1,972.00	111,023,600
日本バルカー工業	104,000	227.00	23,608,000
ユニ・チャーム	138,000	5,400.00	745,200,000
協和発酵キリン	297,000	895.00	265,815,000

武田薬品工業	934,000	4,705.00	4,394,470,000
アステラス製薬	554,200	5,010.00	2,776,542,000
大日本住友製薬	177,600	1,251.00	222,177,600
塩野義製薬	365,000	1,773.00	647,145,000
田辺三菱製薬	206,900	1,285.00	265,866,500
わかもと製薬	39,000	232.00	9,048,000
あすか製薬	32,000	578.00	18,496,000
日本新薬	52,000	1,186.00	61,672,000
中外製薬	289,300	1,984.00	573,971,200
科研製薬	98,000	1,494.00	146,412,000
エーザイ	307,400	3,895.00	1,197,323,000
ロート製薬	106,000	1,178.00	124,868,000
小野薬品工業	121,900	4,850.00	591,215,000
久光製薬	77,200	5,160.00	398,352,000
有機合成薬品工業	28,000	242.00	6,776,000
持田製薬	93,000	1,119.00	104,067,000
参天製薬	85,400	3,980.00	339,892,000
扶桑薬品工業	90,000	363.00	32,670,000
日本ケミファ	41,000	577.00	23,657,000
ツムラ	68,700	3,190.00	219,153,000
日医工	37,800	1,841.00	69,589,800
キッセイ薬品工業	46,100	1,777.00	81,919,700
生化学工業	45,300	965.00	43,714,500
栄研化学	19,100	1,235.00	23,588,500
日水製薬	7,200	954.00	6,868,800
鳥居薬品	14,200	2,106.00	29,905,200
東和薬品	13,100	4,955.00	64,910,500
沢井製薬	16,600	9,880.00	164,008,000
ゼリア新薬工業	36,000	1,378.00	49,608,000
第一三共	786,500	1,616.00	1,270,984,000
キョーリン製薬ホールディングス	66,800	1,957.00	130,727,600
大幸薬品	14,900	851.00	12,679,900
ダイト	9,300	1,379.00	12,824,700
大塚ホールディングス	494,300	2,929.00	1,447,804,700
大正製薬ホールディングス	59,700	6,340.00	378,498,000
日本コークス工業	220,500	121.00	26,680,500
昭和シェル石油	221,200	593.00	131,171,600
コスモ石油	691,000	199.00	137,509,000
ニチレキ	33,000	578.00	19,074,000
東燃ゼネラル石油	375,000	832.00	312,000,000
ユシロ化学工業	16,200	851.00	13,786,200
AOCホールディングス	60,900	353.00	21,497,700
MORESCO	5,700	819.00	4,668,300
出光興産	29,500	7,790.00	229,805,000
JXホールディングス	2,768,400	528.00	1,461,715,200
横浜ゴム	279,000	836.00	233,244,000
東洋ゴム工業	209,000	371.00	77,539,000
ブリヂストン	781,100	2,555.00	1,995,710,500
住友ゴム工業	194,900	1,364.00	265,843,600
藤倉ゴム工業	17,900	260.00	4,654,000
オカモト	86,000	306.00	26,316,000
フコク	10,100	773.00	7,807,300
ニッタ	25,200	1,642.00	41,378,400
東海ゴム工業	46,700	1,026.00	47,914,200
三ツ星ベルト	64,000	487.00	31,168,000
バンドー化学	86,000	293.00	25,198,000
日東紡績	186,000	357.00	66,402,000
旭硝子	1,229,000	645.00	792,705,000

日本板硝子	1,158,000	117.00	135,486,000
石塚硝子	30,000	146.00	4,380,000
日本山村硝子	101,000	175.00	17,675,000
日本電気硝子	446,000	462.00	206,052,000
オハラ	11,500	667.00	7,670,500
住友大阪セメント	448,000	275.00	123,200,000
太平洋セメント	1,382,000	227.00	313,714,000
デイ・シイ	30,400	293.00	8,907,200
日本ヒューム	23,000	522.00	12,006,000
日本コンクリート工業	48,000	294.00	14,112,000
東海カーボン	220,000	350.00	77,000,000
日本カーボン	138,000	191.00	26,358,000
東洋炭素	12,300	2,205.00	27,121,500
ノリタケカンパニーリミテド	115,000	225.00	25,875,000
TOTO	383,000	815.00	312,145,000
日本碍子	327,000	973.00	318,171,000
日本特殊陶業	215,000	1,233.00	265,095,000
MARUWA	5,800	2,296.00	13,316,800
品川リフラクトリーズ	58,000	206.00	11,948,000
黒崎播磨	61,000	224.00	13,664,000
東京窯業	31,000	167.00	5,177,000
ニッカトー	10,200	401.00	4,090,200
フジインコーポレーテッド	23,500	1,393.00	32,735,500
エーアンドエーマテリアル	65,000	81.00	5,265,000
ニチアス	111,000	509.00	56,499,000
ニチハ	28,200	1,226.00	34,573,200
新日鐵住金	10,550,000	260.00	2,743,000,000
神戸製鋼所	3,459,000	129.00	446,211,000
合同製鐵	142,000	180.00	25,560,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	636,100	2,054.00	1,306,549,400
日新製鋼ホールディングス	105,500	782.00	82,501,000
東京製鐵	140,100	497.00	69,629,700
共英製鋼	23,600	1,637.00	38,633,200
大和工業	51,800	2,682.00	138,927,600
東京鐵鋼	52,000	386.00	20,072,000
大阪製鐵	12,500	1,560.00	19,500,000
淀川製鋼所	165,000	355.00	58,575,000
東洋鋼鈑	52,000	305.00	15,860,000
住友鋼管	17,800	739.00	13,154,200
丸一鋼管	82,200	2,226.00	182,977,200
モリ工業	39,000	274.00	10,686,000
大同特殊鋼	385,000	468.00	180,180,000
日本高周波鋼業	118,000	92.00	10,856,000
日本冶金工業	185,000	123.00	22,755,000
山陽特殊製鋼	125,000	347.00	43,375,000
愛知製鋼	127,000	392.00	49,784,000
日立金属	178,000	885.00	157,530,000
日本金属	82,000	122.00	10,004,000
大平洋金属	163,000	508.00	82,804,000
日本電工	99,000	307.00	30,393,000
栗本鐵工所	115,000	319.00	36,685,000
日本鑄鉄管	36,000	242.00	8,712,000
三菱製鋼	151,000	184.00	27,784,000
日亜鋼業	34,000	241.00	8,194,000
日本精線	16,000	328.00	5,248,000
シンニッタン	22,400	384.00	8,601,600
新家工業	59,000	121.00	7,139,000
大紀アルミニウム工業所	48,000	209.00	10,032,000

日本軽金属ホールディングス	518,800	108.00	56,030,400
三井金属鉱業	635,000	232.00	147,320,000
東邦亜鉛	139,000	385.00	53,515,000
三菱マテリアル	1,457,000	281.00	409,417,000
住友金属鉱山	645,000	1,548.00	998,460,000
DOWAホールディングス	276,000	656.00	181,056,000
古河機械金属	421,000	101.00	42,521,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	25,900	1,844.00	47,759,600
東邦チタニウム	45,500	806.00	36,673,000
住友軽金属工業	624,000	85.00	53,040,000
古河スカイ	80,000	249.00	19,920,000
古河電気工業	787,000	198.00	155,826,000
住友電気工業	878,900	1,048.00	921,087,200
フジクラ	397,000	267.00	105,999,000
昭和電線ホールディングス	323,000	77.00	24,871,000
タツタ電線	48,000	625.00	30,000,000
日立電線	206,000	147.00	30,282,000
沖電線	46,000	132.00	6,072,000
平河ヒューテック	4,700	814.00	3,825,800
リョービ	141,000	236.00	33,276,000
アサヒホールディングス	38,000	1,704.00	64,752,000
稲葉製作所	9,900	1,074.00	10,632,600
宮地エンジニアリンググループ	102,000	151.00	15,402,000
トーカロ	15,800	1,332.00	21,045,600
アルファC o	7,800	1,073.00	8,369,400
SUMCO	135,300	932.00	126,099,600
川田テクノロジーズ	6,800	1,788.00	12,158,400
東洋製罐	175,900	1,325.00	233,067,500
ホッカンホールディングス	54,000	279.00	15,066,000
コロナ	11,600	1,111.00	12,887,600
横河ブリッジホールディングス	48,000	793.00	38,064,000
日本橋梁	25,850	344.00	8,892,400
駒井ハルテック	62,000	234.00	14,508,000
高田機工	32,000	195.00	6,240,000
三和ホールディングス	233,000	434.00	101,122,000
文化シャッター	65,000	433.00	28,145,000
三協立山	33,400	1,732.00	57,848,800
L I X I Lグループ	347,900	2,020.00	702,758,000
日本ファイルコン	25,000	366.00	9,150,000
ノーリツ	48,400	1,690.00	81,796,000
長府製作所	21,100	1,888.00	39,836,800
リンナイ	40,100	6,600.00	264,660,000
ダイニチ工業	14,700	810.00	11,907,000
日東精工	40,000	278.00	11,120,000
三洋工業	46,000	180.00	8,280,000
岡部	49,800	664.00	33,067,200
東プレ	48,500	879.00	42,631,500
高周波熱錬	35,000	701.00	24,535,000
東京製綱	184,000	112.00	20,608,000
パイオラックス	10,500	2,382.00	25,011,000
日本発條	182,300	795.00	144,928,500
中央発條	34,000	305.00	10,370,000
三益半導体工業	23,300	720.00	16,776,000
アタカ大機	18,000	320.00	5,760,000
日本製鋼所	388,000	495.00	192,060,000
三浦工業	36,200	2,270.00	82,174,000
タクマ	87,000	586.00	50,982,000
ツガミ	71,000	531.00	37,701,000

オークマ	163,000	702.00	114,426,000
東芝機械	125,000	466.00	58,250,000
アマダ	380,000	571.00	216,980,000
アイダエンジニアリング	60,500	709.00	42,894,500
牧野フライス製作所	117,000	623.00	72,891,000
オーエスジー	103,600	1,257.00	130,225,200
ダイジェット工業	41,000	152.00	6,232,000
旭ダイヤモンド工業	63,000	853.00	53,739,000
森精機製作所	133,000	971.00	129,143,000
ディスコ	28,000	5,350.00	149,800,000
日東工器	12,500	1,821.00	22,762,500
豊和工業	159,000	101.00	16,059,000
大阪機工	115,000	132.00	15,180,000
島精機製作所	33,000	1,808.00	59,664,000
日阪製作所	32,000	840.00	26,880,000
やまびこ	10,500	1,648.00	17,304,000
ペガサスミシン製造	34,200	193.00	6,600,600
ナプテスコ	124,500	1,808.00	225,096,000
三井海洋開発	21,100	1,969.00	41,545,900
レオン自動機	26,000	195.00	5,070,000
S M C	74,400	15,670.00	1,165,848,000
新川	23,200	453.00	10,509,600
ホソカワミクロン	44,000	724.00	31,856,000
ユニオンツール	12,500	1,772.00	22,150,000
オイレス工業	25,800	1,787.00	46,104,600
サトーホールディングス	26,700	1,474.00	39,355,800
日本エアーテック	9,500	433.00	4,113,500
日精樹脂工業	20,600	515.00	10,609,000
ワイエイシー	13,300	484.00	6,437,200
小松製作所	1,164,000	2,416.00	2,812,224,000
住友重機械工業	685,000	393.00	269,205,000
日立建機	127,100	2,166.00	275,298,600
日工	37,000	352.00	13,024,000
巴工業	9,700	1,808.00	17,537,600
井関農機	235,000	253.00	59,455,000
T O W A	26,700	515.00	13,750,500
丸山製作所	66,000	172.00	11,352,000
北川鉄工所	124,000	148.00	18,352,000
クボタ	1,331,000	1,065.00	1,417,515,000
荏原実業	4,300	1,286.00	5,529,800
三菱化工機	85,000	148.00	12,580,000
月島機械	39,000	797.00	31,083,000
帝国電機製作所	8,900	1,675.00	14,907,500
新東工業	50,900	818.00	41,636,200
澁谷工業	17,100	863.00	14,757,300
アイチ コーポレーション	45,300	459.00	20,792,700
小森コーポレーション	62,400	909.00	56,721,600
鶴見製作所	19,000	791.00	15,029,000
住友精密工業	44,000	402.00	17,688,000
酒井重工業	57,000	272.00	15,504,000
荏原製作所	473,000	412.00	194,876,000
石井鐵工所	45,000	193.00	8,685,000
西島製作所	30,800	740.00	22,792,000
ダイキン工業	325,700	3,490.00	1,136,693,000
オルガノ	39,000	498.00	19,422,000
トーヨーカネツ	141,000	234.00	32,994,000
栗田工業	137,100	1,823.00	249,933,300
椿本チエイン	125,000	500.00	62,500,000

大同工業	55,000	142.00	7,810,000
日本コンベヤ	106,000	86.00	9,116,000
木村化工機	29,700	348.00	10,335,600
アネスト岩田	40,000	370.00	14,800,000
ダイフク	110,000	630.00	69,300,000
加藤製作所	65,000	288.00	18,720,000
油研工業	56,000	156.00	8,736,000
タダノ	117,000	901.00	105,417,000
フジテック	70,000	685.00	47,950,000
C K D	67,400	632.00	42,596,800
キトー	151	79,600.00	12,019,600
平和	50,400	1,701.00	85,730,400
理想科学工業	17,400	1,919.00	33,390,600
S A N K Y O	71,800	3,930.00	282,174,000
日本金銭機械	23,900	777.00	18,570,300
マースエンジニアリング	14,000	1,881.00	26,334,000
福島工業	7,100	2,082.00	14,782,200
ダイコク電機	10,500	2,346.00	24,633,000
アマノ	69,900	866.00	60,533,400
サンデン	139,000	398.00	55,322,000
蛇の目ミシン工業	254,000	78.00	19,812,000
マックス	35,000	1,125.00	39,375,000
グローリー	70,300	2,018.00	141,865,400
大和冷機工業	37,000	529.00	19,573,000
セガサミーホールディングス	256,600	1,544.00	396,190,400
日本ピストンリング	96,000	184.00	17,664,000
リケン	85,000	357.00	30,345,000
T P R	27,500	1,243.00	34,182,500
ホシザキ電機	50,300	2,739.00	137,771,700
大豊工業	18,000	1,164.00	20,952,000
日本精工	528,000	690.00	364,320,000
N T N	519,000	264.00	137,016,000
ジェイテクト	252,200	933.00	235,302,600
不二越	227,000	382.00	86,714,000
日本トムソン	84,000	386.00	32,424,000
T H K	159,600	1,680.00	268,128,000
ユースン精機	12,300	1,598.00	19,655,400
前澤給装工業	8,200	1,256.00	10,299,200
イーグル工業	31,000	807.00	25,017,000
日本ビラー工業	27,000	700.00	18,900,000
キッツ	98,700	442.00	43,625,400
日立工機	60,800	777.00	47,241,600
マキタ	145,200	4,140.00	601,128,000
日立造船	946,000	134.00	126,764,000
三菱重工業	3,994,000	509.00	2,032,946,000
I H I	1,627,000	246.00	400,242,000
イビデン	146,500	1,404.00	205,686,000
コニカミノルタホールディングス	630,500	669.00	421,804,500
ブラザー工業	308,300	943.00	290,726,900
ミネベア	331,000	300.00	99,300,000
日立製作所	5,616,000	519.00	2,914,704,000
東芝	4,704,000	411.00	1,933,344,000
三菱電機	2,382,000	780.00	1,857,960,000
富士電機	721,000	250.00	180,250,000
東洋電機製造	55,000	240.00	13,200,000
安川電機	263,000	855.00	224,865,000
シンフォニアテクノロジー	152,000	158.00	24,016,000
明電舎	235,000	282.00	66,270,000

オリジン電気	41,000	389.00	15,949,000
デンヨー	22,400	1,103.00	24,707,200
東芝テック	150,000	502.00	75,300,000
芝浦メカトロニクス	53,000	205.00	10,865,000
マブチモーター	34,800	4,585.00	159,558,000
日本電産	129,100	5,350.00	690,685,000
東光高岳ホールディングス	10,800	1,492.00	16,113,600
ダイヘン	135,000	276.00	37,260,000
ヤーマン	3,500	1,223.00	4,280,500
JVCケンウッド	148,700	257.00	38,215,900
第一精工	9,300	1,423.00	13,233,900
日新電機	51,000	462.00	23,562,000
大崎電気工業	37,000	426.00	15,762,000
オムロン	265,600	2,127.00	564,931,200
日東工業	36,100	1,415.00	51,081,500
I D E C	30,700	800.00	24,560,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	464,000	327.00	151,728,000
サクサホールディングス	70,000	173.00	12,110,000
メルコホールディングス	15,400	1,638.00	25,225,200
日本電気	3,091,000	231.00	714,021,000
富士通	2,298,000	405.00	930,690,000
沖電気工業	894,000	101.00	90,294,000
岩崎通信機	132,000	73.00	9,636,000
電気興業	62,000	371.00	23,002,000
サンケン電気	121,000	345.00	41,745,000
ナカヨ通信機	27,000	261.00	7,047,000
アイホン	13,800	1,500.00	20,700,000
ルネサスエレクトロニクス	68,000	255.00	17,340,000
セイコーエプソン	164,700	891.00	146,747,700
ワコム	446	301,500.00	134,469,000
アルバック	38,400	938.00	36,019,200
アクセル	12,700	2,039.00	25,895,300
ナナオ	20,200	1,517.00	30,643,400
日本信号	61,100	681.00	41,609,100
京三製作所	53,000	291.00	15,423,000
能美防災	29,000	651.00	18,879,000
ホーチキ	22,000	428.00	9,416,000
日本無線	51,000	282.00	14,382,000
パナソニック	2,725,200	667.00	1,817,708,400
シャープ	1,043,000	324.00	337,932,000
アンリツ	129,000	1,294.00	166,926,000
富士通ゼネラル	59,000	769.00	45,371,000
日立国際電気	56,000	789.00	44,184,000
ソニー	1,498,300	1,329.00	1,991,240,700
T D K	134,900	3,340.00	450,566,000
帝国通信工業	65,000	165.00	10,725,000
ミツミ電機	94,200	557.00	52,469,400
タムラ製作所	91,000	188.00	17,108,000
アルプス電気	178,100	647.00	115,230,700
パイオニア	299,300	200.00	59,860,000
日本電波工業	21,600	989.00	21,362,400
日本トリム	2,950	2,707.00	7,985,650
ローランド ディー . ジー .	11,300	1,141.00	12,893,300
フォスター電機	26,000	1,355.00	35,230,000
クラリオン	23,000	126.00	2,898,000
S M K	78,000	271.00	21,138,000
ヨコオ	22,300	450.00	10,035,000
東光	123,000	266.00	32,718,000

ホシデン	65,600	560.00	36,736,000
ヒロセ電機	41,300	10,880.00	449,344,000
日本航空電子工業	57,000	738.00	42,066,000
TOA	28,000	642.00	17,976,000
ユニデン	81,000	218.00	17,658,000
アルパイン	47,200	827.00	39,034,400
スミダコーポレーション	19,600	522.00	10,231,200
アイコム	11,600	1,964.00	22,782,400
船井電機	25,000	1,225.00	30,625,000
横河電機	240,200	939.00	225,547,800
新電元工業	83,000	339.00	28,137,000
アズビル	66,000	1,911.00	126,126,000
日本光電工業	47,900	3,195.00	153,040,500
チノー	49,000	207.00	10,143,000
共和電業	29,000	272.00	7,888,000
日本電子材料	8,800	381.00	3,352,800
堀場製作所	47,600	2,899.00	137,992,400
アドバンテスト	165,300	1,279.00	211,418,700
小野測器	34,000	414.00	14,076,000
エスベック	26,400	690.00	18,216,000
パナソニック デバイス S U N X	23,100	382.00	8,824,200
キーエンス	58,400	26,250.00	1,533,000,000
日置電機	12,100	1,388.00	16,794,800
シスメックス	84,300	4,715.00	397,474,500
メガチップス	19,900	1,363.00	27,123,700
O B A R A G R O U P	18,100	1,278.00	23,131,800
日本電産コパル電子	25,500	423.00	10,786,500
ミヤチテクノス	13,500	865.00	11,677,500
コーセル	34,300	1,039.00	35,637,700
日立メディコ	18,000	1,266.00	22,788,000
オプテックス	16,500	1,148.00	18,942,000
千代田インテグレ	11,700	1,023.00	11,969,100
スタンレー電気	185,200	1,518.00	281,133,600
岩崎電気	100,000	183.00	18,300,000
ウシオ電機	144,300	1,015.00	146,464,500
岡谷電機産業	7,000	339.00	2,373,000
ヘリオス テクノ ホールディング	30,200	196.00	5,919,200
日本セラミック	16,800	1,482.00	24,897,600
日本デジタル研究所	19,600	1,037.00	20,325,200
古河電池	20,000	527.00	10,540,000
双信電機	15,600	323.00	5,038,800
山一電機	32,800	146.00	4,788,800
図研	14,700	571.00	8,393,700
日本電子	93,000	310.00	28,830,000
カシオ計算機	229,600	727.00	166,919,200
ファナック	248,200	15,150.00	3,760,230,000
日本シイエムケイ	57,600	341.00	19,641,600
エンブラス	11,000	3,650.00	40,150,000
ローム	126,000	3,325.00	418,950,000
浜松ホトニクス	92,700	3,590.00	332,793,000
三井ハイテック	37,500	624.00	23,400,000
新光電気工業	81,000	750.00	60,750,000
京セラ	198,000	8,390.00	1,661,220,000
太陽誘電	118,400	1,048.00	124,083,200
村田製作所	250,100	6,010.00	1,503,101,000
ユーシン	35,000	694.00	24,290,000
双葉電子工業	44,100	969.00	42,732,900
北陸電気工業	118,000	111.00	13,098,000

ニチコン	76,300	879.00	67,067,700	
日本ケミコン	145,000	252.00	36,540,000	
K O A	28,200	876.00	24,703,200	
市光工業	66,000	140.00	9,240,000	
小糸製作所	119,000	1,488.00	177,072,000	
ミツバ	45,000	764.00	34,380,000	
スター精密	42,100	961.00	40,458,100	
大日本スクリーン製造	251,000	483.00	121,233,000	
キヤノン電子	20,000	1,814.00	36,280,000	
キヤノン	1,480,000	3,310.00	4,898,800,000	
リコー	718,000	985.00	707,230,000	
M U T O Hホールディングス	42,000	215.00	9,030,000	
東京エレクトロン	200,700	4,245.00	851,971,500	
トヨタ紡織	83,400	1,284.00	107,085,600	
鬼怒川ゴム工業	45,000	458.00	20,610,000	
ユニプレス	42,100	1,828.00	76,958,800	
豊田自動織機	216,400	3,210.00	694,644,000	
モリタホールディングス	42,000	788.00	33,096,000	
三櫻工業	31,800	637.00	20,256,600	
デンソー	589,000	3,635.00	2,141,015,000	
東海理化電機製作所	54,500	1,558.00	84,911,000	
三井造船	910,000	167.00	151,970,000	
佐世保重工業	182,000	108.00	19,656,000	
川崎重工業	1,857,000	280.00	519,960,000	
日本車輛製造	83,000	338.00	28,054,000	
日本輸送機	37,000	385.00	14,245,000	
近畿車輛	47,000	283.00	13,301,000	
日産自動車	3,009,700	950.00	2,859,215,000	
いすゞ自動車	1,382,000	580.00	801,560,000	
トヨタ自動車	3,062,000	4,785.00	14,651,670,000	代用有価証券 で1,800,000株 担保差入
日野自動車	298,000	938.00	279,524,000	
三菱自動車工業	5,780,000	103.00	595,340,000	
エフテック	10,000	1,188.00	11,880,000	
武蔵精密工業	25,600	1,956.00	50,073,600	
日産車体	77,000	1,153.00	88,781,000	
新明和工業	93,000	605.00	56,265,000	
極東開発工業	43,100	940.00	40,514,000	
日信工業	47,800	1,468.00	70,170,400	
トピー工業	181,000	221.00	40,001,000	
ティラド	89,000	236.00	21,004,000	
曙ブレーキ工業	110,500	412.00	45,526,000	
タチエス	32,100	1,528.00	49,048,800	
N O K	113,100	1,287.00	145,559,700	
フタバ産業	71,900	366.00	26,315,400	
カヤバ工業	183,000	380.00	69,540,000	
シロキ工業	57,000	223.00	12,711,000	
大同メタル工業	34,000	771.00	26,214,000	
プレス工業	104,000	464.00	48,256,000	
カルソニックカンセイ	165,000	392.00	64,680,000	
太平洋工業	49,200	521.00	25,633,200	
ケーヒン	49,800	1,390.00	69,222,000	
河西工業	33,000	431.00	14,223,000	
アイシン精機	217,100	3,295.00	715,344,500	
富士機工	33,000	315.00	10,395,000	
マツダ	3,777,000	275.00	1,038,675,000	
ダイハツ工業	253,000	1,857.00	469,821,000	

今仙電機製作所	18,100	1,123.00	20,326,300
本田技研工業	2,010,800	3,505.00	7,047,854,000
スズキ	498,200	2,308.00	1,149,845,600
富士重工業	753,000	1,285.00	967,605,000
ヤマハ発動機	362,200	1,062.00	384,656,400
ショーワ	54,500	1,004.00	54,718,000
T B K	26,000	505.00	13,130,000
エクセディ	32,500	1,961.00	63,732,500
豊田合成	67,300	2,209.00	148,665,700
愛三工業	25,200	832.00	20,966,400
ヨロズ	16,100	1,452.00	23,377,200
エフ・シー・シー	38,200	2,059.00	78,653,800
シマノ	96,100	6,280.00	603,508,000
タカタ	42,500	1,661.00	70,592,500
テイ・エス テック	50,600	2,137.00	108,132,200
日本電産トーソク	13,100	620.00	8,122,000
テルモ	182,700	4,120.00	752,724,000
日機装	83,000	1,022.00	84,826,000
島津製作所	286,000	587.00	167,882,000
J M S	32,000	353.00	11,296,000
長野計器	17,900	619.00	11,080,100
ブイ・テクノロジー	57	237,500.00	13,537,500
東京計器	85,000	177.00	15,045,000
愛知時計電機	26,000	280.00	7,280,000
東京精密	43,400	1,739.00	75,472,600
マニー	7,200	3,125.00	22,500,000
ニコン	444,800	2,141.00	952,316,800
トプコン	48,000	949.00	45,552,000
オリンパス	282,400	2,017.00	569,600,800
理研計器	17,200	550.00	9,460,000
タムロン	18,100	2,090.00	37,829,000
HOYA	577,800	1,786.00	1,031,950,800
ノーリツ鋼機	22,000	471.00	10,362,000
エー・アンド・デイ	25,600	368.00	9,420,800
日本電産コパル	17,800	631.00	11,231,800
シチズンホールディングス	271,000	477.00	129,267,000
リズム時計工業	118,000	166.00	19,588,000
大研医器	3,300	2,020.00	6,666,000
松風	13,500	829.00	11,191,500
セイコーホールディングス	150,000	269.00	40,350,000
ニプロ	126,900	679.00	86,165,100
パラマウントベッドホールディングス	20,700	2,825.00	58,477,500
永大産業	32,000	370.00	11,840,000
ダンロップスポーツ	12,700	1,009.00	12,814,300
バンダイナムコホールディングス	245,900	1,434.00	352,620,600
共立印刷	41,300	234.00	9,664,200
フランスベッドホールディングス	152,000	196.00	29,792,000
パイロットコーポレーション	205	259,500.00	53,197,500
トッパン・フォームズ	43,000	820.00	35,260,000
フジシールインターナショナル	29,100	2,195.00	63,874,500
タカラトミー	80,200	518.00	41,543,600
廣済堂	27,100	312.00	8,455,200
アーク	94,400	161.00	15,198,400
タカノ	6,300	429.00	2,702,700
プロネクサス	29,600	518.00	15,332,800
ホクシン	28,900	176.00	5,086,400
ウッドワン	48,000	277.00	13,296,000
大建工業	96,000	246.00	23,616,000

凸版印刷	668,000	599.00	400,132,000
大日本印刷	723,000	791.00	571,893,000
図書印刷	53,000	133.00	7,049,000
共同印刷	79,000	238.00	18,802,000
日本写真印刷	35,300	1,772.00	62,551,600
光村印刷	23,000	260.00	5,980,000
宝印刷	10,400	631.00	6,562,400
アシックス	222,100	1,343.00	298,280,300
ツツミ	11,900	2,350.00	27,965,000
ローランド	24,200	794.00	19,214,800
小松ウオール工業	10,300	1,625.00	16,737,500
ヤマハ	174,200	897.00	156,257,400
河合楽器製作所	96,000	167.00	16,032,000
クリナップ	27,700	603.00	16,703,100
ビジョン	18,200	4,920.00	89,544,000
兼松日産農林	51,000	151.00	7,701,000
キングジム	22,100	648.00	14,320,800
リンテック	51,100	1,656.00	84,621,600
イトーキ	52,400	473.00	24,785,200
任天堂	136,300	8,760.00	1,193,988,000
三菱鉛筆	18,700	1,663.00	31,098,100
タカラスタANDARD	105,000	643.00	67,515,000
コクヨ	116,100	619.00	71,865,900
ナカバヤシ	56,000	185.00	10,360,000
グローブライド	113,000	106.00	11,978,000
岡村製作所	92,000	580.00	53,360,000
美津濃	112,000	392.00	43,904,000
アデランス	28,800	1,319.00	37,987,200
東京電力	1,711,600	198.00	338,896,800
中部電力	733,500	1,122.00	822,987,000
関西電力	979,600	800.00	783,680,000
中国電力	332,300	1,164.00	386,797,200
北陸電力	237,500	1,008.00	239,400,000
東北電力	601,000	713.00	428,513,000
四国電力	219,000	1,071.00	234,549,000
九州電力	531,800	887.00	471,706,600
北海道電力	229,000	782.00	179,078,000
沖縄電力	14,900	2,743.00	40,870,700
電源開発	149,900	2,252.00	337,574,800
東京瓦斯	2,875,000	446.00	1,282,250,000
大阪瓦斯	2,327,000	346.00	805,142,000
東邦瓦斯	611,000	483.00	295,113,000
北海道瓦斯	56,000	243.00	13,608,000
西部瓦斯	279,000	208.00	58,032,000
静岡瓦斯	66,500	625.00	41,562,500
東武鉄道	1,354,000	489.00	662,106,000
相鉄ホールディングス	375,000	308.00	115,500,000
東京急行電鉄	1,399,000	517.00	723,283,000
京浜急行電鉄	612,000	774.00	473,688,000
小田急電鉄	761,000	936.00	712,296,000
京王電鉄	661,000	700.00	462,700,000
京成電鉄	359,000	840.00	301,560,000
富士急行	71,000	559.00	39,689,000
新京成電鉄	31,000	363.00	11,253,000
東日本旅客鉄道	439,800	6,690.00	2,942,262,000
西日本旅客鉄道	205,800	3,845.00	791,301,000
東海旅客鉄道	198,400	8,600.00	1,706,240,000
西日本鉄道	300,000	369.00	110,700,000

