

**【表紙】**

**【提出書類】** 有価証券届出書

**【提出先】** 関東財務局長

**【提出日】** 平成23年7月7日

**【発行者名】** 三井住友アセットマネジメント株式会社

**【代表者の役職氏名】** 代表取締役社長 前田 良治

**【本店の所在の場所】** 東京都港区愛宕二丁目5番1号

**【事務連絡者氏名】** 隠地 保夫

**【電話番号】** 03-5405-0735

**【届出の対象とした募集内国投資信託受益証 スミセイ・DCバランスファンド（機動的資産配分型）  
券に係るファンドの名称】**

**【届出の対象とした募集内国投資信託受益証 1兆円を上限とします。  
券の金額】**

**【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】

スミセイ・DCバランスファンド（機動的資産配分型）

（愛称として「資産配分おまかせくん」という名称を用いることがあります。）

以下「当ファンド」といいます。

### （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】

1兆円を上限とします。

### （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、「おまかせ」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

**(5) 【申込手数料】**

無手数料です。

**(6) 【申込単位】**

1円以上1円単位

**(7) 【申込期間】**

平成23年7月8日から平成24年7月12日まで

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

**(8) 【申込取扱場所】**

販売会社において申込みを取り扱います。

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

**（ 9 ） 【 払込期日 】**

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

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

**（ 10 ） 【 払込取扱場所 】**

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

**（ 11 ） 【 振替機関に関する事項 】**

当ファンドの振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

**（ 12 ） 【 その他 】**

イ 申込証拠金

ありません。

ロ わが国以外の地域における募集

ありません。

ハ クーリング・オフ制度（金融商品取引法第37条の6）の適用

ありません。

ニ 振替受益権について

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

（参考：投資信託振替制度）

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

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

イ 当ファンドは、国内株式インデックス・マザーファンド（B号）、国内債券パッシブ・マザーファンド、外国株式インデックス・マザーファンド、外国債券パッシブ・マザーファンドおよびマネーインカム・マザーファンドの受益証券への投資を通じて、日本を含む世界各国の株式、公社債および短期金融資産に分散投資を行うことにより、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。

以下上記各マザーファンドを総称して、あるいはそれぞれを「マザーファンド」ということがあります。

ロ 委託会社は、受託会社と合意の上、金1兆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。

ハ 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。

(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、円短期金融資産）資産配分変更型））	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、債券および円短期金融資産であり、ファンドの収益はそれぞれの市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「資産複合」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。

投資対象地域	グローバル（日本を含む）	目論見書または信託約款において、組入資産による投資収益が日本を含む世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。）を投資対象として投資するものをいいます。
為替ヘッジ	為替ヘッジなし	目論見書または信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。







## 《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)
単 位 型	国 内	株 式
		債 券
	海 外	不 動 産 投 信
追 加 型		そ の 他 資 産 ( )
	内 外	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
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		
中 小 型 株	年 4 回	北 米		
債 券	年 6 回 (隔月)	欧 州	ファミリーファンド	あ り
一 般 公 債	年 12 回 (毎月)	ア ジ ア		
社 債	日 々	オ セ ア ニ ア		
その他債券 クレジット属性 ( )	そ の 他 ( )	中 南 米	ファンド・オブ・ファンズ	な し
不動産投信		ア フ リ カ		
その他資産 (投資信託証券(資産複合(株式、債券、 円振替金融資産)資産配分変更型))		中 近 東 (中 東)		
資産複合 ( )		エ マ ー ジ ン グ		
資産配分固定型 資産配分変更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

## （２）【ファンドの沿革】

平成20年3月31日

信託契約締結、設定、運用開始。

### （3）【ファンドの仕組み】

イ 当ファンドの関係法人とその役割

（イ）委託会社 「三井住友アセットマネジメント株式会社」

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

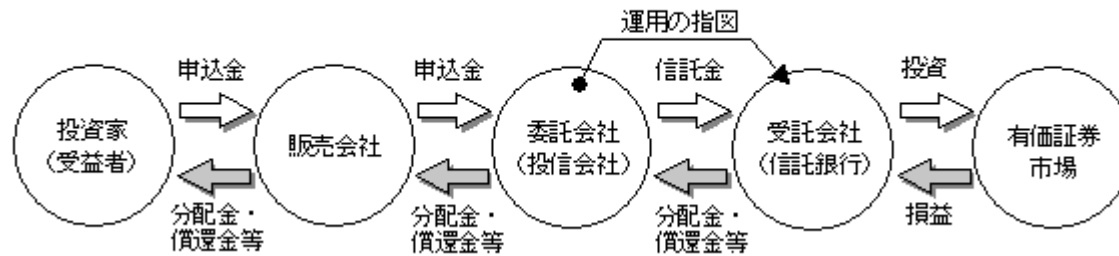
（ロ）受託会社 「住友信託銀行株式会社」

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

（ハ）販売会社

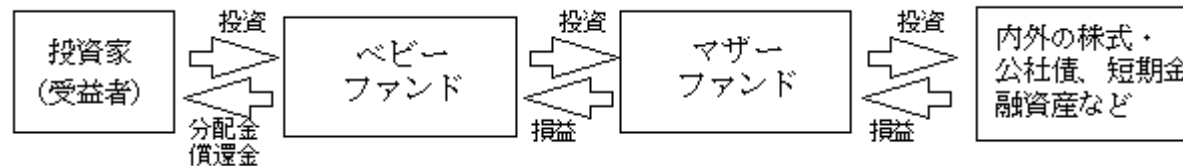
委託会社との間で締結される販売契約（名称の如何を問いません。）に基づき、当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書（目論見書）の提供、受益者からの一部解約実行請求の受付、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を行います。

#### 運営の仕組み



当ファンドの運用は、「ファミリーファンド方式」で行われます。

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



## □ 委託会社の概況

## (イ) 資本金の額

2,000百万円（平成23年5月31日現在）

## (ロ) 会社の沿革

昭和60年7月15日 三生投資顧問株式会社設立

昭和62年2月20日 証券投資顧問業の登録

昭和62年6月10日 投資一任契約にかかる業務の認可

平成11年1月1日 三井生命保険相互会社の特別勘定運用部門と統合

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

平成12年1月27日 証券投資信託委託業の認可取得

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

## (ハ) 大株主の状況

（平成23年5月31日現在）

名称	住所	所有 株式数	比率 (%)
住友生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区城見一丁目4番35号	7,056	40.0
三井住友海上火災保険株式会社	東京都中央区新川二丁目27番2号	4,851	27.5
株式会社三井住友銀行	東京都千代田区丸の内一丁目1番2号	4,851	27.5
三井生命保険株式会社	東京都千代田区大手町二丁目1番1号	882	5.0

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### イ 基本方針

当ファンドは、マザーファンドの受益証券への投資を通じて、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。

#### ロ 投資態度

(イ) 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を主要投資対象とする5つのマザーファンドに分散投資を行います。

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
短期金融資産	マネーインカム・マザーファンド

(ロ) 委託会社が独自に作成する基本資産配分に対し一定の許容変動幅内で機動的に資産配分を変更します。

ファンドの基本資産配分ならびに各資産の許容変動幅

資産配分					
	国内株式	国内債券	外国株式	外国債券	短期金融資産
基本	20%	50%	10%	15%	5%
上限	35%	65%	25%	30%	20%
下限	5%	35%	0%	0%	0%

(注) 基本資産配分は、5年に一回程度検証を行い、必要であれば見直しを行います。

(ハ) 運用にあたっては、基本資産配分に基づいて、以下の指数を合成したベンチマークを上回る投資成果を目指します。

国内株式	国内債券	外国株式	外国債券	短期金融資産
TOPIX (東証株価指数) 配当込み	NOMURA - BPI (総合)	MSCI - KOKUSAI インデックス (円ベース)	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)	無担保コール 翌日物
20%	50%	10%	15%	5%

(注) 基本資産配分の見直しに伴い見直しを行います。

（二）実質外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

（ホ）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．日本を含む世界各国の株式、公社債および短期金融資産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。

実際の運用は、各資産に投資する5つのマザーファンドへの投資を通じて行います（ファミリーファンド方式）。

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
短期金融資産	マネーインカム・マザーファンド

## 〔ファミリーファンド方式〕



- 2．委託会社が独自に作成する基本資産配分に対し一定の許容変動幅内で機動的に資産配分を変更します。

## 〔ファンドの基本資産配分ならびに各資産の許容変動幅〕

資産配分					
	国内株式	国内債券	外国株式	外国債券	短期金融資産
基本	20%	50%	10%	15%	5%

上限	35%	65%	25%	30%	20%
下限	5%	35%	0%	0%	0%

（注）基本資産配分は、5年に一回程度検証を行い、必要であれば見直しを行います。

**3. 運用にあたっては、基本資産配分に基づいて、以下の指数を合成したベンチマークを上回る投資成果を目指します。**

国内株式	国内債券	外国株式	外国債券	短期金融資産
TOPIX （東証株価指数） 配当込み	NOMURA - BPI（総合）	MSCI - KOKUSAI インデックス （円ベース）	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）	無担保コール 翌日物
20%	50%	10%	15%	5%

（注）基本資産配分の見直しに伴い見直しを行います。



#### 4. 実質外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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。

- ・ T O P I X（東証株価指数）配当込み、N O M U R A - B P I（総合）、M S C I - K O K U S A I 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、M S C I インク、シティグループ・グローバル・マーケッツ・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。

#### 〔各マザーファンドの運用プロセス〕

##### 国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

##### 国内債券パッシブ・マザーファンド

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

##### 外国株式インデックス・マザーファンド

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

**外国債券パッシブ・マザーファンド**

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

**マネーインカム・マザーファンド**

主として円貨建の短期公社債および短期金融商品に投資し、安定した収益の確保を目指した運用を行います。

**(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. 約束手形
4. 金銭債権

(ロ) 特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

1. 為替手形

## ロ 投資対象とする有価証券

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

1. 株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証書と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10. コマーシャル・ペーパー
11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
14. 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

16. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）
  17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
  18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
  20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  21. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
- なお、第1号の証券または証書、第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券および第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するもの、および第14号の証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、第13号の証券および第14号の証券（ただし、投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

#### 八 投資対象とする金融商品

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

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

### （3）【運用体制】

#### イ 運用体制

当ファンドの運用は、次のプロセスに基づいて行われます。

#### （イ）計画（Plan）

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

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

#### （ロ）実行（Do）

担当運用グループは、月次運用計画に基づき、ファンドのポートフォリオの構築、およびポートフォリオ管理の一環として日々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

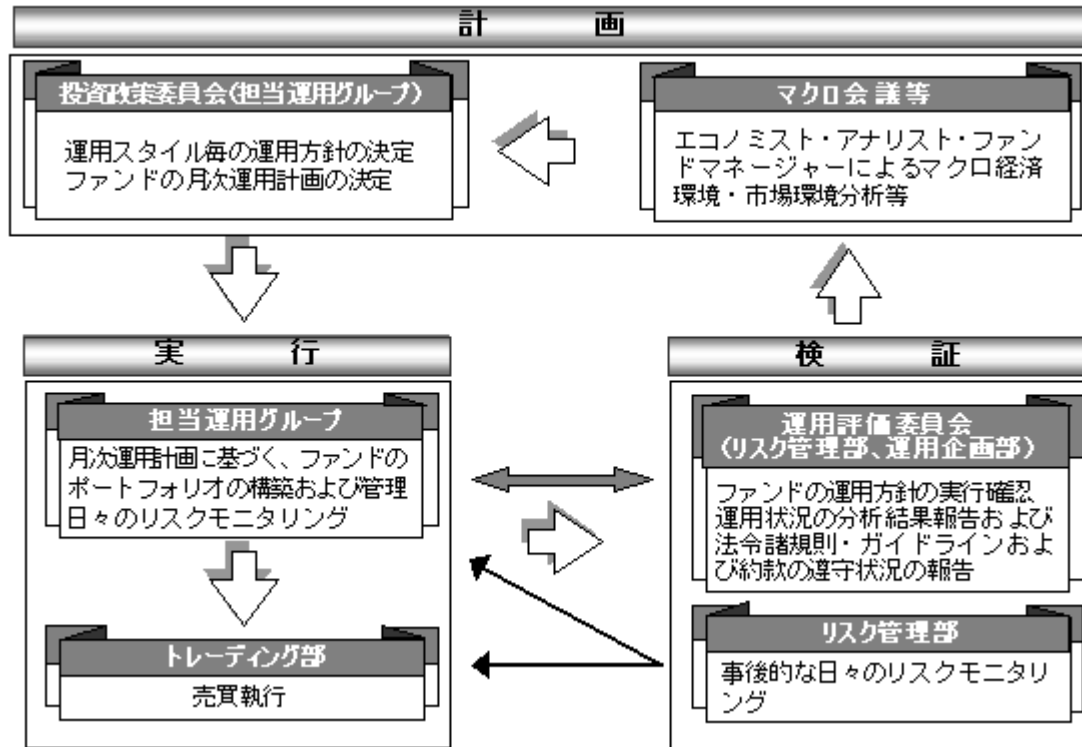
します。

(八) 検証 (Check)

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

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

## 【ファンドの運用体制】



リスク管理部は10名程度、運用企画部は8名程度で構成されています。

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

□ 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】

毎年１回（原則として４月13日、休業日の場合は翌営業日となります。）決算を行い、原則として以下の方針に基づき収益分配を行います。

イ 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と有価証券売買益（評価益を含みます。）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、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合等には、委託会社の判断により収益分配を行わない場合があります。

ハ 留保益の運用については、前記「（１）投資方針」に基づいて運用を行います。

**（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 株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%以下とします。  
実質投資割合とは、当ファンドが保有するある種類の資産の評価額が当ファンドの純資産総額に占める比率（「組入比率」といいます。）と、当該同一種類の資産のマザーファンドにおける組入比率に当該マザーファンド受益証券の当ファンドにおける組入比率を乗じて得た率を合計したものをいいます（以下同じ。）。
- ロ 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
- ハ マザーファンド受益証券以外の投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- 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70%以下とします。
- ホ 同一銘柄の株式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%以下とします。
- 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%以下とします。
- 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%以下とします。

**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とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けにかかる建玉の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
  - （ハ）上記（ロ）において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売付けにかかる建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

- (二) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売付けにかかる建玉の時価総額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。

#### 八 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。）、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。）、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。）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、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、わが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。
- (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、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。

#### 二 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、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限りではありません。
- (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、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。

- (八) 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。
- (二) 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)各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

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

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

(ロ) 上記(イ)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) 上記(イ)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) 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、ならびに信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、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) 上記(イ)の予約取引の指図は、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（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）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。

(ニ) 上記(ロ)において、信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額を

いいます。

#### 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性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、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、
- (ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。
- (ハ) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- (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、

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

## イ 基本方針

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

## ロ 投資態度

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

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

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

**（2）投資対象**

## イ 投資対象とする資産の種類

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

## ロ 投資対象とする有価証券

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

## ハ 投資対象とする金融商品

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

**（3）投資制限**

## イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

（イ）外貨建資産への投資は行いません。

（ロ）株式への投資割合には制限を設けません。

## ロ 法令に基づく投資制限

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

**（国内債券バッシブ・マザーファンド）****（１）投資方針等**

## イ 基本方針

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

## ロ 投資態度

- （イ）NOMURA - B P I（総合）をベンチマークとし、ベンチマークと連動する投資成果を目指します。
- （ロ）公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。
- （ハ）資金動向、市況動向等の急変により上記の運用が困難となった場合、暫定的に上記と異なる運用を行う場合があります。

**（２）投資対象**

## イ 投資対象とする資産の種類

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

## ロ 投資対象とする有価証券

前記「２ 投資方針（２）投資対象 ロ 投資対象とする有価証券」において記載したベビーファンドが投資対象とする有価証券の各号（第１号から第21号）に掲げるものに投資します。

## ハ 投資対象とする金融商品

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

**（３）投資制限**

## イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- （イ）株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- （ロ）新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- （ハ）投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- （ニ）外貨建資産への投資は行いません。
- （ホ）同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。

## ロ 法令に基づく投資制限

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

## （外国株式インデックス・マザーファンド）

### （１）投資方針等

#### イ 基本方針

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

#### ロ 投資態度

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

（ロ）外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行わないものとします。

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

### （２）投資対象

#### イ 投資対象とする資産の種類

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

#### ロ 投資対象とする有価証券

前記「２ 投資方針（２）投資対象 ロ 投資対象とする有価証券」において記載したベビーファンドが投資対象とする有価証券の各号のうち、第1号、第2号、第4号、第5号、第10号から第21号に掲げるものに投資します（ただし、第14号に掲げるもののうち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）株式への投資割合には制限を設けません。

（ロ）外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

#### ロ 法令に基づく投資制限

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

## （外国債券パッシブ・マザーファンド）

### （１）投資方針等

#### イ 基本方針

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

#### ロ 投資態度

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

（ロ）ポートフォリオ構築にあたっては、取引コストを極力抑えながら、推定トラッキングエラーを最小化します。

（ハ）ベンチマークの月次の変化状況とポートフォリオのリスク量の状況を勘案しながらリバランスを行います。

（ニ）保有する外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

（ホ）公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

（ヘ）資金動向、市況動向等の急変により上記の運用が困難となった場合、暫定的に上記と異なる運用を行う場合があります。

### （２）投資対象

#### イ 投資対象とする資産の種類

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

#### ロ 投資対象とする有価証券

前記「２ 投資方針（２）投資対象 ロ 投資対象とする有価証券」において記載したベビーファンドが投資対象とする有価証券の各号（第1号から第21号）に掲げるものに投資します（ただし、第14号に掲げるもののうち投資法人債券を除きます。）。

#### ハ 投資対象とする金融商品

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

### （３）投資制限

#### イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

（ロ）投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

（ハ）外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

内とします。

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

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

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

□ 法令に基づく投資制限

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



**（マネーインカム・マザーファンド）****（１）投資方針等**

## イ 基本方針

円貨建の短期公社債および短期金融商品を主要投資対象とし、安定した収益の確保を目指します。

## ロ 投資態度

（イ）主として、円貨建の短期公社債および短期金融商品に投資し、安定した収益の確保を目指します。

（ロ）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（第１号から第21号）に掲げるものに投資します。

## ハ 投資対象とする金融商品

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

**（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%以下とします。

（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%以下とします。

（ハ）外貨建資産への投資は行いません。

（ニ）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%以下とします。

## 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、主に日本を含む世界各国の株式、債券および短期金融資産を投資対象としています（マザーファンドを通じて間接的に投資する場合を含みます。）。当ファンドの基準価額は、組み入れた株式や債券の値動き、為替相場の変動等の影響により上下しますので、これにより投資元本を割り込むことがあります。また、組み入れた株式や債券の発行者の経営・財務状況の変化およびそれらに関する外部評価の変化等により、投資元本を割り込むことがあります。

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

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

#### （イ）株式市場リスク

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

#### （ロ）債券市場リスク

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

#### （ハ）為替変動リスク

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

#### （ニ）信用リスク

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

#### （ホ）カントリーリスク

海外に投資を行う場合には、投資する有価証券の発行者に起因するリスクのほか、投資先の国の政治・経済・社会状況の不安定化や混乱などによって投資した資金の回収が困難になることや、その影響により投

資する有価証券の価格が大きく変動することがあり、基準価額が下落する要因となります。

(ヘ) 市場流動性リスク

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

(ト) 分配金にかかる留意点

ファンドは、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて分配を行う場合があります。したがって、ファンドの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唆するものではありません。

受益者の個別元本（追加型投資信託における受益者毎の信託時の受益権の価額）の状況によっては、分配金額の一部または全部が、実質的に元本の一部払戻しに相当する場合があります。

分配金はファンドの信託財産から支払われます。そのため、分配金支払い後の純資産総額はその相当額が減少することとなり、基準価額が下落する要因となります。計算期間中に発生した運用収益を超えて分配を行った場合、当該決算日の基準価額はその前期決算日の基準価額と比べて下落することになります。

(チ) ファミリーファンド方式にかかる留意点

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

ロ 投資リスクの管理体制

リスク管理の実効性を高め、また、コンプライアンスの徹底を図るために、運用部門から独立した組織（リスク管理部および法務コンプライアンス部）を設置し、ファンドの投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる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】

純資産総額に年0.6195%（税抜き0.59%）の率を乗じて得た金額が信託報酬として計算され、信託財産の費用として計上されます。

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

信託報酬の実質的配分は以下の通りです。

委託会社	販売会社	受託会社
年0.2205% (0.21%)	年0.3675% (0.35%)	年0.0315% (0.03%)

( )内は税抜き。

##### (4)【その他の手数料等】

イ 信託財産の財務諸表の監査に要する費用は、原則として、計算期間を通じて毎日、純資産総額に年0.00525%（税抜き0.005%）の率を乗じて得た金額が信託財産の費用として計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。監査費用は、将来、監査法人との契約等により変更となることがあります。

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

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

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

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

## （５）【課税上の取扱い】

### イ 個別元本について

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

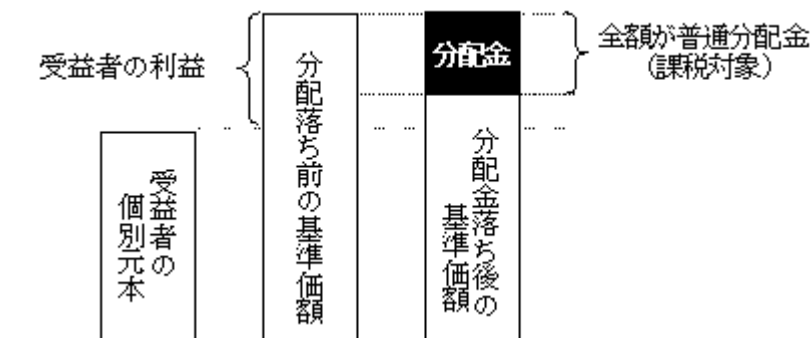
### ロ 一部解約時および償還時の課税について

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

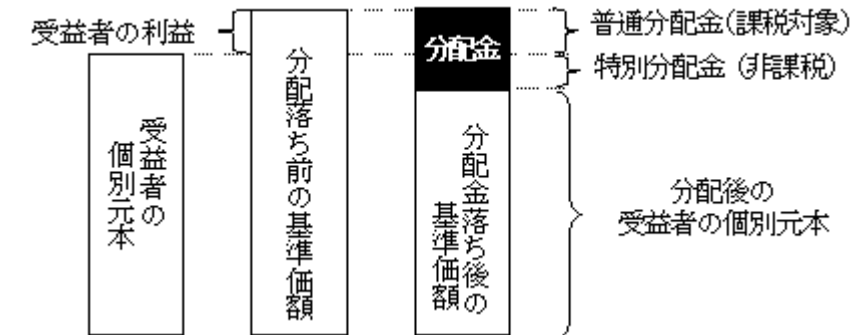
### ハ 収益分配金の課税について

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

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



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



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

## 二 個人、法人別の課税の取扱いについて

### (イ) 個人の受益者に対する課税

#### ・ 収益分配時

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

#### ・ 一部解約時および償還時

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

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

### (ロ) 法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、平成23年12月31日までは7%（所得税のみ）、平成24年1月1日以降は15%（所得税のみ）の税率で源泉徴収されます。

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

当ファンドは、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。

当ファンドの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70%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）。

上記にかかわらず、確定拠出年金制度における受益者が支払いを受ける収益分配金、一部解約金、償還金はいずれも課税されません。

上記「(5)課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、平成23年5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】

平成23年5月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国内株式インデックス・マザーファンド(B号)受益証券	日本	31,239,532	21.89
国内債券パッシブ・マザーファンド受益証券	日本	66,674,229	46.73
外国株式インデックス・マザーファンド受益証券	日本	16,380,984	11.48
外国債券パッシブ・マザーファンド受益証券	日本	21,297,040	14.93
マネーインカム・マザーファンド受益証券	日本	7,087,220	4.97
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,798	0.00
合計(純資産総額)		142,683,803	100.00

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

## (2)【投資資産】

## 【投資有価証券の主要銘柄】

## イ 主要投資銘柄

平成23年5月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量(口)	帳簿価額 単価/金額 (円)	評価額 単価/金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託 受益証券	国内債券パッシブ・ マザーファンド	61,023,457	1.0818 66,018,034	1.0926 66,674,229	46.73
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)	28,062,821	1.1161 31,320,969	1.1132 31,239,532	21.89
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	18,742,445	1.1530 21,611,902	1.1363 21,297,040	14.93
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	12,112,529	1.3853 16,779,663	1.3524 16,380,984	11.48
日本	親投資信託 受益証券	マネーインカム・ マザーファンド	7,026,790	1.0084 7,086,223	1.0086 7,087,220	4.97

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

平成23年 5 月31日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	100.00
合計	100.00

**【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。

## （3）【運用実績】

## 【純資産の推移】

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21年4月13日)(分配落)	16,686,392	8,941
第1期(平成21年4月13日)(分配付)	16,686,392	8,941
第2期(平成22年4月13日)(分配落)	68,468,980	9,680
第2期(平成22年4月13日)(分配付)	68,468,980	9,680
第3期(平成23年4月13日)(分配落)	128,503,036	9,450
第3期(平成23年4月13日)(分配付)	128,503,036	9,450
平成22年5月末日	76,443,095	9,276
平成22年6月末日	81,030,918	9,127
平成22年7月末日	84,282,007	9,249
平成22年8月末日	85,314,223	9,066
平成22年9月末日	89,444,343	9,288
平成22年10月末日	91,411,641	9,177
平成22年11月末日	97,044,806	9,287
平成22年12月末日	111,924,426	9,407
平成23年1月末日	116,322,049	9,454
平成23年2月末日	118,799,681	9,565
平成23年3月末日	128,623,355	9,479
平成23年4月末日	133,226,889	9,507
平成23年5月末日	142,683,803	9,432

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

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

## 【分配の推移】

計算期間	1万口当たり分配金(円)
第1期(平成20年3月31日～平成21年4月13日)	0
第2期(平成21年4月14日～平成22年4月13日)	0

第3期（平成22年4月14日～平成23年4月13日）	0
----------------------------	---

## 【収益率の推移】

計算期間	収益率（％）
第1期	10.6
第2期	8.3
第3期	2.4

（注1）収益率とは、計算期間末の分配付基準価額から前期末分配落基準価額を控除した額を前期末分配落基準価額で除したものをいいます。

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

## （4）【設定及び解約の実績】

計算期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	19,697,539	1,034,910
第2期	55,385,703	3,317,301
第3期	74,934,583	9,676,704

（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：マザーファンドの投資状況・投資資産〕

## 〔国内株式インデックス・マザーファンド（B号）〕

## （１）投資状況

平成23年 5月31日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	305,639,775,640	97.93
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,445,041,453	2.07
合計(純資産総額)		312,084,817,093	100.00

当ファンドは、平成23年 5月31日現在、株価指数先物取引を買建てしており、その評価額は6,323,125,000円（投資比率2.03%）です。

## （２）投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成23年 5月31日現在

国 / 地域	種類	銘柄名 / 業種	数量 (株)	帳簿価額 単価 / 金額 (円)	評価額 単価 / 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車 〔輸送用機器〕	3,475,100	3,224.23 11,204,555,200	3,400.00 11,815,340,000	3.79
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ 〔銀行業〕	20,216,700	394.46 7,974,746,600	375.00 7,581,262,500	2.43
日本	株式	本田技研工業 〔輸送用機器〕	2,282,300	3,013.27 6,877,207,000	3,090.00 7,052,307,000	2.26
日本	株式	キヤノン 〔電気機器〕	1,679,900	3,912.61 6,572,795,700	3,905.00 6,560,009,500	2.10
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ 〔銀行業〕	2,036,600	2,564.13 5,222,114,776	2,350.00 4,786,010,000	1.53
日本	株式	三菱商事 〔卸売業〕	2,138,100	2,118.69 4,529,975,600	2,057.00 4,398,071,700	1.41

日本	株式	みずほフィナンシャルグループ 〔銀行業〕	32,941,200	133.28 4,390,528,281	128.00 4,216,473,600	1.35
日本	株式	武田薬品工業 〔医薬品〕	1,061,200	3,885.89 4,123,715,800	3,865.00 4,101,538,000	1.31
日本	株式	日本電信電話 〔情報・通信業〕	1,002,700	3,781.06 3,791,276,400	3,820.00 3,830,314,000	1.23
日本	株式	ソフトバンク 〔情報・通信業〕	1,182,900	2,915.23 3,448,430,200	3,145.00 3,720,220,500	1.19
日本	株式	ファナック 〔電気機器〕	281,600	11,992.43 3,377,068,300	12,490.00 3,517,184,000	1.13
日本	株式	エヌ・ティ・ティ・ドコモ 〔情報・通信業〕	22,027	136,739.35 3,011,957,772	151,800.00 3,343,698,600	1.07
日本	株式	ソニー 〔電気機器〕	1,519,600	2,926.46 4,447,051,900	2,163.00 3,286,894,800	1.05
日本	株式	小松製作所 〔機械〕	1,341,800	2,344.87 3,146,357,300	2,432.00 3,263,257,600	1.05
日本	株式	三井物産 〔卸売業〕	2,305,500	1,315.76 3,033,486,400	1,384.00 3,190,812,000	1.02
日本	株式	パナソニック 〔電気機器〕	3,149,100	1,179.19 3,713,397,185	954.00 3,004,241,400	0.96
日本	株式	任天堂 〔その他製品〕	154,800	22,568.32 3,493,576,500	18,870.00 2,921,076,000	0.94
日本	株式	日立製作所 〔電気機器〕	6,079,000	398.08 2,419,976,000	464.00 2,820,656,000	0.90
日本	株式	日産自動車 〔輸送用機器〕	3,418,000	780.46 2,667,639,100	814.00 2,782,252,000	0.89
日本	株式	三菱地所 〔不動産業〕	1,870,000	1,414.82 2,645,724,000	1,447.00 2,705,890,000	0.87
日本	株式	三菱電機 〔電気機器〕	2,704,000	836.30 2,261,380,000	915.00 2,474,160,000	0.79
日本	株式	K D D I 〔情報・通信業〕	4,148	482,500.14 2,001,410,584	582,000.00 2,414,136,000	0.77

日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス 〔小売業〕	1,117,300	2,042.93 2,282,570,600	2,156.00 2,408,898,800	0.77
日本	株式	東芝 〔電気機器〕	5,343,000	431.39 2,304,929,000	430.00 2,297,490,000	0.74
日本	株式	野村ホールディングス 〔証券、商品先物取引業〕	5,629,800	476.65 2,683,465,242	408.00 2,296,958,400	0.74
日本	株式	東京海上ホールディングス 〔保険業〕	1,014,100	2,351.91 2,385,080,350	2,229.00 2,260,428,900	0.72
日本	株式	東日本旅客鉄道 〔陸運業〕	471,200	4,963.95 2,339,014,600	4,740.00 2,233,488,000	0.72
日本	株式	信越化学工業 〔化学〕	471,800	4,080.20 1,925,041,300	4,215.00 1,988,637,000	0.64
日本	株式	日本たばこ産業 〔食料品〕	6,307	287,871.34 1,815,604,597	314,000.00 1,980,398,000	0.63
日本	株式	アステラス製薬 〔医薬品〕	628,200	3,001.05 1,885,264,540	3,100.00 1,947,420,000	0.62