ハマキョウレックス	7,400	3,040.00	22,496,000
サカイ引越センター	5,400	2,032.00	10,972,800
近畿日本鉄道	2,156,000	384.00	827,904,000
阪急阪神ホールディングス	1,501,000	500.00	750,500,000
南海電気鉄道	491,000	400.00	196,400,000
京阪電気鉄道	530,000	406.00	215,180,000
名糖運輸	12,600	628.00	7,912,800
名古屋鉄道	826,000	261.00	215,586,000
日本通運	943,000	390.00	367,770,000
ヤマトホールディングス	451,400	1,477.00	666,717,800
山九	295,000	377.00	111,215,000
丸運	19,400	212.00	4,112,800
丸全昭和運輸	69,000	291.00	20,079,000
センコー	97,000	457.00	44,329,000
トナミホールディングス	62,000	183.00	11,346,000
日本梱包運輸倉庫	78,100	1,313.00	102,545,300
日本石油輸送	29,000	201.00	5,829,000
福山通運	138,000	476.00	65,688,000
セイノーホールディングス	180,000	714.00	128,520,000
神奈川中央交通	30,000	485.00	14,550,000
日立物流	42,300	1,293.00	54,693,900
日本郵船	1,875,000	220.00	412,500,000
商船三井	1,156,000	307.00	354,892,000
川崎汽船	1,053,000	180.00	189,540,000
N S ユナイテッド海運	111,000	125.00	13,875,000
乾汽船	39,200	293.00	11,485,600
飯野海運	103,300	421.00	43,489,300
共栄タンカー	35,000	189.00	6,615,000
第一中央汽船	166,000	79.00	13,114,000
日本航空	201,700	4,390.00	885,463,000
全日本空輸	4,666,000	187.00	872,542,000
パスコ	28,000	282.00	7,896,000
日新	85,000	237.00	20,145,000
三菱倉庫	171,000	1,382.00	236,322,000
三井倉庫	118,000	383.00	45,194,000
住友倉庫	162,000	466.00	75,492,000
澁澤倉庫	68,000	313.00	21,284,000
東陽倉庫	42,000	227.00	9,534,000
日本トランスシティ	59,000	324.00	19,116,000
ケイヒン	61,000	123.00	7,503,000
安田倉庫	18,700	662.00	12,379,400
東洋埠頭	84,000	154.00	12,936,000
宇徳	25,700	292.00	7,504,400
上組	266,000	769.00	204,554,000
サンリツ	8,900	573.00	5,099,700
キューソー流通システム	1,900	935.00	1,776,500
郵船ロジスティクス	22,200	935.00	20,757,000
近鉄エクスプレス	22,100	3,050.00	67,405,000
東海運	21,300	246.00	5,239,800
NEC ネットエスアイ	23,100	1,693.00	39,108,300
システナ	264	81,900.00	21,621,600
新日鉄住金ソリューションズ	16,500	1,760.00	29,040,000
コア	9,800	725.00	7,105,000
ITホールディングス	79,900	1,108.00	88,529,200
ネオス	52	56,200.00	2,922,400
グリー	123,700	1,124.00	139,038,800
コーエーテクモホールディングス	49,000	799.00	39,151,000
三菱総合研究所	10,200	1,829.00	18,655,800

ボルテージ	5,400	900.00	4,860,000
ネクソン	196,400	840.00	164,976,000
ダウンゴ	125	238,000.00	29,750,000
マクロミル	21,700	1,007.00	21,851,900
ティーガイア	29,900	924.00	27,627,600
GMOペイメントゲートウェイ	9,800	1,513.00	14,827,400
ザッパラス	163	95,400.00	15,550,200
インターネットイニシアティブ	28,700	2,527.00	72,524,900
SRAホールディングス	10,400	990.00	10,296,000
朝日ネット	19,000	424.00	8,056,000
パナソニック インフォメーションシステムズ	4,000	1,993.00	7,972,000
フェイス	847	10,500.00	8,893,500
野村総合研究所	134,000	2,051.00	274,834,000
インテージ	8,000	2,039.00	16,312,000
シンプレクス・ホールディングス	532	28,860.00	15,353,520
クレスコ	7,100	639.00	4,536,900
フジ・メディア・ホールディングス	2,283	150,200.00	342,906,600
オービック	8,210	19,530.00	160,341,300
TDCソフトウェアエンジニアリング	5,600	791.00	4,429,600
ヤフー	17,305	39,050.00	675,760,250
トレンドマイクロ	94,200	2,599.00	244,825,800
日本オラクル	47,800	3,745.00	179,011,000
アルファシステムズ	9,800	1,104.00	10,819,200
フューチャーアーキテクト	284	35,700.00	10,138,800
シーエーシー	11,200	747.00	8,366,400
オービックビジネスコンサルタント	7,800	4,990.00	38,922,000
伊藤忠テクノソリューションズ	28,400	3,850.00	109,340,000
アイティフォー	31,300	344.00	10,767,200
大塚商会	21,200	8,430.00	178,716,000
サイボウズ	433	24,590.00	10,647,470
電通国際情報サービス	17,300	932.00	16,123,600
ウェザーニューズ	6,800	2,204.00	14,987,200
C I J	27,400	342.00	9,370,800
WOWOW	77	201,100.00	15,484,700
ネットワンシステムズ	89,000	803.00	71,467,000
アルゴグラフィックス	8,000	1,286.00	10,288,000
エイバックス・グループ・ホールディングス	45,600	2,389.00	108,938,400
日本ユニシス	66,200	684.00	45,280,800
兼松エレクトロニクス	10,500	1,070.00	11,235,000
東京放送ホールディングス	126,600	1,116.00	141,285,600
日本テレビホールディングス	214,900	1,375.00	295,487,500
テレビ朝日	59,500	1,618.00	96,271,000
スカパーJ S A Tホールディングス	2,049	46,300.00	94,868,700
テレビ東京ホールディングス	16,200	980.00	15,876,000
アイ・ティー・シーネットワーク	22,600	699.00	15,797,400
NECモバイルリング	8,500	3,940.00	33,490,000
日本電信電話	989,900	4,290.00	4,246,671,000
KDDI	331,800	6,900.00	2,289,420,000
光通信	24,300	4,260.00	103,518,000
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	19,376	139,200.00	2,697,139,200
GMOインターネット	83,200	729.00	60,652,800
学研ホールディングス	81,000	248.00	20,088,000
ゼンリン	33,900	1,047.00	35,493,300
昭文社	11,600	588.00	6,820,800
角川グループホールディングス	21,300	2,377.00	50,630,100
インプレスホールディングス	36,100	127.00	4,584,700
アイネット	13,400	660.00	8,844,000

松竹	157,000	965.00	151,505,000
東宝	167,300	1,734.00	290,098,200
東映	100,000	524.00	52,400,000
AOI Pro.	12,500	590.00	7,375,000
エヌ・ティ・ティ・データ	1,456	272,500.00	396,760,000
DTS	24,100	1,300.00	31,330,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	86,500	1,065.00	92,122,500
シーイーシー	15,400	537.00	8,269,800
カブコン	46,100	1,432.00	66,015,200
ジャステック	14,100	548.00	7,726,800
SCSK	57,700	1,595.00	92,031,500
アイネス	33,500	626.00	20,971,000
TKC	20,400	1,614.00	32,925,600
富士ソフト	34,400	2,003.00	68,903,200
NSD	47,500	947.00	44,982,500
コナミ	107,900	1,829.00	197,349,100
JBCCHホールディングス	21,200	688.00	14,585,600
ソフトバンク	1,124,700	3,450.00	3,880,215,000
高千穂交易	10,300	899.00	9,259,700
伊藤忠食品	4,200	3,185.00	13,377,000
エレマテック	12,600	1,245.00	15,687,000
JALUX	8,100	899.00	7,281,900
あらた	60,000	325.00	19,500,000
トーメンデバイス	2,300	1,778.00	4,089,400
双日	1,483,700	139.00	206,234,300
アルフレッサホールディングス	60,900	4,405.00	268,264,500
横浜冷凍	51,800	648.00	33,566,400
アルコニックス	7,700	1,563.00	12,035,100
あいホールディングス	42,500	695.00	29,537,500
ダイワボウホールディングス	223,000	173.00	38,579,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	45,200	839.00	37,922,800
UKCホールディングス	15,100	1,790.00	27,029,000
TOKAIホールディングス	94,500	291.00	27,499,500
ミタチ産業	8,800	436.00	3,836,800
シップヘルスケアホールディングス	34,400	2,496.00	85,862,400
協栄産業	41,000	152.00	6,232,000
小野建	19,700	849.00	16,725,300
佐島電機	18,800	460.00	8,648,000
伯東	12,200	860.00	10,492,000
コンドーテック	21,200	522.00	11,066,400
ナガイレーベン	31,200	1,170.00	36,504,000
三菱食品	26,000	2,608.00	67,808,000
松田産業	18,400	1,263.00	23,239,200
メディカルホールディングス	235,900	1,159.00	273,408,100
アドヴァン	15,200	887.00	13,482,400
SPK	4,300	1,527.00	6,566,100
アズワン	15,100	1,873.00	28,282,300
スズデン	4,900	466.00	2,283,400
尾家産業	8,900	822.00	7,315,800
シモジマ	15,500	995.00	15,422,500
ドウシシャ	12,400	2,369.00	29,375,600
高速	14,900	804.00	11,979,600
黒田電気	32,500	1,110.00	36,075,000
丸文	22,500	423.00	9,517,500
ハピネット	15,300	750.00	11,475,000
トーメンエレクトロニクス	12,700	1,142.00	14,503,400
エクセル	9,100	854.00	7,771,400
マルカキカイ	9,100	1,192.00	10,847,200

ガリバーインターナショナル	8,630	3,525.00	30,420,750
日本エム・ディ・エム	30,100	245.00	7,374,500
進和	16,700	1,063.00	17,752,100
ダイトエレクトロン	17,300	357.00	6,176,100
シークス	18,000	1,058.00	19,044,000
田中商事	11,000	477.00	5,247,000
オーハシテクニカ	16,700	644.00	10,754,800
マクニカ	12,200	1,693.00	20,654,600
白銅	10,200	817.00	8,333,400
伊藤忠商事	1,874,300	1,086.00	2,035,489,800
丸紅	1,927,000	685.00	1,319,995,000
高島	56,000	266.00	14,896,000
F & A アクアホールディングス	20,500	1,030.00	21,115,000
長瀬産業	129,500	1,019.00	131,960,500
蝶理	16,900	982.00	16,595,800
豊田通商	261,200	2,342.00	611,730,400
三共生興	41,900	324.00	13,575,600
兼松	515,000	131.00	67,465,000
ツカモトコーポレーション	58,000	156.00	9,048,000
三井物産	2,029,700	1,392.00	2,825,342,400
日本紙パルプ商事	117,000	298.00	34,866,000
日立ハイテクノロジーズ	72,100	1,916.00	138,143,600
カメイ	29,000	856.00	24,824,000
東都水産	55,000	132.00	7,260,000
スターゼン	62,000	256.00	15,872,000
山善	91,600	615.00	56,334,000
椿本興業	30,000	252.00	7,560,000
住友商事	1,385,900	1,166.00	1,615,959,400
内田洋行	63,000	249.00	15,687,000
三菱商事	1,834,400	1,924.00	3,529,385,600
第一実業	54,000	433.00	23,382,000
キャノンマーケティングジャパン	79,800	1,250.00	99,750,000
西華産業	83,000	250.00	20,750,000
佐藤商事	21,200	571.00	12,105,200
菱洋エレクトロ	25,600	820.00	20,992,000
東京産業	25,500	283.00	7,216,500
ユアサ商事	246,000	170.00	41,820,000
神鋼商事	61,000	182.00	11,102,000
阪和興業	236,000	375.00	88,500,000
カナデン	24,000	563.00	13,512,000
菱電商事	33,000	561.00	18,513,000
フルサト工業	14,100	826.00	11,646,600
岩谷産業	260,000	357.00	92,820,000
すてきナイスグループ	100,000	221.00	22,100,000
昭光通商	103,000	134.00	13,802,000
二チモウ	45,000	194.00	8,730,000
極東貿易	43,000	157.00	6,751,000
イワキ	39,000	185.00	7,215,000
三愛石油	52,000	392.00	20,384,000
稲畑産業	57,100	616.00	35,173,600
G S I クレオス	76,000	131.00	9,956,000
明和産業	24,600	395.00	9,717,000
東邦ホールディングス	76,200	1,880.00	143,256,000
サンゲツ	39,900	2,302.00	91,849,800
ミツウロコグループホールディングス	41,600	513.00	21,340,800
シナネン	38,000	389.00	14,782,000
伊藤忠エネクス	45,600	489.00	22,298,400
サンリオ	59,800	3,585.00	214,383,000

サンワテクノス	14,400	662.00	9,532,800
リョーサン	38,600	1,995.00	77,007,000
新光商事	23,800	896.00	21,324,800
トーホー	41,000	322.00	13,202,000
三信電気	34,400	643.00	22,119,200
東陽テクニカ	35,000	1,103.00	38,605,000
モスフードサービス	27,000	1,738.00	46,926,000
加賀電子	24,800	767.00	19,021,600
ソーダニッカ	23,000	392.00	9,016,000
立花エレテック	14,300	836.00	11,954,800
P a l t a c	29,000	1,119.00	32,451,000
太平洋興発	114,000	91.00	10,374,000
ヤマタネ	131,000	138.00	18,078,000
丸紅建材リース	39,000	174.00	6,786,000
日鐵商事	54,000	266.00	14,364,000
トラスコ中山	26,100	1,761.00	45,962,100
オートバックスセブン	29,100	3,905.00	113,635,500
加藤産業	31,900	1,728.00	55,123,200
イノテック	23,700	390.00	9,243,000
イエローハット	22,900	1,387.00	31,762,300
富士エレクトロニクス	12,900	1,261.00	16,266,900
J Kホールディングス	24,300	443.00	10,764,900
日伝	9,500	2,140.00	20,330,000
北沢産業	32,000	167.00	5,344,000
杉本商事	12,100	785.00	9,498,500
因幡電機産業	27,000	2,782.00	75,114,000
住金物産	117,000	294.00	34,398,000
ミスミグループ本社	87,900	2,342.00	205,861,800
タキヒヨー	40,000	470.00	18,800,000
スズケン	90,400	3,115.00	281,596,000
ジェコス	20,600	628.00	12,936,800
ローソン	89,400	6,930.00	619,542,000
サンエー	8,700	3,750.00	32,625,000
キリン堂	12,200	643.00	7,844,600
カワチ薬品	17,200	1,878.00	32,301,600
エービーシー・マート	28,900	3,295.00	95,225,500
ハードオフコーポレーション	10,900	638.00	6,954,200
アスクル	16,500	1,288.00	21,252,000
ゲオホールディングス	404	90,800.00	36,683,200
ポイント	22,870	3,225.00	73,755,750
シー・ヴィ・エス・バイエリア	48,000	82.00	3,936,000
くらコーポレーション	15,300	1,277.00	19,538,100
キャンドゥ	144	120,000.00	17,280,000
バル	6,950	4,195.00	29,155,250
エディオン	103,900	394.00	40,936,600
サーラコーポレーション	22,700	486.00	11,032,200
あみやき亭	43	203,300.00	8,741,900
ひらまつ	94	181,800.00	17,089,200
ゲンキー	3,200	1,975.00	6,320,000
大黒天物産	4,200	2,265.00	9,513,000
ハニーズ	19,550	1,122.00	21,935,100
アルペン	17,400	1,602.00	27,874,800
ビックカメラ	887	46,250.00	41,023,750
D C Mホールディングス	121,900	615.00	74,968,500
M o n o t a R O	16,600	3,340.00	55,444,000
J . フロント リテイリング	557,000	543.00	302,451,000
ドトール・日レスホールディングス	41,000	1,298.00	53,218,000
マツモトキヨシホールディングス	40,200	2,378.00	95,595,600

スタートトゥデイ	49,500	940.00	46,530,000
物語コーポレーション	3,100	2,005.00	6,215,500
ココカラファイン	25,000	2,905.00	72,625,000
三越伊勢丹ホールディングス	467,400	953.00	445,432,200
ウエルシアホールディングス	9,000	3,795.00	34,155,000
クリエイトSDホールディングス	9,000	2,856.00	25,704,000
ブックオフコーポレーション	13,200	676.00	8,923,200
あさひ	15,800	1,213.00	19,165,400
日本調剤	4,200	2,228.00	9,357,600
コスモス薬品	10,600	10,640.00	112,784,000
セブン&アイ・ホールディングス	984,400	2,801.00	2,757,304,400
ツルハホールディングス	20,200	7,800.00	157,560,000
サンマルクホールディングス	7,400	3,600.00	26,640,000
フェリシモ	7,300	1,097.00	8,008,100
トリドール	21,500	915.00	19,672,500
クスリのアオキ	4,000	5,920.00	23,680,000
メディカルシステムネットワーク	17,800	377.00	6,710,600
総合メディカル	6,500	3,045.00	19,792,500
はるやま商事	12,500	524.00	6,550,000
カッパ・クリエイトホールディングス	16,950	2,028.00	34,374,600
ライトオン	23,000	662.00	15,226,000
良品計画	25,700	5,250.00	134,925,000
三城ホールディングス	36,500	472.00	17,228,000
コナカ	31,500	750.00	23,625,000
イオン北海道	6,100	482.00	2,940,200
コジマ	45,800	295.00	13,511,000
コーナン商事	29,800	1,084.00	32,303,200
エコス	7,600	588.00	4,468,800
ワタミ	28,000	1,683.00	47,124,000
ドン・キホーテ	64,800	3,685.00	238,788,000
メガネトップ	42,500	1,057.00	44,922,500
西松屋チェーン	47,500	742.00	35,245,000
ゼンショーホールディングス	91,800	1,120.00	102,816,000
幸楽苑	14,000	1,287.00	18,018,000
サイゼリヤ	34,000	1,178.00	40,052,000
ユナイテッドアローズ	26,100	2,279.00	59,481,900
ハイデイ日高	11,600	2,036.00	23,617,600
京都きもの友禅	15,100	1,140.00	17,214,000
コロワイド	80,500	963.00	77,521,500
壱番屋	8,300	2,976.00	24,700,800
スギホールディングス	38,500	3,215.00	123,777,500
スクロール	40,700	270.00	10,989,000
ファミリーマート	73,200	3,840.00	281,088,000
木曽路	27,600	1,757.00	48,493,200
千趣会	38,700	650.00	25,155,000
タカキュー	30,000	323.00	9,690,000
ケーヨー	39,900	494.00	19,710,600
上新電機	50,000	896.00	44,800,000
日本瓦斯	31,900	1,105.00	35,249,500
ベスト電器	99,500	157.00	15,621,500
マルエツ	49,000	303.00	14,847,000
ロイヤルホールディングス	35,500	1,059.00	37,594,500
東天紅	27,000	193.00	5,211,000
いなげや	20,800	1,012.00	21,049,600
島忠	52,600	1,964.00	103,306,400
チヨダ	28,800	2,031.00	58,492,800
ライフコーポレーション	17,200	1,247.00	21,448,400
カスミ	42,200	581.00	24,518,200

リンガーハット	21,900	1,223.00	26,783,700
テナアライド	26,500	304.00	8,056,000
AOKIホールディングス	21,300	2,214.00	47,158,200
オークワ	38,000	1,051.00	39,938,000
コメリ	36,700	2,490.00	91,383,000
青山商事	66,100	1,990.00	131,539,000
しまむら	27,400	9,220.00	252,628,000
CFSコーポレーション	20,100	412.00	8,281,200
高島屋	320,000	723.00	231,360,000
松屋	49,300	798.00	39,341,400
エイチ・ツー・オー リテイリング	157,000	808.00	126,856,000
ニッセンホールディングス	53,100	322.00	17,098,200
パルコ	44,500	917.00	40,806,500
丸井グループ	308,700	753.00	232,451,100
原信ナルスホールディングス	11,400	1,638.00	18,673,200
井筒屋	130,000	90.00	11,700,000
ダイエー	143,050	202.00	28,896,100
イズミヤ	88,000	493.00	43,384,000
イオン	827,600	1,056.00	873,945,600
ユニー	228,600	670.00	153,162,000
イズミ	60,600	1,917.00	116,170,200
東武ストア	31,000	281.00	8,711,000
平和堂	48,500	1,294.00	62,759,000
フジ	25,800	1,824.00	47,059,200
ヤオコー	11,500	3,550.00	40,825,000
ゼビオ	33,100	1,744.00	57,726,400
ケーズホールディングス	60,000	2,296.00	137,760,000
Olympic	17,300	663.00	11,469,900
日産東京販売ホールディングス	43,000	299.00	12,857,000
アインファーマシーズ	13,500	4,845.00	65,407,500
元気寿司	10,100	1,129.00	11,402,900
ヤマダ電機	107,170	3,540.00	379,381,800
アークランドサカモト	16,000	1,368.00	21,888,000
ニトリホールディングス	47,050	6,700.00	315,235,000
グルメ杵屋	20,000	629.00	12,580,000
愛眼	28,400	306.00	8,690,400
吉野家ホールディングス	652	107,700.00	70,220,400
松屋フーズ	9,000	1,608.00	14,472,000
サガミチェーン	28,000	724.00	20,272,000
ブレナス	26,300	1,504.00	39,555,200
ミニストップ	17,100	1,530.00	26,163,000
アークス	40,300	1,779.00	71,693,700
パロー	51,600	1,534.00	79,154,400
ベルク	9,700	1,328.00	12,881,600
大庄	10,800	1,210.00	13,068,000
ファーストリテイリング	47,200	25,390.00	1,198,408,000
サンドラッグ	45,000	3,700.00	166,500,000
東京デリカ	9,700	953.00	9,244,100
ヤマザワ	5,900	1,513.00	8,926,700
やまや	5,000	1,415.00	7,075,000
ベルーナ	29,750	676.00	20,111,000
島根銀行	6,100	1,284.00	7,832,400
新生銀行	2,052,000	206.00	422,712,000
あおぞら銀行	871,000	270.00	235,170,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	17,809,300	533.00	9,492,356,900
りそなホールディングス	2,425,200	430.00	1,042,836,000
三井住友トラスト・ホールディングス	4,921,000	358.00	1,761,718,000
三井住友フィナンシャルグループ	1,778,900	3,820.00	6,795,398,000

第四銀行	301,000	330.00	99,330,000
北越銀行	237,000	210.00	49,770,000
西日本シティ銀行	826,000	248.00	204,848,000
千葉銀行	909,000	602.00	547,218,000
横浜銀行	1,499,000	464.00	695,536,000
常陽銀行	882,000	449.00	396,018,000
群馬銀行	530,000	471.00	249,630,000
武蔵野銀行	38,300	3,190.00	122,177,000
千葉興業銀行	45,200	698.00	31,549,600
筑波銀行	101,000	359.00	36,259,000
東京都民銀行	46,600	899.00	41,893,400
七十七銀行	370,000	439.00	162,430,000
青森銀行	178,000	279.00	49,662,000
秋田銀行	159,000	249.00	39,591,000
山形銀行	144,000	404.00	58,176,000
岩手銀行	17,500	3,750.00	65,625,000
東邦銀行	199,000	289.00	57,511,000
東北銀行	125,000	151.00	18,875,000
みちのく銀行	117,000	205.00	23,985,000
ふくおかフィナンシャルグループ	955,000	412.00	393,460,000
静岡銀行	689,000	920.00	633,880,000
十六銀行	292,000	327.00	95,484,000
スルガ銀行	231,000	1,341.00	309,771,000
八十二銀行	428,000	471.00	201,588,000
山梨中央銀行	143,000	386.00	55,198,000
大垣共立銀行	308,000	302.00	93,016,000
福井銀行	213,000	182.00	38,766,000
北國銀行	272,000	371.00	100,912,000
清水銀行	8,400	2,646.00	22,226,400
滋賀銀行	217,000	537.00	116,529,000
南都銀行	236,000	400.00	94,400,000
百五銀行	209,000	401.00	83,809,000
京都銀行	420,000	794.00	333,480,000
三重銀行	95,000	211.00	20,045,000
ほくほくフィナンシャルグループ	1,656,000	157.00	259,992,000
広島銀行	698,000	382.00	266,636,000
山陰合同銀行	135,000	743.00	100,305,000
中国銀行	180,000	1,340.00	241,200,000
鳥取銀行	82,000	186.00	15,252,000
伊予銀行	250,000	753.00	188,250,000
百十四銀行	255,000	366.00	93,330,000
四国銀行	172,000	242.00	41,624,000
阿波銀行	190,000	557.00	105,830,000
鹿児島銀行	158,000	617.00	97,486,000
大分銀行	142,000	332.00	47,144,000
宮崎銀行	159,000	244.00	38,796,000
肥後銀行	192,000	551.00	105,792,000
佐賀銀行	143,000	216.00	30,888,000
十八銀行	151,000	243.00	36,693,000
沖縄銀行	17,800	3,730.00	66,394,000
琉球銀行	49,800	1,192.00	59,361,600
八千代銀行	12,200	2,298.00	28,035,600
セブン銀行	811,400	239.00	193,924,600
みずほフィナンシャルグループ	30,325,000	204.00	6,186,300,000
紀陽ホールディングス	932,000	140.00	130,480,000
山口フィナンシャルグループ	234,000	883.00	206,622,000
長野銀行	89,000	178.00	15,842,000
名古屋銀行	214,000	334.00	71,476,000

北洋銀行	361,400	322.00	116,370,800
愛知銀行	8,700	4,865.00	42,325,500
第三銀行	138,000	178.00	24,564,000
中京銀行	100,000	199.00	19,900,000
東日本銀行	102,000	243.00	24,786,000
大光銀行	93,000	237.00	22,041,000
愛媛銀行	138,000	235.00	32,430,000
トマト銀行	97,000	176.00	17,072,000
みなと銀行	223,000	162.00	36,126,000
京葉銀行	192,000	467.00	89,664,000
関西アーバン銀行	342,000	115.00	39,330,000
栃木銀行	118,000	374.00	44,132,000
北日本銀行	7,500	2,533.00	18,997,500
東和銀行	264,000	104.00	27,456,000
福島銀行	313,000	84.00	26,292,000
大東銀行	163,000	95.00	15,485,000
トモニホールディングス	183,900	400.00	73,560,000
フィデアホールディングス	141,300	216.00	30,520,800
池田泉州ホールディングス	199,100	503.00	100,147,300
SBIホールディングス	302,000	740.00	223,480,000
ジャフコ	32,700	2,931.00	95,843,700
大和証券グループ本社	2,331,000	548.00	1,277,388,000
野村ホールディングス	4,810,000	541.00	2,602,210,000
岡三証券グループ	203,000	712.00	144,536,000
丸三証券	73,900	704.00	52,025,600
東洋証券	92,000	305.00	28,060,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	273,000	508.00	138,684,000
光世証券	60,000	229.00	13,740,000
水戸証券	71,000	391.00	27,761,000
いちよし証券	52,600	822.00	43,237,200
松井証券	141,300	875.00	123,637,500
だいこう証券ビジネス	16,300	635.00	10,350,500
マネックスグループ	2,706	32,650.00	88,350,900
カブドットコム証券	97,300	465.00	45,244,500
極東証券	33,400	1,205.00	40,247,000
岩井コスモホールディングス	25,000	672.00	16,800,000
NKSJホールディングス	522,900	1,977.00	1,033,773,300
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	702,300	1,981.00	1,391,256,300
ソニーフィナンシャルホールディングス	225,600	1,491.00	336,369,600
第一生命保険	12,592	134,900.00	1,698,660,800
東京海上ホールディングス	910,700	2,741.00	2,496,228,700
T&Dホールディングス	807,100	1,150.00	928,165,000
全国保証	18,000	2,804.00	50,472,000
クレディセゾン	209,400	1,885.00	394,719,000
芙蓉総合リース	23,800	3,205.00	76,279,000
興銀リース	37,400	2,349.00	87,852,600
東京センチュリーリース	57,400	2,092.00	120,080,800
日本証券金融	93,800	629.00	59,000,200
大阪証券金融	53,000	243.00	12,879,000
アイフル	90,000	568.00	51,120,000
ポケットカード	32,000	444.00	14,208,000
リコーリース	18,000	2,323.00	41,814,000
イオンクレジットサービス	89,500	2,017.00	180,521,500
アコム	49,570	2,194.00	108,756,580
ジャックス	140,000	416.00	58,240,000
オリエントコーポレーション	468,000	276.00	129,168,000
日立キャピタル	49,000	1,711.00	83,839,000

オリックス	122,930	10,310.00	1,267,408,300
三菱UFJリース	60,760	4,085.00	248,204,600
NECキャピタルソリューション	12,100	1,557.00	18,839,700
日本駐車場開発	3,677	5,600.00	20,591,200
ヒューリック	309,600	635.00	196,596,000
野村不動産ホールディングス	113,800	1,584.00	180,259,200
常和ホールディングス	5,800	1,665.00	9,657,000
パーク24	124,900	1,639.00	204,711,100
三井不動産	1,110,000	2,120.00	2,353,200,000
三菱地所	1,647,000	2,128.00	3,504,816,000
平和不動産	46,500	1,296.00	60,264,000
東京建物	459,000	457.00	209,763,000
ダイビル	64,600	892.00	57,623,200
東急不動産	518,000	612.00	317,016,000
京阪神ビルディング	34,600	491.00	16,988,600
住友不動産	565,000	2,725.00	1,539,625,000
東宝不動産	24,700	736.00	18,179,200
大京	371,000	220.00	81,620,000
テオーシー	86,200	588.00	50,685,600
東京楽天地	46,000	357.00	16,422,000
レオパレス21	146,900	332.00	48,770,800
フジ住宅	33,200	490.00	16,268,000
空港施設	30,500	460.00	14,030,000
住友不動産販売	9,040	4,115.00	37,199,600
ゴールドクレスト	20,000	1,620.00	32,400,000
東栄住宅	17,100	1,211.00	20,708,100
日本エスリード	11,800	956.00	11,280,800
東急リパブル	26,400	1,350.00	35,640,000
飯田産業	22,900	1,184.00	27,113,600
日神不動産	18,300	578.00	10,577,400
アーネストワン	39,400	1,566.00	61,700,400
タカラレーベン	27,300	1,044.00	28,501,200
サンヨーハウジング名古屋	142	104,000.00	14,768,000
イオンモール	108,900	2,162.00	235,441,800
フージャースコーポレーション	105	75,400.00	7,917,000
タクトホーム	132	130,900.00	17,278,800
トーセイ	344	66,700.00	22,944,800
エヌ・ティ・ティ都市開発	1,476	87,500.00	129,150,000
日本空港ビルデング	84,500	1,037.00	87,626,500
日本工営	84,000	315.00	26,460,000
ネクスト	14,700	986.00	14,494,200
日本M&Aセンター	13,900	3,090.00	42,951,000
アコーディア・ゴルフ	1,131	81,700.00	92,402,700
タケエイ	4,000	2,528.00	10,112,000
パソナグループ	262	43,550.00	11,410,100
リンクアンドモチベーション	101	43,150.00	4,358,150
GCAサヴィアングループ	12,700	891.00	11,315,700
エス・エム・エス	79	213,800.00	16,890,200
テンブホールディングス	34,500	1,361.00	46,954,500
クックパッド	6,400	2,978.00	19,059,200
学情	12,200	318.00	3,879,600
スタジオアリス	13,400	1,251.00	16,763,400
シミックホールディングス	11,400	1,390.00	15,846,000
NECフィールディング	17,100	1,048.00	17,920,800
総合警備保障	90,400	1,231.00	111,282,400
カカクコム	34,900	3,525.00	123,022,500
ルネサンス	13,900	679.00	9,438,100
ツクイ	12,800	1,666.00	21,324,800