## □ 種類別・業種別の投資比率

平成23年 5月31日現在

種類	業種	投資 比率 (%)	種類	業種	投資 比率 (%)
株式（国内）	水産・農林業	0.09	株式（国内）	精密機器	1.47
	鉱業	0.67		その他製品	1.94
	建設業	2.17		電気・ガス業	2.83
	食料品	3.08		陸運業	3.34
	繊維製品	0.96		海運業	0.52
	パルプ・紙	0.35		空運業	0.29
	化学	5.96		倉庫・運輸関連業	0.22
	医薬品	4.70		情報・通信業	5.96
	石油・石炭製品	0.92		卸売業	5.35
	ゴム製品	0.70		小売業	3.63
	ガラス・土石製品	1.33		銀行業	8.72
	鉄鋼	2.10		証券、商品先物取引業	1.29
	非鉄金属	1.36		保険業	2.57
	金属製品	0.72		その他金融業	0.74
	機械	5.24		不動産業	2.31
	電気機器	14.41		サービス業	1.66
	輸送用機器	10.35		合計	97.93

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

平成23年 5月31日現在

種類	取引所等および 資産の名称	買建 / 売建	数量 (枚)	簿価(円)	時価(円)	投資 比率 (%)
株価指数 先物取引	東京証券取引所 TOPIX先物	買建	755	6,218,561,900	6,323,125,000	2.03

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については以下のように評価しております。

- ・原則として基準日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
- ・このような時価が発表されていない場合には、基準日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。



## 〔国内債券バッシブ・マザーファンド〕

## (1) 投資状況

平成23年5月31日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	375,739,007,650	73.98
地方債証券	日本	33,689,882,900	6.63
特殊債券	日本	53,354,480,941	10.50
	韓国	201,917,000	0.04
	小計	53,556,397,941	10.54
社債券	日本	37,410,985,800	7.37
	アメリカ	2,937,286,000	0.58
	イギリス	708,091,000	0.14
	オランダ	399,727,000	0.08
	韓国	204,000,000	0.04
	小計	41,660,089,800	8.20
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,265,722,086	0.64
合計(純資産総額)		507,911,100,377	100.00

## (2) 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成23年5月31日現在

国 / 地域	種類	銘柄名	額面金額 (円)	帳簿価額 単価 / 金額 (円)	評価額 単価 / 金額 (円)	利率(%) / 償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第247回利付国債(10年)	15,585,000,000	101.13 15,761,578,050	101.13 15,762,045,600	0.8 2013/3/20	3.10
日本	国債証券	第272回利付国債(10年)	13,145,000,000	104.44 13,728,947,650	104.38 13,720,751,000	1.4 2015/9/20	2.70
日本	国債証券	第270回利付国債(10年)	11,387,000,000	103.90 11,831,548,480	103.83 11,823,235,970	1.3 2015/6/20	2.33
日本	国債証券	第244回利付国債(10年)	11,392,000,000	101.29 11,539,868,160	101.29 11,539,754,240	1 2012/12/20	2.27

日本	国債証券	第258回利付国債（10年）	11,153,000,000	103.01 11,488,816,830	102.99 11,487,478,470	1.3 2014/3/20	2.26
日本	国債証券	第260回利付国債（10年）	10,735,000,000	104.14 11,179,489,000	104.12 11,178,248,150	1.6 2014/6/20	2.20
日本	国債証券	第265回利付国債（10年）	10,650,000,000	104.29 11,107,843,500	104.24 11,102,518,500	1.5 2014/12/20	2.19
日本	国債証券	第263回利付国債（10年）	10,592,000,000	104.39 11,057,058,800	104.36 11,054,340,800	1.6 2014/9/20	2.18
日本	国債証券	第268回利付国債（10年）	10,315,000,000	104.49 10,778,659,250	104.44 10,773,295,450	1.5 2015/3/20	2.12
日本	国債証券	第277回利付国債（10年）	9,925,000,000	105.65 10,486,457,250	105.57 10,477,822,500	1.6 2016/3/20	2.06
日本	国債証券	第253回利付国債（10年）	9,910,000,000	103.25 10,232,471,400	103.23 10,230,885,800	1.6 2013/9/20	2.01
日本	国債証券	第274回利付国債（10年）	9,605,000,000	105.04 10,089,284,100	104.96 10,081,408,000	1.5 2015/12/20	1.98
日本	国債証券	第250回利付国債（10年）	9,465,000,000	100.66 9,528,036,900	100.66 9,527,658,300	0.5 2013/6/20	1.88
日本	国債証券	第256回利付国債（10年）	8,110,000,000	103.05 8,357,760,500	103.04 8,356,706,200	1.4 2013/12/20	1.65
日本	国債証券	第313回利付国債（10年）	7,550,000,000	101.56 7,668,050,000	101.40 7,656,379,500	1.3 2021/3/20	1.51
日本	国債証券	第312回利付国債（10年）	6,670,000,000	100.96 6,734,176,500	100.73 6,718,891,100	1.2 2020/12/20	1.32
日本	国債証券	第310回利付国債（10年）	6,600,000,000	99.57 6,571,950,000	99.28 6,552,612,000	1 2020/9/20	1.29
日本	国債証券	第303回利付国債（10年）	6,195,000,000	104.02 6,444,410,700	103.70 6,424,215,000	1.4 2019/9/20	1.26
日本	国債証券	第305回利付国債（10年）	6,140,000,000	102.97 6,322,372,000	102.64 6,302,403,000	1.3 2019/12/20	1.24
日本	国債証券	第306回利付国債（10年）	5,850,000,000	103.57 6,058,962,000	103.27 6,041,587,500	1.4 2020/3/20	1.19
日本	国債証券	第301回利付国債（10年）	5,295,000,000	104.98 5,558,691,000	104.65 5,541,641,100	1.5 2019/6/20	1.09
日本	国債証券	第280回利付国債（10年）	5,137,000,000	107.28 5,511,341,000	107.20 5,507,223,590	1.9 2016/6/20	1.08
日本	国債証券	第308回利付国債（10年）	5,070,000,000	102.49 5,196,293,700	102.19 5,181,134,400	1.3 2020/6/20	1.02
日本	国債証券	第290回利付国債（10年）	4,497,000,000	104.88 4,716,768,390	104.74 4,710,337,680	1.4 2018/3/20	0.93

日本	国債証券	第288回利付国債（10年）	4,405,000,000	106.84 4,706,698,450	106.74 4,701,897,000	1.7 2017/9/20	0.93
日本	国債証券	第297回利付国債（10年）	4,503,000,000	104.53 4,707,301,110	104.27 4,695,278,100	1.4 2018/12/20	0.92
日本	国債証券	第284回利付国債（10年）	4,367,000,000	106.60 4,655,440,350	106.50 4,651,117,020	1.7 2016/12/20	0.92
日本	国債証券	第286回利付国債（10年）	4,330,000,000	107.42 4,651,372,600	107.31 4,646,696,200	1.8 2017/6/20	0.91
日本	国債証券	第289回利付国債（10年）	4,344,000,000	105.61 4,587,712,400	105.47 4,581,660,240	1.5 2017/12/20	0.90
日本	国債証券	第282回利付国債（10年）	4,300,000,000	106.48 4,578,726,000	106.35 4,573,394,000	1.7 2016/9/20	0.90

□ 種類別の投資比率

平成23年 5月31日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	73.98
地方債証券	6.63
特殊債券	10.54
社債券	8.20
合計	99.36

**投資不動産物件**

該当事項はありません。

**その他投資資産の主要なもの**

該当事項はありません。

## 〔外国株式インデックス・マザーファンド〕

## (1) 投資状況

平成23年5月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	116,979,841,436	50.89
	カナダ	13,458,285,208	5.85
	ドイツ	9,649,031,424	4.20
	イタリア	3,087,300,606	1.34
	フランス	10,611,621,568	4.62
	オーストラリア	8,923,940,798	3.88
	イギリス	23,409,271,603	10.18
	スイス	10,368,577,278	4.51
	バミューダ	802,032,152	0.35
	香港	2,635,205,496	1.15
	シンガポール	1,767,419,550	0.77
	ニュージーランド	131,278,340	0.06
	オランダ	3,059,666,563	1.33
	スペイン	3,926,918,183	1.71
	ベルギー	1,053,621,473	0.46
	スウェーデン	3,617,541,086	1.57
	ノルウェー	948,115,363	0.41
	オーストリア	362,403,411	0.16
	ルクセンブルク	630,412,340	0.27
	フィンランド	1,183,323,207	0.51
	デンマーク	1,195,959,049	0.52
	アイルランド	1,424,031,047	0.62
	ギリシャ	213,931,893	0.09
	キプロス	25,637,535	0.01
	イスラエル	810,097,343	0.35
	ポルトガル	293,819,477	0.13
	ケイマン諸島	165,869,912	0.07
	モーリシャス	35,645,571	0.02
	リベリア	53,922,158	0.02
	ジャージー	677,794,574	0.29
ガーンジー	75,964,469	0.03	

	アンティル	1,126,594,030	0.49	
	マン島	95,456,757	0.04	
	小計	222,800,530,900	96.92	
投資証券	アメリカ	2,282,799,795	0.99	
	カナダ	31,014,133	0.01	
	フランス	319,863,717	0.14	
	オーストラリア	764,460,758	0.33	
	イギリス	312,372,399	0.14	
	香港	74,096,620	0.03	
	シンガポール	108,060,374	0.05	
	オランダ	37,891,920	0.02	
	小計	3,930,559,716	1.71	
	現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,155,972,830	1.37
	合計(純資産総額)		229,887,063,446	100.00

## (2) 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成23年5月31日現在

国/ 地域	種類	銘柄名 / 業種	数量 (株)	帳簿価額 単価 / 金額 (円)	評価額 単価 / 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION 〔エネルギー〕	607,393	5,624.39 3,416,218,273	6,683.11 4,059,276,904	1.77
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〕	110,524	25,659.98 2,836,044,602	27,289.72 3,016,169,101	1.31
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED 〔食品・飲料・タバコ〕	417,400	5,320.70 2,220,861,348	5,194.65 2,168,249,414	0.94
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP 〔ソフトウェア・サービス〕	149,626	11,566.64 1,730,671,393	13,547.39 2,027,043,272	0.88
アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION 〔エネルギー〕	242,490	6,622.45 1,605,878,967	8,347.62 2,024,215,537	0.88
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO 〔資本財〕	1,283,220	1,293.27 1,659,551,469	1,572.30 2,017,616,045	0.88
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP 〔ソフトウェア・サービス〕	927,834	2,047.07 1,899,343,744	2,002.58 1,858,069,976	0.81
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO 〔家庭用品・パーソナル用品〕	337,270	5,024.26 1,694,534,058	5,354.25 1,805,829,921	0.79
アメリカ	株式	AT&T INC 〔電気通信サービス〕	712,165	2,240.37 1,595,517,374	2,530.73 1,802,301,033	0.78
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC 〔銀行〕	2,131,144	869.99 1,854,087,607	842.60 1,795,702,360	0.78
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〕	330,938	5,004.85 1,656,296,505	5,400.35 1,787,183,543	0.78
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〕	965,239	1,340.99 1,294,376,232	1,692.81 1,633,974,339	0.71
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO 〔各種金融〕	470,789	3,069.39 1,445,037,873	3,460.85 1,629,332,558	0.71

オーストラリア	株式	BHP BILLITON LTD 〔素材〕	387,130	3,762.31 1,456,505,973	3,819.73 1,478,732,423	0.64
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC 〔電気通信サービス〕	6,287,112	212.48 1,335,933,339	226.38 1,423,315,142	0.62
イギリス	株式	BP PLC 〔エネルギー〕	2,263,723	571.97 1,294,802,470	614.27 1,390,551,296	0.60
アメリカ	株式	WELLS FARGO & COMPANY 〔銀行〕	600,481	2,203.17 1,322,962,445	2,275.96 1,366,672,658	0.59
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE 〔食品・飲料・タバコ〕	251,737	5,127.79 1,290,854,974	5,379.32 1,354,176,094	0.59
アメリカ	株式	ORACLE CORPORATION 〔ソフトウェア・サービス〕	484,329	2,203.97 1,067,451,429	2,725.65 1,320,114,244	0.57
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〕	254,312	5,158.36 1,311,835,340	5,166.00 1,313,778,080	0.57
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A 〔ソフトウェア・サービス〕	29,936	47,100.46 1,409,999,610	42,130.39 1,261,215,414	0.55
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC. 〔食品・飲料・タバコ〕	218,502	4,679.71 1,022,527,480	5,703.65 1,246,260,592	0.54
イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS 〔エネルギー〕	426,964	2,601.97 1,110,947,860	2,851.87 1,217,649,067	0.53
アメリカ	株式	INTEL CORP 〔半導体・半導体製造装置〕	672,279	1,724.36 1,159,252,092	1,796.34 1,207,644,885	0.53
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN 〔医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス〕	84,580	13,229.18 1,118,924,433	14,037.02 1,187,251,997	0.52
フランス	株式	TOTAL SA 〔エネルギー〕	254,396	4,318.26 1,098,550,055	4,586.27 1,166,728,781	0.51
アメリカ	株式	CITIGROUP INC 〔各種金融〕	350,151	3,396.96 1,189,451,658	3,313.65 1,160,279,121	0.50
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP 〔各種金融〕	1,215,579	916.37 1,113,920,614	945.48 1,149,314,385	0.50
アンティル	株式	SCHLUMBERGER LTD 〔エネルギー〕	164,434	6,231.80 1,024,720,458	6,851.34 1,126,594,030	0.49

イギリス	株式	GLAXOSMITHKLINE PLC 〔医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス〕	625,643	1,634.41 1,022,561,680	1,760.03 1,101,155,954	0.48
------	----	---	---------	---------------------------	---------------------------	------

□ 種類別・業種別の投資比率

平成23年5月31日現在

種類	業種	投資比率 (%)	種類	業種	投資比率 (%)
株式（外国）	エネルギー	12.14	株式（外国）	ヘルスケア機器・サービス	2.74
	素材	7.95		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.20
	資本財	7.71		銀行	7.90
	商業・専門サービス	0.87		各種金融	5.28
	運輸	1.74		保険	4.17
	自動車・自動車部品	1.41		不動産	0.70
	耐久消費財・アパレル	1.23		ソフトウェア・サービス	5.17
	消費者サービス	1.50		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.28
	メディア	2.62		電気通信サービス	4.11
	小売	2.53		公益事業	3.81
	食品・生活必需品小売り	2.32		半導体・半導体製造装置	1.53
	食品・飲料・タバコ	6.36		投資証券	1.71
	家庭用品・パーソナル用品	1.65		合計	98.63

**投資不動産物件**

該当事項はありません。



## その他投資資産の主要なもの

平成23年5月31日現在

種類	取引所等および 資産の名称	買建 / 売建	数量 (枚)	簿価(円)	時価(円)	投資 比率 (%)
海外金融 先物取引	シカゴ商業取引所 S P 500 11 / 06	買建	71	1,897,514,802	1,909,231,038	0.83
海外金融 先物取引	ロンドン国際金融先物オプション取引所 F T S E 11 / 06	買建	47	372,449,869	372,311,017	0.16
海外金融 先物取引	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所 D J E U R 11 / 06	買建	232	769,661,357	757,987,384	0.33

(注) 時価の算定方法

海外金融先物取引の時価については以下のように評価しております。

- ・原則として基準日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。
- ・このような時価が発表されていない場合には、基準日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

平成23年5月31日現在

種類	取引所等および 資産の名称	買建 / 売建	数量 (枚)	簿価(円)	時価(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	市場外取引 米ドル	買建	1,357,360	109,742,556	109,769,703	0.05

(注)

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

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

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

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

## 〔外国債券バッシブ・マザーファンド〕

## (1) 投資状況

平成23年5月31日現在

資産の種類	国/地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	95,826,166,450	37.35
	カナダ	7,354,748,477	2.87
	ドイツ	24,290,612,617	9.47
	イタリア	25,586,878,945	9.97
	フランス	25,013,402,747	9.75
	オーストラリア	2,907,930,693	1.13
	イギリス	20,273,614,752	7.90
	スイス	1,515,093,039	0.59
	シンガポール	1,035,753,051	0.40
	マレーシア	1,273,926,410	0.50
	オランダ	6,570,121,208	2.56
	スペイン	11,169,243,236	4.35
	ベルギー	6,798,331,544	2.65
	スウェーデン	1,822,242,326	0.71
	ノルウェー	680,625,000	0.27
	オーストリア	4,675,462,029	1.82
	フィンランド	1,731,956,756	0.68
	デンマーク	2,197,022,954	0.86
	メキシコ	2,495,767,764	0.97
	アイルランド	1,611,466,388	0.63
ポーランド	2,283,158,932	0.89	
ポルトガル	2,145,198,940	0.84	
	小計	249,258,724,258	97.15
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,299,496,707	2.85
合計(純資産総額)		256,558,220,965	100.00

## (2) 投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

## イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成23年5月31日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額 単価 / 金額 (円)	評価額 単価 / 金額 (円)	利率(%) / 償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US T 2.625% 20/11/15	18,000,000	7,560.05 1,360,809,376	7,825.14 1,408,525,200	2.625 2020/11/15	0.55
アメリカ	国債証券	US T 3.625% 20/02/15	15,000,000	8,269.98 1,240,497,000	8,601.08 1,290,162,375	3.625 2020/2/15	0.50
アメリカ	国債証券	US T 3.5% 20/05/15	15,000,000	8,160.03 1,224,005,062	8,486.08 1,272,912,187	3.5 2020/5/15	0.50
アメリカ	国債証券	US T 3.375% 19/11/15	15,000,000	8,139.81 1,220,972,062	8,474.70 1,271,206,125	3.375 2019/11/15	0.50
アメリカ	国債証券	US T 2.625% 20/8/15	15,000,000	7,548.37 1,132,256,812	7,869.37 1,180,405,687	2.625 2020/8/15	0.46
アメリカ	国債証券	US T 2.75% 19/02/15	13,000,000	7,870.43 1,023,156,264	8,200.47 1,066,061,587	2.75 2019/2/15	0.42
アメリカ	国債証券	US T 3.125% 19/05/15	12,000,000	8,052.41 966,289,536	8,374.87 1,004,984,550	3.125 2019/5/15	0.39
アメリカ	国債証券	US T 3.75% 18/11/15	11,000,000	8,494.82 934,430,904	8,795.70 967,527,000	3.75 2018/11/15	0.38
イギリス	国債証券	UKT 4.5% 13/03/07	6,700,000	14,315.11 959,112,763	14,346.78 961,234,833	4.5 2013/3/7	0.37
イギリス	国債証券	UKT 2.25% 14/03/07	7,000,000	13,576.22 950,335,422	13,696.22 958,736,032	2.25 2014/3/7	0.37
アメリカ	国債証券	US T 3.625% 19/08/15	11,000,000	8,330.64 916,370,400	8,650.36 951,540,562	3.625 2019/8/15	0.37
フランス	国債証券	FRTR 3.0% 15/10/25	8,000,000	11,940.92 955,274,320	11,879.30 950,344,472	3 2015/10/25	0.37
アメリカ	国債証券	US T 2.375% 15/02/28	11,000,000	8,300.31 913,034,100	8,460.80 930,688,687	2.375 2015/2/28	0.36

フランス	国債証券	FRTR 3.75% 21/04/25	7,700,000	11,920.00 917,840,030	11,994.41 923,569,816	3.75 2021/4/25	0.36
アメリカ	国債証券	US T 4.375% 39/11/15	11,000,000	7,823.64 860,601,112	8,272.50 909,975,825	4.375 2039/11/15	0.35
アメリカ	国債証券	US T 4.375% 40/05/15	11,000,000	7,824.50 860,695,898	8,268.71 909,558,787	4.375 2040/5/15	0.35
イギリス	国債証券	UKT 2.75% 15/01/22	6,500,000	13,632.07 886,084,785	13,831.74 899,063,100	2.75 2015/1/22	0.35
アメリカ	国債証券	US T 4.25% 40/11/15	11,000,000	7,750.66 852,573,013	8,088.00 889,680,000	4.25 2040/11/15	0.35
アメリカ	国債証券	US T 2.125% 14/11/30	10,500,000	8,251.02 866,357,493	8,400.14 882,015,355	2.125 2014/11/30	0.34
ドイツ	国債証券	DBR 5% 12/07/04	7,220,000	12,351.01 891,743,159	12,081.61 872,292,653	5 2012/7/4	0.34
フランス	国債証券	FRTR 4.25% 19/04/25	6,900,000	12,506.00 862,914,082	12,528.09 864,438,382	4.25 2019/4/25	0.34
イタリア	国債証券	BTPS 6% 31/05/01	6,900,000	12,767.60 880,965,000	12,512.97 863,395,440	6 2031/5/1	0.34
アメリカ	国債証券	US T 4.625% 40/02/15	10,000,000	8,163.82 816,382,500	8,622.56 862,256,625	4.625 2040/2/15	0.34
アメリカ	国債証券	US T 2.5% 15/04/30	10,000,000	8,328.74 832,874,441	8,492.40 849,240,000	2.5 2015/4/30	0.33
アメリカ	国債証券	US T 2.375% 14/09/30	10,000,000	8,350.22 835,022,816	8,463.33 846,333,375	2.375 2014/9/30	0.33
アメリカ	国債証券	US T 2.25% 15/01/31	10,000,000	8,269.67 826,967,705	8,427.31 842,731,691	2.25 2015/1/31	0.33
イタリア	国債証券	BTPS 5.25% 29/11/01	7,200,000	11,797.91 849,450,016	11,694.43 841,999,435	5.25 2029/11/1	0.33
フランス	国債証券	BTNS 3.75% 13/01/12	7,000,000	12,159.10 851,137,094	12,008.36 840,585,592	3.75 2013/1/12	0.33
イギリス	国債証券	UKT 3.75% 19/09/07	6,000,000	13,551.89 813,113,870	13,986.76 839,205,744	3.75 2019/9/7	0.33

イタリア	国債証券	BTPS 3.75% 15/08/01	7,200,000	11,772.33 847,608,300	11,635.13 837,730,000	3.75 2015/8/1	0.33
------	------	---------------------	-----------	--------------------------	--------------------------	------------------	------

## □ 種類別の投資比率

平成23年5月31日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	97.15
合計	97.15

**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。

## 〔マネーインカム・マザーファンド〕

## (1) 投資状況

平成23年5月31日現在

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	917,347,930	98.41
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		14,782,540	1.59
合計(純資産総額)		932,130,470	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

平成23年5月31日現在

国 / 地域	種類	銘柄名	額面金額 (円)	帳簿価額 単価 / 金額 (円)	評価額 単価 / 金額 (円)	利率(%) / 償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第234回利付国債(10年)	464,000,000	100.43 466,040,480	100.38 465,763,200	1.4 2011/9/20	49.97
日本	国債証券	第239回利付国債(10年)	149,000,000	101.32 150,978,580	101.30 150,945,940	1.4 2012/6/20	16.19
日本	国債証券	第237回利付国債(10年)	149,000,000	101.21 150,815,310	101.07 150,607,710	1.5 2012/3/20	16.16
日本	国債証券	第235回利付国債(10年)	149,000,000	100.81 150,219,850	100.69 150,031,080	1.4 2011/12/20	16.10

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

## ロ 種類別の投資比率

平成23年5月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	98.41
合計	98.41

## 投資不動産物件

該当事項はありません。

**その他投資資産の主要なもの**

該当事項はありません。



## 〔参考情報〕

基準日2011年5月31日

※ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。

※委託会社ホームページにおいてもファンドの運用状況は適宜開示しています。

## 基準価額・純資産の推移



※基準価額は、1万円当たり、信託報酬引除後です。

基準価額	9,432円
純資産総額	1億円

## 分配の推移

決算期	分配金
2011年4月	0円
2010年4月	0円
2009年4月	0円
設定来累計	0円

※分配金は1万円当たり、税引前です。

## 年間収益率の推移（暦年ベース）



2008年のファンドの収益率は、ファンドの設定日(2008年3月31日)から年末までの騰落率を表示しています。

2011年の収益率は、年初から2011年5月31日までの騰落率を表示しています。

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

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### イ 申込方法

- (イ) ファンドの取得申込者は、お申込みを取り扱う販売会社に取引口座を開設の上、当ファンドの取得申込みを行っていただきます。
- (ロ) 原則として午後3時まで取得申込みが行われ、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の申込受付分とします。
- なお、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得申込みの受け付けを中止させていただく場合、既に受け付けた取得申込みを取り消させていただく場合があります。
- (ハ) 当ファンドの取得申込者は販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。
- 販売会社は、当該取得申込みの代金の支払いと引換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。
- ファンドのお買付けに関しましては、クーリング・オフ制度の適用はありません。

#### ロ 申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

#### ハ 申込手数料

無手数料です。

#### ニ 申込単位

1円以上1円単位

#### ホ 照会先

手続き等のご不明な点についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

#### ヘ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

#### ト 払込期日

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

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

## 2【換金（解約）手続等】

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

お買付けの販売会社にお申し出ください。

解約請求のお申込みに関しては、原則として午後3時まで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。）を法令および社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます（基準価額は、便宜上1万口単位で表示される場合があります。）。

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

#### ロ 基準価額の算出頻度・照会方法

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝

刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、「おまかせ」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20年3月31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4月14日から翌年4月13日までとすることを原則としますが、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始するものとします。なお、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

## （５）【その他】

イ 信託の終了

（イ）信託契約の解約

- a . 委託会社は、当ファンドの信託契約を解約することが受益者にとって有利であると認めるとき、残存口数が1億口を下回ることとなったとき、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、当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b . 委託会社は、上記aの事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知られたる受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- c . 書面決議において、受益者（委託会社等を除きます。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

- d . 書面決議は議決権を行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e . 上記b～dまでの取扱いは、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状況に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b～dまでの取扱いを行うことが困難な場合も同様とします。
- (ロ) 信託契約に関する監督官庁の命令  
委託会社は、監督官庁より当ファンドの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い信託契約を解約し、信託を終了させます。
- (ハ) 委託会社の登録取消等に伴う取扱い  
委託会社が、監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が当ファンドに関する委託会社の業務を他の委託会社に引継ぐことを命じたときは、当ファンドは、その委託会社と受託会社との間において存続します。
- (ニ) 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い
- a . 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。また、受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたこと、その他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。
- 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。
- ロ 収益分配金、償還金の支払い
- (イ) 収益分配金
- a . 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。分配対象額が少額の場合等には委託会社の判断により分配を行わないことがあります。
- b . 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します。）に支払われます。
- ハ 信託約款の変更等
- (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、または当ファンドと他のファンドとの併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合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)の事項(変更についてはその内容が重大なものに限ります。以下、併合と合わせて「重大な信託約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知られたる受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- (ハ) 上記(ロ)の書面決議において、受益者(委託会社等を除きます。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- (ニ) 書面決議は議決権を行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います(書面決議は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じません。)
- (ホ) 上記(ロ)から(ニ)までの取扱いは、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- (ヘ) 上記にかかわらず、当ファンドと他のファンドとの併合の場合は、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、相手方となる他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、併合を行うことはできません。

## 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等が行われる場合において、書面決議において当該議案に反対した受益者は、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でも、何らの意思表示もない場合は、自動的に1年間更新されます。販売契約の内容は、必要に応じて、委託会社と販売会社との合意により変更されることがあります。

## ヘ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

## ト 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

## チ 運用にかかる報告書の開示方法

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

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

#### 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、現時点では、分配金自動再投資コースのみの取扱いしかありませんので、収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日の翌営業日に再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

##### ロ 償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。

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

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

##### ハ 一部解約実行請求権

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

##### ニ 書面決議における議決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等を行おうとする場合において、受益者は、それぞれの書面決議手続きにおいて、受益権の口数に応じて議決権を有しこれを行使することができます。

書面決議の結果、当ファンドの解約または重大な信託約款の変更等が行われる場合は、書面決議において当該議案に反対した受益者は、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2期（平成21年4月14日から平成22年4月13日まで）の財務諸表については、あずさ監査法人により監査を受け、第3期（平成22年4月14日から平成23年4月13日まで）の財務諸表については、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。  
なお、あずさ監査法人は、監査法人の種類の変更により平成22年7月1日をもって有限責任 あずさ監査法人となっております。



## （参考情報）

スミセイ・DCバランスファンド（機動的資産配分型）は、「国内株式インデックス・マザーファンド（B号）」、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」および「マネーインカム・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」はすべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外です。

「国内株式インデックス・マザーファンド（B号）」の状況

## （1）貸借対照表

対象年月日	（平成22年4月13日現在）	（平成23年4月13日現在）
科目	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	6,077,571,323	4,774,138,718
株式	345,374,324,198	297,711,795,325
派生商品評価勘定	155,157,700	35,939,500
未収配当金	3,130,205,295	3,314,174,910
未収利息	8,325	6,539
前払金	-	384,403,000
差入委託証拠金	-	67,410,000
流動資産合計	354,737,266,841	306,287,867,992
資産合計	354,737,266,841	306,287,867,992
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	27,586,800	421,206,650
前受金	127,930,000	-
未払金	47,795,250	-
未払解約金	576,674,976	12,207,740
流動負債合計	779,987,026	433,414,390
負債合計	779,987,026	433,414,390
純資産の部		
元本等		
元本		
元本	275,836,932,817	272,894,945,293
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	78,120,346,998	32,959,508,309
元本等合計	353,957,279,815	305,854,453,602
純資産合計	353,957,279,815	305,854,453,602
負債純資産合計	354,737,266,841	306,287,867,992

（注）「国内株式インデックス・マザーファンド（B号）」は、毎年11月30日（ただし、休業日の場合は翌営業日）に決算を行います。上記の貸借対照表は平成22年4月13日ならびに平成23年4月13日現在における同マザーファンドの状況です。

## (2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自平成21年4月14日 至平成22年4月13日	自平成22年4月14日 至平成23年4月13日
1. 有価証券の評価基準及び 評価方法	株式（売買目的有価証券） 移動平均法に基づき、原則として時価で 評価しております。時価評価にあたって は、取引所もしくは店頭市場における最 終相場（最終相場のないものについて は、それに準じる価額）または金融商品 取引業者等から提示される気配相場に基 づいて評価しております。	株式（売買目的有価証券） 同左
2. デリバティブの評価基準 及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価 しております。時価評価にあたっては、原 則として、計算日に知りうる直近の日の 主たる取引所の発表する清算値段または 最終相場によっております。	先物取引 同左
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日 において、確定配当金額または予想配当 金額を計上しております。	受取配当金の計上基準 同左

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成22年4月13日現在)	(平成23年4月13日現在)								
1. 担保資産	代用として、担保に供している資産は次 の通りであります。 <table style="margin-left: 40px;"> <tr> <td style="text-align: center;"><u>担保資産</u></td> <td style="text-align: center;"><u>金額</u></td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">株式</td> <td style="text-align: right;">4,446,000,000円</td> </tr> </table>	<u>担保資産</u>	<u>金額</u>	株式	4,446,000,000円	代用として、担保に供している資産は次 の通りであります。 <table style="margin-left: 40px;"> <tr> <td style="text-align: center;"><u>担保資産</u></td> <td style="text-align: center;"><u>金額</u></td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">株式</td> <td style="text-align: right;">5,913,000,000円</td> </tr> </table>	<u>担保資産</u>	<u>金額</u>	株式	5,913,000,000円
<u>担保資産</u>	<u>金額</u>									
株式	4,446,000,000円									
<u>担保資産</u>	<u>金額</u>									
株式	5,913,000,000円									
2. 受益権総数	平成22年4月13日現在における受益権の 総数  275,836,932,817口	平成23年4月13日現在における受益権の 総数  272,894,945,293口								
3. 1単位当たり純資産額	1.2832円 (1万口 = 12,832円)	1.1208円 (1万口 = 11,208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21年4月14日 至平成22年4月13日	自平成22年4月14日 至平成23年4月13日
	<p>（追加情報） 当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）および「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。</p>	
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>	同左
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>（1）金融商品の内容 1）有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式を組み入れております。 2）デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。当ファンドにおけるデリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、および価格変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、先物取引を行っております。 3）コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 （2）金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>	<p>（1）金融商品の内容 1）有価証券 同左 2）デリバティブ取引 同左 3）コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 （2）金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 同左</p>