エムスリー	588	164,600.00	96,784,800
ベストプライダル	82	103,500.00	8,487,000
ディー・エヌ・エー	124,000	2,645.00	327,980,000
博報堂DYホールディングス	34,360	6,780.00	232,960,800
ぐるなび	21,000	963.00	20,223,000
ジェイコムホールディングス	6,800	716.00	4,868,800
PGMホールディングス	358	69,300.00	24,809,400
JPホールディングス	8,900	1,221.00	10,866,900
イービーエス	159	232,600.00	36,983,400
アミューズ	9,500	1,796.00	17,062,000
ケネディクス	2,476	19,010.00	47,068,760
電通	226,500	2,864.00	648,696,000
テイクアンドギヴ・ニーズ	1,228	9,390.00	11,530,920
びあ	9,800	1,309.00	12,828,200
イオンファンタジー	9,800	1,316.00	12,896,800
みらかホールディングス	65,300	4,260.00	278,178,000
アルプス技研	12,000	763.00	9,156,000
サニックス	44,700	361.00	16,136,700
オリエンタルランド	74,100	12,490.00	925,509,000
ダスキン	64,800	1,808.00	117,158,400
明光ネットワークジャパン	23,500	1,050.00	24,675,000
ファルコSDホールディングス	14,100	1,021.00	14,396,100
ラウンドワン	81,400	577.00	46,967,800
リゾートトラスト	42,600	1,983.00	84,475,800
ビー・エム・エル	15,000	2,314.00	34,710,000
ワタベウェディング	9,200	728.00	6,697,600
もしもしホットライン	43,400	1,243.00	53,946,200
東急コミュニティー	4,900	3,460.00	16,954,000
リソー教育	2,928	7,760.00	22,721,280
ユー・エス・エス	27,980	9,820.00	274,763,600
セントラルスポーツ	7,100	1,428.00	10,138,800
フルキャストホールディングス	365	15,100.00	5,511,500
リゾートソリューション	36,000	186.00	6,696,000
リロ・ホールディング	8,800	3,390.00	29,832,000
エイチ・アイ・エス	20,800	3,150.00	65,520,000
共立メンテナンス	11,300	2,388.00	26,984,400
イチネンホールディングス	27,400	576.00	15,782,400
建設技術研究所	16,600	586.00	9,727,600
燦ホールディングス	5,200	1,318.00	6,853,600
東京テアトル	124,000	125.00	15,500,000
よみうりランド	55,000	455.00	25,025,000
東京都競馬	205,000	207.00	42,435,000
常磐興産	109,000	145.00	15,805,000
カナモト	31,000	1,347.00	41,757,000
東京ドーム	195,000	322.00	62,790,000
トランス・コスモス	33,700	1,150.00	38,755,000
乃村工藝社	57,000	434.00	24,738,000
藤田観光	75,000	293.00	21,975,000
日本管財	8,200	1,593.00	13,062,600
トーカイ	10,800	2,500.00	27,000,000
白洋舎	36,000	211.00	7,596,000
セコム	258,900	4,620.00	1,196,118,000
セントラル警備保障	8,000	872.00	6,976,000
丹青社	30,000	350.00	10,500,000
メイテック	39,400	2,305.00	90,817,000
アサツー ディ・ケイ	41,000	2,403.00	98,523,000
応用地質	27,300	1,012.00	27,627,600
船井総合研究所	25,300	590.00	14,927,000

進学会	13,900	315.00	4,378,500	
ベネッセホールディングス	76,300	3,635.00	277,350,500	
イオンディライト	25,100	1,707.00	42,845,700	
ナック	5,300	2,584.00	13,695,200	
ニチイ学館	50,900	866.00	44,079,400	
ダイセキ	38,700	1,334.00	51,625,800	
合計	368,575,826		316,216,058,890	

(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

(単位 : 円)

(平成24年 2月20日現在) (平成25年 2月18日現在)

資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,011,568,439	846,139,084
国債証券	361,628,836,480	395,178,775,790
地方債証券	31,284,270,027	30,140,770,422
特殊債券	50,347,412,738	45,384,806,564
社債券	33,190,025,700	29,238,076,500
未収入金		2,056,910,200
未収利息	2,171,856,634	2,184,716,003
前払費用	64,221,438	116,213,703
流動資産合計	479,698,191,456	505,146,408,266
資産合計		
	479,698,191,456	505,146,408,266
負債の部		
流動負債		
未払金		553,488,000
未払解約金		1,031,204,605
流動負債合計		1,584,692,605
負債合計		
		1,584,692,605
純資産の部		
元本等		
元本	429,837,460,158	442,240,335,913
剰余金		
剰余金又は欠損金 ()	49,860,731,298	61,321,379,748
元本等合計	479,698,191,456	503,561,715,661
純資産合計		
	479,698,191,456	503,561,715,661
負債純資産合計		
	479,698,191,456	505,146,408,266

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 平成24年 2月21日 至 平成25年 2月18日
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p>

(3) 時価が入手できなかった有価証券
直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。

(追加情報)

自 平成24年 2月21日
至 平成25年 2月18日

当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更およ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）および「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。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成24年 2月20日現在)	(平成25年 2月18日現在)
1. 受益権総数	平成24年 2月20日における受益権の総数 429,837,460,158口	平成25年 2月18日における受益権の総数 442,240,335,913口
2. 1単位当たり純資産額	1.1160円 (1万口 = 11,160円)	1.1387円 (1万口 = 11,387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24年 2月21日 至 平成25年 2月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成25年 2月18日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成24年2月20日現在)
該当事項はありません。

(平成25年2月18日現在)
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。

（自 平成24年2月21日 至 平成25年2月18日）

該当事項はありません。

（その他の注記）

（平成24年 2月20日現在）

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	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日現在の元本の内訳	
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

S M A M ・ F G 新興国重視型バランス20 V A < 適格機関投資家限定 >	19,067,757円
S M A M ・ F G グローバルバランス25 V A < 適格機関投資家限定 >	11,622,602円
合 計	429,837,460,158円

(平成25年 2月18日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	429,837,460,158円
同期中における追加設定元本額	45,546,957,739円
同期中における一部解約元本額	33,144,081,984円
平成25年 2月18日現在の元本の内訳	
三井住友・D C 年金バランス30 (債券重点型)	1,458,972,989円
三井住友・D C 年金バランス50 (標準型)	2,614,707,916円
三井住友・D C 年金バランス70 (株式重点型)	557,793,302円
スミセイ・D C バランスファンド (機動的資産配分型)	132,077,489円
スミセイ・D C ターゲットイヤーファンド2020	18,051,210円
スミセイ・D C ターゲットイヤーファンド2025	18,611,782円
スミセイ・D C ターゲットイヤーファンド2030	9,728,295円
スミセイ・D C ターゲットイヤーファンド2035	8,018,473円
スミセイ・D C ターゲットイヤーファンド2040	2,298,302円
スミセイ・D C ターゲットイヤーファンド2045	3,902,311円
S M A M ・ 年金グローバル債券ファンド < 適格機関投資家限定 >	9,686,542,542円
S M A M ・ バランスファンド V A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	46,354,581,403円
S M A M ・ バランスファンド V A 3 7 . 5 < 適格機関投資家専用 >	11,372,267,513円
S M A M ・ バランスファンド V A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	26,626,800,057円
S M A M ・ バランスファンド V L 3 0 < 適格機関投資家限定 >	541,014,699円
S M A M ・ バランスファンド V L 5 0 < 適格機関投資家限定 >	776,256,963円
世界6資産バランスファンド V A < 適格機関投資家限定 >	159,029,685円
S M A M ・ バランスファンド V A 7 5 < 適格機関投資家専用 >	395,676,620円
S M A M ・ バランスファンド V L 国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	140,366,369円
S M A M ・ インデックス・バランス V A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	2,757,796,366円
S M A M ・ インデックス・バランス V A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	3,131,571,582円
S M A M ・ バランスファンド V A 4 0 < 適格機関投資家専用 >	7,834,360,216円
S M A M ・ バランスファンド V A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	18,410,894,745円
S M A M ・ バランス V A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	1,317,525,611円
三井住友・国内債券インデックスファンド・ V A S (適格機関投資家専用)	10,197,727,513円
三井住友・5資産バランスファンド・ V A S (適格機関投資家専用)	63,015,276,752円
S M A M ・ グローバルバランス 4 0 V A < 適格機関投資家限定 >	850,739,221円
S M A M ・ バランスファンド V A 2 0 < 適格機関投資家専用 >	11,745,196,682円
三井住友・7資産バランスファンド・ V A S (適格機関投資家専用)	193,220,675,214円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 A < 適格機関投資家専用 >	1,324,338,188円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 5 A < 適格機関投資家専用 >	322,553,357円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 5 0 A < 適格機関投資家専用 >	61,188,479円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 L < 適格機関投資家専用 >	3,701,272,733円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 5 L < 適格機関投資家専用 >	4,599,064,206円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 T < 適格機関投資家専用 >	3,983,501,432円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	1,579,476,233円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 >	332,866,337円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 >	33,173,189円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 3 0 L 2 < 適格機関投資家専用 >	771,297,120円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 >	11,225,114,781円
S M A M ・ アセットバランスファンド V A 2 0 T 2 < 適格機関投資家専用 >	915,903,507円
S M A M ・ F G 新興国重視型バランス20 V A < 適格機関投資家限定 >	16,764,080円
S M A M ・ F G グローバルバランス25 V A < 適格機関投資家限定 >	15,360,449円
合 計	442,240,335,913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)	510,000,000	563,672,400	
	第2回利付国債(40年)	722,000,000	758,612,620	
	第3回利付国債(40年)	880,000,000	920,400,800	
	第4回利付国債(40年)	1,080,000,000	1,124,258,400	
	第5回利付国債(40年)	830,000,000	814,802,700	
	第260回利付国債(10年)	2,885,000,000	2,944,546,400	
	第263回利付国債(10年)	10,872,000,000	11,139,016,320	
	第264回利付国債(10年)	3,300,000,000	3,375,834,000	
	第265回利付国債(10年)	16,490,000,000	16,928,634,000	
	第268回利付国債(10年)	13,745,000,000	14,159,824,100	
	第270回利付国債(10年)	12,367,000,000	12,727,992,730	
	第272回利付国債(10年)	9,895,000,000	10,240,533,400	
	第274回利付国債(10年)	8,815,000,000	9,177,472,800	
	第277回利付国債(10年)	8,495,000,000	8,899,446,950	
	第280回利付国債(10年)	9,347,000,000	9,918,288,640	
	第282回利付国債(10年)	9,370,000,000	9,913,741,100	
	第284回利付国債(10年)	10,657,000,000	11,311,872,650	
	第285回利付国債(10年)	9,963,000,000	10,610,196,480	
	第286回利付国債(10年)	8,500,000,000	9,116,845,000	
	第288回利付国債(10年)	6,065,000,000	6,500,042,450	
	第289回利付国債(10年)	9,654,000,000	10,286,337,000	
	第290回利付国債(10年)	4,717,000,000	5,015,303,080	
	第293回利付国債(10年)	2,900,000,000	3,151,285,000	
	第296回利付国債(10年)	3,363,000,000	3,606,279,420	
	第297回利付国債(10年)	3,643,000,000	3,890,432,560	
	第298回利付国債(10年)	1,100,000,000	1,168,376,000	
	第299回利付国債(10年)	1,780,000,000	1,891,873,000	
	第300回利付国債(10年)	1,780,000,000	1,913,179,600	
	第301回利付国債(10年)	2,645,000,000	2,844,776,850	
	第303回利付国債(10年)	4,395,000,000	4,700,892,000	
	第305回利付国債(10年)	5,875,000,000	6,245,183,750	
	第306回利付国債(10年)	5,750,000,000	6,147,785,000	
	第307回利付国債(10年)	1,100,000,000	1,168,530,000	
	第308回利付国債(10年)	3,450,000,000	3,664,521,000	
	第309回利付国債(10年)	2,200,000,000	2,304,720,000	
	第310回利付国債(10年)	6,090,000,000	6,330,859,500	
	第312回利付国債(10年)	5,420,000,000	5,708,018,800	
	第313回利付国債(10年)	5,900,000,000	6,256,655,000	
	第315回利付国債(10年)	6,230,000,000	6,549,848,200	
	第317回利付国債(10年)	2,630,000,000	2,739,539,500	
	第318回利付国債(10年)	3,200,000,000	3,305,792,000	
	第319回利付国債(10年)	1,750,000,000	1,820,315,000	
	第320回利付国債(10年)	4,780,000,000	4,929,996,400	
	第321回利付国債(10年)	3,100,000,000	3,191,605,000	

第322回利付国債(10年)	3,750,000,000	3,828,712,500
第323回利付国債(10年)	630,000,000	641,875,500
第324回利付国債(10年)	4,900,000,000	4,947,236,000
第325回利付国債(10年)	6,350,000,000	6,395,529,500
第326回利付国債(10年)	1,250,000,000	1,244,837,500
第327回利付国債(10年)	1,550,000,000	1,558,509,500
第2回利付国債(30年)	570,000,000	644,288,100
第4回利付国債(30年)	300,000,000	360,129,000
第5回利付国債(30年)	290,000,000	315,685,300
第7回利付国債(30年)	549,000,000	603,323,550
第9回利付国債(30年)	100,000,000	94,638,000
第10回利付国債(30年)	585,000,000	522,293,850
第11回利付国債(30年)	570,000,000	566,146,800
第12回利付国債(30年)	620,000,000	657,807,600
第14回利付国債(30年)	1,110,000,000	1,235,352,300
第16回利付国債(30年)	1,195,000,000	1,351,270,150
第18回利付国債(30年)	1,010,000,000	1,104,616,800
第19回利付国債(30年)	815,000,000	891,259,550
第21回利付国債(30年)	715,000,000	782,338,700
第22回利付国債(30年)	715,000,000	809,129,750
第23回利付国債(30年)	529,000,000	598,690,460
第24回利付国債(30年)	660,000,000	747,615,000
第25回利付国債(30年)	790,000,000	863,793,900
第26回利付国債(30年)	803,000,000	893,682,790
第27回利付国債(30年)	1,060,000,000	1,200,757,400
第28回利付国債(30年)	1,406,000,000	1,593,940,020
第29回利付国債(30年)	1,212,000,000	1,350,010,440
第30回利付国債(30年)	1,360,000,000	1,487,268,800
第31回利付国債(30年)	1,580,000,000	1,693,617,800
第32回利付国債(30年)	1,630,000,000	1,779,976,300
第33回利付国債(30年)	1,880,000,000	1,929,726,000
第34回利付国債(30年)	1,940,000,000	2,073,122,800
第35回利付国債(30年)	2,030,000,000	2,077,217,800
第36回利付国債(30年)	1,505,000,000	1,537,492,950
第37回利付国債(30年)	2,020,000,000	2,014,263,200
第32回利付国債(20年)	70,000,000	77,831,600
第35回利付国債(20年)	170,000,000	192,086,400
第37回利付国債(20年)	302,000,000	342,999,520
第39回利付国債(20年)	458,000,000	514,792,000
第40回利付国債(20年)	390,000,000	435,559,800
第42回利付国債(20年)	480,000,000	548,011,200
第43回利付国債(20年)	1,370,000,000	1,598,310,500
第46回利付国債(20年)	775,000,000	873,456,000
第48回利付国債(20年)	955,000,000	1,101,038,600
第50回利付国債(20年)	918,000,000	1,017,437,760
第52回利付国債(20年)	720,000,000	809,481,600
第54回利付国債(20年)	965,000,000	1,094,474,050
第56回利付国債(20年)	818,000,000	914,720,320
第59回利付国債(20年)	1,455,000,000	1,586,619,300
第61回利付国債(20年)	1,205,000,000	1,232,642,700
第64回利付国債(20年)	1,445,000,000	1,603,184,150
第65回利付国債(20年)	1,420,000,000	1,575,674,600
第70回利付国債(20年)	1,660,000,000	1,928,870,200
第72回利付国債(20年)	1,583,000,000	1,786,906,230
第74回利付国債(20年)	2,424,000,000	2,734,999,200

第75回利付国債(20年)	1,250,000,000	1,409,550,000
第78回利付国債(20年)	1,260,000,000	1,390,561,200
第82回利付国債(20年)	1,340,000,000	1,507,232,000
第84回利付国債(20年)	1,740,000,000	1,934,549,400
第85回利付国債(20年)	1,720,000,000	1,929,857,200
第88回利付国債(20年)	1,717,000,000	1,965,638,770
第90回利付国債(20年)	1,690,000,000	1,911,897,000
第92回利付国債(20年)	2,339,000,000	2,611,914,520
第93回利付国債(20年)	1,687,000,000	1,858,466,680
第95回利付国債(20年)	1,660,000,000	1,890,175,600
第97回利付国債(20年)	1,697,000,000	1,906,392,830
第99回利付国債(20年)	2,118,000,000	2,347,633,560
第100回利付国債(20年)	1,387,000,000	1,552,177,830
第101回利付国債(20年)	635,000,000	728,097,350
第102回利付国債(20年)	1,982,000,000	2,267,903,500
第105回利付国債(20年)	1,510,000,000	1,661,120,800
第106回利付国債(20年)	200,000,000	222,744,000
第107回利付国債(20年)	1,968,000,000	2,157,695,520
第109回利付国債(20年)	2,100,000,000	2,236,311,000
第111回利付国債(20年)	2,196,000,000	2,427,853,680
第113回利付国債(20年)	2,192,000,000	2,387,219,520
第114回利付国債(20年)	2,153,000,000	2,337,576,690
第116回利付国債(20年)	2,760,000,000	3,030,866,400
第118回利付国債(20年)	450,000,000	479,623,500
第119回利付国債(20年)	860,000,000	890,581,600
第120回利付国債(20年)	1,080,000,000	1,085,886,000
第121回利付国債(20年)	1,900,000,000	1,991,865,000
第122回利付国債(20年)	1,250,000,000	1,291,387,500
第123回利付国債(20年)	1,640,000,000	1,766,001,200
第124回利付国債(20年)	1,150,000,000	1,219,736,000
第125回利付国債(20年)	1,210,000,000	1,319,190,400
第126回利付国債(20年)	80,000,000	84,724,000
第127回利付国債(20年)	1,340,000,000	1,398,316,800
第128回利付国債(20年)	580,000,000	603,374,000
第129回利付国債(20年)	1,900,000,000	1,946,949,000
第130回利付国債(20年)	820,000,000	838,081,000
第131回利付国債(20年)	1,660,000,000	1,669,428,800
第132回利付国債(20年)	450,000,000	451,606,500
第133回利付国債(20年)	2,330,000,000	2,376,786,400
第134回利付国債(20年)	900,000,000	914,940,000
第135回利付国債(20年)	380,000,000	380,273,600
第136回利付国債(20年)	710,000,000	698,760,700
第137回利付国債(20年)	260,000,000	259,433,200
第138回利付国債(20年)	280,000,000	270,278,400
第139回利付国債(20年)	1,750,000,000	1,718,290,000
第140回利付国債(20年)	3,330,000,000	3,317,812,200
第141回利付国債(20年)	2,200,000,000	2,188,626,000
国債証券 小計	373,613,000,000	395,178,775,790
地方債証券		
第1回東京都公募公債(20年)	100,000,000	106,707,000
第1回東京都公募公債(30年)	100,000,000	105,087,000
第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	110,781,000
第7回東京都公募公債(20年)	100,000,000	112,337,000
第8回東京都公募公債(20年)	100,000,000	114,407,000
第8回東京都公募公債(30年)	400,000,000	417,468,000
第13回東京都公募公債(30年)	500,000,000	484,285,000

第596回東京都公募公債	100,000,000	100,103,000
第598回東京都公募公債	200,000,000	200,262,000
第602回東京都公募公債	200,000,000	201,744,000
第603回東京都公募公債	200,000,000	202,114,000
第604回東京都公募公債	100,000,000	101,174,000
第608回東京都公募公債	600,000,000	609,660,000
第610回東京都公募公債	100,000,000	102,305,000
第613回東京都公募公債	100,000,000	102,316,000
第623回東京都公募公債	200,000,000	205,676,000
第628回東京都公募公債	100,000,000	104,218,000
第629回東京都公募公債	100,000,000	103,823,000
第634回東京都公募公債	106,000,000	112,180,860
第642回東京都公募公債	200,000,000	213,012,000
第643回東京都公募公債	100,000,000	106,297,000
第646回東京都公募公債	100,000,000	107,877,000
第652回東京都公募公債	200,000,000	214,476,000
第653回東京都公募公債	200,000,000	213,038,000
第660回東京都公募公債	700,000,000	750,792,000
第662回東京都公募公債	100,000,000	107,911,000
第668回東京都公募公債	200,000,000	214,882,000
平成16年度第3回北海道公募公債	100,000,000	101,969,000
平成17年度第4回北海道公募公債	100,000,000	102,694,000
平成17年度第9回北海道公募公債	100,000,000	103,803,000
平成19年度第2回北海道公募公債	100,000,000	106,868,000
平成19年度第7回北海道公募公債	100,000,000	107,126,000
平成20年度第12回北海道公募公債	100,000,000	107,979,000
平成20年度第15回北海道公募公債 (5年)	200,000,000	202,188,000
平成20年度第4回北海道公募公債	100,000,000	108,919,000
平成20年度第9回北海道公募公債(5年)	300,000,000	303,201,000
第1回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	116,848,000
第3回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	111,758,000
第7回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	111,882,000
第122回神奈川県公募公債	200,000,000	201,814,000
第129回神奈川県公募公債	100,000,000	102,540,000
第143回神奈川県公募公債	100,000,000	106,218,000
第144回神奈川県公募公債	300,000,000	319,341,000
第147回神奈川県公募公債	100,000,000	107,810,000
第149回神奈川県公募公債	100,000,000	107,625,000
第157回神奈川県公募公債	115,600,000	124,364,792
第3回大阪府公募公債(7年)	200,000,000	204,822,000
第52回大阪府公募公債(5年)	400,000,000	404,648,000
第261回大阪府公募公債(10年)	105,000,000	106,197,000
第262回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,179,000
第267回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	101,978,000
第277回大阪府公募公債(10年)	600,000,000	616,410,000
第299回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	213,616,000
第303回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	107,401,000
第306回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	214,640,000
第313回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	107,230,000
平成19年度第1回京都府公募公債	130,260,000	139,989,119
平成15年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	100,423,000
平成16年度第12回兵庫県公募公債	100,000,000	102,463,000
平成17年度第2回兵庫県公募公債	200,000,000	205,514,000
平成17年度第6回兵庫県公募公債	101,000,000	103,856,280

平成20年度第5回兵庫県公募公債	100,000,000	108,844,000
平成21年度第11回兵庫県公募公債	200,000,000	215,892,000
平成21年度第23回兵庫県公募公債	200,000,000	212,250,000
平成21年度第3回兵庫県公募公債	200,000,000	215,348,000
平成18年度第2回静岡県公募公債	100,000,000	106,314,000
平成18年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	106,306,000
平成19年度第7回静岡県公募公債	100,000,000	107,693,000
平成20年度第1回静岡県公募公債	200,000,000	224,870,000
平成20年度第7回静岡県公募公債	100,000,000	108,245,000
平成21年度第5回静岡県公募公債	300,000,000	318,810,000
平成17年度第2回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	102,727,000
平成18年度第4回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	106,082,000
平成19年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	107,672,000
平成20年度第5回愛知県公募公債(5年)	500,000,000	503,635,000
平成21年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	107,869,000
平成21年度第7回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	215,032,000
平成19年度第3回広島県公募公債	200,000,000	213,974,000
平成20年度第1回広島県公募公債	100,000,000	108,232,000
平成15年度第3回埼玉県公募公債	205,670,000	207,502,519
平成16年度第3回埼玉県公募公債	100,000,000	102,740,000
平成16年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	102,530,000
平成17年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	104,152,000
平成18年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	106,800,000
平成19年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	107,634,000
平成21年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	107,361,000
平成21年度第4回埼玉県公募公債	200,000,000	213,984,000
平成18年度第1回福岡県公募公債	100,000,000	106,956,000
平成19年度第2回福岡県公募公債	100,000,000	107,939,000
平成20年度第9回福岡県公募公債	200,000,000	201,418,000
平成16年度第9回千葉県公募公債	100,000,000	102,938,000
平成18年度第1回千葉県公募公債	200,000,000	212,290,000
平成18年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	106,118,000
平成19年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	106,817,000
平成21年度第2回千葉県公募公債	345,000,000	371,351,100
平成17年度第1回新潟県公募公債	200,000,000	205,818,000
平成19年度第1回岐阜県公募公債(10年)	200,000,000	215,608,000
第1回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,103,000
第2回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,123,000
第4回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,421,000
第6回共同発行市場公募地方債	200,000,000	201,768,000
第7回共同発行市場公募地方債	319,400,000	322,172,392
第12回共同発行市場公募地方債	437,000,000	443,240,360
第15回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,025,000
第20回共同発行市場公募地方債	300,000,000	307,407,000
第21回共同発行市場公募地方債	300,000,000	307,197,000
第22回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,004,000
第23回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,428,000
第27回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,823,000
第29回共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,822,000
第30回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,250,000

第3 1 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,750,000	
第3 2 回共同発行市場公募地方債	300,000,000	312,414,000	
第3 3 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,260,000	
第3 5 回共同発行市場公募地方債	400,000,000	418,056,000	
第3 6 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,629,000	
第3 8 回共同発行市場公募地方債	200,000,000	212,290,000	
第4 0 回共同発行市場公募地方債	300,000,000	320,343,000	
第4 6 回共同発行市場公募地方債	200,000,000	212,948,000	
第5 5 回共同発行市場公募地方債	200,000,000	215,512,000	
第5 6 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,250,000	
第5 7 回共同発行市場公募地方債	300,000,000	321,123,000	
第6 2 回共同発行市場公募地方債	200,000,000	215,970,000	
第6 4 回共同発行市場公募地方債	300,000,000	325,113,000	
第6 5 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,566,000	
第7 3 回共同発行市場公募地方債	300,000,000	323,193,000	
第7 5 回共同発行市場公募地方債	900,000,000	972,990,000	
第7 7 回共同発行市場公募地方債	200,000,000	215,014,000	
平成1 8 年度第2 回大阪市公募公債	200,000,000	212,294,000	
平成1 8 年度第3 回大阪市公募公債	100,000,000	106,646,000	
平成1 8 年度第6 回大阪市公募公債	300,000,000	320,100,000	
平成1 9 年度第1 0 回大阪市公募公債	100,000,000	107,243,000	
平成1 9 年度第5 回大阪市公募公債	100,000,000	107,809,000	
平成2 1 年度第4 回大阪市公募公債	300,000,000	323,298,000	
第1 回名古屋市公募公債(2 0 年)	200,000,000	221,970,000	
第3 回名古屋市公募公債(2 0 年)	100,000,000	110,883,000	
第1 1 回名古屋市公募公債(5 年)	300,000,000	303,237,000	
第1 2 回ひ号名古屋市公募公債	100,000,000	102,908,000	
第4 5 5 回名古屋市公募公債(1 0 年)	100,000,000	105,946,000	
第1 回京都市公募公債(3 0 年)	100,000,000	110,395,000	
第7 回京都市公募公債(2 0 年)	100,000,000	112,327,000	
平成1 8 年度第3 回京都市公募公債	200,000,000	213,830,000	
平成1 5 年度第1 回神戸市公募公債	100,000,000	100,124,000	
平成1 9 年度第1 0 回神戸市公募公債	100,000,000	107,133,000	
第4 回横浜市公募公債(2 0 年)	100,000,000	110,985,000	
第9 回横浜市公募公債(2 0 年)	100,000,000	114,069,000	
第1 4 回横浜市公募公債(2 0 年)	100,000,000	112,426,000	
平成1 7 年度第3 回横浜市公募公債	100,000,000	103,891,000	
平成1 7 年度第4 回横浜市公募公債	200,000,000	208,064,000	
平成1 8 年度第1 回横浜市公募公債	100,000,000	105,582,000	
平成1 8 年度第3 回横浜市公募公債	200,000,000	213,200,000	
平成1 8 年度第4 回横浜市公募公債	300,000,000	320,664,000	
平成2 0 年度第6 回横浜市公募公債	200,000,000	214,372,000	
平成1 8 年度第4 回札幌市公募公債	200,000,000	211,918,000	
第2 回川崎市1 5 年公募公債	100,000,000	108,152,000	
第4 回川崎市1 5 年公募公債	100,000,000	112,057,000	
第1 9 回川崎市公募公債(5 年)	100,000,000	100,428,000	
平成1 5 年度第2 回北九州市公募公債	100,000,000	101,153,000	
平成1 9 年度第2 回北九州市公募公債	100,000,000	106,779,000	
平成1 8 年度第4 回福岡市公募公債	100,000,000	106,069,000	
平成2 0 年度第5 回福岡市公募公債	100,000,000	107,301,000	
平成2 1 年度第7 回福岡市公募公債	200,000,000	201,768,000	
平成1 9 年度第1 回広島市公募公債	100,000,000	107,274,000	
平成2 1 年度第1 回千葉市公募公債	200,000,000	215,272,000	
地方債証券 小計	28,664,930,000	30,140,770,422	
特殊債券			
第1 回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	107,683,000	

第2回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	213,148,000	
第3回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	225,024,000	
第5回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	106,679,000	
第9回日本政策投資銀行債券	100,000,000	100,814,000	
第10回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,316,000	
第15回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	111,332,000	
第16回日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,132,000	
第20回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	111,395,000	
第20回日本政策投資銀行債券	100,000,000	108,171,000	
第23回政府保証日本政策投資銀行債券	400,000,000	430,120,000	
第24回日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,802,000	
第27回日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,355,000	
第30回日本政策投資銀行債券	100,000,000	109,314,000	
第36回日本政策投資銀行債券	100,000,000	110,532,000	
第51回日本政策投資銀行債券	100,000,000	108,200,000	
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	149,810,400	
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	219,242,000	
第5回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	158,000,000	165,239,560	
第7回道路債券	100,000,000	116,795,000	
第8回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,689,000	
第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	114,067,000	
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	110,423,000	
第9回道路債券	100,000,000	116,386,000	
第12回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,245,000	
第13回道路債券	300,000,000	339,225,000	
第16回道路債券	200,000,000	200,134,000	
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	108,799,320	
第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,693,000	
第21回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,256,000	
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	306,336,000	
第23回道路債券	200,000,000	201,698,000	
第23回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	224,968,000	
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	319,689,000	
第26回道路債券	300,000,000	303,714,000	
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	533,450,000	
第27回道路債券	100,000,000	114,394,000	
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	101,457,000	
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	212,774,000	
第30回道路債券	100,000,000	101,712,000	

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	106,615,000	
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	164,565,270	
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	323,193,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,955,000	
第39回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,993,000	
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	323,565,000	
第40回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,355,000	
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	428,196,000	
第42回道路債券	200,000,000	224,022,000	
第44回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	214,524,000	
第45回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	215,406,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	221,796,000	
第48回日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	431,764,000	
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	106,529,000	
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	214,202,000	
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	212,456,000	
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	539,555,000	
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	108,512,000	
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	108,052,000	
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	215,350,000	
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	107,715,000	
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	216,970,000	
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	107,709,000	
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	324,591,000	
第325回政府保証道路債券	100,000,000	101,228,000	
第327回政府保証道路債券	552,000,000	561,279,120	
第329回政府保証道路債券	300,000,000	306,162,000	
第330回政府保証道路債券	100,000,000	102,475,000	
第335回政府保証道路債券	100,000,000	102,443,000	
第336回政府保証道路債券	200,000,000	205,140,000	
第337回政府保証道路債券	100,000,000	102,476,000	
第338回政府保証道路債券	200,000,000	205,978,000	
第339回政府保証道路債券	100,000,000	102,895,000	
第340回政府保証道路債券	100,000,000	108,817,000	
第341回政府保証道路債券	100,000,000	102,780,000	
第346回政府保証道路債券	301,000,000	311,020,290	