<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・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。リスクを管理する部署では、各種リスクごとに定められた頻度で、測定項目が上下限值（リミットあるいは注意レベル）内に収まっているかどうかのモニタリングを行っております。上下限値を越えていることが発見された場合は、原則として速やかに修正を行うよう、リスク管理を行う部署から関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われます。また、是正勧告あるいは報告を受けた関連運用グループでは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、リスク管理を行う部署は、上下限値に抵触した事実ならびにその後の対処結果あるいは関連運用グループの対処方針の決定に関し、必要に応じて、リスク管理を行う部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告する体制となっております。</p>	<p>同 左</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>	<p>同 左</p>

## ・金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成22年4月13日現在）	（平成23年4月13日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（株式） 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1) 有価証券（株式） 同左</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） 同左</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 同左</p>

## （デリバティブ取引に関する注記）

（平成22年4月13日現在）

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 （TOPIX先物）				
	買建	8,398,510,000 (8,398,869,100)	- (-)	8,526,440,000	127,930,000 (127,570,900)
	買建 合計	8,398,510,000 (8,398,869,100)	- (-)	8,526,440,000	127,930,000 (127,570,900)

## （注）1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については以下のように評価しております。

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

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりませぬ。

なお、（ ）内は手数料相当額を含んだ場合の金額を表わしています。

4. 株価指数先物取引の取引市場は、東京証券取引所です。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありませぬ。

（平成23年4月13日現在）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 （TOPIX先物）				
	買建	8,535,023,000 (8,535,887,150)	- (-)	8,150,620,000	384,403,000 (385,267,150)
	買建 合計	8,535,023,000 (8,535,887,150)	- (-)	8,150,620,000	384,403,000 (385,267,150)

（注）1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については以下のように評価しております。

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

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

なお、（ ）内は手数料相当額を含んだ場合の金額を表わしています。

4. 株価指数先物取引の取引市場は、東京証券取引所です。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

（自平成21年4月14日至平成22年4月13日）

該当事項はありません。

（自平成22年4月14日至平成23年4月13日）

該当事項はありません。

(その他の注記)

(平成22年 4月13日現在)	
本有価証券報告書における開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	254,319,939,520円
同期中における追加設定元本額	63,002,395,920円
同期中における一部解約元本額	41,485,402,623円
平成22年 4月13日現在における元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	6,709,083,714円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	250,023,428円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,407,096,431円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	901,850,730円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	11,392,343円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	2,549,053円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	338,059円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	2,926,011円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	419,952円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	241,579円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	891,908円
国内株式指数ファンド(TOPIX)	83,036,427円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	72,694,779,420円
バランスファンドVA(安定運用型) <適格機関投資家限定>	1,051,808,715円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型 <適格機関投資家限定>	50,610,519,734円
SMAM・バランスファンドVA25 <適格機関投資家専用>	16,849,761,449円
SMAM・バランスファンドVA37.5 <適格機関投資家専用>	8,238,559,246円
SMAM・バランスファンドVA50 <適格機関投資家専用>	27,937,268,563円
SMAM・バランスファンドVL30 <適格機関投資家限定>	169,568,801円
SMAM・バランスファンドVL50 <適格機関投資家限定>	557,484,160円
世界6資産バランスファンドVA <適格機関投資家限定>	105,360,772円
SMAM・バランスファンドVA75 <適格機関投資家専用>	2,579,791,777円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型 <適格機関投資家限定>	124,104,806円
SMAM・インデックス・バランスVA25 <適格機関投資家専用>	1,068,445,668円
SMAM・インデックス・バランスVA50 <適格機関投資家専用>	3,615,048,459円
SMAM・バランスファンドVA40 <適格機関投資家専用>	4,882,590,404円
SMAM・バランスファンドVA35 <適格機関投資家専用>	12,098,902,936円
SMAM・バランスVA株40T <適格機関投資家限定>	1,366,607,879円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	10,285,570,403円
SMAM・グローバルバランス40VA <適格機関投資家限定>	216,627,919円
SMAM・バランスファンドVA20 <適格機関投資家専用>	2,962,375,576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)	44,344,558,865円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A <適格機関投資家専用>	299,434,358円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A <適格機関投資家専用>	153,743,885円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A <適格機関投資家専用>	60,311,161円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L <適格機関投資家専用>	900,325,560円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L <適格機関投資家専用>	1,588,872,617円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T <適格機関投資家専用>	544,371,625円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2 <適格機関投資家専用>	81,983,940円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2 <適格機関投資家専用>	35,699,579円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2 <適格機関投資家専用>	8,704,256円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2 <適格機関投資家専用>	37,571,176円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2 <適格機関投資家専用>	996,329,473円
合計	275,836,932,817円

(平成23年4月13日現在)

本有価証券報告書における開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	275,836,932,817円
同期中における追加設定元本額	41,617,593,587円
同期中における一部解約元本額	44,559,581,111円
平成23年4月13日現在における元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	7,859,934,410円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	349,487,717円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,840,666,491円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,243,335,794円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	22,488,660円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	4,250,339円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	1,950,483円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	4,401,485円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	1,895,055円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	884,411円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	2,233,513円
国内株式指数ファンド(TOPIX)	480,899,685円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	67,527,953,158円
バランスファンドVA(安定運用型) <適格機関投資家限定>	799,481,628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>	49,362,704,147円
SMAM・バランスファンドVA25 <適格機関投資家専用>	16,846,177,800円
SMAM・バランスファンドVA37.5 <適格機関投資家専用>	7,847,550,132円
SMAM・バランスファンドVA50 <適格機関投資家専用>	26,784,551,179円
SMAM・バランスファンドVL30 <適格機関投資家限定>	179,510,581円
SMAM・バランスファンドVL50 <適格機関投資家限定>	564,650,021円
世界6資産バランスファンドVA <適格機関投資家限定>	102,281,905円
SMAM・バランスファンドVA75 <適格機関投資家専用>	2,539,054,024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>	125,841,755円
SMAM・インデックス・バランスVA25 <適格機関投資家専用>	1,033,685,539円
SMAM・インデックス・バランスVA50 <適格機関投資家専用>	3,445,469,606円
SMAM・バランスファンドVA40 <適格機関投資家専用>	4,821,282,931円
SMAM・バランスファンドVA35 <適格機関投資家専用>	11,440,894,360円
SMAM・バランスVA株40T <適格機関投資家限定>	1,308,024,930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)	10,720,667,380円
SMAM・グローバルバランス40VA <適格機関投資家限定>	227,032,408円
SMAM・バランスファンドVA20 <適格機関投資家専用>	2,848,876,307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)	44,718,190,952円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A <適格機関投資家専用>	308,579,777円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A <適格機関投資家専用>	157,085,637円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A <適格機関投資家専用>	55,535,062円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L <適格機関投資家専用>	877,540,752円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L <適格機関投資家専用>	1,541,225,819円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T <適格機関投資家専用>	558,908,346円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2 <適格機関投資家専用>	308,338,066円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2 <適格機関投資家専用>	131,754,787円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2 <適格機関投資家専用>	28,161,878円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2 <適格機関投資家専用>	270,982,659円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2 <適格機関投資家専用>	2,793,779,329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)	656,474,407円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2 <適格機関投資家専用>	129,379,379円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA <適格機関投資家限定>	15,400,825円
SMAM・FGグローバルバランス25VA <適格機関投資家限定>	5,489,784円
合計	272,894,945,293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	111,000	167	18,537,000	
日本水産	343,500	222	76,257,000	
マルハニチロホールディングス	580,000	115	66,700,000	
サカタのタネ	42,600	1,147	48,862,200	
ホクト	29,900	1,781	53,251,900	
住石ホールディングス	100,300	142	14,242,600	
日鉄鉱業	76,000	392	29,792,000	
三井松島産業	174,000	188	32,712,000	
国際石油開発帝石	2,982	610,000	1,819,020,000	
日本海洋掘削	7,800	3,415	26,637,000	
関東天然瓦斯開発	25,000	508	12,700,000	
石油資源開発	46,000	3,930	180,780,000	
ショーボンドホールディングス	25,100	2,116	53,111,600	
ミライト・ホールディングス	73,500	619	45,496,500	
ダイセキ環境ソリューション	33	178,700	5,897,100	
間組	130,500	119	15,529,500	
東急建設	109,590	230	25,205,700	
コムシスホールディングス	142,200	802	114,044,400	
ミサワホーム	37,600	491	18,461,600	
高松コンストラクショングループ	21,900	1,208	26,455,200	
東建コーポレーション	11,100	3,545	39,349,500	
ヤマウラ	16,000	213	3,408,000	
大成建設	1,394,000	203	282,982,000	
大林組	886,000	363	321,618,000	
清水建設	836,000	356	297,616,000	
長谷工コーポレーション	1,869,000	60	112,140,000	
松井建設	36,000	330	11,880,000	
鹿島建設	1,296,000	239	309,744,000	
不動テトラ	198,200	197	39,045,400	
鉄建建設	197,000	113	22,261,000	
安藤建設	115,000	109	12,535,000	
太平工業	60,000	371	22,260,000	
西松建設	393,000	121	47,553,000	
三井住友建設	204,600	89	18,209,400	
大豊建設	115,000	126	14,490,000	
前田建設工業	185,000	244	45,140,000	
佐田建設	106,000	81	8,586,000	
ナカノフドー建設	28,000	205	5,740,000	
奥村組	278,000	320	88,960,000	
大和小田急建設	22,000	220	4,840,000	

東鉄工業	35,000	733	25,655,000	
イチケン	50,000	115	5,750,000	
浅沼組	106,000	95	10,070,000	
戸田建設	312,000	308	96,096,000	
熊谷組	235,000	91	21,385,000	
青木あすなる建設	25,000	428	10,700,000	
北野建設	68,000	200	13,600,000	
植木組	49,000	188	9,212,000	
三井ホーム	33,000	405	13,365,000	
矢作建設工業	40,000	434	17,360,000	
ピーエス三菱	27,800	404	11,231,200	
大東建託	115,100	6,280	722,828,000	
新日本建設	43,800	251	10,993,800	
N I P P O	67,000	656	43,952,000	
東亜道路工業	76,000	187	14,212,000	
前田道路	83,000	804	66,732,000	
日本道路	96,000	258	24,768,000	
東亜建設工業	243,000	156	37,908,000	
東洋建設	412,000	97	39,964,000	
五洋建設	373,000	193	71,989,000	
大林道路	48,000	210	10,080,000	
世紀東急工業	88,000	71	6,248,000	
福田組	57,000	286	16,302,000	
住友林業	202,600	690	139,794,000	
日本基礎技術	45,000	322	14,490,000	
日成ビルド工業	95,000	206	19,570,000	
エス・バイ・エル	166,000	80	13,280,000	
巴コーポレーション	49,400	330	16,302,000	
パナホーム	96,000	510	48,960,000	
大和ハウス工業	732,000	961	703,452,000	
ライト工業	66,900	298	19,936,200	
積水ハウス	883,000	778	686,974,000	
日特建設	87,000	198	17,226,000	
北陸電気工事	15,000	265	3,975,000	
ユアテック	45,000	488	21,960,000	
西部電気工業	18,000	346	6,228,000	
四電工	20,000	358	7,160,000	
中電工	42,700	1,019	43,511,300	
関電工	130,000	443	57,590,000	
きんでん	193,000	722	139,346,000	
東京エネシス	31,000	539	16,709,000	
トーエネック	36,000	448	16,128,000	
住友電設	14,500	367	5,321,500	
日本電設工業	52,000	824	42,848,000	
協和エクシオ	103,800	791	82,105,800	
新日本空調	20,200	394	7,958,800	

日本電話施設	48,000	261	12,528,000	
九電工	52,000	485	25,220,000	
三機工業	67,000	501	33,567,000	
日揮	296,000	1,979	585,784,000	
中外炉工業	97,000	340	32,980,000	
ヤマト	28,000	307	8,596,000	
太平電業	38,000	691	26,258,000	
高砂熱学工業	82,000	691	56,662,000	
三晃金属工業	48,000	250	12,000,000	
NEC ネットエスアイ	24,000	1,053	25,272,000	
朝日工業社	35,000	346	12,110,000	
大気社	45,600	1,514	69,038,400	
ダイダン	39,000	463	18,057,000	
日比谷総合設備	37,500	754	28,275,000	
東芝プラントシステム	48,000	863	41,424,000	
東洋エンジニアリング	173,000	308	53,284,000	
千代田化工建設	193,000	754	145,522,000	
新興プランテック	56,500	958	54,127,000	
日本製粉	164,000	385	63,140,000	
日清製粉グループ本社	263,500	988	260,338,000	
日東富士製粉	19,000	291	5,529,000	
昭和産業	119,000	226	26,894,000	
鳥越製粉	23,300	694	16,170,200	
協同飼料	122,000	89	10,858,000	
中部飼料	27,400	608	16,659,200	
日本配合飼料	108,000	87	9,396,000	
東洋精糖	64,000	109	6,976,000	
日本甜菜製糖	164,000	185	30,340,000	
三井製糖	119,000	389	46,291,000	
森永製菓	280,000	187	52,360,000	
中村屋	70,000	391	27,370,000	
江崎グリコ	105,000	930	97,650,000	
名糖産業	13,000	1,060	13,780,000	
不二家	188,000	126	23,688,000	
山崎製パン	215,000	1,010	217,150,000	
第一屋製パン	66,000	92	6,072,000	
モロゾフ	43,000	266	11,438,000	
森永乳業	249,000	311	77,439,000	
ヤクルト本社	158,600	2,160	342,576,000	
明治ホールディングス	86,400	3,390	292,896,000	
雪印メグミルク	58,100	1,258	73,089,800	
プリマハム	179,000	97	17,363,000	
日本ハム	205,000	1,081	221,605,000	
伊藤ハム	164,000	299	49,036,000	
林兼産業	126,000	81	10,206,000	
丸大食品	124,000	262	32,488,000	

米久	25,000	625	15,625,000	
S Foods	14,000	658	9,212,000	
サッポロホールディングス	425,000	315	133,875,000	
アサヒビール	551,700	1,416	781,207,200	
キリンホールディングス	1,182,000	1,085	1,282,470,000	
宝ホールディングス	248,000	393	97,464,000	
オエノンホールディングス	86,000	184	15,824,000	
養命酒製造	21,000	740	15,540,000	
三国コカ・コーラボトリング	31,900	735	23,446,500	
コカ・コーラウエスト	91,100	1,696	154,505,600	
コカ・コーラ セントラル ジャパン	33,200	1,104	36,652,800	
ダイドードリンコ	12,400	3,090	38,316,000	
伊藤園	90,100	1,451	130,735,100	
キーコーヒー	24,200	1,397	33,807,400	
ジャパンフーズ	4,000	849	3,396,000	
日清オイリオグループ	131,000	385	50,435,000	
不二製油	72,500	1,073	77,792,500	
J - オイルミルズ	114,000	224	25,536,000	
キッコーマン	239,000	773	184,747,000	
味の素	800,000	873	698,400,000	
キューピー	149,700	964	144,310,800	
ハウス食品	103,000	1,310	134,930,000	
カゴメ	104,400	1,405	146,682,000	
焼津水産化学工業	12,200	746	9,101,200	
アリアケジャパン	24,700	1,352	33,394,400	
ニチレイ	330,000	344	113,520,000	
東洋水産	127,000	1,843	234,061,000	
日清食品ホールディングス	105,400	2,931	308,927,400	
永谷園	24,000	818	19,632,000	
フジッコ	29,000	987	28,623,000	
ロック・フィールド	14,200	1,324	18,800,800	
日本たばこ産業	6,120	312,000	1,909,440,000	
わらべや日洋	17,000	947	16,099,000	
なとり	12,800	791	10,124,800	
ミヨシ油脂	112,000	116	12,992,000	
片倉工業	32,800	787	25,813,600	
グンゼ	189,000	285	53,865,000	
川島織物セルコン	119,000	63	7,497,000	
東洋紡績	1,167,000	122	142,374,000	
ユニチカ	629,000	62	38,998,000	
富士紡ホールディングス	133,000	165	21,945,000	
日清紡ホールディングス	172,000	780	134,160,000	
倉敷紡績	261,000	142	37,062,000	
シキボウ	180,000	91	16,380,000	
日本毛織	93,000	688	63,984,000	
トーア紡コーポレーション	115,000	61	7,015,000	

ダイドーリミテッド	31,600	805	25,438,000	
帝国繊維	26,000	509	13,234,000	
帝人	1,047,000	347	363,309,000	
東レ	2,129,000	560	1,192,240,000	
サカイオーベックス	95,000	129	12,255,000	
住江織物	78,000	163	12,714,000	
日本フェルト	10,200	380	3,876,000	
イチカワ	22,000	149	3,278,000	
日本バイリーン	28,000	373	10,444,000	
日東製網	47,000	114	5,358,000	
芦森工業	82,000	121	9,922,000	
アツギ	235,000	95	22,325,000	
ダイニック	62,000	139	8,618,000	
セーレン	68,400	518	35,431,200	
東海染工	51,000	81	4,131,000	
小松精練	34,000	345	11,730,000	
ワコールホールディングス	161,000	1,017	163,737,000	
ホギメディカル	14,600	3,350	48,910,000	
サンエー・インターナショナル	13,300	955	12,701,500	
レナウン	65,200	177	11,540,400	
クラウディア	2,800	1,121	3,138,800	
三陽商会	135,000	247	33,345,000	
オンワードホールディングス	185,000	603	111,555,000	
ルック	59,000	123	7,257,000	
ゴールドウイン	69,000	220	15,180,000	
東京スタイル	99,000	574	56,826,000	
デサント	66,000	345	22,770,000	
ヤマトインターナショナル	12,600	341	4,296,600	
特種東海製紙	174,000	167	29,058,000	
王子製紙	1,215,000	373	453,195,000	
三菱製紙	399,000	80	31,920,000	
北越紀州製紙	168,000	453	76,104,000	
中越パルプ工業	106,000	142	15,052,000	
巴川製紙所	54,000	203	10,962,000	
大王製紙	114,000	605	68,970,000	
日本製紙グループ本社	132,700	1,678	222,670,600	
レンゴー	221,000	498	110,058,000	
トモク	86,000	236	20,296,000	
ザ・パックス	18,600	1,266	23,547,600	
クラレ	405,200	1,044	423,028,800	
旭化成	1,599,000	525	839,475,000	
共和レザー	12,400	293	3,633,200	
コープケミカル	57,000	107	6,099,000	
昭和電工	1,833,000	159	291,447,000	
住友化学	1,891,000	406	767,746,000	
日本化成	63,000	171	10,773,000	

住友精化	55,000	450	24,750,000
日産化学工業	194,800	818	159,346,400
クレハ	178,000	391	69,598,000
テイカ	49,000	268	13,132,000
石原産業	482,000	88	42,416,000
片倉チッカリン	23,000	227	5,221,000
日本曹達	164,000	346	56,744,000
東ソー	685,000	276	189,060,000
トクヤマ	431,000	404	174,124,000
セントラル硝子	264,000	320	84,480,000
東亜合成	273,000	414	113,022,000
ダイソー	108,000	262	28,296,000
関東電化工業	62,000	581	36,022,000
電気化学工業	578,000	389	224,842,000
信越化学工業	457,900	4,190	1,918,601,000
日本カーバイド工業	74,000	176	13,024,000
堺化学工業	87,000	389	33,843,000
エア・ウォーター	223,000	964	214,972,000
大陽日酸	360,000	653	235,080,000
日本化学工業	105,000	171	17,955,000
日本パーカライジング	65,000	1,053	68,445,000
高圧ガス工業	36,000	469	16,884,000
チタン工業	36,000	337	12,132,000
四国化成工業	38,000	486	18,468,000
戸田工業	42,000	701	29,442,000
ステラ ケミファ	12,600	3,050	38,430,000
保土谷化学工業	67,000	279	18,693,000
日本触媒	225,000	956	215,100,000
大日精化工業	98,000	358	35,084,000
カネカ	341,000	554	188,914,000
三菱瓦斯化学	435,000	561	244,035,000
三井化学	1,255,000	285	357,675,000
J S R	230,100	1,480	340,548,000
東京応化工業	49,500	1,539	76,180,500
三菱ケミカルホールディングス	1,594,000	509	811,346,000
日本合成化学工業	65,000	480	31,200,000
ダイセル化学工業	357,000	487	173,859,000
住友ベークライト	258,000	460	118,680,000
積水化学工業	571,000	624	356,304,000
日本ゼオン	258,000	708	182,664,000
アイカ工業	79,300	1,052	83,423,600
宇部興産	1,154,000	252	290,808,000
積水樹脂	37,000	851	31,487,000
タキロン	64,000	316	20,224,000
旭有機材工業	104,000	216	22,464,000
日立化成工業	118,900	1,532	182,154,800

ニチバン	18,000	272	4,896,000	
リケンテクノス	46,000	230	10,580,000	
大倉工業	73,000	250	18,250,000	
積水化成品工業	62,000	296	18,352,000	
群栄化学工業	76,000	212	16,112,000	
タイガースポリマー	16,400	351	5,756,400	
日本カーリット	22,800	422	9,621,600	
日本化薬	190,000	753	143,070,000	
日本精化	20,000	496	9,920,000	
A D E K A	109,400	756	82,706,400	
日油	238,000	348	82,824,000	
ハリマ化成	24,200	571	13,818,200	
花王	748,900	2,031	1,521,015,900	
第一工業製薬	54,000	244	13,176,000	
三洋化成工業	75,000	659	49,425,000	
大日本塗料	167,000	106	17,702,000	
日本ペイント	236,000	525	123,900,000	
関西ペイント	312,000	674	210,288,000	
中国塗料	73,000	674	49,202,000	
日本特殊塗料	23,500	319	7,496,500	
藤倉化成	34,400	484	16,649,600	
太陽ホールディングス	19,900	2,472	49,192,800	
D I C	1,058,000	172	181,976,000	
サカタインクス	53,000	362	19,186,000	
東洋インキS Cホールディングス	247,000	389	96,083,000	
富士フイルムホールディングス	586,600	2,481	1,455,354,600	
資生堂	456,900	1,395	637,375,500	
ライオン	311,000	409	127,199,000	
高砂香料工業	92,000	408	37,536,000	
マンダム	27,700	2,128	58,945,600	
ミルボン	14,500	2,260	32,770,000	
ファンケル	54,000	1,116	60,264,000	
コーセー	49,600	2,006	99,497,600	
ドクターシーラボ	179	305,000	54,595,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	25,000	1,770	44,250,000	
エステー	13,700	870	11,919,000	
コニシ	21,400	1,103	23,604,200	
長谷川香料	33,500	1,243	41,640,500	
小林製薬	37,900	3,735	141,556,500	
荒川化学工業	18,500	737	13,634,500	
メック	21,300	354	7,540,200	
日本高純度化学	79	227,900	18,004,100	
荏原ユージライト	4,500	2,073	9,328,500	
アース製薬	18,500	2,750	50,875,000	
イハラケミカル工業	53,000	261	13,833,000	
北興化学工業	27,000	246	6,642,000	

大成ラミック	5,700	2,240	12,768,000	
クミアイ化学工業	61,000	223	13,603,000	
日本農薬	59,000	362	21,358,000	
アキレス	218,000	115	25,070,000	
有沢製作所	47,100	377	17,756,700	
日東電工	227,000	4,150	942,050,000	
レック	7,900	1,225	9,677,500	
アロン化成	34,000	504	17,136,000	
きもと	26,700	579	15,459,300	
藤森工業	20,000	1,033	20,660,000	
前澤化成工業	18,200	792	14,414,400	
J S P	17,900	1,360	24,344,000	
エフピコ	13,700	4,405	60,348,500	
天馬	23,400	866	20,264,400	
信越ポリマー	54,000	440	23,760,000	
東リ	74,000	178	13,172,000	
ニフコ	52,600	1,915	100,729,000	
日本バルカー工業	121,000	214	25,894,000	
ユニ・チャーム	151,700	3,025	458,892,500	
協和発酵キリン	326,000	787	256,562,000	
武田薬品工業	1,029,600	3,990	4,108,104,000	
アステラス製薬	610,100	3,135	1,912,663,500	
大日本住友製薬	196,200	765	150,093,000	
塩野義製薬	401,400	1,416	568,382,400	
田辺三菱製薬	228,900	1,306	298,943,400	
わかもと製薬	34,000	247	8,398,000	
あすか製薬	34,000	683	23,222,000	
日本新薬	63,000	1,016	64,008,000	
中外製薬	273,300	1,394	380,980,200	
科研製薬	115,000	1,034	118,910,000	
エーザイ	338,800	3,010	1,019,788,000	
ロート製薬	126,000	836	105,336,000	
小野薬品工業	137,500	4,030	554,125,000	
久光製薬	77,100	3,345	257,899,500	
有機合成薬品工業	26,000	204	5,304,000	
持田製薬	107,000	939	100,473,000	
大正製薬	219,000	1,769	387,411,000	
参天製薬	85,100	3,150	268,065,000	
扶桑薬品工業	95,000	228	21,660,000	
日本ケミファ	49,000	248	12,152,000	
ツムラ	75,300	2,615	196,909,500	
日医工	32,300	2,154	69,574,200	
キッセイ薬品工業	55,200	1,522	84,014,400	
生化学工業	51,300	947	48,581,100	
栄研化学	21,500	945	20,317,500	
日水製薬	8,400	671	5,636,400	



鳥居薬品	18,400	1,570	28,888,000
東和薬品	13,900	4,025	55,947,500
沢井製薬	18,200	7,380	134,316,000
ゼリア新薬工業	38,000	970	36,860,000
第一三共	925,100	1,582	1,463,508,200
キョーリン製薬ホールディングス	74,000	1,408	104,192,000
大幸薬品	11,600	892	10,347,200
大塚ホールディングス	478,900	2,126	1,018,141,400
昭和シェル石油	245,500	852	209,166,000
コスモ石油	760,000	262	199,120,000
ニチレキ	34,000	389	13,226,000
東燃ゼネラル石油	412,000	996	410,352,000
ユシロ化学工業	15,200	1,059	16,096,800
ビーピー・カストロール	11,300	333	3,762,900
AOCホールディングス	71,300	515	36,719,500
MORESCO	6,300	863	5,436,900
出光興産	32,600	9,520	310,352,000
JXホールディングス	3,051,800	535	1,632,713,000
横浜ゴム	304,000	397	120,688,000
東洋ゴム工業	233,000	188	43,804,000
ブリヂストン	861,800	1,703	1,467,645,400
住友ゴム工業	193,800	847	164,148,600
藤倉ゴム工業	15,000	304	4,560,000
オカモト	101,000	300	30,300,000
フコク	10,900	727	7,924,300
ニッタ	25,100	1,451	36,420,100
東海ゴム工業	41,700	924	38,530,800
三ツ星ベルト	67,000	406	27,202,000
バンドー化学	97,000	344	33,368,000
日東紡績	226,000	193	43,618,000
旭硝子	1,353,000	1,009	1,365,177,000
日本板硝子	1,184,000	241	285,344,000
石塚硝子	41,000	152	6,232,000
日本山村硝子	116,000	222	25,752,000
日本電気硝子	568,000	1,124	638,432,000
オハラ	11,600	902	10,463,200
住友大阪セメント	520,000	230	119,600,000
太平洋セメント	1,165,000	143	166,595,000
デイ・シイ	30,300	255	7,726,500
日本ヒューム	16,000	364	5,824,000
日本コンクリート工業	43,000	267	11,481,000
東海カーボン	254,000	423	107,442,000
日本カーボン	135,000	190	25,650,000
東洋炭素	15,400	4,365	67,221,000
ノリタケカンパニーリミテド	143,000	309	44,187,000
TOTO	393,000	635	249,555,000

日本碍子	331,000	1,381	457,111,000
日本特殊陶業	244,000	1,097	267,668,000
MARUWA	6,600	2,734	18,044,400
品川リフラクトリーズ	69,000	251	17,319,000
黒崎播磨	62,000	334	20,708,000
東京窯業	32,000	192	6,144,000
ニッカトー	10,600	374	3,964,400
フジミインコーポレーテッド	24,400	1,074	26,205,600
エーアンドエーマテリアル	57,000	93	5,301,000
ニチアス	134,000	485	64,990,000
ニチハ	29,300	754	22,092,200
新日本製鐵	7,214,000	255	1,839,570,000
住友金属工業	5,103,000	176	898,128,000
神戸製鋼所	3,811,000	204	777,444,000
日新製鋼	1,060,000	159	168,540,000
中山製鋼所	160,000	114	18,240,000
合同製鐵	166,000	205	34,030,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	651,000	2,248	1,463,448,000
東京製鐵	153,800	911	140,111,800
共英製鋼	30,300	1,490	45,147,000
大和工業	62,700	2,545	159,571,500
東京鐵鋼	60,000	238	14,280,000
大阪製鐵	17,200	1,414	24,320,800
淀川製鋼所	210,000	356	74,760,000
東洋鋼鈑	66,000	418	27,588,000
住友鋼管	18,300	622	11,382,600
丸一鋼管	91,600	1,994	182,650,400
モリ工業	48,000	348	16,704,000
大同特殊鋼	463,000	428	198,164,000
日本高周波鋼業	127,000	119	15,113,000
日本金属工業	46,000	90	4,140,000
日本冶金工業	67,000	186	12,462,000
山陽特殊製鋼	139,000	410	56,990,000
愛知製鋼	148,000	464	68,672,000
日立金属	181,000	955	172,855,000
日本金属	85,000	138	11,730,000
大太平洋金属	191,000	599	114,409,000
日本電工	108,000	478	51,624,000
栗本鐵工所	151,000	174	26,274,000
日本鑄鉄管	45,000	234	10,530,000
三菱製鋼	173,000	262	45,326,000
日亜鋼業	37,000	222	8,214,000
日本精線	23,000	409	9,407,000
シンニッタン	31,800	380	12,084,000
新家工業	68,000	129	8,772,000
日本軽金属	627,000	165	103,455,000