第1回政府保証地方公営企業等金融機構債券	300,000,000	322,950,000	
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券	300,000,000	322,017,000	
第2回地方公営企業等金融機構債券(20年)	100,000,000	110,285,000	
第3回公営企業債券(20年)	100,000,000	101,438,000	
第3回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	107,459,000	
第5回公営企業債券(20年)	100,000,000	111,911,000	
第6回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	106,088,000	
第6回公営企業債券	100,000,000	100,043,000	
第6回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	107,092,000	
第7回政府保証地方公営企業等金融機構債券	500,000,000	533,560,000	
第10回公営企業債券	100,000,000	102,177,000	
第11回公営企業債券(20年)	100,000,000	111,498,000	
第11回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,696,000	
第12回公営企業債券	100,000,000	102,223,000	
第15回公営企業債券	100,000,000	102,777,000	
第16回公営企業債券(20年)	100,000,000	110,934,000	
第17回公営企業債券	100,000,000	103,714,000	
第17回公営企業債券(20年)	100,000,000	114,241,000	
第18回公営企業債券(20年)	100,000,000	116,529,000	
第20回公営企業債券	100,000,000	106,303,000	
第22回公営企業債券(20年)	100,000,000	112,593,000	
第24回公営企業債券	100,000,000	106,704,000	
第24回公営企業債券(20年)	200,000,000	222,834,000	
第30回公営企業債券	100,000,000	109,055,000	
第827回政府保証公営企業債券	200,000,000	200,260,000	
第829回政府保証公営企業債券	500,000,000	502,100,000	
第833回政府保証公営企業債券	200,000,000	202,122,000	
第834回政府保証公営企業債券	200,000,000	202,374,000	
第836回政府保証公営企業債券	300,000,000	303,735,000	
第838回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,675,000	
第840回政府保証公営企業債券	200,000,000	204,050,000	
第841回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,456,000	
第843回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,284,000	
第844回政府保証公営企業債券	400,000,000	410,296,000	
第846回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,436,000	
第847回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,566,000	
第849回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,962,000	
第851回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,755,000	
第852回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,872,000	
第858回政府保証公営企業債券	200,000,000	208,100,000	
第861回政府保証公営企業債券	300,000,000	313,980,000	
第863回政府保証公営企業債券	100,000,000	106,224,000	
第865回政府保証公営企業債券	300,000,000	319,404,000	
第866回政府保証公営企業債券	200,000,000	213,198,000	
第875回政府保証公営企業債券	200,000,000	213,150,000	
第883回政府保証公営企業債券	100,000,000	106,167,000	
第884回政府保証公営企業債券	300,000,000	318,651,000	
第885回政府保証公営企業債券	200,000,000	215,752,000	
第886回政府保証公営企業債券	200,000,000	216,996,000	
第3回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	100,594,000	
第187回政府保証首都高速道路債券	193,000,000	195,238,800	

第195回政府保証首都高速道路債券	400,000,000	410,168,000	
第197回政府保証首都高速道路債券	300,000,000	308,889,000	
第199回政府保証首都高速道路債券	200,000,000	206,648,000	
第4回阪神高速道路債券	200,000,000	200,116,000	
第23回中小企業債券	100,000,000	100,092,000	
第10回国際協力銀行債券	300,000,000	303,213,000	
第15回国際協力銀行債券	200,000,000	204,192,000	
第21回国際協力銀行債券	100,000,000	103,623,000	
第27回国際協力銀行債券	100,000,000	106,280,000	
第8回都市再生債券	200,000,000	206,382,000	
第19回都市再生債券	100,000,000	108,710,000	
第27回都市再生債券	300,000,000	302,160,000	
第3回本州四国連絡橋債券	100,000,000	102,388,000	
第7回本州四国連絡橋債券	100,000,000	112,172,000	
第332回東京交通債券	100,000,000	114,432,000	
第342回東京交通債券	100,000,000	114,137,000	
第13回関西国際空港株式会社社債	100,000,000	106,949,000	
第16回関西国際空港株式会社社債	100,000,000	107,806,000	
第51回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	112,205,000	
第14回独立行政法人福祉医療機構債券	200,000,000	214,966,000	
第17回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	108,959,000	
第1回貸付債権担保住宅金融公庫債券	39,866,000	41,832,589	
第1回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	60,140,000	62,716,999	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	73,440,000	78,206,990	
第2回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	62,318,000	65,268,757	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	113,886,000	122,296,481	
第3回貸付債権担保住宅金融公庫債券	21,371,000	22,544,909	
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	30,832,000	32,599,906	
第4回貸付債権担保住宅金融公庫債券	22,351,000	23,457,374	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,255,000	56,115,599	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	126,468,000	134,200,253	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	32,026,000	33,723,698	
第6回貸付債権担保住宅金融公庫債券	47,534,000	49,998,637	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	33,221,000	35,729,185	
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	100,956,000	108,551,929	
第7回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	44,698,000	47,282,885	
第8回貸付債権担保住宅金融公庫債券	25,020,000	26,103,616	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	104,631,000	112,030,504	
第8回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,691,000	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	69,364,000	74,352,658	
第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	49,968,000	53,323,351	
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券	26,442,000	27,347,902	
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	106,539,000	113,987,141	

第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	55,073,000	58,416,481	
第11回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	55,916,000	59,468,902	
第12回貸付債権担保住宅金融公庫債券	33,959,000	35,427,047	
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	56,303,000	59,245,394	
第14回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	215,942,000	
第16回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	117,564,000	123,519,792	
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	120,246,000	126,738,081	
第19回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	64,578,000	68,840,793	
第21回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,810,000	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	132,236,000	142,397,014	
第25回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	215,156,000	
第26回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	194,262,000	207,050,267	
第27回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	66,638,000	70,682,926	
第28回貸付債権担保住宅金融公庫債券	46,069,000	48,260,041	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	71,770,000	75,784,096	
第29回貸付債権担保住宅金融公庫債券	49,253,000	51,677,725	
第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,904,000	76,875,080	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,627,000	77,769,255	
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券	52,145,000	54,368,462	
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	54,809,000	57,103,852	
第32回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	151,134,000	158,303,796	
第33回貸付債権担保住宅金融公庫債券	53,111,000	55,312,982	
第34回貸付債権担保住宅金融公庫債券	111,896,000	117,381,141	
第35回貸付債権担保住宅金融公庫債券	55,100,000	57,656,640	
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,361,000	86,605,062	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	52,533,000	55,256,836	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,811,000	87,829,737	
第38回貸付債権担保住宅金融公庫債券	102,634,000	108,127,998	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	51,473,000	54,024,001	
第40回貸付債権担保住宅金融公庫債券	105,008,000	110,671,081	
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	53,090,000	56,443,695	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	100,768,000	108,568,450	
第43回貸付債権担保住宅金融公庫債券	98,742,000	106,064,706	
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,186,000	93,279,379	
第44回貸付債権担保住宅金融公庫債券	46,899,000	50,454,882	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	180,810,000	189,436,445	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,514,000	95,251,502	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	182,256,000	192,263,676	
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,027,000	96,097,354	

第5 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	49,915,000	53,363,627
第5 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	278,814,000	288,823,422
第5 2 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,170,000
第5 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	51,636,000	54,846,726
第5 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	190,290,000	193,682,870
第5 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,538,000	97,418,187
第5 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,037,000	97,613,927
第5 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	192,652,000	196,358,624
第6 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	289,992,000	293,115,213
第6 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,976,000	97,304,748
第6 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,410,000	98,232,985
第6 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	300,000,000	301,008,000
第1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	103,804,000	110,636,379
第2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	104,360,000	111,535,793
第3 回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	38,409,000	40,930,934
第6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	51,431,000	54,798,701
第5 回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	87,466,000	92,338,730
第1 5 回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	113,490,000	119,174,714
第3 6 回国民生活債券	100,000,000	100,077,000
第6 回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	101,636,000
第1 0 回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	106,860,000
第4 回政府保証新東京国際空港債券	100,000,000	100,431,000
第5 回新東京国際空港債券	100,000,000	101,188,000
第3 回沖縄振興開発金融公庫債券	200,000,000	203,100,000
第5 回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	102,479,000
い第7 0 3号商工債	200,000,000	202,208,000
い第7 1 1号商工債	100,000,000	101,312,000
い第7 1 2号商工債	100,000,000	101,135,000
い第7 2 2号商工債	100,000,000	100,861,000
い第7 2 3号商工債	100,000,000	100,891,000
い第7 2 5号商工債	200,000,000	201,068,000
い第7 2 7号商工債	200,000,000	202,892,000
い第7 3 3号商工債	500,000,000	506,585,000
い第6 9 7号農林債	200,000,000	200,948,000
い第6 9 8号農林債	100,000,000	100,583,000
い第7 0 4号農林債	200,000,000	202,090,000
い第7 0 7号農林債	100,000,000	101,390,000
い第7 0 8号農林債	300,000,000	303,720,000
い第7 1 2号農林債	300,000,000	303,474,000
い第7 1 3号農林債	100,000,000	101,060,000
い第7 1 4号農林債	400,000,000	405,124,000
い第7 2 3号農林債	200,000,000	201,882,000
い第7 2 8号農林債	400,000,000	404,384,000

い第735号農林債	400,000,000	403,484,000	
第240回信金中金債(5年)	200,000,000	202,668,000	
第243回信金中金債(5年)	100,000,000	101,120,000	
第225回信金中金債(5年)	500,000,000	503,040,000	
第227回信金中金債(5年)	100,000,000	100,865,000	
第228回信金中金債(5年)	400,000,000	404,088,000	
第229回信金中金債(5年)	300,000,000	303,171,000	
第230回信金中金債(5年)	100,000,000	101,026,000	
第231回信金中金債(5年)	100,000,000	101,232,000	
第233回信金中金債(5年)	500,000,000	507,130,000	
第236回信金中金債(5年)	200,000,000	202,168,000	
第149号商工債(3年)	200,000,000	200,468,000	
第1回政府保証東日本高速道路債券	137,000,000	142,727,970	
第3回政府保証東日本高速道路債券	100,000,000	106,186,000	
第1回政府保証中日本高速道路債券	250,000,000	260,452,500	
第1回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,463,000	
第3回政府保証中日本高速道路債券	163,000,000	170,403,460	
第5回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	216,130,000	
第6回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	107,491,000	
第10回政府保証中日本高速道路債券	100,000,000	106,267,000	
第12回政府保証中日本高速道路債券	103,000,000	109,722,810	
第14回政府保証中日本高速道路債券	100,000,000	107,517,000	
第19回政府保証中日本高速道路債券	124,000,000	132,027,760	
第21回政府保証中日本高速道路債券	200,000,000	215,686,000	
第25回政府保証中日本高速道路債券	200,000,000	214,612,000	
第46回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,198,000	
第8回政府保証西日本高速道路債券	233,000,000	248,291,790	
第15回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	108,451,000	
第19回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	106,682,000	
第5回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	205,738,000	
第3回東京地下鉄株式会社社債	200,000,000	212,140,000	
特殊債券 小計	43,298,251,000	45,384,806,564	
社債券			
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	100,515,000	
第1回ジェイ・ピー・モルガン・チェース・アンド・カ	100,000,000	102,108,000	
第2回ジェー・ピー・モルガン・チェース・アンド・カ	100,000,000	103,277,000	
第3回ジェイ・ピー・モルガン・チェース・アンド・カ	300,000,000	315,855,000	
第9回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク	100,000,000	105,428,000	
第11回シティグループ・インク円貨社債(2003)	200,000,000	200,274,000	
第17回シティグループ・インク円貨債券	100,000,000	102,582,000	
第22回シティグループ・インク円貨債券	300,000,000	306,588,000	
第3回バンク・オブ・アメリカ・コーポレーション円貨	100,000,000	102,446,000	
第4回パークレイズ・バンク・ピエールシー円貨社債(2010)	300,000,000	300,780,000	
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	304,563,000	
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	305,904,000	

第10回コーペラティブ・セントラル・ライファイゼン・ボエレン	300,000,000	303,138,000	
第18回コーペラティブ・セントラル・ライファイゼン・ボエレン	300,000,000	302,427,000	
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	101,640,000	
H S B C 銀行 P L C 第1回円貨社債	100,000,000	101,797,000	
H S B C 銀行 P L C 第2回円貨社債	100,000,000	101,507,000	
第11回森永乳業株式会社無担保社債	100,000,000	101,527,000	
第3回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,192,000	
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	214,408,000	
第2回サントリーホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,237,000	
第19回味の素株式会社無担保社債	100,000,000	101,848,000	
第38回住友化学株式会社無担保社債	100,000,000	105,893,000	
第33回三菱化学株式会社無担保社債	200,000,000	210,354,000	
第35回三菱化学株式会社無担保社債	100,000,000	106,535,000	
第38回三菱化学株式会社無担保社債	100,000,000	109,077,000	
第35回三井化学株式会社無担保社債	100,000,000	105,968,000	
第11回武田薬品工業株式会社無担保社債	200,000,000	200,970,000	
第26回新日本石油株式会社無担保社債	200,000,000	212,344,000	
第16回住友ゴム工業株式会社無担保社債	100,000,000	107,932,000	
第12回旭硝子株式会社無担保社債	200,000,000	217,858,000	
第30回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	111,798,000	
第55回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	105,224,000	
第62回住友金属工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,855,000	
第46回株式会社神戸製鋼所無担保社債	100,000,000	101,320,000	
第15回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	103,748,000	
第18回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	110,084,000	
第12回株式会社クボタ無担保社債	200,000,000	200,032,000	
第13回株式会社クボタ無担保社債	100,000,000	99,783,000	
第45回株式会社東芝無担保社債	200,000,000	211,846,000	
日本電産株式会社第1回無担保社債	100,000,000	100,201,000	
第7回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	201,300,000	
第10回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	198,300,000	
第11回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	98,813,000	
第20回三洋電機株式会社無担保社債	200,000,000	203,422,000	
第22回三菱重工株式会社無担保社債	200,000,000	215,394,000	
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	204,104,000	
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	101,308,000	
第1回日本生命2012基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,736,000	
第9回トヨタ自動車株式会社無担保社債	300,000,000	303,705,000	
第5回アイシン精機株式会社無担保社債	100,000,000	102,271,000	
第43回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	106,911,000	
第66回伊藤忠商事株式会社無担保社債	200,000,000	200,274,000	
第89回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	101,874,000	
第61回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	105,993,000	

第63回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	111,541,000	
第30回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	104,417,000	
第33回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	105,855,000	
第67回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	106,457,000	
第68回三菱商事株式会社無担保社債	200,000,000	213,412,000	
第69回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	108,434,000	
第33回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	106,472,000	
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	102,558,000	
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	108,426,000	
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	221,436,000	
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	112,826,000	
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	202,316,000	
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	405,276,000	
株式会社東京三菱銀行第8回無担保社債	100,000,000	103,383,000	
第9回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	115,016,000	
第11回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	200,000,000	214,522,000	
株式会社三菱東京UFJ銀行第12回無担保社債	200,000,000	215,918,000	
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	300,000,000	311,754,000	
第72回株式会社東京三菱銀行無担保社債	100,000,000	100,943,000	
第100回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	200,000,000	201,016,000	
第104回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	101,390,000	
第110回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	106,761,000	
第4回株式会社りそな銀行無担保社債	200,000,000	223,728,000	
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	101,445,000	
第11回株式会社静岡銀行無担保社債	100,000,000	102,676,000	
第9回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債	200,000,000	212,844,000	
第7回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	106,161,000	
第8回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	110,972,000	
第11回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	105,267,000	
中央三井信託銀行第3回無担保社債	100,000,000	103,105,000	
第6回株式会社セブン銀行無担保社債	200,000,000	201,166,000	
第7回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	101,734,000	
第8回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	102,871,000	
第9回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	103,697,000	
第20回株式会社三井住友銀行無担保社債	300,000,000	330,336,000	
第24回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	105,830,000	
第43回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	100,173,000	
第45回株式会社三井住友銀行無担保社債	200,000,000	201,962,000	

第8回株式会社みずほ銀行無担保社債	200,000,000	212,112,000	
第9回株式会社みずほ銀行無担保社債	100,000,000	110,019,000	
第10回株式会社みずほ銀行無担保社債	200,000,000	214,610,000	
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	202,652,000	
第22回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	200,000,000	199,936,000	
第19回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	200,000,000	200,684,000	
第17回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	109,260,000	
第21回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	106,158,000	
第41回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	101,152,000	
第113回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	106,467,000	
第162回オリックス株式会社無担保社債	200,000,000	202,386,000	
第19回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,547,000	
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	306,126,000	
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	207,160,000	
第34回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	109,655,000	
第58回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	114,346,000	
第65回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	100,222,000	
第87回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	106,914,000	
第81回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,060,000	
第63回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	109,497,000	
第41回小田急電鉄株式会社無担保社債	200,000,000	213,852,000	
第42回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	106,944,000	
第2回東日本旅客鉄道株式会社社債	200,000,000	219,080,000	
第7回東日本旅客鉄道株式会社社債	200,000,000	227,392,000	
第9回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	113,975,000	
第15回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	115,153,000	
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	200,000,000	227,486,000	
第34回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	115,929,000	
第52回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	106,889,000	
第3回西日本旅客鉄道株式会社社債	200,000,000	224,698,000	
第5回西日本旅客鉄道株式会社社債	200,000,000	226,924,000	
第3回東海旅客鉄道株式会社普通社債	100,000,000	111,980,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	112,403,000	
第11回東海旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	102,677,000	
第21回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	104,667,000	
第28回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	106,354,000	
第41回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,283,000	
第42回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	220,274,000	
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	104,788,000	

第48回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	102,274,000	
第51回日本電信電話株式会社電信電話債券	300,000,000	318,693,000	
第53回日本電信電話株式会社電信電話債券	300,000,000	318,414,000	
第60回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	105,153,000	
第15回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	108,979,000	
第15回株式会社エヌ・ティ・ティ・ドコモ無担保社債	200,000,000	217,432,000	
第425回東京電力株式会社社債	100,000,000	103,161,000	
第514回東京電力株式会社社債	100,000,000	98,217,000	
第515回東京電力株式会社社債	200,000,000	194,974,000	
第516回東京電力株式会社社債	100,000,000	97,196,000	
第522回東京電力株式会社社債	300,000,000	289,878,000	
第524回東京電力株式会社社債	100,000,000	95,030,000	
第526回東京電力株式会社社債	300,000,000	284,016,000	
第527回東京電力株式会社社債	100,000,000	98,567,000	
第528回東京電力株式会社社債	100,000,000	91,070,000	
第532回東京電力株式会社社債	200,000,000	187,418,000	
第533回東京電力株式会社社債	200,000,000	196,386,000	
第535回東京電力株式会社社債	200,000,000	187,110,000	
第537回東京電力株式会社社債	100,000,000	88,988,000	
第544回東京電力株式会社社債	200,000,000	186,444,000	
第547回東京電力株式会社社債	100,000,000	88,992,000	
第552回東京電力株式会社社債	100,000,000	99,126,000	
第408回中部電力株式会社社債	100,000,000	109,249,000	
第409回中部電力株式会社社債	200,000,000	222,776,000	
第474回中部電力株式会社社債	100,000,000	103,865,000	
第475回中部電力株式会社社債	200,000,000	210,160,000	
第486回中部電力株式会社社債	200,000,000	211,136,000	
第440回関西電力株式会社社債	100,000,000	102,027,000	
第444回関西電力株式会社社債	100,000,000	102,027,000	
第449回関西電力株式会社社債	100,000,000	104,207,000	
第451回関西電力株式会社社債	100,000,000	103,244,000	
第453回関西電力株式会社社債	100,000,000	103,366,000	
第467回関西電力株式会社社債	100,000,000	102,007,000	
第472回関西電力株式会社社債	100,000,000	102,324,000	
第306回中国電力株式会社社債	200,000,000	222,696,000	
第310回中国電力株式会社社債	100,000,000	111,715,000	
第349回中国電力株式会社社債	200,000,000	211,858,000	
第286回北陸電力株式会社社債	100,000,000	107,481,000	
第368回東北電力株式会社社債	50,000,000	52,480,500	
第376回東北電力株式会社社債	100,000,000	108,378,000	
第431回東北電力株式会社社債	100,000,000	105,804,000	
第445回東北電力株式会社社債	100,000,000	104,312,000	
第229回四国電力株式会社社債	100,000,000	111,488,000	
第245回四国電力株式会社社債	100,000,000	107,626,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	97,356,000	
第268回四国電力株式会社社債	100,000,000	105,162,000	
第346回九州電力株式会社社債	100,000,000	105,860,000	
第384回九州電力株式会社社債	100,000,000	103,158,000	
第394回九州電力株式会社社債	100,000,000	105,010,000	
第400回九州電力株式会社社債	100,000,000	104,296,000	
第405回九州電力株式会社社債	100,000,000	104,711,000	

第408回九州電力株式会社社債	100,000,000	103,949,000	
第258回北海道電力株式会社社債	200,000,000	222,336,000	
第300回北海道電力株式会社社債	100,000,000	105,159,000	
第11回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	105,116,000	
第19回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	105,808,000	
第21回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	104,952,000	
第23回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	105,937,000	
第17回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	224,532,000	
第25回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	101,803,000	
第18回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	210,968,000	
第22回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	106,011,000	
第27回東邦瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	101,940,000	
第30回東邦瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	106,193,000	
社債券 小計	28,050,000,000	29,238,076,500	
合計	473,626,181,000	499,942,429,276	

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

「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

(単位 : 円)

(平成24年 2月20日現在) (平成25年 2月18日現在)

資産の部		
流動資産		
預金	1,215,979,564	1,762,537,752
コール・ローン	116,848,821	730,816,424
株式	222,660,583,298	234,314,972,282
投資証券	4,526,595,370	5,509,170,013
派生商品評価勘定	104,468,528	31,787,735
未収入金	2,051,859,409	1,046,233
未収配当金	365,623,265	361,869,278
未収利息	160	1,001
差入委託証拠金	869,508,461	1,100,403,497
流動資産合計	231,911,466,876	243,812,604,215
資産合計	231,911,466,876	243,812,604,215
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	20,769,164	2,550,068
未払解約金	1,066,150,705	954,653,601
流動負債合計	1,086,919,869	957,203,669
負債合計	1,086,919,869	957,203,669
純資産の部		
元本等		
元本	178,000,383,872	140,691,895,418
剰余金		
剰余金又は欠損金 ()	52,824,163,135	102,163,505,128
元本等合計	230,824,547,007	242,855,400,546
純資産合計	230,824,547,007	242,855,400,546
負債純資産合計	231,911,466,876	243,812,604,215

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自 平成24年 2月21日 至 平成25年 2月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 (2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。

	(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	(1) 先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。 (2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。
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。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。

(追加情報)

自 平成24年 2月21日 至 平成25年 2月18日
当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更およ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）および「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。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成24年 2月20日現在)	(平成25年 2月18日現在)
1. 受益権総数	平成24年 2月20日における受益権の総数 178,000,383,872口	平成25年 2月18日における受益権の総数 140,691,895,418口
2. 1単位当たり純資産額	1.2968円 (1万口 = 12,968円)	1.7262円 (1万口 = 17,262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24年 2月21日 至 平成25年 2月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、投資証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成25年 2月18日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（株式、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(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 12/03	2,345,808,163		2,408,467,203	62,659,040
	FTSE 12/03	434,235,361		445,982,382	11,747,021
	DJ EUR 12/03	785,245,356		808,644,060	23,398,704
	小計	3,565,288,880		3,663,093,645	97,804,765
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。

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		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	米ドル	473,814,000		477,600,000	3,786,000
	オーストラリアドル	33,964,000		34,364,000	400,000
	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
	香港ドル	10,180,000		10,270,000	90,000
	ユーロ	82,925,600		84,160,000	1,234,400
	小計	693,379,050		700,032,500	6,653,450
	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
	オーストラリアドル	84,789,886		85,788,471	998,585
	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
	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
	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
	イスラエルシェケル	12,279,634		12,455,058	175,424
	ユーロ	265,674,693		269,629,429	3,954,736
	小計	2,029,229,155		2,049,988,006	20,758,851
	合計	2,722,608,205		2,750,020,506	14,105,401

(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25年2月18日現在)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引
株式関連

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	SP500 13/03	1,610,087,240		1,636,844,703	26,757,463
	FTSE 13/03	279,267,495		284,251,547	4,984,052
	DJ EUR 13/03	555,397,713		552,860,685	2,537,028
	小計	2,444,752,448		2,473,956,935	29,204,487
	合計	2,444,752,448		2,473,956,935	29,204,487

(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。

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		

市場取引以外の取引	為替予約取引 売建				
	米ドル	375,282,400		375,240,000	42,400
	カナダドル	46,576,350		46,575,000	1,350
	オーストラリアドル	38,595,240		38,596,000	760
	英ポンド	188,944,470		188,942,000	2,470
	スイスフラン	40,631,840		40,632,000	160
	ユーロ	150,107,880		150,120,000	12,120
	小計	840,138,180		840,105,000	33,180
合計	840,138,180		840,105,000	33,180	

(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。

(自 平成24年2月21日 至 平成25年2月18日)
該当事項はありません。

(その他の注記)

(平成24年 2月20日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	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日現在の元本の内訳	
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

(平成25年 2月18日現在)

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	178,000,383,872円
同期中における追加設定元本額	5,372,650,222円
同期中における一部解約元本額	42,681,138,676円
平成25年 2月18日現在の元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	5,050,418,190円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	178,575,058円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	761,699,274円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	493,014,441円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	21,761,975円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	1,966,053円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	3,359,794円

スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	3,753,775円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	4,703,724円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	1,649,704円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	3,536,874円
外国株式指数ファンド	239,679,842円
三井住友・DC全海外株式インデックスファンド	691,150円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	29,445,553,141円
バランスファンドVA(安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	218,423,070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 >	16,815,825,701円
SMAM・バランスファンドVA25 < 適格機関投資家専用 >	7,979,639,828円
SMAM・バランスファンドVA37.5 < 適格機関投資家専用 >	4,508,195,873円
SMAM・バランスファンドVA50 < 適格機関投資家専用 >	18,288,928,965円
SMAM・バランスファンドVL30 < 適格機関投資家限定 >	61,330,948円
SMAM・バランスファンドVL50 < 適格機関投資家限定 >	263,974,230円
世界6資産バランスファンドVA < 適格機関投資家限定 >	46,350,691円
SMAM・バランスファンドVA75 < 適格機関投資家専用 >	2,129,815,881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 >	143,201,316円
SMAM・インデックス・バランスVA25 < 適格機関投資家専用 >	467,801,740円
SMAM・インデックス・バランスVA50 < 適格機関投資家専用 >	2,129,893,390円
SMAM・バランスファンドVA40 < 適格機関投資家専用 >	3,552,313,716円
SMAM・バランスファンドVA35 < 適格機関投資家専用 >	5,332,009,906円
SMAM・バランスVA株40T < 適格機関投資家限定 >	882,219,863円
三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	2,367,141,376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)	7,329,498,755円
SMAM・グローバルバランス40VA < 適格機関投資家限定 >	428,635,943円
SMAM・バランスファンドVA20 < 適格機関投資家専用 >	1,985,913,896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)	28,445,784,888円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A < 適格機関投資家専用 >	69,293,138円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A < 適格機関投資家専用 >	43,877,533円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A < 適格機関投資家専用 >	17,835,303円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L < 適格機関投資家専用 >	173,627,443円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L < 適格機関投資家専用 >	408,026,473円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T < 適格機関投資家専用 >	368,484,356円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA < 適格機関投資家限定 >	11,550,034円
SMAM・FGグローバルバランス25VA < 適格機関投資家限定 >	10,697,758円
SMAM・グローバル・マルチアセット・グロース・ファンド(安定成長型) < 適格機関投資家限定 >	1,240,409円
合計	140,691,895,418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				
REGENERON PHARMACEUTICALS	7,652	164.93	1,262,044.36	
ANADARKO PETROLEUM CORP	51,613	82.08	4,236,395.04	
APACHE CORPORATION	40,471	76.85	3,110,196.35	
BAKER HUGHES INC	45,652	46.58	2,126,470.16	
CABOT OIL & GAS CORPORATION	22,200	54.31	1,205,682.00	
CAMERON INTERNATIONAL CORP	24,953	64.58	1,611,464.74	
CHESAPEAKE ENERGY CORPORATION	67,103	20.01	1,342,731.03	

CHEVRON CORPORATION	203,135	114.96	23,352,399.60
CIMAREX ENERGY CO	9,230	64.95	599,488.50
COBALT INTERNATIONAL ENERGY	20,600	25.09	516,854.00
CONCHO RESOURCES INC	10,582	96.44	1,020,528.08
CONOCOPHILLIPS	119,381	57.02	6,807,104.62
CONSOL ENERGY INC	23,362	34.08	796,176.96
CONTINENTAL RESOURCES, INC.	5,100	83.88	427,788.00
CORE LABORATORIES N.V.	4,790	133.23	638,171.70
DENBURY RESOURCES INC	39,546	18.44	729,228.24
DEVON ENERGY CORPORATION	40,045	59.25	2,372,666.25
DIAMOND OFFSHORE DRILLING, INC.	7,356	74.75	549,861.00
ENSCO PLC-CL A	24,100	64.35	1,550,835.00
EOG RESOURCES INC	27,915	129.19	3,606,338.85
EXXON MOBIL CORPORATION	478,096	88.36	42,244,562.56
FMC TECHNOLOGIES INC	24,590	51.80	1,273,762.00
HALLIBURTON CO	96,238	42.70	4,109,362.60
HELMERICH & PAYNE INC	11,300	67.83	766,479.00
HESS CORPORATION	31,815	67.42	2,144,967.30
HOLLYFRONTIER CORP	19,800	55.55	1,099,890.00
KINDER MORGAN INC	66,607	37.52	2,499,094.64
KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	10,347	81.77	846,074.19
MARATHON OIL CORP	72,469	34.66	2,511,775.54
MARATHON PETROLEUM CORPORATION	35,486	82.56	2,929,724.16
MURPHY OIL CORPORATION	19,207	61.35	1,178,349.45
NABORS INDUSTRIES LTD	31,184	17.68	551,333.12
NATIONAL-OILWELL VARCO INC.	44,022	69.33	3,052,045.26
NEWFIELD EXPLORATION CO	14,787	27.15	401,467.05
NOBLE CORPORATION	25,918	39.11	1,013,652.98
NOBLE ENERGY INC	18,599	112.02	2,083,459.98
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	83,953	84.71	7,111,658.63
OCEANEERING INTL INC	10,800	63.54	686,232.00
PEABODY ENERGY CORP	27,953	24.40	682,053.20
PHILLIPS 66	61,495	64.17	3,946,134.15
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	12,175	130.56	1,589,568.00
PLAINS EXPLORATION & PRODUCTION COMPANY	14,100	47.64	671,724.00
RANGE RESOURCES CORPORATION	16,582	70.36	1,166,709.52
ROWAN COMPANIES PLC	13,345	35.84	478,284.80
SCHLUMBERGER LTD	137,551	80.03	11,008,206.53
SOUTHWESTERN ENERGY COMPANY	36,375	33.04	1,201,830.00
SPECTRA ENERGY CORPORATION	67,863	29.46	1,999,243.98
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	16,400	26.64	436,896.00
ULTRA PETROLEUM CORP	16,448	16.00	263,168.00
VALERO ENERGY CORP	58,242	47.29	2,754,264.18
WEATHERFORD INTL LTD	78,118	12.89	1,006,941.02
WHITING PETROLEUM CORP	11,800	49.82	587,876.00
WILLIAMS COS INC	68,943	35.11	2,420,588.73
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	22,049	88.23	1,945,383.27
AIRGAS INC	6,440	98.40	633,696.00
ALBEMARLE CORPORATION	9,500	65.42	621,490.00
ALCOA INC	115,699	9.32	1,078,314.68
ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	9,880	33.81	334,042.80
BALL CORPORATION	15,706	45.54	715,251.24
CELANESE CORPORATION	16,023	50.16	803,713.68
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	6,538	216.67	1,416,588.46
CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	14,155	28.85	408,371.75
CROWN HOLDINGS INC	14,900	39.79	592,871.00
DOW CHEMICAL	123,778	32.16	3,980,700.48
DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	96,410	46.94	4,525,485.40