大紀アルミニウム工業所	44,000	245	10,780,000
三井金属鉱業	793,000	262	207,766,000
東邦亜鉛	158,000	421	66,518,000
三菱マテリアル	1,717,000	267	458,439,000
住友金属鉱山	760,000	1,407	1,069,320,000
DOWAホールディングス	327,000	491	160,557,000
古河機械金属	471,000	93	43,803,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	30,400	5,520	167,808,000
東邦チタニウム	45,800	2,067	94,668,600
住友軽金属工業	290,000	93	26,970,000
古河スカイ	115,000	210	24,150,000
古河電気工業	866,000	321	277,986,000
住友電気工業	970,500	1,065	1,033,582,500
フジクラ	413,000	381	157,353,000
昭和電線ホールディングス	346,000	101	34,946,000
タツタ電線	53,000	322	17,066,000
日立電線	222,000	196	43,512,000
沖電線	51,000	209	10,659,000
平河ヒューテック	4,900	626	3,067,400
リョービ	158,000	292	46,136,000
アサヒホールディングス	39,400	1,638	64,537,200
稲葉製作所	11,600	858	9,952,800
宮地エンジニアリンググループ	107,000	109	11,663,000
三協・立山ホールディングス	379,000	122	46,238,000
トーカロ	15,000	1,354	20,310,000
アルファC O	9,400	808	7,595,200
SUMCO	169,400	1,602	271,378,800
川田テクノロジーズ	6,300	1,601	10,086,300
東洋製罐	191,700	1,342	257,261,400
ホッカンホールディングス	64,000	269	17,216,000
コロナ	12,500	792	9,900,000
横河ブリッジホールディングス	50,000	572	28,600,000
駒井ハルテック	58,000	218	12,644,000
高田機工	29,000	206	5,974,000
三和ホールディングス	277,000	261	72,297,000
文化シャッター	76,000	225	17,100,000
住生活グループ	331,700	2,003	664,395,100
日本ファイルコン	24,200	387	9,365,400
ノーリツ	50,600	1,412	71,447,200
長府製作所	25,400	1,951	49,555,400
リンナイ	43,900	5,340	234,426,000
ダイニチ工業	12,600	640	8,064,000
日東精工	41,000	231	9,471,000
三洋工業	47,000	147	6,909,000
岡部	56,500	452	25,538,000
中国工業	63,000	115	7,245,000

東プレ	52,100	619	32,249,900
高周波熱錬	36,600	649	23,753,400
東京製綱	190,000	310	58,900,000
パイオラックス	12,100	1,790	21,659,000
日本発條	201,000	738	148,338,000
中央発條	38,000	294	11,172,000
三益半導体工業	23,400	947	22,159,800
アタカ大機	21,000	279	5,859,000
日本製鋼所	423,000	650	274,950,000
日立ツール	16,900	828	13,993,200
三浦工業	43,500	2,288	99,528,000
タクマ	105,000	294	30,870,000
ツガミ	81,000	597	48,357,000
オークマ	181,000	668	120,908,000
東芝機械	167,000	397	66,299,000
アマダ	388,000	638	247,544,000
アイダエンジニアリング	74,500	355	26,447,500
牧野フライス製作所	127,000	688	87,376,000
オーエスジー	121,800	1,056	128,620,800
ダイジェット工業	39,000	126	4,914,000
旭ダイヤモンド工業	59,000	1,574	92,866,000
森精機製作所	146,800	943	138,432,400
ディスコ	28,000	5,630	157,640,000
日東工器	15,000	1,891	28,365,000
豊和工業	157,000	83	13,031,000
大阪機工	99,000	105	10,395,000
オーエム製作所	26,000	517	13,442,000
津田駒工業	72,000	196	14,112,000
島精機製作所	36,100	2,124	76,676,400
日阪製作所	35,000	906	31,710,000
やまびこ	11,400	889	10,134,600
ペガサスミシン製造	34,000	251	8,534,000
ナブテスコ	103,400	2,009	207,730,600
三井海洋開発	23,500	1,456	34,216,000
レオン自動機	22,000	187	4,114,000
S M C	82,100	13,630	1,119,023,000
新川	21,100	763	16,099,300
ホソカワミクロン	50,000	341	17,050,000
ユニオンツール	17,100	1,763	30,147,300
オイレス工業	27,800	1,496	41,588,800
サトー	25,800	996	25,696,800
日本エアーテック	8,400	366	3,074,400
日精樹脂工業	26,900	249	6,698,100
ワイエイシイ	13,700	633	8,672,100
小松製作所	1,302,100	2,803	3,649,786,300
住友重機械工業	701,000	514	360,314,000

日立建機	122,600	2,074	254,272,400	
日工	37,000	336	12,432,000	
巴工業	10,200	1,590	16,218,000	
井関農機	287,000	186	53,382,000	
TOWA	28,200	554	15,622,800	
丸山製作所	65,000	163	10,595,000	
北川鉄工所	135,000	151	20,385,000	
クボタ	1,153,000	767	884,351,000	
荏原実業	5,600	1,236	6,921,600	
三菱化工機	80,000	175	14,000,000	
月島機械	45,000	739	33,255,000	
帝国電機製作所	8,800	1,476	12,988,800	
新東工業	55,800	781	43,579,800	
澁谷工業	15,900	853	13,562,700	
アイチ コーポレーション	42,800	429	18,361,200	
小森コーポレーション	73,900	755	55,794,500	
鶴見製作所	20,000	609	12,180,000	
住友精密工業	50,000	516	25,800,000	
酒井重工業	55,000	158	8,690,000	
荏原製作所	486,000	439	213,354,000	
石井鐵工所	43,000	197	8,471,000	
西島製作所	31,500	1,254	39,501,000	
ダイキン工業	286,700	2,476	709,869,200	
オルガノ	46,000	582	26,772,000	
トーヨーカネツ	152,000	210	31,920,000	
栗田工業	151,200	2,298	347,457,600	
椿本チエイン	139,000	400	55,600,000	
大同工業	59,000	155	9,145,000	
日本コンベヤ	99,000	84	8,316,000	
木村化工機	26,600	464	12,342,400	
アネスト岩田	48,000	384	18,432,000	
ダイフク	113,000	561	63,393,000	
加藤製作所	64,000	231	14,784,000	
油研工業	56,000	158	8,848,000	
タダノ	116,000	482	55,912,000	
フジテック	76,000	400	30,400,000	
シーケーディ	74,800	702	52,509,600	
キトー	100	74,400	7,440,000	
平和	57,600	1,255	72,288,000	
理想科学工業	21,100	1,299	27,408,900	
SANKYO	79,400	4,060	322,364,000	
日本金銭機械	24,800	658	16,318,400	
マースエンジニアリング	12,900	1,320	17,028,000	
福島工業	8,400	941	7,904,400	
オーイズミ	15,300	259	3,962,700	
ダイコク電機	10,800	969	10,465,200	

アマノ	70,700	726	51,328,200	
J U K I	68,000	189	12,852,000	
サンデン	152,000	333	50,616,000	
蛇の目ミシン工業	274,000	73	20,002,000	
マックス	45,000	1,036	46,620,000	
グローリー	72,300	1,700	122,910,000	
大和冷機工業	36,000	407	14,652,000	
セガサミーホールディングス	261,000	1,369	357,309,000	
日本ピストンリング	110,000	150	16,500,000	
リケン	104,000	296	30,784,000	
帝国ピストンリング	33,000	660	21,780,000	
ホシザキ電機	52,200	1,380	72,036,000	
大豊工業	18,500	667	12,339,500	
日本精工	583,000	652	380,116,000	
N T N	607,000	361	219,127,000	
ジェイテクト	278,700	939	261,699,300	
不二越	266,000	403	107,198,000	
日本トムソン	91,000	560	50,960,000	
T H K	175,200	1,911	334,807,200	
ユーシン精機	13,600	1,361	18,509,600	
前澤給装工業	7,700	1,079	8,308,300	
イーグル工業	32,000	793	25,376,000	
日本ビラー工業	30,000	693	20,790,000	
キッツ	110,700	409	45,276,300	
日立工機	69,000	754	52,026,000	
マキタ	171,100	3,755	642,480,500	
日立造船	1,104,500	116	128,122,000	
三菱重工業	4,400,000	370	1,628,000,000	
I H I	1,795,000	200	359,000,000	
イビデン	160,300	2,540	407,162,000	
コニカミノルタホールディングス	695,000	692	480,940,000	
ブラザー工業	338,300	1,178	398,517,400	
ミネベア	391,000	422	165,002,000	
日立製作所	5,894,000	409	2,410,646,000	
東芝	5,184,000	396	2,052,864,000	
三菱電機	2,625,000	867	2,275,875,000	
富士電機	796,000	255	202,980,000	
東洋電機製造	50,000	365	18,250,000	
安川電機	289,000	888	256,632,000	
シンフォニアテクノロジー	165,000	220	36,300,000	
明電舎	264,000	355	93,720,000	
オリジン電気	39,000	406	15,834,000	
デンヨー	26,100	1,168	30,484,800	
東芝テック	161,000	350	56,350,000	
芝浦メカトロニクス	53,000	234	12,402,000	
マブチモーター	37,300	3,960	147,708,000	

日本電産	130,300	7,000	912,100,000	
高岳製作所	108,000	351	37,908,000	
ダイヘン	146,000	332	48,472,000	
日新電機	45,000	660	29,700,000	
大崎電気工業	39,000	707	27,573,000	
オムロン	292,800	2,174	636,547,200	
日東工業	40,400	881	35,592,400	
I D E C	31,800	802	25,503,600	
エルピーダメモリ	217,800	1,134	246,985,200	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	506,000	549	277,794,000	
サクサホールディングス	72,000	131	9,432,000	
メルコホールディングス	14,700	2,423	35,618,100	
テクノメディカ	20	281,100	5,622,000	
日本電気	3,398,000	172	584,456,000	
富士通	2,531,000	448	1,133,888,000	
沖電気工業	981,000	68	66,708,000	
岩崎通信機	130,000	93	12,090,000	
電気興業	83,000	390	32,370,000	
サンケン電気	157,000	424	66,568,000	
ナカヨ通信機	26,000	171	4,446,000	
アイホン	16,100	1,327	21,364,700	
ルネサスエレクトロニクス	70,300	698	49,069,400	
セイコーエプソン	179,900	1,339	240,886,100	
ワコム	532	100,400	53,412,800	
アルバック	49,100	1,822	89,460,200	
アクセル	9,900	1,818	17,998,200	
ナナオ	21,900	1,783	39,047,700	
日本信号	60,500	620	37,510,000	
京三製作所	58,000	408	23,664,000	
能美防災	33,000	481	15,873,000	
ホーチキ	24,000	416	9,984,000	
マスプロ電工	18,800	757	14,231,600	
日本無線	84,000	202	16,968,000	
パナソニック	3,057,235	1,018	3,112,265,230	
シャープ	1,178,000	765	901,170,000	
アンリツ	117,000	580	67,860,000	
富士通ゼネラル	63,000	378	23,814,000	
日立国際電気	62,000	630	39,060,000	
ソニー	1,474,300	2,505	3,693,121,500	
T D K	147,700	4,535	669,819,500	
帝国通信工業	57,000	166	9,462,000	
宮越商事	15,100	310	4,681,000	
ミツミ電機	92,000	1,022	94,024,000	
タムラ製作所	82,000	216	17,712,000	
アルプス電気	209,200	727	152,088,400	
バイオニア	377,100	314	118,409,400	

日本電波工業	23,000	1,167	26,841,000
日本トリム	3,200	2,075	6,640,000
ローランド ディー . ジー .	12,500	1,252	15,650,000
フォスター電機	26,000	1,738	45,188,000
クラリオン	30,000	127	3,810,000
S M K	77,000	353	27,181,000
ヨコオ	22,800	576	13,132,800
東光	124,000	153	18,972,000
ホシデン	65,900	763	50,281,700
ヒロセ電機	42,400	8,450	358,280,000
日本航空電子工業	61,000	517	31,537,000
T O A	29,000	471	13,659,000
ユニデン	83,000	323	26,809,000
アルパイン	52,000	901	46,852,000
スミダコーポレーション	18,000	768	13,824,000
アイコム	14,500	2,232	32,364,000
船井電機	24,200	2,522	61,032,400
横河電機	265,300	591	156,792,300
新電元工業	97,000	354	34,338,000
山武	73,400	1,952	143,276,800
日本光電工業	48,700	1,714	83,471,800
チノー	56,000	199	11,144,000
共和電業	29,000	261	7,569,000
日本電子材料	13,300	525	6,982,500
堀場製作所	45,400	2,345	106,463,000
アドバンテスト	180,400	1,484	267,713,600
小野測器	34,000	218	7,412,000
エスベック	28,700	628	18,023,600
パナソニック電工 S U N X	27,800	403	11,203,400
キーエンス	58,500	20,060	1,173,510,000
日置電機	12,000	1,579	18,948,000
シスメックス	91,600	2,873	263,166,800
メガチップス	24,000	1,338	32,112,000
O B A R A	20,200	906	18,301,200
日本電産コパル電子	26,500	545	14,442,500
ミヤチテクノス	14,400	661	9,518,400
東京電波	10,600	492	5,215,200
澤藤電機	22,000	276	6,072,000
コーセル	38,700	1,158	44,814,600
日立メディコ	20,000	1,064	21,280,000
オブテックス	17,700	1,041	18,425,700
千代田インテグレ	10,900	1,190	12,971,000
東光電気	20,000	429	8,580,000
スタンレー電気	177,800	1,263	224,561,400
岩崎電気	104,000	197	20,488,000
ウシオ電機	159,700	1,613	257,596,100



岡谷電機産業	14,100	476	6,711,600
ヘリオス テクノ ホールディング	31,800	190	6,042,000
日本セラミック	17,400	1,567	27,265,800
新神戸電機	22,000	1,143	25,146,000
日本デジタル研究所	20,800	908	18,886,400
古河電池	20,000	721	14,420,000
双信電機	16,100	452	7,277,200
山一電機	33,800	240	8,112,000
図研	19,500	611	11,914,500
日本電子	98,000	222	21,756,000
カシオ計算機	251,900	636	160,208,400
ファナック	273,300	13,310	3,637,623,000
日本シイエムケイ	54,900	314	17,238,600
エンプラス	14,500	1,014	14,703,000
ローム	131,700	4,985	656,524,500
浜松ホトニクス	102,000	3,105	316,710,000
三井ハイテック	33,100	392	12,975,200
新光電気工業	67,300	841	56,599,300
京セラ	218,300	8,420	1,838,086,000
太陽誘電	118,000	1,043	123,074,000
村田製作所	275,600	5,610	1,546,116,000
ユーシン	32,400	538	17,431,200
双葉電子工業	44,100	1,476	65,091,600
北陸電気工業	112,000	162	18,144,000
ニチコン	83,100	1,167	96,977,700
日本ケミコン	167,000	393	65,631,000
K O A	32,900	833	27,405,700
市光工業	71,000	171	12,141,000
小糸製作所	131,000	1,233	161,523,000
ミツバ	50,000	595	29,750,000
スター精密	51,500	921	47,431,500
大日本スクリーン製造	292,000	736	214,912,000
キャノン電子	24,400	2,091	51,020,400
キャノン	1,630,600	3,635	5,927,231,000
リコー	789,000	915	721,935,000
日本電産サンキョー	63,000	546	34,398,000
M U T O Hホールディングス	37,000	174	6,438,000
東京エレクトロン	206,300	4,455	919,066,500
トヨタ紡織	91,500	1,102	100,833,000
鬼怒川ゴム工業	68,000	364	24,752,000
ユニプレス	38,300	1,470	56,301,000
豊田自動織機	237,800	2,333	554,787,400
モリタホールディングス	48,000	512	24,576,000
三櫻工業	29,600	643	19,032,800
デンソー	575,600	2,538	1,460,872,800
東海理化電機製作所	61,000	1,319	80,459,000