EASTMAN CHEMICAL COMPANY	15,554	73.46	1,142,596.84	
ECOLAB INC	29,824	75.21	2,243,063.04	
FMC CORPORATION	14,600	59.47	868,262.00	
FREEMONT-MCMORAN COPPER-B	98,008	35.04	3,434,200.32	
INTERNATIONAL PAPER CO	43,081	42.17	1,816,725.77	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	8,042	73.88	594,142.96	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	33,159	60.40	2,002,803.60	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	4,993	101.09	504,742.37	
MEADWESTVACO CORP	18,515	35.65	660,059.75	
MONSANTO CO	55,146	103.51	5,708,162.46	
MOSAIC CO/THE	32,688	62.18	2,032,539.84	
NEWMONT MINING CORP	51,823	43.27	2,242,381.21	
NUCOR CORP	32,703	48.12	1,573,668.36	
OWENS-ILLINOIS INC	16,039	26.21	420,382.19	
PPG INDUSTRIES INC	14,846	139.39	2,069,383.94	
PRAXAIR INC	30,786	110.15	3,391,077.90	
ROCK-TENN COMPANY CL A	7,500	83.69	627,675.00	
SEALED AIR CORP	18,538	19.40	359,637.20	
SIGMA-ALDRICH	12,406	77.15	957,122.90	
UNITED STATES STEEL CORPORATION	15,109	23.16	349,924.44	
VULCAN MATERIALS CO	12,853	55.03	707,300.59	
WEYERHAEUSER CO	55,743	30.65	1,708,522.95	
3M COMPANY	67,978	103.23	7,017,368.94	
AGCO CORP	10,654	53.68	571,906.72	
AMETEK INC	25,560	41.91	1,071,219.60	
BOEING CO	73,983	75.03	5,550,944.49	
CATERPILLAR INC	67,660	95.61	6,468,972.60	
CUMMINS INC	18,512	119.21	2,206,815.52	
DANAHER CORP	61,215	61.68	3,775,741.20	
DEERE & CO	38,453	89.75	3,451,156.75	
DOVER CORP	19,440	72.56	1,410,566.40	
EATON CORP PLC	47,793	60.87	2,909,159.91	
EMERSON ELECTRIC CO	75,187	58.29	4,382,650.23	
FASTENAL COMPANY	28,436	52.79	1,501,136.44	
FLOWSERVE CORPORATION	5,269	159.95	842,776.55	
FLUOR CORP	17,331	64.51	1,118,022.81	
GENERAL DYNAMICS CORP	31,217	66.40	2,072,808.80	
GENERAL ELECTRIC CO	1,093,545	23.29	25,468,663.05	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	76,694	70.11	5,377,016.34	
ILLINOIS TOOL WORKS	43,498	63.25	2,751,248.50	
INGERSOLL-RAND PLC	31,464	53.03	1,668,535.92	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	12,890	49.35	636,121.50	
JOY GLOBAL INC	10,760	62.86	676,373.60	
KBR, INC.	16,285	31.61	514,768.85	
L-3 COMMUNICATIONS HLDGS INC	9,770	77.67	758,835.90	
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	28,353	87.87	2,491,378.11	
MASCO CORP	35,966	20.00	719,320.00	
NORTHROP GRUMMAN CORP	24,333	65.63	1,596,974.79	
PACCAR INC	35,484	48.09	1,706,425.56	
PALL CORPORATION	12,626	68.51	865,007.26	
PARKER HANNIFIN CORPORATION	15,786	96.04	1,516,087.44	
PENTAIR LTD-REGISTERED	22,179	52.91	1,173,490.89	
PRECISION CASTPARTS CORP	14,998	185.47	2,781,679.06	
QUANTA SERVICES INC	20,759	28.74	596,613.66	
RAYTHEON COMPANY	34,627	53.98	1,869,165.46	
ROCKWELL AUTOMATION INC	14,309	90.76	1,298,684.84	
ROCKWELL COLLINS INC.	14,444	59.10	853,640.40	
ROPER INDUSTRIES INC	10,190	120.04	1,223,207.60	

SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	10,000	33.45	334,500.00
SPX CORP	5,088	79.37	403,834.56
TEXTRON INC	29,568	29.39	869,003.52
THE ADT CORPORATION	24,359	46.40	1,130,257.60
TRANSDIGM GROUP INC	5,300	143.77	761,981.00
TYCO INTERNATIONAL LTD	47,681	32.05	1,528,176.05
UNITED TECHNOLOGIES CORP	89,639	90.78	8,137,428.42
VW GRAINGER INC	6,070	229.48	1,392,943.60
XYLEM INC	18,566	28.28	525,046.48
AVERY DENNISON CORP	11,162	39.73	443,466.26
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3,229	314.19	1,014,519.51
CINTAS CORP	10,936	44.27	484,136.72
DUN & BRADSTREET CORP	4,801	81.75	392,481.75
EQUIFAX INC	12,942	55.17	714,010.14
IHS INC-CLASS A	6,140	104.91	644,147.40
IRON MOUNTAIN INC	14,247	34.71	494,513.37
MANPOWERGROUP	7,792	54.73	426,456.16
NETFLIX INC	5,278	189.61	1,000,761.58
NIELSEN HOLDINGS NV	12,400	32.40	401,760.00
PITNEY BOWES INC	20,973	13.45	282,086.85
REPUBLIC SERVICES INC	31,894	31.31	998,601.14
ROBERT HALF INTL INC	12,891	35.52	457,888.32
STERICYCLE, INC.	8,651	97.12	840,185.12
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	15,200	54.87	834,024.00
WASTE MANAGEMENT INC	45,929	36.69	1,685,135.01
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	14,300	59.41	849,563.00
C.H.ROBINSON WORLDWIDE, INC.	17,202	57.79	994,103.58
CSX CORPORATION	109,308	22.79	2,491,129.32
DELTA AIR LINES INC	21,520	14.45	310,964.00
EXPEDITORS INTL WASH INC	21,578	42.26	911,886.28
FEDEX CORP	30,731	106.42	3,270,393.02
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	30,375	19.51	592,616.25
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	10,300	66.80	688,040.00
KANSAS CITY SOUTHERN	11,340	97.77	1,108,711.80
NORFOLK SOUTHERN CORP	32,873	71.50	2,350,419.50
SOUTHWEST AIRLINES	18,800	11.60	218,080.00
UNION PACIFIC CORP	49,011	136.83	6,706,175.13
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	8,200	26.37	216,234.00
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	75,138	83.48	6,272,520.24
AUTOLIV INC	10,100	67.42	680,942.00
BORGWARNER INC	11,800	76.11	898,098.00
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	31,800	39.98	1,271,364.00
FORD MOTOR COMPANY	367,519	13.02	4,785,097.38
GENERAL MOTORS CO	80,273	27.76	2,228,378.48
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	26,234	14.10	369,899.40
HARLEY-DAVIDSON INC	23,486	52.66	1,236,772.76
JOHNSON CONTROLS INC	71,117	32.14	2,285,700.38
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	11,250	60.32	678,600.00
BEAM INC	15,062	61.50	926,313.00
COACH INC	29,345	48.40	1,420,298.00
D.R.HORTON INC	29,248	23.66	692,007.68
FOSSIL INC	5,500	104.86	576,730.00
GARMIN LTD	11,416	39.14	446,822.24
HASBRO INC	12,914	40.53	523,404.42
LEGGETT & PLATT INC	14,915	30.70	457,890.50
LULULEMON ATHLETICA INC	10,380	67.85	704,283.00
MATTEL INC	35,203	40.85	1,438,042.55
MOHAWK INDUSTRIES INC	6,403	107.80	690,243.40

NEWELL RUBBERMAID INC	29,044	24.18	702,283.92	
NIKE INC -CL B	75,214	54.95	4,133,009.30	
POLARIS INDUSTRIES INC	7,000	85.88	601,160.00	
PULTE GROUP INC	37,000	20.31	751,470.00	
PVH CORP	7,230	120.10	868,323.00	
RALPH LAUREN CORPORATION	6,228	176.07	1,096,563.96	
STANLEY BLACK & DECKER INC	16,641	78.46	1,305,652.86	
TOLL BROTHERS INC	15,339	37.08	568,770.12	
UNDER ARMOUR INC	8,300	49.55	411,265.00	
VF CORP	9,075	157.88	1,432,761.00	
WHIRLPOOL CORP	7,784	111.33	866,592.72	
CARNIVAL CORP	45,677	36.92	1,686,394.84	
DARDEN RESTAURANTS INC	13,740	45.15	620,361.00	
H&R BLOCK INC	29,592	25.10	742,759.20	
INTL GAME TECHNOLOGY	29,160	16.27	474,433.20	
LAS VEGAS SANDS CORP	42,039	52.90	2,223,863.10	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	27,647	41.23	1,139,885.81	
MCDONALD'S CORPORATION	104,510	93.90	9,813,489.00	
MGM MIRAGE	38,000	12.88	489,440.00	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	15,571	35.67	555,417.57	
STARBUCKS CORP	78,846	54.34	4,284,491.64	
STARWOOD HOTELS & RESORTS	20,380	62.26	1,268,858.80	
WYNN RESORTS LTD	8,164	122.96	1,003,845.44	
YUM! BRANDS INC	47,052	63.99	3,010,857.48	
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	19,920	15.15	301,788.00	
CBS CORP-CL B	61,229	44.64	2,733,262.56	
CHARTER COMMUNICATTION-A	4,300	79.54	342,022.00	
COMCAST CORP-CL A	219,105	41.24	9,035,890.20	
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	60,371	39.41	2,379,221.11	
DIRECTV	64,955	49.19	3,195,136.45	
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-A	15,630	70.30	1,098,789.00	
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-C	9,530	63.01	600,485.30	
DISH NETWORK CORP.	21,864	36.93	807,437.52	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	44,125	12.57	554,651.25	
LIBERTY GLOBAL INC-A	13,840	65.61	908,042.40	
LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	12,063	60.26	726,916.38	
LIBERTY MEDIA CORP	11,100	111.08	1,232,988.00	
MCGRAW-HILL COMPANIES INC	25,528	44.95	1,147,483.60	
NEWS CORP-CL A	161,905	28.91	4,680,673.55	
NEWS CORPORATION-CLASS B	45,731	29.32	1,340,832.92	
OMNICOM GROUP	26,888	57.71	1,551,706.48	
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	8,800	62.16	547,008.00	
SIRIUS XM RADIO INC	392,000	3.15	1,234,800.00	
THE WALT DISNEY CO.	176,438	55.61	9,811,717.18	
TIME WARNER CABLE, INC.	31,607	86.94	2,747,912.58	
TIME WARNER INC	98,273	53.52	5,259,570.96	
VIACOM INC-CLASS B	47,959	59.46	2,851,642.14	
VIRGIN MEDIA INC	26,277	44.97	1,181,676.69	
ADVANCE AUTO PARTS	7,338	79.00	579,702.00	
AMAZON.COM INC	37,433	265.12	9,924,236.96	
AUTOZONE INC	3,582	373.70	1,338,593.40	
BED BATH & BEYOND INC	23,439	57.70	1,352,430.30	
BEST BUY COMPANY INC	30,816	16.87	519,865.92	
CARMAX INC	24,222	39.36	953,377.92	
DICK'S SPORTING GOODS INC	9,600	48.44	465,024.00	
DOLLAR GENERAL CORP	26,500	44.37	1,175,805.00	
DOLLAR TREE INC	24,470	41.12	1,006,206.40	
EXPEDIA INC	10,691	64.61	690,745.51	

FAMILY DOLLAR STORES	10,136	55.94	567,007.84
GAMESTOP CORP-CL A	11,747	25.37	298,021.39
GAP INC/THE	33,505	32.88	1,101,644.40
GENUINE PARTS CO	15,884	71.44	1,134,752.96
HOME DEPOT INC	156,073	67.52	10,538,048.96
J.C.PENNEY CO INC (HLDG CO)	15,697	19.80	310,800.60
KOHL'S CORP	22,771	46.34	1,055,208.14
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION-A	52,572	21.58	1,134,503.76
LIMITED BRANDS	25,103	44.06	1,106,038.18
LKQ CORPORATION	32,000	23.25	744,000.00
LOWE'S COMPANIES INC	121,573	39.14	4,758,367.22
MACY'S INC	41,422	39.12	1,620,428.64
NORDSTROM INC	16,335	55.40	904,959.00
O'REILLY AUTOMOTIVE INC NEW	12,170	101.32	1,233,064.40
PETSMART INC	11,691	64.81	757,693.71
PRICELINE.COM INC	5,145	702.26	3,613,127.70
ROSS STORES INC	23,726	59.90	1,421,187.40
SEARS HOLDINGS CORP	3,910	47.36	185,177.60
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	9,110	166.70	1,518,637.00
STAPLES INC	71,576	12.95	926,909.20
TARGET CORP	64,433	61.71	3,976,160.43
TIFFANY & CO	12,907	64.78	836,115.46
TJX COMPANIES INC	76,249	45.01	3,431,967.49
TRACTOR SUPPLY COMPANY	7,630	103.77	791,765.10
ULTA SALON COSMETICS & FRAGRANCE INC	6,020	87.96	529,519.20
URBAN OUTFITTERS, INC.	12,600	41.29	520,254.00
COSTCO WHOLESALE CORP	44,797	102.17	4,576,909.49
CVS CAREMARK CORPORATION	131,931	51.12	6,744,312.72
KROGER CO	54,787	27.89	1,528,009.43
SAFEWAY INC	23,549	20.42	480,870.58
SYSCO CORP	60,799	32.07	1,949,823.93
WALGREEN CO	92,721	41.15	3,815,469.15
WAL-MART STORES INC	192,658	69.30	13,351,199.40
WHOLE FOODS MARKET INC	17,794	88.12	1,568,007.28
ALTRIA GROUP INC	210,373	34.38	7,232,623.74
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	68,503	32.57	2,231,142.71
BROWN-FORMAN CORPORATION	13,092	65.24	854,122.08
BUNGE LIMITED	15,360	74.91	1,150,617.60
CAMPBELL SOUP CO	19,279	39.40	759,592.60
COCA-COLA CO/THE	420,374	37.42	15,730,395.08
COCA-COLA ENTERPRISES INC	30,304	36.26	1,098,823.04
CONAGRA FOODS INC	42,233	33.73	1,424,519.09
CONSTELLATION BRANDS INC-A	16,723	43.39	725,610.97
DR.PEPPER SNAPPLE GROUP, INC	21,170	42.91	908,404.70
GENERAL MILLS INC	66,876	44.59	2,982,000.84
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTERS, INC.	13,550	44.42	601,891.00
HJ HEINZ CO	33,353	72.28	2,410,754.84
HORMEL FOODS CORPORATION	15,200	36.08	548,416.00
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	11,440	92.40	1,057,056.00
KELLOGG CO	26,128	59.77	1,561,670.56
KRAFT FOODS GROUP INC	57,888	47.17	2,730,576.96
LORILLARD INC	40,880	41.46	1,694,884.80
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	12,600	64.69	815,094.00
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	20,610	78.95	1,627,159.50
MOLSON COORS BREWING COMPANY	15,225	43.53	662,744.25
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	174,716	26.72	4,668,411.52
MONSTER BEVERAGE CORPORATION	15,000	51.08	766,200.00
PEPSICO INC	161,197	73.68	11,876,994.96

PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	174,650	89.99	15,716,753.50
REYNOLDS AMERICAN INC	34,513	43.58	1,504,076.54
THE HERSHEY COMPANY	16,410	80.93	1,328,061.30
TYSON FOODS INC-CL A	29,800	24.01	715,498.00
AVON PRODUCTS INC	43,990	20.57	904,874.30
CHURCH & DWIGHT CO INC	14,070	59.88	842,511.60
CLOROX COMPANY	13,141	81.75	1,074,276.75
COLGATE-PALMOLIVE CO	49,044	110.02	5,395,820.88
ENERGIZER HOLDINGS INC	6,597	90.54	597,292.38
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	24,522	63.11	1,547,583.42
HERBALIFE LTD	12,650	38.74	490,061.00
KIMBERLY-CLARK CORP	40,945	91.20	3,734,184.00
PROCTER & GAMBLE CO	285,545	76.54	21,855,614.30
AETNA INC	34,739	49.20	1,709,158.80
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	20,004	86.01	1,720,544.04
AMERISOURCEBERGEN CORP	25,918	46.60	1,207,778.80
BARD(C.R.) INC	8,340	100.79	840,588.60
BAXTER INTERNATIONAL INC	56,766	68.17	3,869,738.22
BECTON DICKINSON & CO	21,018	88.49	1,859,882.82
BOSTON SCIENTIFIC CORP	145,525	7.54	1,097,258.50
CARDINAL HEALTH INC	34,505	46.70	1,611,383.50
CAREFUSION CORPORATION	22,145	32.80	726,356.00
CERNER CORP	15,510	87.93	1,363,794.30
CIGNA CORP	29,952	61.08	1,829,468.16
COVENTRY HEALTH CARE INC	14,313	46.19	661,117.47
COVIDIEN PLC	49,407	63.62	3,143,273.34
DAVITA HEALTH PARTNERS INC	10,178	117.46	1,195,507.88
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	15,409	42.80	659,505.20
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	12,450	86.36	1,075,182.00
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	84,046	55.59	4,672,117.14
HCA HOLDINGS, INC.	22,300	36.28	809,044.00
HENRY SCHEIN INC	9,450	88.68	838,026.00
HOLOGIC INC	28,280	21.95	620,746.00
HOSPIRA INC	17,533	29.13	510,736.29
HUMANA INC.	16,773	77.99	1,308,126.27
INTUITIVE SURGICAL INC	4,114	569.21	2,341,729.94
LABORATORY CRP OF AMR HLDGS	9,803	89.84	880,701.52
MCKESSON CORP	24,224	103.42	2,505,246.08
MEDTRONIC INC	105,940	47.12	4,991,892.80
OMNICARE INC	11,095	39.57	439,029.15
PATTERSON COS INC	8,832	37.22	328,727.04
QUEST DIAGNOSTICS	16,316	57.32	935,233.12
RESMED INC	15,500	42.66	661,230.00
ST JUDE MEDICAL INC	32,450	41.53	1,347,648.50
STRYKER CORP	32,127	63.85	2,051,308.95
UNITEDHEALTH GROUP INC	107,001	57.32	6,133,297.32
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	11,367	70.05	796,258.35
WELLPOINT INC	33,846	62.70	2,122,144.20
ZIMMER HOLDINGS INC	18,097	75.90	1,373,562.30
ABBOTT LABORATORIES	162,282	35.08	5,692,852.56
ABBVIE INC	162,382	37.58	6,102,315.56
ACTAVIS INC	13,000	85.24	1,108,120.00
ALLERGAN INC	31,810	108.02	3,436,116.20
AMGEN INC	79,869	83.64	6,680,243.16
BIOGEN IDEC INC	23,189	168.74	3,912,911.86
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	173,753	36.58	6,355,884.74
CELGENE CORP	44,582	98.77	4,403,364.14
ELI LILLY & CO	108,261	53.59	5,801,706.99

FOREST LABORATORIES, INC.	27,330	36.00	983,880.00
GILEAD SCIENCES INC	156,776	41.58	6,518,746.08
ILLUMINA INC	12,489	48.73	608,588.97
JOHNSON & JOHNSON	285,564	76.16	21,748,554.24
LIFE TECHNOLOGIES CORPORATION	18,083	63.50	1,148,270.50
MERCK & CO. INC.	315,322	41.42	13,060,637.24
MYLAN INC	43,600	29.22	1,273,992.00
PERRIGO CO	9,150	113.64	1,039,806.00
PFIZER INC	773,601	27.29	21,111,571.29
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	37,712	74.43	2,806,904.16
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	22,308	45.61	1,017,467.88
WARNER CHILCOTT PLC	21,500	14.59	313,685.00
WATERS CORP	8,921	92.61	826,173.81
BB & T CORPORATION	72,007	30.27	2,179,651.89
COMERICA INC	21,050	34.83	733,171.50
FIFTH THIRD BANCORP	95,538	16.06	1,534,340.28
FIRST REPUBLIC BANK/CA	9,100	37.11	337,701.00
HUDSON CITY BANCORP INC	51,969	8.71	452,649.99
KEYCORP	97,315	9.48	922,546.20
M & T BANK CORP	12,138	104.83	1,272,426.54
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	46,868	13.59	636,936.12
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	34,000	12.95	440,300.00
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	54,645	63.87	3,490,176.15
REGIONS FINANCIAL CORPORATION	145,022	7.85	1,138,422.70
SUNTRUST BANKS INC	55,109	28.12	1,549,665.08
US BANCORP	196,343	33.91	6,657,991.13
WELLS FARGO & COMPANY	519,969	35.16	18,282,110.04
AFFILIATED MANAGERS GROUP	5,280	146.51	773,572.80
AMERICAN EXPRESS COMPANY	105,558	61.69	6,511,873.02
AMERIPRISE FINANCIAL INC	21,867	68.77	1,503,793.59
BANK OF AMERICA CORP	1,115,218	12.03	13,416,072.54
BANK OF NEW YORK MELLON CORP(THE)	122,197	27.99	3,420,294.03
BLACKROCK INC	13,800	242.95	3,352,710.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	60,022	54.03	3,242,988.66
CIT GROUP INC	20,200	42.65	861,530.00
CITIGROUP INC	303,841	43.84	13,320,389.44
CME GROUP INC.	33,140	58.54	1,940,015.60
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	53,530	39.15	2,095,699.50
EATON VANCE CORP	12,400	40.71	504,804.00
FRANKLIN RESOURCES INC	15,584	144.56	2,252,823.04
GOLDMAN SACHS GROUP INC	47,148	154.99	7,307,468.52
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	7,508	156.46	1,174,701.68
INVESCO LIMITED	46,239	27.36	1,265,099.04
JPMORGAN CHASE & CO	393,285	48.88	19,223,770.80
LEGG MASON INC	12,803	27.52	352,338.56
LEUCADIA NATIONAL CORPORATION	21,984	27.06	594,887.04
MOODY'S CORP	21,168	46.80	990,662.40
MORGAN STANLEY	153,454	23.87	3,662,946.98
NASDAQ STOCK MARKET INC	13,480	31.08	418,958.40
NORTHERN TRUST CORP	22,405	53.47	1,197,995.35
NYSE EURONEXT	24,829	37.58	933,073.82
SCHWAB (CHARLES) CORP	112,236	16.90	1,896,788.40
SEI INVESTMENTS COMPANY	14,524	28.25	410,303.00
SLM CORPORATION	50,461	18.96	956,740.56
STATE STREET CORP	49,071	57.24	2,808,824.04
T ROWE PRICE GROUP INC	26,324	73.13	1,925,074.12
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	21,694	20.12	436,483.28
ACE LIMITED	34,916	86.50	3,020,234.00

AFLAC INC	48,465	49.34	2,391,263.10
ALLEGHANY CORPORATION	1,360	376.76	512,393.60
ALLSTATE CORP	50,246	45.85	2,303,779.10
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	145,249	38.35	5,570,299.15
AON PLC	31,131	57.00	1,774,467.00
ARCH CAPITAL GROUP LTD.	13,600	47.56	646,816.00
ASSURANT INC	8,889	41.84	371,915.76
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	12,503	40.25	503,245.75
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	95,663	99.77	9,544,297.51
CHUBB CORP	27,777	83.77	2,326,879.29
CINCINNATI FINANCIAL CORP	16,226	44.84	727,573.84
EVEREST RE GROUP LTD	5,643	121.05	683,085.15
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL INC-CL A	21,361	25.85	552,181.85
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	41,986	24.20	1,016,061.20
LINCOLN NATIONAL CORP	27,627	30.33	837,926.91
LOEWS CORPORATION	32,038	43.91	1,406,788.58
MARSH & MCLENNAN COS	55,407	36.12	2,001,300.84
METLIFE INC	88,163	36.44	3,212,659.72
PARTNERRE LTD	6,343	85.75	543,912.25
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	30,228	31.69	957,925.32
PROGRESSIVE CORP	60,083	24.19	1,453,407.77
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	48,029	57.28	2,751,101.12
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	4,963	84.53	419,522.39
TORCHMARK CORPORATION	9,408	56.21	528,823.68
TRAVELERS COS INC(THE)	39,913	80.39	3,208,606.07
UNUM GROUP	28,370	24.46	693,930.20
W.R.BERKLEY CORPORATION	12,784	41.57	531,430.88
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	18,098	36.69	664,015.62
XL GROUP PLC	30,600	28.67	877,302.00
CBRE GROUP INC-A	32,800	24.28	796,384.00
LENNAR CORP-CL A	17,000	40.20	683,400.00
ACCENTURE PLC-CL A	65,764	74.16	4,877,058.24
ACTIVISION BLIZZARD INC	44,020	14.37	632,567.40
ADOBE SYSTEMS INC	50,217	38.64	1,940,384.88
AKAMA I TECHNOLOGIES	18,666	38.49	718,454.34
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	5,050	155.41	784,820.50
ANSYS INC	9,900	75.62	748,638.00
AUTODESK INC	22,734	39.00	886,626.00
AUTOMATIC DATA PROCESSING	50,060	61.22	3,064,673.20
BMC SOFTWARE INC	16,578	41.37	685,831.86
CA INC	33,313	25.05	834,490.65
CITRIX SYSTEMS INC	19,098	72.66	1,387,660.68
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATION	31,311	76.87	2,406,876.57
COMPUTER SCIENCES CORP	15,762	48.07	757,679.34
EBAY INC	120,064	56.70	6,807,628.80
ELECTRONIC ARTS INC	33,781	16.97	573,263.57
EQUINIX INC	4,920	224.53	1,104,687.60
F5 NETWORKS INC	8,311	101.72	845,394.92
FACEBOOK INC-A	102,160	28.32	2,893,171.20
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	24,012	36.49	876,197.88
FISERV INC	14,185	80.87	1,147,140.95
GOOGLE INC-CL A	27,121	793.17	21,511,563.57
INTL BUSINESS MACHINES CORP	112,416	200.98	22,593,367.68
INTUIT INC	29,033	62.07	1,802,078.31
LINKEDIN CORP-A	8,100	162.66	1,317,546.00
MASTERCARD INC-CL A	11,159	523.13	5,837,607.67
MICROSOFT CORP	781,465	28.02	21,896,649.30
NUANCE COMMUNICATIONS INC	25,200	18.72	471,744.00

ORACLE CORPORATION	404,547	34.81	14,082,281.07	
PAYCHEX INC	33,344	33.97	1,132,695.68	
RACKSPACE HOSTING INC	11,400	59.00	672,600.00	
RED HAT INC	19,920	53.93	1,074,285.60	
SAIC INC	31,400	12.24	384,336.00	
SALESFORCE.COM, INC.	13,520	175.03	2,366,405.60	
SYMANTEC CORPORATION	72,986	22.53	1,644,374.58	
SYNOPSYS INC	14,584	34.54	503,731.36	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	16,119	23.27	375,089.13	
VERIFONE SYSTEMS INC	10,600	32.72	346,832.00	
VERISIGN INC	16,618	46.13	766,588.34	
VISA INC	54,630	157.99	8,630,993.70	
VMWARE INC	8,400	74.95	629,580.00	
WESTERN UNION COMPANY	64,004	14.40	921,657.60	
YAHOO! INC	118,508	21.00	2,488,668.00	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	35,168	42.25	1,485,848.00	
AMPHENOL CORPORATION -CL A	16,578	70.42	1,167,422.76	
APPLE INC	97,084	460.25	44,682,911.00	
ARROW ELECTRONICS INC	10,490	40.82	428,201.80	
AVAGO TECHNOLOGIES LTD.	24,800	35.14	871,472.00	
AVNET INC	15,000	36.18	542,700.00	
CISCO SYSTEMS INC	554,515	20.99	11,639,269.85	
CORNING INC	156,120	12.79	1,996,774.80	
DELL INC	154,851	13.78	2,133,846.78	
DOLBY LABORATORIES INC-CL A	5,800	31.73	184,034.00	
EMC CORP/MASS	217,067	24.00	5,209,608.00	
FLEXTRONICS INTL LTD	67,131	6.67	447,763.77	
FLIR SYSTEMS INC	15,640	26.74	418,213.60	
HARRIS CORP	12,050	47.61	573,700.50	
HEWLETT-PACKARD CO	204,234	16.79	3,429,088.86	
JUNIPER NETWORKS INC	54,856	21.86	1,199,152.16	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	26,645	61.43	1,636,802.35	
NETAPP INC	37,383	36.55	1,366,348.65	
QUALCOMM INC	176,465	65.43	11,546,104.95	
SANDISK CORP	25,777	51.71	1,332,928.67	
SEAGATE TECHNOLOGY	36,968	34.45	1,273,547.60	
TE CONNECTIVITY LTD	43,741	41.03	1,794,693.23	
TERADATA CORP	17,724	62.59	1,109,345.16	
TRIMBLE NAVIGATION LTD	12,700	61.71	783,717.00	
WESTERN DIGITAL CORP	22,323	48.60	1,084,897.80	
XEROX CORP	131,663	7.97	1,049,354.11	
AT&T INC	597,424	35.36	21,124,912.64	
CENTURYLINK INC	64,155	33.02	2,118,398.10	
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	30,017	67.90	2,038,154.30	
FRONTIER COMMUNICATIONS CORPORATION	104,153	4.09	425,985.77	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	15,366	20.81	319,766.46	
METROPCS COMMUNICATIONS INC.	34,131	10.35	353,255.85	
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	12,500	68.70	858,750.00	
SPRINT NEXTEL CORP	316,323	5.91	1,869,468.93	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	295,117	44.40	13,103,194.80	
WINDSTREAM CORPORATION	59,400	8.93	530,442.00	
AES CORPORATION	64,966	11.17	725,670.22	
ALLIANT ENERGY CORP	11,048	46.94	518,593.12	
AMEREN CORPORATION	25,324	33.13	838,984.12	
AMERICAN ELECTRIC POWER	51,187	45.13	2,310,069.31	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	18,000	39.17	705,060.00	
CALPINE CORP	31,000	18.75	581,250.00	
CENTERPOINT ENERGY INC	42,509	20.41	867,608.69	

CMS ENERGY CORPORATION	27,800	25.77	716,406.00	
CONSOLIDATED EDISON INC	30,182	56.58	1,707,697.56	
DOMINION RESOURCES INC/VA	59,093	54.92	3,245,387.56	
DTE ENERGY COMPANY	17,573	64.42	1,132,052.66	
DUKE ENERGY CORP	72,946	68.06	4,964,704.76	
EDISON INTERNATIONAL	31,985	46.68	1,493,059.80	
ENERGEN CORPORATION	7,400	47.88	354,312.00	
ENTERGY CORP	18,071	61.45	1,110,462.95	
EQT CORPORATION	15,680	59.37	930,921.60	
EXELON CORP	89,567	30.62	2,742,541.54	
FIRSTENERGY CORP	44,076	40.57	1,788,163.32	
INTEGRYS ENERGY GROUP, INC.	8,000	56.16	449,280.00	
MDU RESOURCES GROUP INC	17,500	23.95	419,125.00	
NEXTERA ENERGY INC	41,450	72.50	3,005,125.00	
NISOURCE INC	30,692	26.78	821,931.76	
NORTHEAST UTILITIES	32,412	40.94	1,326,947.28	
NRG ENERGY INC	34,025	23.94	814,558.50	
OGE ENERGY CORP	10,100	59.40	599,940.00	
ONEOK INC	19,600	47.75	935,900.00	
P G & E CORPORATION	43,581	42.72	1,861,780.32	
PEPCO HOLDINGS INC	24,434	19.86	485,259.24	
PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	11,844	54.34	643,602.96	
PPL CORPORATION	60,262	30.41	1,832,567.42	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	51,351	31.09	1,596,502.59	
QEP RESOURCES INC	17,566	29.89	525,047.74	
SCANA CORP	13,363	47.92	640,354.96	
SEMPRA ENERGY	23,853	75.62	1,803,763.86	
SOUTHERN CO	90,543	44.11	3,993,851.73	
WISCONSIN ENERGY CORP	24,232	39.78	963,948.96	
XCEL ENERGY INC	49,660	28.11	1,395,942.60	
ALTERA CORPORATION	33,208	35.75	1,187,186.00	
ANALOG DEVICES INC	30,901	46.18	1,427,008.18	
APPLIED MATERIALS INC	130,474	13.74	1,792,712.76	
BROADCOM CORP-CL A	52,436	34.44	1,805,895.84	
CREE INC	10,800	45.72	493,776.00	
INTEL CORP	517,839	21.12	10,936,759.68	
KLA-TENCOR CORPORATION	16,924	55.76	943,682.24	
LAM RESEARCH CORP	19,064	42.50	810,220.00	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	24,854	37.93	942,712.22	
LSI CORPORATION	57,857	7.11	411,363.27	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	48,074	9.35	449,491.90	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	31,200	32.28	1,007,136.00	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	20,208	37.09	749,514.72	
MICRON TECHNOLOGY INC	110,482	7.91	873,912.62	
NVIDIA CORP	62,994	12.74	802,543.56	
TEXAS INSTRUMENTS INC	117,521	33.58	3,946,942.78	
XILINX INC	28,353	38.12	1,080,816.36	
米ドル小計	31,697,539		1,444,766,390.95	
(邦貨換算額 : 円)			(135,547,982,798)	
カナダドル				
ARC RESOURCES LTD	29,500	25.46	751,070.00	
ATHABASCA OIL CORP	36,100	10.19	367,859.00	
BAYTEX ENERGY CORPORATION	13,107	44.47	582,868.29	
BONAVISTA ENERGY CORPORATION	17,500	12.49	218,575.00	
CAMECO CORP	42,043	21.74	914,014.82	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	113,519	31.02	3,521,359.38	
CANADIAN OIL SANDS LTD	49,442	21.55	1,065,475.10	

CENOVUS ENERGY INC	77,933	32.17	2,507,104.61	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	36,445	38.19	1,391,834.55	
ENBRIDGE INC	78,149	44.36	3,466,689.64	
ENCANA CORP	76,844	18.06	1,387,802.64	
ENERPLUS CORP	19,590	12.66	248,009.40	
HUSKY ENERGY INC	36,542	30.42	1,111,607.64	
IMPERIAL OIL LTD	30,751	42.39	1,303,534.89	
MEG ENERGY CORPORATION	14,600	34.49	503,554.00	
NEXEN INC	53,847	27.63	1,487,792.61	
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORPORATION	30,700	24.39	748,773.00	
PEMBINA PIPELINE CORP	29,400	29.17	857,598.00	
PENGROWTH ENERGY CORPORATION	47,700	4.46	212,742.00	
PENN WEST PETROLEUM LTD	49,053	10.20	500,340.60	
SUNCOR ENERGY INC	160,101	31.75	5,083,206.75	
TALISMAN ENERGY INC	107,607	12.47	1,341,859.29	
TOURMALINE OIL CORP	12,700	35.64	452,628.00	
TRANSCANADA CORP	72,742	46.80	3,404,325.60	
VERMILION ENERGY INC	10,000	50.99	509,900.00	
AGNICO-EAGLE MINES	18,150	41.44	752,136.00	
AGRIUM INC	15,473	107.55	1,664,121.15	
BARRICK GOLD CORP	102,908	31.82	3,274,532.56	
CENTERRA GOLD INC	21,000	7.61	159,810.00	
ELDORADO GOLD CORPORATION	67,231	10.10	679,033.10	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	50,710	20.02	1,015,214.20	
FRANCO-NEVADA CORPORATION	14,800	50.46	746,808.00	
GOLDCORP INC	83,656	33.99	2,843,467.44	
IAMGOLD CORP	38,500	7.96	306,460.00	
INMET MINING CORPORATION	5,382	70.47	379,269.54	
KINROSS GOLD CORP	116,427	8.03	934,908.81	
NEW GOLD INC	50,500	9.64	486,820.00	
OSISKO MINING CORPORATION	42,630	5.95	253,648.50	
PAN AMERICAN SILVER CORP	13,972	16.91	236,266.52	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	89,103	42.17	3,757,473.51	
SILVER WHEATON CORPORATION	36,686	35.37	1,297,583.82	
SINO-FOREST CORPORATION-CL A	30,871	0.01	308.71	
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	60,505	33.29	2,014,211.45	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	40,466	7.27	294,187.82	
YAMANA GOLD INC	79,390	15.20	1,206,728.00	
BOMBARDIER INC 'B'	152,759	4.07	621,729.13	
CAE INC	26,614	10.54	280,511.56	
FINNING INTERNATIONAL INC	17,895	26.71	477,975.45	
SNC-LAVALIN GROUP INC	15,781	49.03	773,742.43	
RITCHIE BROS. AUCTIONEERS	9,000	22.55	202,950.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	44,964	100.59	4,522,928.76	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	17,731	119.63	2,121,159.53	
MAGNA INTERNATIONAL INC	22,836	54.40	1,242,278.40	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	11,200	37.11	415,632.00	
TIM HORTONS INC	16,230	49.83	808,740.90	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	38,871	23.80	925,129.80	
THOMSON REUTERS CORP	37,978	30.80	1,169,722.40	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	8,038	68.26	548,673.88	
DOLLARAMA INC	7,800	59.73	465,894.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B	12,600	53.44	673,344.00	
EMPIRE CO LTD A	3,300	62.97	207,801.00	
LOBLAW COMPANIES LTD	12,553	39.86	500,362.58	
METRO INC	10,150	64.33	652,949.50	
SHOPPERS DRUG MART CORP	21,160	42.26	894,221.60	
WESTON (GEORGE) LTD	5,620	72.46	407,225.20	

SAPUTO INC	12,890	49.56	638,828.40	
CATAMARAN CORPORATION	20,800	54.07	1,124,656.00	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	30,184	66.95	2,020,818.80	
BANK OF MONTREAL	66,813	62.61	4,183,161.93	
BANK OF NOVA SCOTIA	118,710	58.51	6,945,722.10	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	41,953	83.49	3,502,655.97	
NATIONAL BANK OF CANADA	16,807	78.97	1,327,248.79	
ROYAL BANK OF CANADA	149,614	63.30	9,470,566.20	
TORONTO-DOMINION BANK	94,558	82.75	7,824,674.50	
CI FINANCIAL CORP	17,600	27.38	481,888.00	
IGM FINANCIAL INC	11,201	44.42	497,548.42	
ONEX CORPORATION	8,923	45.05	401,981.15	
GREAT-WEST LIFE CO INC	29,204	26.78	782,083.12	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANC	9,000	38.13	343,170.00	
INTACT FINANCIAL CORPORATION	13,310	63.94	851,041.40	
MANULIFE FINANCIAL CORP	186,997	15.52	2,902,193.44	
POWER CORP OF CANADA	35,560	26.81	953,363.60	
POWER FINANCIAL CORP	25,030	29.04	726,871.20	
SUN LIFE FINANCIAL INC	61,733	28.88	1,782,849.04	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	58,690	37.26	2,186,789.40	
BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES	27,463	16.91	464,399.33	
CGI GROUP INC - CL A	19,687	27.53	541,983.11	
OPEN TEXT CORPORATION	6,300	57.83	364,329.00	
RESEARCH IN MOTION	48,255	14.23	686,668.65	
BCE INC	25,770	44.53	1,147,538.10	
BELL ALIANT INC.	7,550	27.17	205,133.50	
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	40,100	47.32	1,897,532.00	
TELUS CORPORATION	15,987	67.81	1,084,078.47	
CANADIAN UTILITIES LIMITED	6,340	72.70	460,918.00	
FORTIS INC	19,740	33.04	652,209.60	
TRANSALTA CORP	23,868	16.17	385,945.56	
カナダドル小計	3,967,992		130,995,332.84	
(邦貨換算額 : 円)			(12,203,525,207)	
オーストラリアドル				
CALTEX AUSTRALIA LIMITED	14,400	18.74	269,856.00	
ORIGIN ENERGY LIMITED	112,259	12.16	1,365,069.44	
SANTOS LTD	101,811	12.46	1,268,565.06	
WHITEHAVEN COAL LTD	40,000	3.24	129,600.00	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	68,748	36.90	2,536,801.20	
WORLEY PARSONS LIMITED	20,150	26.64	536,796.00	
ALUMINA LTD	276,977	1.23	340,681.71	
AMCOR LIMITED	127,877	8.91	1,139,384.07	
BHP BILLITON LTD	333,857	38.59	12,883,541.63	
BORAL LIMITED	79,596	4.88	388,428.48	
FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	140,000	5.23	732,200.00	
ILUKA RESOURCES LIMITED	44,000	10.82	476,080.00	
INCITEC PIVOT LTD	157,000	3.15	494,550.00	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	41,803	9.60	401,308.80	
NEWCREST MINING LIMITED	79,379	23.10	1,833,654.90	
ORICA LIMITED	37,773	27.04	1,021,381.92	
OZ MINERALS LIMITED	30,546	7.47	228,178.62	
RIO TINTO LIMITED	45,011	70.15	3,157,521.65	
SIMS METAL MANAGEMENT LTD	18,995	10.85	206,095.75	
LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	16,305	22.68	369,797.40	
ALS LTD	36,500	11.92	435,080.00	
BRAMBLES LIMITED	163,732	8.29	1,357,338.28	
FLIGHT CENTRE LIMITED	5,800	32.16	186,528.00	

ASCIANO LTD	96,966	5.11	495,496.26	
AURIZON HOLDINGS LTD	191,000	4.15	792,650.00	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	97,138	1.62	157,849.25	
TOLL HOLDINGS LIMITED	72,620	5.54	402,314.80	
CROWN LTD	39,265	11.77	462,149.05	
ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD	78,345	3.66	286,742.70	
TABCORP HOLDINGS LIMITED	77,545	3.16	245,042.20	
TATTS GROUP LTD	152,000	3.37	512,240.00	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	57,850	2.29	132,476.50	
METCASH LTD	92,000	4.06	373,520.00	
WESFARMERS LIMITED	104,146	39.55	4,118,974.30	
WOOLWORTHS LIMITED	127,448	32.90	4,193,039.20	
COCA-COLA AMATIL LIMITED	58,117	13.62	791,553.54	
TREASURY WINE ESTATES LTD	72,000	4.94	355,680.00	
COCHLEAR LIMITED	6,213	71.20	442,365.60	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	13,100	29.79	390,249.00	
SONIC HEALTHCARE LTD	38,826	14.01	543,952.26	
CSL LIMITED	52,164	55.84	2,912,837.76	
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	281,353	27.77	7,813,172.81	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	41,400	9.85	407,790.00	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	165,016	67.03	11,061,022.48	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	235,223	29.51	6,941,430.73	
WESTPAC BANKING CORPORATION	318,784	29.15	9,292,553.60	
ASX LTD	17,610	35.55	626,035.50	
MACQUARIE GROUP LTD	32,583	37.80	1,231,637.40	
AMP LIMITED	303,325	5.42	1,644,021.50	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	220,006	5.19	1,141,831.14	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	123,581	13.55	1,674,522.55	
SUNCORP GROUP LTD	135,581	11.21	1,519,863.01	
COMPUTERSHARE LIMITED	49,429	9.73	480,944.17	
TELSTRA CORPORATION LIMITED	457,187	4.63	2,116,775.81	
AGL ENERGY LIMITED	56,569	15.21	860,414.49	
オーストラリアドル小計	5,856,909		96,179,586.52	
(邦貨換算額：円)			(9,281,330,099)	
英ポンド				
AMEC PLC	32,335	10.26	331,757.10	
BG GROUP PLC	351,786	11.42	4,017,396.12	
BP PLC	1,972,550	4.48	8,838,996.55	
PETROFAC LIMITED	27,200	16.44	447,168.00	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	384,813	21.04	8,098,389.58	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	272,266	21.51	5,856,441.66	
TULLOW OIL PLC	95,594	12.63	1,207,352.22	
ANGLO AMERICAN PLC	143,566	20.39	2,927,310.74	
ANTOFAGASTA PLC	39,670	11.19	443,907.30	
BHP BILLITON PLC	218,931	22.30	4,882,161.30	
CRODA INTERNATIONAL PLC	13,900	25.48	354,172.00	
EURASIAN NATURAL RESOURCES CORPORATION	28,187	4.02	113,509.04	
EVRAZ PLC	38,000	2.89	110,010.00	
FRESNILLO PLC	20,000	15.50	310,000.00	
GLENORE INTERNATIONAL PLC	389,100	3.92	1,525,466.55	
JOHNSON MATTHEY PLC	21,878	22.94	501,881.32	
KAZAKHMYS PLC	19,600	7.46	146,314.00	
MELROSE INDUSTRIES PLC	125,000	2.38	297,750.00	
RANDGOLD RESOURCES LTD	9,202	55.80	513,471.60	
REXAM PLC	87,884	4.68	412,088.07	
RIO TINTO PLC	138,767	37.33	5,180,865.94	
VEDANTA RESOURCES PLC	9,900	12.98	128,502.00	

XSTRATA PLC	216,639	11.81	2,558,506.59
BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	38,300	10.55	404,065.00
BAE SYSTEMS PLC	340,792	3.28	1,120,864.88
BALFOUR BEATTY PLC	69,839	2.74	191,428.69
BUNZL PLC	34,408	12.01	413,240.08
COBHAM PLC	122,074	2.20	268,929.02
IMI PLC	34,000	11.60	394,400.00
INVENSYS PLC	85,258	3.51	299,767.12
MEGGITT PLC	80,900	4.51	365,182.60
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	193,003	10.09	1,947,400.27
SMITHS GROUP PLC	39,266	12.38	486,113.08
WEIR GROUP PLC/THE	20,900	21.82	456,038.00
WOLSELEY PLC	28,276	30.77	870,052.52
AGGREKO PLC	27,593	16.80	463,562.40
CAPITA PLC	65,299	8.31	542,961.18
EXPERIAN PLC	106,594	10.85	1,156,544.90
G4S PLC	146,927	2.84	418,448.09
INTERTEK GROUP PLC	16,500	32.75	540,375.00
SERCO GROUP PLC	53,128	5.66	300,704.48
GKN PLC	161,000	2.57	414,253.00
BURBERRY GROUP PLC	45,837	13.54	620,632.98
CARNIVAL PLC	18,247	25.05	457,087.35
COMPASS GROUP PLC	191,573	7.84	1,501,932.32
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	28,299	19.84	561,452.16
TUI TRAVEL PLC	44,000	3.19	140,360.00
WHITBREAD PLC	18,456	26.71	492,959.76
BRITISH SKY BROADCASTING PLC	113,121	8.28	936,641.88
ITV PLC	399,592	1.17	467,522.64
PEARSON PLC	83,353	11.84	986,899.52
REED ELSEVIER PLC	123,978	6.93	859,787.43
WPP PLC	132,650	10.47	1,388,845.50
KINGFISHER PLC	248,225	2.72	676,661.35
MARKS & SPENCER GROUP PLC	169,699	3.87	656,904.82
NEXT PLC	17,194	41.75	717,849.50
SAINSBURY (J) PLC	124,638	3.31	412,551.78
TESCO PLC	833,101	3.64	3,038,735.89
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	237,042	2.61	619,153.70
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	38,400	18.19	698,496.00
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	201,291	33.40	6,724,125.85
DIAGEO PLC	259,357	19.33	5,013,370.81
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	102,396	23.18	2,373,539.28
SABMILLER PLC	98,874	31.86	3,150,125.64
TATE & LYLE PLC	47,800	7.84	374,752.00
UNILEVER PLC	133,007	25.64	3,410,299.48
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	67,268	44.78	3,012,261.04
SMITH & NEPHEW PLC	93,623	7.01	656,297.23
ASTRAZENECA PLC	128,541	29.36	3,773,963.76
GLAXOSMITHKLINE PLC	515,233	14.71	7,581,653.59
SHIRE PLC	59,063	20.60	1,216,697.80
BARCLAYS PLC	1,205,018	3.21	3,871,120.32
HSBC HOLDINGS PLC	1,897,261	7.26	13,781,703.90
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,361,412	0.54	2,383,947.79
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	214,067	3.44	736,818.61
STANDARD CHARTERED PLC	247,582	17.18	4,253,458.76
3I GROUP PLC	100,000	3.00	300,800.00
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	89,400	4.28	382,632.00
HARGREAVES LANSDOWN PLC	24,000	8.48	203,520.00
ICAP PLC	57,716	3.46	199,928.22

INVESTEC PLC	57,200	4.93	282,167.60	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	18,902	12.88	243,457.76	
SCHRODERS PLC	11,800	19.56	230,808.00	
ADMIRAL GROUP PLC	22,600	12.72	287,472.00	
AVIVA PLC	303,709	3.62	1,100,641.41	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	598,945	1.51	905,604.84	
OLD MUTUAL PLC	508,057	1.96	998,840.06	
PRUDENTIAL PLC	264,061	9.45	2,495,376.45	
RESOLUTION LTD	149,468	2.62	392,353.50	
RSA INSURANCE GROUP PLC	383,885	1.32	507,112.08	
STANDARD LIFE PLC	246,048	3.36	827,213.37	
SAGE GROUP PLC (THE)	129,463	3.37	437,455.47	
ARM HOLDINGS PLC	140,400	9.40	1,319,760.00	
BT GROUP PLC	812,771	2.75	2,237,558.56	
INMARSAT PLC	47,300	6.61	312,653.00	
VODAFONE GROUP PLC	5,090,697	1.67	8,542,189.56	
CENTRICA PLC	536,581	3.48	1,872,131.10	
NATIONAL GRID PLC	376,867	6.82	2,570,232.94	
SEVERN TRENT PLC	24,794	15.84	392,736.96	
SSE PLC	98,508	14.08	1,386,992.64	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	69,091	7.20	497,455.20	
英ポンド小計	28,982,286		166,733,451.15	
(邦貨換算額：円)			(24,234,707,124)	
スイスフラン				
TRANSOCEAN LTD	36,955	51.65	1,908,725.75	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	700	260.00	182,000.00	
GIVAUDAN-REG	912	1,100.00	1,003,200.00	
HOLCIM LTD-REG	23,955	72.15	1,728,353.25	
SIKA AG	222	2,323.00	515,706.00	
SYNGENTA AG	9,620	397.90	3,827,798.00	
ABB LTD	227,919	20.97	4,779,461.43	
GEBERIT AG-REG	3,890	223.20	868,248.00	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,140	137.00	293,180.00	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4,900	140.80	689,920.00	
SULZER AG	2,450	157.50	385,875.00	
ADECCO SA-REG	13,934	54.05	753,132.70	
SGS SA	575	2,294.00	1,319,050.00	
KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	5,502	110.40	607,420.80	
CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-BR A	53,943	75.90	4,094,273.70	
THE SWATCH GROUP AG-B	3,231	525.00	1,696,275.00	
THE SWATCH GROUP AG-REG	4,600	92.45	425,270.00	
ARYZTA AG	9,900	53.50	529,650.00	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	160	895.00	143,200.00	
LINDT & SPRUENGLI AG	80	3,400.00	272,000.00	
LINDT & SPRUENGLI AG-REG	11	39,015.00	429,165.00	
NESTLE SA-REGISTERED	333,890	63.20	21,101,848.00	
SONOVA HOLDING AG	4,912	114.60	562,915.20	
ACTELION LTD	10,716	47.72	511,367.52	
LONZA GROUP AG-REG	5,587	60.45	337,734.15	
NOVARTIS AG-REG SHS	238,258	63.90	15,224,686.20	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	72,805	206.00	14,997,830.00	
BANQUE CANTONALE VAUDOISE	340	496.00	168,640.00	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	130,035	26.67	3,468,033.45	
JULIUS BAER GROUP LTD	22,969	37.40	859,040.60	
PARGESA HOLDING SA-BR	2,300	66.50	152,950.00	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,700	213.10	362,270.00	
UBS AG-REGISTERED	377,308	15.23	5,746,400.84	

BALOISE HOLDING AG	4,910	82.15	403,356.50	
SWISS LIFE HOLDING AG	3,160	145.60	460,096.00	
SWISS RE AG	36,334	72.90	2,648,748.60	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	15,227	259.20	3,946,838.40	
SWISS PRIME SITE-REG	5,800	74.85	434,130.00	
SWISSCOM AG-REG	2,441	416.90	1,017,652.90	
スイスフラン小計	1,674,291		98,856,442.99	
(邦貨換算額：円)			(10,041,837,478)	
香港ドル				
HUTCHISON WHAMPOA LTD	219,000	85.50	18,724,500.00	
NWS HOLDINGS LTD	160,500	14.12	2,266,260.00	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	214,000	34.75	7,436,500.00	
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	144,000	15.20	2,188,800.00	
MTR CORPORATION	144,500	31.95	4,616,775.00	
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	21,500	52.80	1,135,200.00	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	78,000	27.25	2,125,500.00	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	100,000	17.58	1,758,000.00	
SANDS CHINA LTD	248,000	37.50	9,300,000.00	
SHANGRI-LA ASIA LTD.	166,000	18.10	3,004,600.00	
SJM HOLDINGS LIMITED	201,000	20.70	4,160,700.00	
WYNN MACAU LTD	158,000	21.00	3,318,000.00	
LI & FUNG LTD	595,200	10.20	6,071,040.00	
BANK OF EAST ASIA	125,220	31.50	3,944,430.00	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	381,500	26.95	10,281,425.00	
HANG SENG BANK LTD	78,300	126.20	9,881,460.00	
WING HANG BANK LIMITED	15,500	86.45	1,339,975.00	
FIRST PACIFIC COMPANY	220,000	9.70	2,134,000.00	
HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	114,600	147.90	16,949,340.00	
AIA GROUP LTD	1,124,000	31.05	34,900,200.00	
CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	143,000	124.10	17,746,300.00	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	224,000	30.40	6,809,600.00	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	102,000	54.05	5,513,100.00	
HOPEWELL HOLDINGS LTD	57,000	34.95	1,992,150.00	
HYSAN DEVELOPMENT CO	62,000	38.65	2,396,300.00	
KERRY PROPERTIES LTD	76,500	40.35	3,086,775.00	
NEW WORLD DEVELOPMENT	371,000	13.98	5,186,580.00	
SINO LAND CO	324,200	14.22	4,610,124.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	161,000	123.50	19,883,500.00	
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	73,000	100.10	7,307,300.00	
SWIRE PROPERTIES LIMITED	130,000	28.75	3,737,500.00	
WHARF HOLDINGS LTD	160,000	68.35	10,936,000.00	
WHEELOK&COMPANY LTD	96,000	42.80	4,108,800.00	
PCCW LIMITED	370,000	3.71	1,372,700.00	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	50,000	50.55	2,527,500.00	
CLP HOLDINGS LTD	186,100	66.35	12,347,735.00	
HONG KONG & CHINA GAS	527,415	21.60	11,392,164.00	
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	147,500	71.20	10,502,000.00	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	20,000	104.10	2,082,000.00	
香港ドル小計	7,789,535		279,074,833.00	
(邦貨換算額：円)			(3,376,805,479)	
シンガポールドル				
FRASER & NEAVE LTD	94,000	9.44	887,360.00	
KEPPEL CORP LTD	151,400	11.72	1,774,408.00	
NOBLE GROUP LTD	409,400	1.19	487,186.00	
SEBACORP INDUSTRIES LTD	109,820	5.45	598,519.00	
SEBACORP MARINE LTD	88,400	4.66	411,944.00	

SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG	150,000	4.00	600,000.00	
YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	160,000	0.96	154,400.00	
COMFORTDELGRO CORP LTD	205,000	1.89	387,450.00	
SINGAPORE AIRLINES LTD	58,266	10.96	638,595.36	
GENTING SINGAPORE PLC	653,000	1.58	1,031,740.00	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	158,250	4.12	651,990.00	
CYCLE & CARRIAGE LTD	11,000	51.60	567,600.00	
OLAM INTERNATIONAL LTD	176,000	1.64	288,640.00	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	676,600	0.65	439,790.00	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	200,000	3.66	732,000.00	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	187,000	15.00	2,805,000.00	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	269,000	9.99	2,687,310.00	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	134,000	19.32	2,588,880.00	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	85,000	7.80	663,000.00	
CAPITALAND LTD	271,000	3.91	1,059,610.00	
CAPITAMALLS ASIA LTD	140,000	2.12	296,800.00	
CITY DEVELOPMENTS LTD	55,000	11.43	628,650.00	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LIMITED	221,000	2.70	596,700.00	
KEPPEL LAND LTD	70,000	4.23	296,100.00	
UOL GROUP LIMITED	48,000	6.23	299,040.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	837,015	3.48	2,912,812.20	
STARHUB LIMITED	57,000	4.09	233,130.00	
シンガポールドル小計	5,675,151		24,718,654.56	
(邦貨換算額：円)			(1,870,213,404)	
ニュージーランドドル				
FLETCHER BUILDING LTD	73,057	8.87	648,015.59	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	100,557	2.77	278,542.89	
SKYCITY ENTERTAINMENT GROUP	61,890	4.02	248,797.80	
TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	187,409	2.22	416,047.98	
CONTACT ENERGY LIMITED	36,256	5.13	185,993.28	
ニュージーランドドル小計	459,169		1,777,397.54	
(邦貨換算額：円)			(140,752,111)	
スウェーデンクローナ				
LUNDIN PETROLEUM AB	23,700	149.50	3,543,150.00	
BOLIDEN AB	26,900	111.80	3,007,420.00	
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	59,867	155.80	9,327,278.60	
ALFA LAVAL AB	35,252	145.40	5,125,640.80	
ASSA ABLOY AB-B	34,616	249.30	8,629,768.80	
ATLAS COPCO AB-A SHS	70,409	185.80	13,081,992.20	
ATLAS COPCO AB-B SHS	39,896	166.50	6,642,684.00	
HEXAGON AB-B SHS	25,800	181.60	4,685,280.00	
SANDVIK AB	105,854	106.10	11,231,109.40	
SCANIA AB-B SHS	31,732	138.10	4,382,189.20	
SKANSKA AB-B SHS	41,190	113.80	4,687,422.00	
SKF AB-B SHARES	40,538	158.00	6,405,004.00	
VOLVO AB-B SHS	142,394	98.00	13,954,612.00	
SECURITAS AB-B SHS	31,057	57.65	1,790,436.05	
ELECTROLUX AB-SER B	25,083	162.00	4,063,446.00	
HUSQVARNA AB-B SHS	39,983	38.18	1,526,550.94	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	98,144	228.90	22,465,161.60	
SWEDISH MATCH AB	20,671	221.70	4,582,760.70	
ELEKTA AB-B SHS	36,600	102.30	3,744,180.00	
GETINGE AB-B SHS	21,738	193.90	4,214,998.20	
NORDEA BANK AB	276,287	73.05	20,182,765.35	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A	144,023	65.35	9,411,903.05	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	50,426	265.30	13,378,017.80	

SWEDBANK AB - A SHARES	84,164	151.90	12,784,511.60	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	12,800	118.00	1,510,400.00	
INVESTOR AB-B SHS	47,549	186.30	8,858,378.70	
KINNEVIK INVESTMENT AB-B	21,000	149.00	3,129,000.00	
RATOS AB-B SHS	18,400	65.05	1,196,920.00	
ERICSSON LM-B SHS	314,069	79.05	24,827,154.45	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	6,215	532.00	3,306,380.00	
TELE2 AB -B SHS	33,698	104.00	3,504,592.00	
TELIASONERA AB	222,871	43.36	9,663,686.56	
スウェーデンクローナ小計	2,182,926		248,844,794.00	
(邦貨換算額：円)			(3,680,414,503)	
ノルウェークローネ				
AKER SOLUTIONS ASA	17,600	107.00	1,883,200.00	
SEADRILL LID	36,281	210.20	7,626,266.20	
STATOIL ASA	115,106	143.60	16,529,221.60	
SUBSEA 7 SA	28,800	131.90	3,798,720.00	
NORSK HYDRO ASA	97,297	27.45	2,670,802.65	
YARA INTERNATIONAL ASA	19,312	287.00	5,542,544.00	
ORKLA ASA	80,750	47.20	3,811,400.00	
DNB ASA	103,819	84.60	8,783,087.40	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	19,200	88.70	1,703,040.00	
TELENOR ASA	71,462	122.70	8,768,387.40	
ノルウェークローネ小計	589,627		61,116,669.25	
(邦貨換算額：円)			(1,031,649,376)	
デンマーククローネ				
NOVOZYMES A/S-B SHARES	24,535	192.00	4,710,720.00	
A P MOLLER - MAERSK A/S	138	44,600.00	6,154,800.00	
A P MOLLER-MAERSK A/S-A	58	42,440.00	2,461,520.00	
DSV A/S	20,180	142.90	2,883,722.00	
CARLSBERG AS-B	11,166	602.50	6,727,515.00	
COLOPLAST-B	11,205	292.00	3,271,860.00	
WILLIAM DEMANT HOLDING	2,860	489.90	1,401,114.00	
NOVO NORDISK A/S-B	42,228	956.00	40,369,968.00	
DANSKE BANK A/S	69,638	108.30	7,541,795.40	
TRYG A/S	2,368	447.10	1,058,732.80	
TDC A/S	51,300	41.68	2,138,184.00	
デンマーククローネ小計	235,676		78,719,931.20	
(邦貨換算額：円)			(1,320,133,246)	
イスラエルシュケル				
DELEK GROUP LTD	530	946.20	501,486.00	
ISRAEL CHEMICALS LIMITED	44,600	49.40	2,203,240.00	
ISRAEL CORPORATION LTD/THE	245	2,648.00	648,760.00	
TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	97,453	141.00	13,740,873.00	
BANK HAPOALIM BM	104,000	16.45	1,710,800.00	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	139,000	13.15	1,827,850.00	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	10,000	39.52	395,200.00	
NICE SYSTEMS LTD	6,400	133.80	856,320.00	
MELLANOX TECHNOLOGIES LTD	3,800	196.10	745,180.00	
BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	203,000	4.73	960,190.00	
イスラエルシュケル小計	609,028		23,589,899.00	
(邦貨換算額：円)			(601,070,626)	
ユーロ				
COMPAGNIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE-VERITA	16,650	20.94	348,651.00	
ENI SPA	263,648	17.69	4,663,933.12	

FUGRO NV-CVA	6,795	37.43	254,370.82
GALP ENERGIA SGPS S.A	25,700	11.75	302,103.50
NESTE OIL OYJ	12,285	11.18	137,346.30
OMV AG	15,199	29.92	454,830.07
REPSOL SA	86,268	15.38	1,326,801.84
SAIPEM	27,165	20.99	570,193.35
TECHNIP S.A.	10,649	80.02	852,132.98
TENARIS S.A.	48,674	15.17	738,384.58
TOTAL SA	220,427	37.30	8,221,927.10
AIR LIQUIDE	32,219	90.11	2,903,254.09
AKZO NOBEL	24,775	52.20	1,293,255.00
ARCELOR MITTAL	104,811	12.11	1,269,261.21
ARKEMA	6,380	84.41	538,535.80
BASF SE	95,059	70.75	6,725,424.25
CRH PLC	75,880	16.09	1,221,288.60
HEIDELBERGCEMENT AG	14,185	49.81	706,625.77
IMERYS SA	3,513	52.60	184,783.80
K+S AG	18,620	33.62	626,004.40
KONINKLIJKE DSM NV	15,446	45.48	702,561.31
LAFARGE SA	19,741	45.64	901,077.94
LANXESS	8,700	66.42	577,854.00
LINDE AG	19,094	132.25	2,525,181.50
SALZGITTER AG	4,539	35.00	158,865.00
SOLVAY SA	6,085	111.45	678,173.25
STORA ENSO OYJ-R SHS	59,712	4.84	289,483.77
THYSSENKRUPP AG	40,126	17.55	704,411.93
UMICORE	12,200	37.16	453,413.00
UPM-KYMMENE OYJ	51,916	8.60	446,477.60
VOESTALPINE AG	10,523	25.98	273,387.54
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	15,235	17.61	268,364.52
ALSTOM RGPT	21,113	33.40	705,174.20
ANDRITZ AG	7,400	50.43	373,182.00
BOSKALIS WESTMINSTER NV	7,300	32.61	238,089.50
BOUYGUES SA	20,431	20.45	417,813.95
BRENTAG AG	5,620	109.60	615,952.00
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	40,724	30.56	1,244,729.06
EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	43,378	34.89	1,513,675.31
FINMECCANICA SPA	46,589	3.99	185,890.11
GEA GROUP AG	18,500	26.45	489,325.00
HOCHTIEF AG	2,837	52.27	148,289.99
KONE OYJ-B	16,335	64.70	1,056,874.50
LEGRAND SA	24,829	33.91	842,075.53
MAN SE	4,188	88.61	371,098.68
METSO OYJ	12,535	33.76	423,181.60
PHILIPS ELECTRONICS NV	107,341	21.94	2,355,061.54
PRYSMIAN SPA	22,100	15.74	347,854.00
REXEL SA	12,000	16.97	203,640.00
SAFRAN SA	23,319	34.21	797,859.58
SCHNEIDER ELECTRIC SA	54,382	54.49	2,963,275.18
SIEMENS AG-REG	85,121	78.11	6,648,801.31
THALES SA	10,375	27.43	284,638.12
VALLUREC	10,347	39.52	408,965.17
VINCI S.A.	48,381	35.00	1,693,576.90
WARTSILA OYJ-B SHARES	17,402	37.07	645,092.14
WENDEL	3,300	80.70	266,310.00
ZARDOYA OTIS SA	15,500	10.58	163,990.00
ZODIAC AEROSPACE	3,360	85.05	285,768.00
BIC	2,800	90.15	252,420.00

BUREAU VERITAS SA	5,950	93.14	554,183.00
EDENRED	16,767	25.29	424,121.26
RANDSTAD HOLDING NV	12,498	31.73	396,624.03
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	37,410	12.88	481,840.80
AEROPORTS DE PARIS (ADP)	2,760	62.27	171,865.20
ATLANTIA SPA	32,810	13.52	443,591.20
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	22,479	15.44	347,075.76
DEUTSCHE POST AG-REG	94,884	16.92	1,605,437.28
FERROVIAL SA	43,568	11.77	513,013.20
FRAPORT AG	4,030	43.42	174,982.60
GROUPE EUROTUNNEL SA	57,800	6.47	374,428.40
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP	90,344	2.64	238,508.16
RYANAIR HOLDINGS PLC	1,656	5.70	9,447.48
TNT EXPRESS NV	39,093	5.54	216,809.77
VOPAK	7,700	53.70	413,490.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	34,307	71.65	2,458,096.55
BAYERISCHE MOTOREN WERKE(BMW)AG-PFD	5,340	49.89	266,412.60
CONTINENTAL AG	11,358	88.55	1,005,750.90
DAIMLER AG	94,053	43.95	4,134,099.61
FIAT INDUSTRIAL SPA	87,004	9.61	836,108.44
FIAT SPA	93,416	4.38	409,909.40
MICHELIN (CGDE)-B	19,035	66.51	1,266,017.85
NOKIAN RENKAAT OYJ	12,083	36.31	438,733.73
PIRELLI & C.	26,502	8.71	230,832.42
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PREF	15,765	64.30	1,013,689.50
PSA PEUGEOT CITROEN	21,455	6.38	137,054.54
RENAULT SA	19,665	48.11	946,181.47
VOLKSWAGEN AG	3,097	167.35	518,282.95
VOLKSWAGEN AG PFD	14,930	177.00	2,642,610.00
ADIDAS AG	21,799	70.10	1,528,109.90
CHRISTIAN DIOR SA	5,530	125.70	695,121.00
HUGO BOSS AG	2,390	87.82	209,889.80
LUXOTTICA GROUP SPA	16,530	33.95	561,193.50
LVMH MOET HENNESSY LOUI V SA	26,358	133.00	3,505,614.00
ACCOR SA	14,767	29.57	436,734.02
OPAP SA	23,406	7.69	179,992.14
SODEXO	10,006	69.00	690,414.00
AXEL SPRINGER AG	4,100	35.66	146,206.00
EUTELSAT COMMUNICATIONS	14,100	26.40	372,310.50
JC DECAUX S.A.	7,300	21.75	158,775.00
KABEL DEUTSCHLAND HOLDINGS AG	8,850	68.44	605,694.00
LAGARDERE S.C.A.	12,171	26.10	317,663.10
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-PFD	10,000	23.98	239,850.00
PUBLICIS GROUPE	18,400	50.00	920,000.00
REED ELSEVIER NV	70,546	11.42	805,635.32
SES	31,896	23.04	735,043.32
WOLTERS KLUWER-CVA	32,815	15.27	501,249.12
INDITEX	22,523	103.50	2,331,130.50
PPR	7,769	172.00	1,336,268.00
CARREFOUR SA	62,533	20.00	1,250,660.00
CASINO GUICHARD PERRACHON	6,060	76.82	465,529.20
COLRUYT NV	7,245	35.23	255,241.35
DELHAIZE GROUP	11,098	36.19	401,636.62
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	62,133	5.80	360,495.66
JERONIMO MARTINS SGPS S.A.	23,700	15.75	373,275.00
KESKO OYJ-B SHS	6,334	24.40	154,549.60
KONINKLIJKE AHOLD NV	105,733	10.91	1,153,547.03
METRO AG	13,448	24.20	325,441.60

ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	83,244	69.69	5,801,274.36
COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	20,429	19.91	406,741.39
DANONE	59,835	50.13	2,999,528.55
DE MASTER BLENDERS 1753 NV-W/I	59,032	8.73	515,408.39
HEINEKEN HOLDING NV	10,689	45.80	489,556.20
HEINEKEN NV	24,000	54.49	1,307,760.00
KERRY GROUP PLC-A	15,498	40.11	621,624.78
PERNOD-RICARD SA	21,734	96.44	2,096,026.96
REMY COINTREAU	2,500	97.42	243,550.00
SUEDZUCKER AG	9,000	32.57	293,130.00
UNILEVER NV-CVA	168,634	29.46	4,967,957.64
BEIERSDORF AG	10,440	65.80	686,952.00
HENKEL AG & CO KGAA	13,070	55.51	725,515.70
HENKEL AG & CO KGAA	18,503	66.06	1,222,308.18
L'OREAL	25,024	110.50	2,765,152.00
CELESIO AG	8,204	13.25	108,703.00
ESSILOR INTERNATIONAL	20,813	72.76	1,514,353.88
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	21,680	52.08	1,129,094.40
FRESENIUS SE & CO KGAA	12,860	89.07	1,145,440.20
BAYER AG	85,717	69.01	5,915,330.17
ELAN CORPORATION PLC	52,166	7.71	402,199.86
GRIFOLS S.A.	15,050	26.31	395,965.50
MERCK KGAA	7,069	103.35	730,581.15
ORION OYJ	10,798	23.10	249,433.80
QIAGEN N.V.	23,000	16.30	375,015.00
SANOFI	123,550	71.90	8,883,245.00
UCB SA	11,797	41.71	492,111.85
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	633,414	0.23	145,685.22
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	575,615	7.52	4,332,078.49
BANCO DE SABADELL SA	307,836	1.70	523,321.20
BANCO ESPIRITO SANTO,S.A(BES)	192,900	1.01	195,986.40
BANCO POPOLARE SPA	173,182	1.39	241,588.89
BANCO POPULAR ESPANOL	610,047	0.66	402,631.02
BANCO SANTANDER SA	1,084,113	5.89	6,389,762.02
BNP PARIBAS	104,022	46.00	4,785,532.11
COMMERZBANK AG	387,990	1.49	578,493.09
CREDIT AGRICOLE SA	104,158	7.18	748,791.86
ERSTE GROUP BANK AG	23,983	23.05	552,808.15
INTESA SANPAOLO	1,062,840	1.37	1,460,342.16
INTESA SANPAOLO-RSP	108,503	1.16	126,405.99
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	96,000	0.00	96.00
KBC GROUPE SA	24,401	29.67	723,977.67
NATIXIS	98,051	2.83	278,366.78
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	5,550	30.45	168,997.50
SOCIETE GENERALE	72,648	29.99	2,178,713.52
UNICREDIT SPA	416,112	4.30	1,790,946.04
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	87,494	3.55	310,778.68
AGEAS	23,100	25.52	589,627.50
DEUTSCHE BANK AG -REG	96,363	35.98	3,467,140.74
DEUTSCHE BOERSE AG	19,917	47.76	951,335.50
EURAZEO	3,748	39.79	149,151.66
EXOR SPA	7,897	22.23	175,550.31
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	8,575	59.70	511,927.50
ING GROEP NV-CVA	395,981	6.56	2,598,427.32
MEDIOBANCA SPA	52,143	5.36	279,747.19
POHJOLA BANK PLC	13,403	12.03	161,238.09
AEGON NV	184,288	5.17	953,506.11
ALLIANZ SE-REG	47,145	102.30	4,822,933.50

ASSICURAZIONI GENERALI	120,073	12.92	1,551,343.16	
AXA SA	183,373	13.45	2,466,366.85	
CNP ASSURANCES	15,184	12.35	187,522.40	
DELTA LLOYD NV	14,100	14.03	197,893.50	
HANNOVER RUECKVERSICHERUNGS AG	6,500	57.57	374,205.00	
MAPFRE SA	93,649	2.35	220,543.39	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	18,551	132.85	2,464,500.35	
SAMPO OYJ-A SHS	44,154	27.90	1,231,896.60	
SCOR SE	16,258	21.40	347,921.20	
VIENNA INSURANCE GROUP AG WIENER VERSICH	3,600	38.17	137,430.00	
IMMOFINANZ AG	89,200	3.33	297,838.80	
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	32,450	20.04	650,298.00	
ATOS	5,851	56.90	332,921.90	
CAP GEMINI SA	15,504	35.77	554,655.60	
DASSAULT SYSTEMES SA	6,263	84.06	526,467.78	
SAP AG	95,383	59.78	5,701,995.74	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	9,300	17.50	162,750.00	
GEMALTO	7,900	69.83	551,657.00	
NOKIA OYJ	393,780	2.99	1,178,189.76	
BELGACOM SA	15,881	20.90	331,912.90	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	289,960	8.19	2,375,642.28	
ELISA OYJ	14,922	15.91	237,409.02	
FRANCE TELECOM SA	190,001	7.56	1,436,597.56	
ILIAD SA	2,490	142.60	355,074.00	
KONINKLIJKE KPN NV	107,258	3.25	348,910.27	
PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	65,052	4.03	262,679.97	
TELECOM ITALIA SPA	973,901	0.61	599,436.06	
TELECOM ITALIA-RNC	644,811	0.54	349,165.15	
TELEFONICA S.A.	423,794	9.74	4,131,143.91	
TELEKOM AUSTRIA AG	25,354	5.24	132,880.31	
TELENET GROUP HOLDINGS NV	5,400	38.15	206,037.00	
VIVENDI SA	134,280	15.69	2,107,524.60	
ZIGGO NV	12,300	25.64	315,372.00	
ACCIONA S.A.	2,330	47.19	109,964.35	
E.ON SE	186,415	12.97	2,417,802.55	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	192,624	2.33	449,777.04	
ELECTRICITE DE FRANCE(EDF)	26,549	14.67	389,606.57	
ENAGAS	21,200	17.65	374,180.00	
ENEL GREEN POWER SPA	171,000	1.46	251,199.00	
ENEL SPA	678,395	2.89	1,961,918.34	
FORTUM OYJ	44,611	14.97	667,826.67	
GAS NATURAL SDG SA	37,446	15.35	574,983.33	
GDF SUEZ	131,698	14.58	1,920,156.84	
IBERDROLA SA	417,778	3.68	1,539,929.70	
RED ELECTRICA CORPORATION S.A.	10,600	41.36	438,469.00	
RWE AG	50,030	27.34	1,367,820.20	
RWE AG-NON VTG PFD	4,413	26.06	115,024.84	
SNAM SPA	181,376	3.61	655,855.61	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	28,900	9.83	284,173.70	
TERNA SPA	138,846	3.16	439,586.43	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	33,330	9.37	312,468.75	
VERBUND AG	7,470	16.90	126,243.00	
ASML HOLDING NV	32,455	54.64	1,773,341.20	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	114,349	6.30	720,741.74	
STMICROELECTRONICS NV	68,101	6.36	433,735.26	
ユーロ小計	18,259,173		247,678,264.04	
(邦貨換算額：円)			(30,984,550,831)	

合計	107,979,302	234,314,972,282
(外貨建有価証券邦貨換算額合計:円)		(234,314,972,282)

(注)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。

通貨	銘柄数		組入株式時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	株式	576銘柄	55.8%	57.8%
カナダドル	株式	96銘柄	5.0%	5.2%
オーストラリアドル	株式	55銘柄	3.8%	4.0%
英ポンド	株式	101銘柄	10.0%	10.3%
スイスフラン	株式	39銘柄	4.1%	4.3%
香港ドル	株式	39銘柄	1.4%	1.4%
シンガポールドル	株式	27銘柄	0.8%	0.8%
ニュージーランドドル	株式	5銘柄	0.1%	0.1%
スウェーデンクローナ	株式	32銘柄	1.5%	1.6%
ノルウェークローネ	株式	10銘柄	0.4%	0.4%
デンマーククローネ	株式	11銘柄	0.5%	0.6%
イスラエルシェケル	株式	10銘柄	0.2%	0.3%
ユーロ	株式	231銘柄	12.8%	13.2%

(b)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	34,737	1,129,299.87	
		AMERICAN TOWER CORP	40,776	3,065,539.68	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	99,398	1,506,873.68	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,349	1,478,320.74	
		BOSTON PROPERTIES INC	15,766	1,690,272.86	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	9,000	629,370.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	12,700	808,355.00	
		DUKE REALTY CORP	31,773	502,966.59	
		EQUITY RESIDENTIAL	33,455	1,923,997.05	
		FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	6,474	702,623.22	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	43,020	858,679.20	
		HCP, INC.	47,053	2,249,133.40	
		HEALTH CARE REIT INC	26,913	1,694,442.48	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	76,738	1,317,591.46	
		HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	503,000	420,005.00	
		KIMCO REALTY CORPORATION	41,132	892,975.72	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	12,565	496,820.10	
		MACERICH COMPANY/THE	13,839	851,513.67	
		PLUM CREEK TIMBER COMPANY	16,293	780,108.84	
		PROLOGIS INC	47,068	1,828,121.12	
		PUBLIC STORAGE	14,898	2,253,471.48	
		RAYONIER INC	13,000	717,600.00	
REALTY INCOME CORPORATION	18,600	826,956.00			
REGENCY CENTERS CORP	9,800	506,660.00			

	SIMON PROPERTY GROUP INC	31,380	5,017,662.00	
	SL GREEN REALTY CORP	9,600	793,920.00	
	UDR INC	26,800	655,260.00	
	VENTAS INC	30,970	2,151,485.90	
	VORNADO REALTY TRUST	17,193	1,459,513.77	
	米ドル小計 (邦貨換算額：円)	1,295,290	39,209,538.83 (3,678,638,933)	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	9,500	217,455.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,800	433,710.00	
	カナダドル小計 (邦貨換算額：円)	25,300	651,165.00 (60,662,531)	
オーストラリアドル	APA GROUP	81,000	467,370.00	
	CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP	213,612	442,176.84	
	DEXUS PROPERTY GROUP	473,804	492,756.16	
	FEDERATION CENTRES	140,000	333,200.00	
	GOODMAN GROUP	177,000	800,040.00	
	GPT GROUP	146,994	555,637.32	
	LEND LEASE GROUP	57,572	615,444.68	
	MIRVAC GROUP	336,710	520,216.95	
	SP AUSNET	167,000	197,895.00	
	STOCKLAND	222,614	794,731.98	
	SYDNEY AIRPORT	12,800	40,576.00	
	TRANSURBAN GROUP	133,832	821,728.48	
	WESTFIELD GROUP	221,227	2,426,860.19	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	298,993	908,938.72	
	オーストラリアドル小計 (邦貨換算額：円)	2,683,158	9,417,572.32 (908,795,728)	
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	85,605	497,365.05	
	CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP PLC	54,855	198,136.26	
	HAMMERSON PLC	73,997	360,513.38	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	80,127	669,060.45	
	SEGRO PLC	71,434	181,442.36	
	英ポンド小計 (邦貨換算額：円)	366,018	1,906,517.50 (277,112,318)	
香港ドル	HKT TRUST AND HKT LTD	250,000	1,862,500.00	
	LINK REIT	231,500	9,919,775.00	
	香港ドル小計 (邦貨換算額：円)	481,500	11,782,275.00 (142,565,527)	
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	183,000	483,120.00	
	CAPITACOMMERCIAL TRUST	220,000	359,700.00	
	CAPITAMALL TRUST	226,000	492,680.00	
	シンガポールドル小計 (邦貨換算額：円)	629,000	1,335,500.00 (101,043,930)	
ユーロ	CORIO NV	6,966	244,053.81	

	FONCIERE DES REGIONS	2,450	154,913.50	
	GECINA SA	2,280	195,236.40	
	ICADE	2,770	189,828.10	
	KLEPIERRE	10,332	307,428.66	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	9,439	1,629,171.40	
	ユーロ小計 (邦貨換算額：円)	34,237	2,720,631.87 (340,351,046)	
	投資証券合計		5,509,170,013 (5,509,170,013)	
	合計		5,509,170,013	
	(外貨建有価証券邦貨換算額合計：円)		(5,509,170,013)	

(注) 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。

通貨	銘柄数		組入投資証券 時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	投資証券	29銘柄	1.5%	66.8%
カナダドル	投資証券	2銘柄	0.0%	1.1%
オーストラリアドル	投資証券	14銘柄	0.4%	16.5%
英ポンド	投資証券	5銘柄	0.1%	5.0%
香港ドル	投資証券	2銘柄	0.1%	2.6%
シンガポールドル	投資証券	3銘柄	0.0%	1.8%
ユーロ	投資証券	6銘柄	0.1%	6.2%

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、省略しておりません。

「外国債券パッシブ・マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

	(単位：円)	
	(平成24年 2月20日現在)	(平成25年 2月18日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	2,349,245,639	1,018,945,000
コール・ローン	1,235,821,883	1,146,799,682
国債証券	250,584,025,767	263,295,271,726
未収利息	2,616,985,776	2,628,048,517
前払費用	129,067,259	107,272,243
流動資産合計	256,915,146,324	268,196,337,168
資産合計	256,915,146,324	268,196,337,168
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,270,279	23,193,553
流動負債合計	1,270,279	23,193,553
負債合計	1,270,279	23,193,553
純資産の部		
元本等		
元本	225,450,227,371	191,481,315,208
剰余金		
剰余金又は欠損金 ()	31,463,648,674	76,691,828,407
元本等合計	256,913,876,045	268,173,143,615
純資産合計	256,913,876,045	268,173,143,615
負債純資産合計	256,915,146,324	268,196,337,168

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項 目	自 平成24年 2月21日 至 平成25年 2月18日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>

2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。

(追加情報)

自 平成24年 2月21日 至 平成25年 2月18日
当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更およ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）および「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。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成24年 2月20日現在)	(平成25年 2月18日現在)
1. 受益権総数	平成24年 2月20日における受益権の総数 225,450,227,371口	平成25年 2月18日における受益権の総数 191,481,315,208口
2. 1単位当たり純資産額	1.1396円 (1万口 = 11,396円)	1.4005円 (1万口 = 14,005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24年 2月21日 至 平成25年 2月18日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 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。

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成25年 2月18日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（国債証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（デリバティブ取引に関する注記）

（平成24年2月20日現在）
該当事項はありません。

（平成25年2月18日現在）
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。

（自 平成24年2月21日 至 平成25年2月18日）

該当事項はありません。

（その他の注記）

（平成24年 2月20日現在）

開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	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日現在の元本の内訳	
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

(平成25年 2月18日現在)

開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	225,450,227,371円
同期中における追加設定元本額	2,613,027,966円
同期中における一部解約元本額	36,581,940,129円

平成25年 2月18日現在の元本の内訳

三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	3,376,468,805円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	219,533,740円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	619,710,080円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	301,583,658円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	30,901,357円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	4,427,988円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	6,874,818円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	4,944,748円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	5,213,829円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	1,687,864円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	2,954,195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>	2,799,800,775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>	10,290,177,647円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	33,326,035,036円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	10,214,427,809円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	21,921,424,186円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	74,799,440円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	160,997,541円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	37,695,327円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	1,301,449,240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>	174,683,670円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	1,975,852,173円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,598,037,663円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	6,496,007,155円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	13,057,245,940円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,080,104,381円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	21,880,941,662円
三井住友・外国債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,934,743,171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)	7,920,113,060円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	349,041,096円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	9,633,695,079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)	34,057,693,617円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	253,521,813円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	80,275,526円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	21,756,303円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	317,608,167円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	1,161,139,056円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	340,291,203円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	304,378,169円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	82,841,102円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	11,794,548円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	2,834,052,543円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	77,454,841円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定>	84,252,123円

S M A M ・ F G グローバルバランス25 V A < 適格機関投資家限定 >
合計

(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	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B 0.125	7,000,000	6,989,609.41	
		US TREASURY N/B 0.25	5,000,000	5,003,125.00	
		US TREASURY N/B 0.25	4,000,000	4,002,500.00	
		US TREASURY N/B 0.25	6,000,000	6,001,875.00	
		US TREASURY N/B 0.25	9,000,000	9,002,812.50	
		US TREASURY N/B 0.25	6,000,000	6,003,281.28	
		US TREASURY N/B 0.25	7,000,000	6,999,179.67	
		US TREASURY N/B 0.25	7,000,000	6,999,453.16	
		US TREASURY N/B 0.25	13,000,000	12,998,984.44	
		US TREASURY N/B 0.25	7,000,000	6,995,625.00	
		US TREASURY N/B 0.25	13,000,000	12,980,703.19	
		US TREASURY N/B 0.25	14,000,000	13,972,656.32	
		US TREASURY N/B 0.25	8,000,000	7,981,250.00	
		US TREASURY N/B 0.25	14,000,000	13,962,812.50	
		US TREASURY N/B 0.25	8,000,000	7,968,125.04	
		US TREASURY N/B 0.375	9,000,000	9,020,390.67	
		US TREASURY N/B 0.375	4,000,000	4,006,875.00	
		US TREASURY N/B 0.375	8,000,000	8,013,125.04	
		US TREASURY N/B 0.375	8,000,000	8,010,000.00	
		US TREASURY N/B 0.375	4,000,000	4,000,000.00	
		US TREASURY N/B 0.5	8,000,000	8,032,500.00	
		US TREASURY N/B 0.5	10,000,000	10,041,406.30	
		US TREASURY N/B 0.5	8,000,000	7,911,250.00	
		US TREASURY N/B 0.625	7,000,000	7,039,375.00	
		US TREASURY N/B 0.625	5,000,000	4,981,250.00	
		US TREASURY N/B 0.625	10,000,000	9,935,156.30	
		US TREASURY N/B 0.75	9,000,000	9,063,281.25	
		US TREASURY N/B 0.75	5,000,000	5,003,515.65	
		US TREASURY N/B 0.875	6,000,000	6,063,750.00	
		US TREASURY N/B 0.875	8,000,000	8,079,375.04	
		US TREASURY N/B 0.875	7,000,000	7,065,078.16	
		US TREASURY N/B 0.875	3,000,000	3,026,015.64	
		US TREASURY N/B 1	3,000,000	3,022,265.64	
		US TREASURY N/B 1	11,000,000	11,106,562.50	
		US TREASURY N/B 1	6,000,000	6,096,562.50	
		US TREASURY N/B 1	5,000,000	5,079,687.50	
		US TREASURY N/B 1	4,000,000	4,061,562.52	
		US TREASURY N/B 1	7,000,000	7,091,328.16	
		US TREASURY N/B 1	7,000,000	6,903,203.16	
		US TREASURY N/B 1	8,000,000	7,864,375.04	
US TREASURY N/B 1	2,000,000	1,963,437.50			

US TREASURY N/B 1	8,000,000	7,829,375.04
US TREASURY N/B 1.125	3,000,000	2,986,406.25
US TREASURY N/B 1.25	4,000,000	4,041,875.00
US TREASURY N/B 1.25	6,000,000	6,067,500.00
US TREASURY N/B 1.25	5,000,000	5,060,156.25
US TREASURY N/B 1.25	8,000,000	8,181,250.00
US TREASURY N/B 1.25	7,000,000	7,162,968.75
US TREASURY N/B 1.25	5,000,000	5,117,968.75
US TREASURY N/B 1.25	5,000,000	5,020,703.15
US TREASURY N/B 1.375	5,000,000	5,136,328.15
US TREASURY N/B 1.375	6,500,000	6,619,335.97
US TREASURY N/B 1.375	5,000,000	5,086,328.15
US TREASURY N/B 1.375	8,000,000	8,110,000.00
US TREASURY N/B 1.5	7,000,000	7,079,843.75
US TREASURY N/B 1.5	5,500,000	5,682,187.50
US TREASURY N/B 1.5	8,000,000	8,266,250.00
US TREASURY N/B 1.5	2,000,000	2,052,812.50
US TREASURY N/B 1.625	8,000,000	7,790,625.04
US TREASURY N/B 1.625	13,000,000	12,593,750.00
US TREASURY N/B 1.75	6,500,000	6,596,484.37
US TREASURY N/B 1.75	8,000,000	8,138,125.04
US TREASURY N/B 1.75	5,000,000	5,171,875.00
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000	3,123,750.00
US TREASURY N/B 1.75	3,000,000	3,116,484.39
US TREASURY N/B 1.75	6,000,000	5,933,906.28
US TREASURY N/B 1.875	6,000,000	6,103,593.78
US TREASURY N/B 1.875	8,000,000	8,159,375.04
US TREASURY N/B 1.875	7,000,000	7,256,484.41
US TREASURY N/B 1.875	3,000,000	3,147,656.25
US TREASURY N/B 1.875	10,000,000	10,489,062.50
US TREASURY N/B 1.875	6,000,000	6,294,375.00
US TREASURY N/B 11.25	2,000,000	2,434,375.00
US TREASURY N/B 2	7,000,000	7,324,843.75
US TREASURY N/B 2	3,000,000	3,055,546.89
US TREASURY N/B 2	6,600,000	6,696,937.50
US TREASURY N/B 2.125	10,500,000	10,848,632.86
US TREASURY N/B 2.125	8,000,000	8,328,125.04
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000	3,147,421.89
US TREASURY N/B 2.125	3,000,000	3,153,046.89
US TREASURY N/B 2.125	11,000,000	11,357,500.00
US TREASURY N/B 2.25	7,000,000	7,181,015.66
US TREASURY N/B 2.25	10,000,000	10,383,984.40
US TREASURY N/B 2.25	4,000,000	4,267,500.00
US TREASURY N/B 2.25	2,000,000	2,134,687.50
US TREASURY N/B 2.375	8,000,000	8,256,875.04
US TREASURY N/B 2.375	10,000,000	10,342,187.50
US TREASURY N/B 2.375	8,000,000	8,288,125.04
US TREASURY N/B 2.375	9,000,000	9,379,687.50
US TREASURY N/B 2.375	5,500,000	5,825,703.12
US TREASURY N/B 2.375	5,000,000	5,358,203.15
US TREASURY N/B 2.375	2,000,000	2,148,125.00
US TREASURY N/B 2.5	9,000,000	9,419,765.67
US TREASURY N/B 2.5	10,000,000	10,479,687.50
US TREASURY N/B 2.5	5,000,000	5,382,421.90
US TREASURY N/B 2.625	9,000,000	9,293,203.17

US TREASURY N/B 2.625	6,000,000	6,207,656.28
US TREASURY N/B 2.625	8,000,000	8,350,312.48
US TREASURY N/B 2.625	5,000,000	5,328,125.00
US TREASURY N/B 2.625	5,000,000	5,340,234.40
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000	4,341,250.00
US TREASURY N/B 2.625	4,000,000	4,346,250.00
US TREASURY N/B 2.625	8,000,000	8,650,625.04
US TREASURY N/B 2.625	13,500,000	14,566,289.13
US TREASURY N/B 2.75	6,000,000	6,480,937.50
US TREASURY N/B 2.75	7,000,000	7,605,390.66
US TREASURY N/B 2.75	4,000,000	4,364,375.00
US TREASURY N/B 2.75	9,000,000	9,851,484.42
US TREASURY N/B 2.75	2,000,000	1,833,750.00
US TREASURY N/B 2.75	13,000,000	11,900,078.19
US TREASURY N/B 2.875	4,000,000	4,394,375.00
US TREASURY N/B 3	4,000,000	4,343,125.00
US TREASURY N/B 3	5,000,000	5,435,546.90
US TREASURY N/B 3	7,000,000	7,654,609.41
US TREASURY N/B 3	7,000,000	6,774,140.66
US TREASURY N/B 3.125	6,000,000	6,559,687.50
US TREASURY N/B 3.125	7,000,000	7,679,765.66
US TREASURY N/B 3.125	7,000,000	7,704,375.00
US TREASURY N/B 3.125	7,000,000	7,830,703.16
US TREASURY N/B 3.125	11,000,000	12,256,406.25
US TREASURY N/B 3.125	2,000,000	1,990,468.76
US TREASURY N/B 3.125	3,000,000	2,982,421.89
US TREASURY N/B 3.25	4,000,000	4,359,687.52
US TREASURY N/B 3.25	4,000,000	4,366,562.52
US TREASURY N/B 3.25	5,000,000	5,466,796.90
US TREASURY N/B 3.25	4,000,000	4,402,187.52
US TREASURY N/B 3.25	4,000,000	4,420,625.00
US TREASURY N/B 3.375	9,000,000	10,213,593.75
US TREASURY N/B 3.5	8,500,000	9,591,718.75
US TREASURY N/B 3.5	7,500,000	8,578,125.00
US TREASURY N/B 3.5	4,000,000	4,310,312.52
US TREASURY N/B 3.625	9,000,000	10,352,812.50
US TREASURY N/B 3.625	9,000,000	10,366,875.00
US TREASURY N/B 3.625	10,000,000	11,536,718.80
US TREASURY N/B 3.75	7,000,000	8,052,734.41
US TREASURY N/B 3.75	5,000,000	5,597,656.25
US TREASURY N/B 3.875	6,000,000	6,906,562.50
US TREASURY N/B 3.875	7,000,000	8,021,562.50
US TREASURY N/B 4	6,500,000	6,744,765.62
US TREASURY N/B 4	7,700,000	8,267,273.47
US TREASURY N/B 4	3,500,000	4,068,203.12
US TREASURY N/B 4.125	4,200,000	4,555,687.50
US TREASURY N/B 4.25	5,400,000	5,721,890.65
US TREASURY N/B 4.25	6,100,000	6,521,757.84
US TREASURY N/B 4.25	5,000,000	5,800,390.65
US TREASURY N/B 4.25	4,000,000	4,871,250.00
US TREASURY N/B 4.25	6,000,000	7,310,156.28
US TREASURY N/B 4.375	2,200,000	2,726,281.25
US TREASURY N/B 4.375	5,000,000	6,211,328.15
US TREASURY N/B 4.375	5,000,000	6,210,546.90
US TREASURY N/B 4.375	6,000,000	7,457,812.50

US TREASURY N/B 4.5	5,800,000	6,448,875.00	
US TREASURY N/B 4.5	2,400,000	2,689,687.51	
US TREASURY N/B 4.5	3,000,000	3,477,187.50	
US TREASURY N/B 4.5	3,500,000	4,407,265.62	
US TREASURY N/B 4.5	3,000,000	3,787,500.00	
US TREASURY N/B 4.5	4,000,000	5,062,812.52	
US TREASURY N/B 4.625	5,200,000	5,974,718.77	
US TREASURY N/B 4.625	3,000,000	3,471,328.14	
US TREASURY N/B 4.625	7,000,000	9,034,375.00	
US TREASURY N/B 4.75	6,400,000	6,758,000.00	
US TREASURY N/B 4.75	3,000,000	3,529,687.50	
US TREASURY N/B 4.75	1,000,000	1,305,312.50	
US TREASURY N/B 4.75	5,000,000	6,582,031.25	
US TREASURY N/B 4.875	3,400,000	3,910,796.89	
US TREASURY N/B 5	2,000,000	2,700,156.26	
US TREASURY N/B 5.125	3,700,000	4,251,242.20	
US TREASURY N/B 5.25	2,000,000	2,672,343.76	
US TREASURY N/B 5.25	2,000,000	2,675,781.26	
US TREASURY N/B 5.375	3,020,000	4,154,387.50	
US TREASURY N/B 5.5	2,000,000	2,735,468.76	
US TREASURY N/B 6	1,000,000	1,407,734.38	
US TREASURY N/B 6.125	1,000,000	1,441,796.88	
US TREASURY N/B 6.125	1,100,000	1,610,125.00	
US TREASURY N/B 6.25	2,500,000	3,508,007.82	
US TREASURY N/B 6.25	1,000,000	1,491,875.00	
US TREASURY N/B 6.5	1,000,000	1,475,703.13	
US TREASURY N/B 6.75	1,000,000	1,502,265.63	
US TREASURY N/B 6.875	1,000,000	1,501,328.13	
US TREASURY N/B 7.125	1,400,000	2,066,968.75	
US TREASURY N/B 7.25	4,000,000	4,866,562.52	
US TREASURY N/B 7.25	2,500,000	3,687,890.62	
US TREASURY N/B 7.5	2,400,000	3,012,000.00	
US TREASURY N/B 7.5	1,000,000	1,554,218.75	
US TREASURY N/B 8	2,800,000	4,243,093.76	
US TREASURY N/B 8.125	1,000,000	1,507,421.88	
US TREASURY N/B 8.75	3,000,000	4,010,156.25	
US TREASURY N/B 8.75	1,000,000	1,522,812.50	
US TREASURY N/B 8.875	2,000,000	2,718,125.00	
US TREASURY N/B 8.875	2,100,000	3,052,218.75	
米ドル小計 (邦貨換算額:円)	1,085,420,000	1,157,841,280.71 (108,628,668,956)	
カナダドル			
CANADA-GOV'T 1	1,500,000	1,496,250.00	
CANADA-GOV'T 1.5	1,000,000	1,007,000.00	
CANADA-GOV'T 1.5	2,000,000	2,004,440.00	
CANADA-GOV'T 1.5	1,000,000	1,001,000.00	
CANADA-GOV'T 2	3,000,000	3,028,710.00	
CANADA-GOV'T 2	4,000,000	4,060,960.00	
CANADA-GOV'T 2	2,000,000	2,042,720.00	
CANADA-GOV'T 2.5	2,000,000	2,015,420.00	
CANADA-GOV'T 2.5	2,000,000	2,060,000.00	
CANADA-GOV'T 2.75	2,000,000	2,094,300.00	
CANADA-GOV'T 2.75	2,000,000	2,123,400.00	
CANADA-GOV'T 3	4,500,000	4,609,440.00	
CANADA-GOV'T 3	3,000,000	3,142,740.00	
CANADA-GOV'T 3.25	3,000,000	3,302,400.00	
CANADA-GOV'T 3.5	3,000,000	3,020,640.00	

	CANADA-GOV'T 3.5	3,000,000	3,341,460.00	
	CANADA-GOV'T 3.75	4,000,000	4,487,600.00	
	CANADA-GOV'T 4	3,000,000	3,255,690.00	
	CANADA-GOV'T 4	2,000,000	2,209,660.00	
	CANADA-GOV'T 4	4,000,000	5,088,000.00	
	CANADA-GOV'T 4.25	2,500,000	2,841,250.00	
	CANADA-GOV'T 4.5	2,000,000	2,149,640.00	
	CANADA-GOV'T 5	2,500,000	2,624,050.00	
	CANADA-GOV'T 5	4,000,000	5,667,520.00	
	CANADA-GOV'T 5.75	1,300,000	1,868,490.00	
	CANADA-GOV'T 5.75	3,000,000	4,484,640.00	
	CANADA-GOV'T 8	400,000	617,544.00	
	CANADA-GOV'T 8	1,000,000	1,682,760.00	
	CANADA-GOV'T 9	980,000	1,688,491.00	
	カナダドル小計 (邦貨換算額:円)	69,680,000	79,016,215.00 (7,361,150,589)	
オーストラリアドル	AUSTRALIAN GOVT. 2.75	1,000,000	917,966.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.25	1,000,000	1,050,800.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	3,000,000	3,081,510.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.5	4,000,000	4,317,008.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.75	1,000,000	1,046,100.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.75	4,000,000	4,238,340.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 4.75	1,200,000	1,310,760.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.25	5,000,000	5,578,720.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	2,000,000	2,222,600.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.5	2,000,000	2,335,400.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	4,000,000	4,666,800.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 5.75	2,000,000	2,357,400.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 6	3,300,000	3,676,530.00	
	AUSTRALIAN GOVT. 6.25	1,500,000	1,568,104.50	
	AUSTRALIAN GOVT. 6.25	3,000,000	3,209,850.00	
	オーストラリアドル小計 (邦貨換算額:円)	38,000,000	41,577,888.50 (4,012,266,240)	
英ポンド	TREASURY 1	3,800,000	3,804,712.00	
	TREASURY 1.75	3,000,000	3,112,740.00	
	TREASURY 1.75	2,000,000	1,925,800.00	
	TREASURY 2	3,000,000	3,129,390.00	
	TREASURY 2.25	5,000,000	5,101,600.00	
	TREASURY 2.75	5,000,000	5,231,250.00	
	TREASURY 3.75	4,300,000	4,905,741.00	
	TREASURY 3.75	5,000,000	5,713,250.00	
	TREASURY 3.75	5,000,000	5,698,500.00	
	TREASURY 3.75	2,300,000	2,387,515.00	
	TREASURY 4	4,800,000	5,375,520.00	
	TREASURY 4	2,000,000	2,320,380.00	
	TREASURY 4	2,000,000	2,209,400.00	
	TREASURY 4.25	2,300,000	2,706,456.00	
	TREASURY 4.25	2,800,000	3,261,832.00	
	TREASURY 4.25	3,800,000	4,389,380.00	
	TREASURY 4.25	2,500,000	2,879,100.00	
	TREASURY 4.25	3,500,000	4,014,745.00	
	TREASURY 4.25	3,900,000	4,493,463.00	
	TREASURY 4.25	2,700,000	3,114,828.00	
	TREASURY 4.25	3,900,000	4,509,843.00	
	TREASURY 4.5	4,200,000	4,961,460.00	

	TREASURY 4.5	2,500,000	2,997,925.00	
	TREASURY 4.5	3,500,000	4,201,225.00	
	TREASURY 4.75	4,400,000	4,888,048.00	
	TREASURY 4.75	4,200,000	5,074,440.00	
	TREASURY 4.75	3,800,000	4,702,880.00	
	TREASURY 4.75	3,500,000	4,350,220.00	
	TREASURY 5	5,500,000	5,897,210.00	
	TREASURY 5	3,500,000	4,174,800.00	
	TREASURY 5	3,100,000	3,926,150.00	
	TREASURY 6	2,000,000	2,815,800.00	
	TREASURY 8	1,900,000	2,303,826.00	
	TREASURY 8	2,620,000	3,860,308.00	
	TREASURY 8.75	1,300,000	1,753,869.00	
	英債券小計 (邦貨換算額:円)	118,620,000	136,193,606.00 (19,795,740,632)	
スイスフラン	SWISS (GOVT) 2.25	500,000	564,100.00	
	SWISS (GOVT) 2.5	2,000,000	2,152,000.00	
	SWISS (GOVT) 3	1,000,000	1,136,500.00	
	SWISS (GOVT) 3	1,500,000	1,747,200.00	
	SWISS (GOVT) 4	1,000,000	1,309,300.00	
	SWISS (GOVT) 4	900,000	1,263,060.00	
	SWISS (GOVT) 4.25	800,000	829,760.00	
	SWISS (GOVT) 4.25	1,000,000	1,175,700.00	
	スイスフラン小計 (邦貨換算額:円)	8,700,000	10,177,620.00 (1,033,842,639)	
シンガポールドル	SINGAPORE GOV'T 2.25	500,000	531,580.50	
	SINGAPORE GOV'T 2.875	1,000,000	1,059,223.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.125	1,000,000	1,138,401.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.25	2,000,000	2,274,174.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.5	1,500,000	1,728,093.00	
	SINGAPORE GOV'T 3.625	2,500,000	2,615,397.50	
	SINGAPORE GOV'T 3.75	1,000,000	1,117,671.00	
	SINGAPORE GOV'T 4	3,200,000	3,770,441.60	
	シンガポールドル小計 (邦貨換算額:円)	12,700,000	14,234,981.60 (1,077,018,707)	
マレーシアリンギット	MALAYSIAN GOV'T 3.418	8,000,000	7,968,264.00	
	MALAYSIAN GOV'T 3.502	9,000,000	8,824,959.00	
	MALAYSIAN GOV'T 3.741	10,000,000	10,132,350.00	
	MALAYSIAN GOV'T 3.814	2,000,000	2,049,594.00	
	MALAYSIAN GOV'T 4.24	5,000,000	5,225,260.00	
	MALAYSIAN GOV'T 4.262	3,000,000	3,115,113.00	
	MALAYSIAN GOV'T 4.378	5,000,000	5,295,585.00	
	MALAYSIAN GOV'T 5.094	6,000,000	6,142,662.00	
	マレーシアリンギット小計 (邦貨換算額:円)	48,000,000	48,753,787.00 (1,473,826,981)	
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVERNMENT 3	11,000,000	11,633,600.00	
	SWEDISH GOVERNMENT 3.5	5,000,000	5,623,800.00	
	SWEDISH GOVERNMENT 3.5	10,000,000	11,343,700.00	
	SWEDISH GOVERNMENT 3.75	13,200,000	14,526,600.00	
	SWEDISH GOVERNMENT 4.25	15,000,000	17,214,000.00	
	SWEDISH GOVERNMENT 4.5	13,000,000	14,076,400.00	
	SWEDISH GOVERNMENT 5	17,000,000	20,833,500.00	
	SWEDISH GOVERNMENT 6.75	16,100,000	17,231,830.00	

スウェーデンクローナ小計 (邦貨換算額:円)		100,300,000	112,483,430.00 (1,663,629,929)
ノルウェーク ローネ	NORWEGIAN GOV'T 3.75	16,000,000	17,672,000.00
	NORWEGIAN GOV'T 4.25	10,000,000	10,993,000.00
	NORWEGIAN GOV'T 4.5	6,000,000	6,837,000.00
	NORWEGIAN GOV'T 5	10,000,000	10,730,000.00
	NORWEGIAN GOV'T 6.5	2,000,000	2,021,000.00
ノルウェークローネ小計 (邦貨換算額:円)		44,000,000	48,253,000.00 (814,510,640)
デンマークク ローネ	DENMARK - BULLET 2	13,000,000	13,438,750.00
	DENMARK - BULLET 3	10,000,000	11,305,000.00
	DENMARK - BULLET 4	16,000,000	17,628,800.00
	DENMARK - BULLET 4	15,000,000	17,400,000.00
	DENMARK - BULLET 4	21,000,000	25,081,140.00
	DENMARK - BULLET 4.5	24,000,000	34,555,200.00
	DENMARK - BULLET 7	5,080,000	7,945,120.00
デンマーククローネ小計 (邦貨換算額:円)		104,080,000	127,354,010.00 (2,135,726,747)
メキシコペソ	MEXICAN BONOS 7.25	70,000,000	76,614,790.00
	MEXICAN BONOS 7.75	20,000,000	22,714,540.00
	MEXICAN BONOS 8	50,000,000	60,111,700.00
	MEXICAN BONOS 8.5	50,000,000	64,903,300.00
	MEXICAN BONOS 8.5	55,000,000	72,561,500.00
	MEXICAN BONOS 9.5	60,000,000	65,545,740.00
メキシコペソ小計 (邦貨換算額:円)		305,000,000	362,451,570.00 (2,682,141,618)
ポーランドズ ロチ	POLAND GOVT BOND 5	1,500,000	1,514,250.00
	POLAND GOVT BOND 5	4,000,000	4,180,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.25	8,000,000	8,582,400.00
	POLAND GOVT BOND 5.25	5,000,000	5,475,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.5	8,000,000	8,304,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.5	6,000,000	6,594,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	8,000,000	8,204,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	4,000,000	4,492,000.00
	POLAND GOVT BOND 5.75	10,200,000	11,546,400.00
	POLAND GOVT BOND 6.25	7,500,000	8,028,750.00
ポーランドズロチ小計 (邦貨換算額:円)		62,200,000	66,920,800.00 (1,999,593,504)
南アフリカ ランド	REP SOUTH AFRICA 6.5	10,000,000	8,052,000.00
	REP SOUTH AFRICA 6.75	40,000,000	40,748,000.00
	REP SOUTH AFRICA 7	35,000,000	31,983,000.00
	REP SOUTH AFRICA 8	50,000,000	54,597,500.00
	REP SOUTH AFRICA 8.25	8,000,000	8,780,400.00
	REP SOUTH AFRICA 8.75	8,000,000	8,490,320.00
南アフリカランド小計 (邦貨換算額:円)		151,000,000	152,651,220.00 (1,618,102,932)
ユーロ	BELGIAN 0326 4	1,000,000	1,123,480.00
	BELGIAN 0282 8	2,000,000	2,315,300.00
	BELGIAN 0291 5.5	3,000,000	3,952,140.00
	BELGIAN 0300 5.5	1,740,000	2,085,042.00
	BELGIAN 0303 4.25	2,500,000	2,656,375.00
	BELGIAN 0304 5	3,500,000	4,486,300.00
	BELGIAN 0306 3.75	2,300,000	2,491,130.00

BELGIAN 0307 3.25	2,500,000	2,717,875.00
BELGIAN 0308 4	3,500,000	4,008,655.00
BELGIAN 0309 4	2,500,000	2,805,250.00
BELGIAN 0312 4	2,000,000	2,277,700.00
BELGIAN 0314 4	3,200,000	3,332,800.00
BELGIAN 0315 4	2,500,000	2,869,200.00
BELGIAN 0316 3.5	1,500,000	1,595,850.00
BELGIAN 0318 3.75	3,000,000	3,394,500.00
BELGIAN 0319 2.75	2,000,000	2,127,900.00
BELGIAN 0320 4.25	2,000,000	2,338,700.00
BELGIAN 0321 4.25	3,000,000	3,501,300.00
BELGIAN 0323 3.5	2,000,000	2,208,700.00
BELGIAN 0324 4.5	1,000,000	1,186,380.00
BELGIAN 0325 4.25	2,000,000	2,324,700.00
BELGIAN 0327 3	2,000,000	2,169,500.00
BTAN 1	3,500,000	3,509,030.00
BTAN 1.75	3,500,000	3,627,575.00
BTAN 2	5,000,000	5,188,650.00
BTAN 2.25	4,000,000	4,202,880.00
BTAN 2.5	7,200,000	7,496,640.00
BTAN 2.5	3,600,000	3,822,300.00
BTAN 3	5,500,000	5,712,850.00
BTPS 2.5	3,000,000	3,039,450.00
BTPS 3	2,000,000	2,038,300.00
BTPS 3	2,500,000	2,553,950.00
BTPS 3	6,400,000	6,535,552.00
BTPS 3	4,000,000	4,083,200.00
BTPS 3.5	4,000,000	4,106,000.00
BTPS 3.75	6,200,000	6,432,500.00
BTPS 3.75	3,000,000	3,126,000.00
BTPS 3.75	4,700,000	4,891,196.00
BTPS 3.75	5,000,000	4,979,400.00
BTPS 3.75	6,300,000	6,260,625.00
BTPS 4	6,000,000	6,269,400.00
BTPS 4	4,500,000	4,570,560.00
BTPS 4	5,000,000	4,406,850.00
BTPS 4.25	1,300,000	1,349,790.00
BTPS 4.25	4,900,000	5,095,510.00
BTPS 4.25	5,000,000	5,241,100.00
BTPS 4.25	5,400,000	5,618,160.00
BTPS 4.25	6,000,000	6,237,480.00
BTPS 4.25	5,000,000	5,167,850.00
BTPS 4.5	6,000,000	6,364,320.00
BTPS 4.5	5,000,000	5,288,400.00
BTPS 4.5	2,000,000	2,106,100.00
BTPS 4.5	3,700,000	3,883,446.00
BTPS 4.5	3,000,000	3,010,590.00
BTPS 4.75	3,500,000	3,753,505.00
BTPS 4.75	4,000,000	4,278,200.00
BTPS 4.75	2,000,000	2,137,960.00
BTPS 4.75	6,000,000	6,332,100.00
BTPS 4.75	5,500,000	5,685,350.00
BTPS 5	2,000,000	2,131,160.00
BTPS 5	5,000,000	5,241,400.00
BTPS 5	4,970,000	5,033,864.50

BTPS 5	4,000,000	4,045,720.00
BTPS 5	4,000,000	4,030,520.00
BTPS 5.25	5,000,000	5,460,750.00
BTPS 5.25	5,700,000	5,991,441.00
BTPS 5.5	5,000,000	5,473,750.00
BTPS 5.5	1,000,000	1,091,730.00
BTPS 5.75	2,700,000	2,984,580.00
BTPS 6	1,000,000	1,075,400.00
BTPS 6	5,600,000	6,359,920.00
BTPS 6.5	5,960,000	7,061,229.20
BTPS 7.25	2,000,000	2,517,960.00
BTPS 9	2,000,000	2,762,960.00
BUNDESUBL-154 2.25	4,000,000	4,097,800.00
BUNDESUBL-155 2.5	4,000,000	4,153,400.00
BUNDESUBL-156 2.5	4,500,000	4,711,500.00
BUNDESUBL-157 2.25	5,500,000	5,743,100.00
BUNDESUBL-158 1.75	4,000,000	4,160,720.00
BUNDESUBL-159 2	3,000,000	3,155,700.00
BUNDESUBL-160 2.75	4,000,000	4,305,400.00
BUNDESUBL-161 1.25	2,000,000	2,063,460.00
BUNDESUBL-162 0.75	2,500,000	2,529,325.00
BUNDESUBL-163 0.5	5,000,000	5,004,500.00
BUNDESUBL-164 0.5	3,000,000	2,990,340.00
DEUTSCHLAND REP 1.5	3,000,000	2,977,590.00
DEUTSCHLAND REP 1.75	5,500,000	5,590,915.00
DEUTSCHLAND REP 2	2,000,000	2,087,360.00
DEUTSCHLAND REP 2.25	3,500,000	3,771,880.00
DEUTSCHLAND REP 2.25	3,000,000	3,208,410.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	4,000,000	4,371,920.00
DEUTSCHLAND REP 2.5	2,000,000	2,029,500.00
DEUTSCHLAND REP 3	4,000,000	4,525,920.00
DEUTSCHLAND REP 3.25	5,500,000	5,895,450.00
DEUTSCHLAND REP 3.25	4,000,000	4,591,200.00
DEUTSCHLAND REP 3.25	4,000,000	4,596,320.00
DEUTSCHLAND REP 3.25	2,500,000	2,945,450.00
DEUTSCHLAND REP 3.5	5,200,000	5,680,896.00
DEUTSCHLAND REP 3.5	5,000,000	5,799,750.00
DEUTSCHLAND REP 3.75	6,000,000	6,402,900.00
DEUTSCHLAND REP 3.75	5,000,000	5,639,400.00
DEUTSCHLAND REP 3.75	5,000,000	5,840,750.00
DEUTSCHLAND REP 4	3,900,000	4,377,555.00
DEUTSCHLAND REP 4	6,000,000	6,972,900.00
DEUTSCHLAND REP 4	4,200,000	5,437,866.00
DEUTSCHLAND REP 4.25	6,500,000	6,866,275.00
DEUTSCHLAND REP 4.25	4,000,000	4,644,400.00
DEUTSCHLAND REP 4.25	4,200,000	4,980,696.00
DEUTSCHLAND REP 4.25	2,500,000	3,409,575.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	2,300,000	3,085,979.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	4,100,000	5,755,170.00
DEUTSCHLAND REP 4.75	3,000,000	4,418,490.00
DEUTSCHLAND REP 5.5	3,300,000	4,859,745.00
DEUTSCHLAND REP 5.625	2,980,000	4,316,530.00
DEUTSCHLAND REP 6	890,000	1,056,252.00
DEUTSCHLAND REP 6.25	2,200,000	3,186,810.00
DEUTSCHLAND REP 6.25	1,700,000	2,661,061.00

DEUTSCHLAND REP 6.5	2,000,000	3,113,160.00
FINNISH GOV'T 1.625	2,000,000	1,963,200.00
FINNISH GOV'T 1.75	1,200,000	1,248,636.00
FINNISH GOV'T 3.125	1,500,000	1,569,870.00
FINNISH GOV'T 3.375	1,200,000	1,362,156.00
FINNISH GOV'T 3.5	1,000,000	1,144,800.00
FINNISH GOV'T 3.875	2,000,000	2,277,740.00
FINNISH GOV'T 4	1,000,000	1,198,380.00
FINNISH GOV'T 4.25	1,300,000	1,421,264.00
FINNISH GOV'T 4.375	1,000,000	1,195,480.00
FRANCE O.A.T. 2.25	1,000,000	997,830.00
FRANCE O.A.T. 2.5	5,500,000	5,782,865.00
FRANCE O.A.T. 3	7,200,000	7,682,976.00
FRANCE O.A.T. 3	8,000,000	8,561,040.00
FRANCE O.A.T. 3.25	6,700,000	7,257,574.00
FRANCE O.A.T. 3.25	7,000,000	7,675,360.00
FRANCE O.A.T. 3.5	5,600,000	5,979,400.00
FRANCE O.A.T. 3.5	6,000,000	6,748,980.00
FRANCE O.A.T. 3.5	6,000,000	6,519,780.00
FRANCE O.A.T. 3.75	5,000,000	5,593,150.00
FRANCE O.A.T. 3.75	5,000,000	5,707,500.00
FRANCE O.A.T. 3.75	5,700,000	6,493,725.00
FRANCE O.A.T. 4	5,300,000	5,538,235.00
FRANCE O.A.T. 4	5,000,000	5,310,750.00
FRANCE O.A.T. 4	4,000,000	4,580,520.00
FRANCE O.A.T. 4	4,700,000	5,332,761.00
FRANCE O.A.T. 4	2,870,000	3,262,185.50
FRANCE O.A.T. 4	2,000,000	2,276,960.00
FRANCE O.A.T. 4.25	4,500,000	5,170,275.00
FRANCE O.A.T. 4.25	5,000,000	5,823,650.00
FRANCE O.A.T. 4.25	7,400,000	8,652,820.00
FRANCE O.A.T. 4.25	7,000,000	8,201,900.00
FRANCE O.A.T. 4.5	4,700,000	5,768,451.00
FRANCE O.A.T. 4.75	3,600,000	4,524,120.00
FRANCE O.A.T. 5	5,600,000	6,468,000.00
FRANCE O.A.T. 5.5	5,500,000	7,329,190.00
FRANCE O.A.T. 5.75	4,700,000	6,591,985.00
FRANCE O.A.T. 6	3,500,000	4,769,450.00
FRANCE O.A.T. 8.5	2,550,000	3,685,260.00
FRANCE O.A.T. 8.5	2,200,000	3,435,520.00
IRISH GOVT 4.4	1,500,000	1,590,225.00
IRISH GOVT 4.5	2,000,000	2,157,960.00
IRISH GOVT 4.5	2,490,000	2,635,540.50
IRISH GOVT 4.6	1,800,000	1,950,624.00
IRISH GOVT 5	2,000,000	2,181,400.00
IRISH GOVT 5.4	2,000,000	2,185,060.00
IRISH GOVT 5.9	2,000,000	2,290,960.00
ITALY GOV'T INT 5.75	1,000,000	1,091,550.00
NETHERLANDS GOVT 0.75	2,000,000	2,019,400.00
NETHERLANDS GOVT 1	2,500,000	2,520,250.00
NETHERLANDS GOVT 1.25	1,500,000	1,523,325.00
NETHERLANDS GOVT 2.25	3,000,000	3,095,910.00
NETHERLANDS GOVT 2.5	3,000,000	3,207,600.00
NETHERLANDS GOVT 2.5	1,600,000	1,586,288.00
NETHERLANDS GOVT 2.75	3,500,000	3,665,130.00

NETHERLANDS GOVT 3.25	3,600,000	3,849,480.00
NETHERLANDS GOVT 3.25	3,500,000	3,925,950.00
NETHERLANDS GOVT 3.5	3,000,000	3,423,750.00
NETHERLANDS GOVT 3.75	3,400,000	3,569,592.00
NETHERLANDS GOVT 3.75	2,000,000	2,321,500.00
NETHERLANDS GOVT 3.75	2,500,000	3,080,250.00
NETHERLANDS GOVT 4	3,300,000	3,681,480.00
NETHERLANDS GOVT 4	3,500,000	4,041,100.00
NETHERLANDS GOVT 4	1,500,000	1,752,075.00
NETHERLANDS GOVT 4	2,700,000	3,379,050.00
NETHERLANDS GOVT 4.5	3,000,000	3,478,650.00
NETHERLANDS GOVT 5.5	2,500,000	3,473,575.00
NETHERLANDS GOVT 7.5	1,000,000	1,500,950.00
REP OF AUSTRIA 3.15	1,000,000	1,068,980.00
REP OF AUSTRIA 3.2	2,700,000	2,964,600.00
REP OF AUSTRIA 3.4	2,000,000	2,106,300.00
REP OF AUSTRIA 3.5	3,200,000	3,441,280.00
REP OF AUSTRIA 3.5	3,000,000	3,409,290.00
REP OF AUSTRIA 3.65	2,000,000	2,296,260.00
REP OF AUSTRIA 3.9	3,000,000	3,493,140.00
REP OF AUSTRIA 4	1,000,000	1,118,780.00
REP OF AUSTRIA 4.15	2,800,000	3,480,064.00
REP OF AUSTRIA 4.3	2,400,000	2,538,960.00
REP OF AUSTRIA 4.3	1,500,000	1,731,075.00
REP OF AUSTRIA 4.35	2,200,000	2,601,280.00
REP OF AUSTRIA 4.65	2,000,000	2,354,900.00
REP OF AUSTRIA 4.85	2,000,000	2,571,060.00
REP OF AUSTRIA 6.25	1,500,000	2,203,500.00
SPANISH GOV'T 3	6,000,000	6,059,880.00
SPANISH GOV'T 3.15	3,800,000	3,819,684.00
SPANISH GOV'T 3.25	5,000,000	5,023,000.00
SPANISH GOV'T 3.3	5,000,000	5,096,500.00
SPANISH GOV'T 3.4	1,000,000	1,020,400.00
SPANISH GOV'T 3.75	2,000,000	2,044,460.00
SPANISH GOV'T 3.8	4,500,000	4,559,400.00
SPANISH GOV'T 4	2,500,000	2,576,125.00
SPANISH GOV'T 4	4,000,000	3,899,200.00
SPANISH GOV'T 4.1	3,000,000	3,031,260.00
SPANISH GOV'T 4.2	3,250,000	2,638,187.50
SPANISH GOV'T 4.25	3,500,000	3,592,225.00
SPANISH GOV'T 4.25	4,000,000	4,124,800.00
SPANISH GOV'T 4.3	4,000,000	4,014,200.00
SPANISH GOV'T 4.4	3,800,000	3,952,114.00
SPANISH GOV'T 4.5	1,500,000	1,546,845.00
SPANISH GOV'T 4.6	3,500,000	3,586,555.00
SPANISH GOV'T 4.65	2,500,000	2,335,125.00
SPANISH GOV'T 4.7	2,000,000	1,728,300.00
SPANISH GOV'T 4.75	3,500,000	3,640,000.00
SPANISH GOV'T 4.8	3,300,000	3,178,560.00
SPANISH GOV'T 4.85	4,000,000	4,059,600.00
SPANISH GOV'T 4.9	4,000,000	3,562,880.00
SPANISH GOV'T 5.4	1,000,000	1,016,880.00
SPANISH GOV'T 5.5	3,380,000	3,641,882.40
SPANISH GOV'T 5.5	4,000,000	4,198,000.00
SPANISH GOV'T 5.75	2,700,000	2,756,916.00

	SPANISH GOV'T 5.85	3,500,000	3,719,275.00	
	SPANISH GOV'T 5.9	1,000,000	1,042,000.00	
	SPANISH GOV'T 6	2,400,000	2,522,040.00	
	ユーロ小計 (邦貨換算額:円)	792,680,000	871,295,376.60 (108,999,051,612)	
	国債証券合計		263,295,271,726 (263,295,271,726)	
	合計		263,295,271,726	
	(外貨建有価証券邦貨換算額合計:円)		(263,295,271,726)	

(注)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。

通貨	銘柄数		組入債券時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	国債証券	190銘柄	40.5%	41.3%
カナダドル	国債証券	29銘柄	2.7%	2.8%
オーストラリアドル	国債証券	15銘柄	1.5%	1.5%
英ポンド	国債証券	35銘柄	7.4%	7.5%
スイスフラン	国債証券	8銘柄	0.4%	0.4%
シンガポールドル	国債証券	8銘柄	0.4%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券	8銘柄	0.5%	0.6%
スウェーデンクローナ	国債証券	8銘柄	0.6%	0.6%
ノルウェークローネ	国債証券	5銘柄	0.3%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券	7銘柄	0.8%	0.8%
メキシコペソ	国債証券	6銘柄	1.0%	1.0%
ポーランドズロチ	国債証券	10銘柄	0.7%	0.8%
南アフリカランド	国債証券	6銘柄	0.6%	0.6%
ユーロ	国債証券	230銘柄	40.6%	41.4%

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

独立監査人の監査報告書

平成25年3月26日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

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30（債券重点型）の平成24年2月21日から平成25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。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）の平成25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。

利害関係

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

以上

-
- (注) 1. 上記は、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25年3月26日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

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24年2月21日から平成25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。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・DC年金バランス50（標準型）の平成25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。

利害関係

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

以上

-
- (注) 1. 上記は、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25年3月26日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

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24年2月21日から平成25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。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）の平成25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。

利害関係

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

以上

-
- (注) 1. 上記は、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24年 6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 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期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友アセットマネジメント株式会社の平成24年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成24年11月30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
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	辰 巳 幸 久

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」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24年4月1日から平成25年3月31日までの第28期事業年度の中間会計期間（平成24年4月1日から平成24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24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24年4月1日から平成24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。

強調事項

追加情報に記載されているとおり、会社は平成24年9月28日に、トヨタアセットマネジメント株式会社、トヨタファイナンシャルサービス株式会社、あいおいニッセイ同和損害保険株式会社、三井住友海上火災保険株式会社と、平成25年4月1日を効力発生日としてトヨタアセットマネジメント株式会社と経営統合する旨の合意書を締結した。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以上

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。