三井造船	1,013,000	202	204,626,000	
佐世保重工業	167,000	159	26,553,000	
川崎重工業	2,044,000	348	711,312,000	
日本車輛製造	95,000	355	33,725,000	
日本輸送機	34,000	189	6,426,000	
近畿車輛	40,000	337	13,480,000	
日産自動車	3,315,700	716	2,374,041,200	
いすゞ自動車	1,524,000	292	445,008,000	
トヨタ自動車	3,372,800	3,285	11,079,648,000	
日野自動車	329,000	381	125,349,000	
三菱自動車工業	5,398,000	98	529,004,000	
エフテック	9,100	1,221	11,111,100	
武蔵精密工業	25,600	1,875	48,000,000	
トヨタ車体	45,000	1,314	59,130,000	
日産車体	99,000	561	55,539,000	
関東自動車工業	40,500	517	20,938,500	
新明和工業	116,000	339	39,324,000	
極東開発工業	50,900	401	20,410,900	
日信工業	52,800	1,284	67,795,200	
トピー工業	218,000	199	43,382,000	
ティラド	93,000	304	28,272,000	
曙ブレーキ工業	124,900	395	49,335,500	
タチエス	34,100	1,215	41,431,500	
N O K	127,800	1,341	171,379,800	
フタバ産業	77,100	426	32,844,600	
カヤバ工業	163,000	598	97,474,000	
シロキ工業	62,000	261	16,182,000	
大同メタル工業	43,000	615	26,445,000	
プレス工業	125,000	302	37,750,000	
カルソニックカンセイ	136,000	304	41,344,000	
太平洋工業	53,000	372	19,716,000	
ケーヒン	54,400	1,477	80,348,800	
河西工業	34,000	398	13,532,000	
アイシン精機	216,000	2,574	555,984,000	
富士機工	35,000	259	9,065,000	
マツダ	2,036,000	180	366,480,000	
ダイハツ工業	278,000	1,125	312,750,000	
愛知機械工業	61,000	266	16,226,000	
今仙電機製作所	16,800	1,018	17,102,400	
本田技研工業	2,214,000	2,957	6,546,798,000	
スズキ	548,000	1,797	984,756,000	
富士重工業	831,000	546	453,726,000	
ヤマハ発動機	400,200	1,463	585,492,600	
ショーワ	57,500	525	30,187,500	
T B K	29,000	357	10,353,000	
エクセディ	31,700	2,234	70,817,800	

豊田合成	73,700	1,629	120,057,300
愛三工業	31,200	734	22,900,800
ヨロズ	15,200	1,585	24,092,000
エフ・シー・シー	38,800	1,929	74,845,200
シマノ	107,000	4,280	457,960,000
タカタ	41,000	2,183	89,503,000
テイ・エス テック	49,100	1,278	62,749,800
日本電産トーソク	17,700	700	12,390,000
テルモ	205,800	4,375	900,375,000
クリエートメディック	6,800	798	5,426,400
日機装	92,000	635	58,420,000
島津製作所	313,000	679	212,527,000
JMS	28,000	277	7,756,000
クボテック	89	48,500	4,316,500
長野計器	18,900	645	12,190,500
ブイ・テクノロジー	41	629,000	25,789,000
東京計器	108,000	113	12,204,000
愛知時計電機	31,000	252	7,812,000
東京精密	51,200	1,424	72,908,800
ニコン	457,100	1,641	750,101,100
トプコン	62,400	405	25,272,000
オリンパス	309,100	2,235	690,838,500
理研計器	19,100	690	13,179,000
タムロン	25,200	1,719	43,318,800
HOYA	602,900	1,708	1,029,753,200
ノーリツ鋼機	23,100	462	10,672,200
エー・アンド・デイ	29,700	254	7,543,800
日本電産コパル	20,500	956	19,598,000
シチズンホールディングス	285,500	473	135,041,500
リズム時計工業	137,000	111	15,207,000
大研医器	4,100	900	3,690,000
セイコーホールディングス	142,000	261	37,062,000
ニプロ	50,300	1,613	81,133,900
SRIスポーツ	164	86,200	14,136,800
バンダイナムコホールディングス	306,100	854	261,409,400
共立印刷	36,700	115	4,220,500
フランスベッドホールディングス	187,000	100	18,700,000
パイロットコーポレーション	243	147,000	35,721,000
トッパン・フォームズ	52,900	667	35,284,300
フジシールインターナショナル	27,300	1,646	44,935,800
タカラトミー	77,700	635	49,339,500
廣済堂	14,900	231	3,441,900
タカノ	12,000	498	5,976,000
プロネクサス	31,200	412	12,854,400
ホクシン	34,000	142	4,828,000
ウッドワン	47,000	429	20,163,000

大建工業	113,000	291	32,883,000	
凸版印刷	738,000	637	470,106,000	
大日本印刷	797,000	974	776,278,000	
図書印刷	50,000	118	5,900,000	
共同印刷	75,000	168	12,600,000	
日本写真印刷	48,800	1,693	82,618,400	
光村印刷	25,000	253	6,325,000	
宝印刷	12,100	642	7,768,200	
アシックス	245,000	1,115	273,175,000	
ツツミ	11,700	1,872	21,902,400	
ローランド	25,800	914	23,581,200	
小松ウオール工業	7,600	802	6,095,200	
ヤマハ	209,500	970	203,215,000	
河合楽器製作所	110,000	156	17,160,000	
クリナップ	28,200	553	15,594,600	
ビジョン	18,700	2,641	49,386,700	
パラマウントベッド	20,900	2,080	43,472,000	
兼松日産農林	55,000	176	9,680,000	
キングジム	22,100	618	13,657,800	
リンテック	56,200	2,256	126,787,200	
イトーキ	62,300	188	11,712,400	
任天堂	150,200	20,710	3,110,642,000	
三菱鉛筆	21,400	1,235	26,429,000	
タカラスタンダード	118,000	612	72,216,000	
コクヨ	134,600	599	80,625,400	
ナカバヤシ	53,000	160	8,480,000	
グローブライド	126,000	86	10,836,000	
岡村製作所	102,000	419	42,738,000	
美津濃	128,000	343	43,904,000	
ユニハアー	31,000	889	27,559,000	
東京電力	1,801,000	502	904,102,000	
中部電力	808,600	1,860	1,503,996,000	
関西電力	1,071,000	1,779	1,905,309,000	
中国電力	362,500	1,495	541,937,500	
北陸電力	268,800	1,723	463,142,400	
東北電力	655,700	1,326	869,458,200	
四国電力	265,600	2,128	565,196,800	
九州電力	579,400	1,575	912,555,000	
北海道電力	245,200	1,507	369,516,400	
沖縄電力	16,000	3,780	60,480,000	
電源開発	163,500	2,304	376,704,000	
東京瓦斯	3,285,000	363	1,192,455,000	
大阪瓦斯	2,638,000	310	817,780,000	
東邦瓦斯	675,000	409	276,075,000	
北海道瓦斯	47,000	244	11,468,000	
西部瓦斯	294,000	195	57,330,000	

静岡瓦斯	71,500	487	34,820,500	
東武鉄道	1,375,000	323	444,125,000	
相鉄ホールディングス	427,000	220	93,940,000	
東京急行電鉄	1,441,000	333	479,853,000	
京浜急行電鉄	677,000	565	382,505,000	
小田急電鉄	838,000	666	558,108,000	
京王電鉄	676,000	463	312,988,000	
京成電鉄	420,000	456	191,520,000	
富士急行	75,000	413	30,975,000	
新京成電鉄	34,000	337	11,458,000	
東日本旅客鉄道	457,000	4,555	2,081,635,000	
西日本旅客鉄道	2,449	310,500	760,414,500	
東海旅客鉄道	2,282	621,000	1,417,122,000	
西日本鉄道	332,000	347	115,204,000	
ハマキョウレックス	8,100	2,316	18,759,600	
サカイ引越センター	4,000	1,542	6,168,000	
近畿日本鉄道	2,379,000	248	589,992,000	
阪急阪神ホールディングス	1,760,000	370	651,200,000	
南海電気鉄道	546,000	314	171,444,000	
京阪電気鉄道	585,000	332	194,220,000	
名糖運輸	9,800	602	5,899,600	
名古屋鉄道	910,000	213	193,830,000	
日本通運	1,042,000	320	333,440,000	
ヤマトホールディングス	534,200	1,292	690,186,400	
山九	321,000	370	118,770,000	
丸運	14,700	207	3,042,900	
丸全昭和運輸	86,000	254	21,844,000	
センコー	116,000	240	27,840,000	
トナミホールディングス	63,000	142	8,946,000	
日本梱包運輸倉庫	79,000	878	69,362,000	
日本石油輸送	30,000	203	6,090,000	
福山通運	180,000	388	69,840,000	
セイノーホールディングス	203,000	600	121,800,000	
神奈川中央交通	30,000	405	12,150,000	
日立物流	45,000	1,183	53,235,000	
日本郵船	2,219,000	309	685,671,000	
商船三井	1,275,000	464	591,600,000	
川崎汽船	810,000	283	229,230,000	
N S ユナイテッド海運	98,000	168	16,464,000	
乾汽船	29,000	445	12,905,000	
明治海運	28,500	283	8,065,500	
飯野海運	129,300	394	50,944,200	
共栄タンカー	30,000	175	5,250,000	
第一中央汽船	157,000	150	23,550,000	
全日本空輸	3,492,000	236	824,112,000	
バスコ	35,000	272	9,520,000	

国際航業ホールディングス	19,000	282	5,358,000	
日新	98,000	209	20,482,000	
三菱倉庫	186,000	904	168,144,000	
三井倉庫	123,000	302	37,146,000	
住友倉庫	193,000	391	75,463,000	
澁澤倉庫	68,000	258	17,544,000	
東陽倉庫	37,000	173	6,401,000	
日本トランスシティ	54,000	261	14,094,000	
ケイヒン	66,000	94	6,204,000	
安田倉庫	21,500	473	10,169,500	
東洋埠頭	90,000	133	11,970,000	
宇徳	20,800	207	4,305,600	
上組	287,000	690	198,030,000	
サンリツ	8,700	579	5,037,300	
キムラユニティー	2,500	657	1,642,500	
キューソー流通システム	4,400	848	3,731,200	
郵船ロジスティクス	21,800	1,350	29,430,000	
近鉄エクスプレス	23,700	2,664	63,136,800	
東海運	17,100	193	3,300,300	
バンテック	126	233,000	29,358,000	
システナ	269	83,800	22,542,200	
新日鉄ソリューションズ	22,400	1,453	32,547,200	
コア	9,200	619	5,694,800	
デジタルハーツ	25	161,000	4,025,000	
ITホールディングス	86,900	816	70,910,400	
グリー	85,700	1,356	116,209,200	
コーエーテックモホールディングス	53,100	604	32,072,400	
三菱総合研究所	10,500	1,628	17,094,000	
ドワンゴ	136	208,500	28,356,000	
ベリサーブ	14	105,000	1,470,000	
マクロミル	33,400	910	30,394,000	
ティーガイア	216	134,400	29,030,400	
GMOペイメントゲートウェイ	66	290,000	19,140,000	
ザッパラス	164	113,000	18,532,000	
インターネットイニシアティブ	158	232,900	36,798,200	
ソネットエンタテインメント	150	297,200	44,580,000	
SRAホールディングス	13,300	699	9,296,700	
JBSホールディングス	31,000	262	8,122,000	
朝日ネット	19,000	316	6,004,000	
パナソニック電工インフォメーションシステムズ	4,900	2,016	9,878,400	
フェイス	1,005	10,140	10,190,700	
野村総合研究所	147,200	1,778	261,721,600	
サイバネットシステム	211	19,800	4,177,800	
インテージ	7,700	1,722	13,259,400	
シンプレクス・ホールディングス	493	36,600	18,043,800	
クレスコ	8,600	529	4,549,400	

フジ・メディア・ホールディングス	2,707	108,000	292,356,000	
オービック	8,960	15,080	135,116,800	
ティーディーシーソフトウェアエンジニアリング	5,600	630	3,528,000	
ヤフー	19,047	28,250	538,077,750	
トレンドマイクロ	115,000	2,177	250,355,000	
日本オラクル	41,700	3,420	142,614,000	
アルファシステムズ	8,000	1,233	9,864,000	
フューチャーアーキテクト	329	31,250	10,281,250	
シーエーシー	15,800	644	10,175,200	
ソフトバンク・テクノロジー	7,200	611	4,399,200	
トーセ	8,200	493	4,042,600	
オービックビジネスコンサルタント	6,750	4,720	31,860,000	
日立ビジネスソリューション	7,900	694	5,482,600	
伊藤忠テクノソリューションズ	37,200	2,766	102,895,200	
アイティフォー	33,900	239	8,102,100	
エクスネット	23	124,500	2,863,500	
大塚商会	20,900	4,935	103,141,500	
サイボウズ	472	17,790	8,396,880	
アグレックス	6,800	755	5,134,000	
電通国際情報サービス	19,000	510	9,690,000	
ウェザーニューズ	8,400	1,754	14,733,600	
C I J	23,800	258	6,140,400	
ネットワンシステムズ	642	134,200	86,156,400	
アルゴグラフィックス	10,100	1,000	10,100,000	
エイベックス・グループ・ホールディングス	51,000	985	50,235,000	
日本ユニシス	72,600	507	36,808,200	
兼松エレクトロニクス	17,800	799	14,222,200	
東京放送ホールディングス	140,800	901	126,860,800	
日本テレビ放送網	22,740	11,200	254,688,000	
テレビ朝日	653	123,200	80,449,600	
スカパーJ S A Tホールディングス	1,987	30,800	61,199,600	
テレビ東京ホールディングス	11,700	1,055	12,343,500	
アイ・ティー・シーネットワーク	20,300	456	9,256,800	
イー・アクセス	1,071	40,450	43,321,950	
N E C モバイルリング	9,200	2,533	23,303,600	
日本電信電話	973,100	3,790	3,688,049,000	
K D D I	4,024	506,000	2,036,144,000	
光通信	34,100	1,567	53,434,700	
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	21,407	150,500	3,221,753,500	
G M O インターネット	35,100	352	12,355,200	
学研ホールディングス	121,000	146	17,666,000	
ゼンリン	37,700	802	30,235,400	
昭文社	16,300	618	10,073,400	
角川グループホールディングス	24,900	1,790	44,571,000	
インプレスホールディングス	41,100	134	5,507,400	
アイネット	12,300	426	5,239,800	

松竹	162,000	571	92,502,000	
東宝	168,900	1,156	195,248,400	
東映	110,000	363	39,930,000	
葵プロモーション	12,500	409	5,112,500	
エヌ・ティ・ティ・データ	1,833	246,300	451,467,900	
D T S	25,000	767	19,175,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	86,000	1,376	118,336,000	
シーイーシー	18,600	398	7,402,800	
カプコン	55,800	1,531	85,429,800	
ジャステック	13,300	463	6,157,900	
住商情報システム	25,800	1,088	28,070,400	
C S K	40,200	250	10,050,000	
日本システムウエア	14,400	297	4,276,800	
アイネス	36,900	502	18,523,800	
T K C	17,900	1,701	30,447,900	
富士ソフト	35,200	1,210	42,592,000	
N S D	49,800	760	37,848,000	
コナミ	120,100	1,482	177,988,200	
福井コンピュータ	8,700	427	3,714,900	
J B C Cホールディングス	20,800	496	10,316,800	
ソフトバンク	1,148,000	3,400	3,903,200,000	
ハウスイ	35,000	91	3,185,000	
インターニックス	13,400	351	4,703,400	
高千穂交易	6,900	866	5,975,400	
伊藤忠食品	5,400	2,702	14,590,800	
エレマテック	18,300	1,019	18,647,700	
J A L U X	8,800	727	6,397,600	
トーメンデバイス	3,000	2,099	6,297,000	
東京エレクトロン デバイス	54	147,200	7,948,800	
双日	1,738,600	159	276,437,400	
アルフレッサ ホールディングス	67,900	2,972	201,798,800	
横浜冷凍	46,700	556	25,965,200	
神栄	48,000	129	6,192,000	
山下医科器械	2,200	1,050	2,310,000	
ラサ商事	12,400	332	4,116,800	
アルコニックス	4,800	2,187	10,497,600	
あい ホールディングス	46,600	326	15,191,600	
ダイワボウホールディングス	247,000	160	39,520,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	49,500	634	31,383,000	
U K Cホールディングス	16,500	879	14,503,500	
T O K A Iホールディングス	62,000	410	25,420,000	
日本コークス工業	229,500	158	36,261,000	
ミタチ産業	7,300	420	3,066,000	
J F E 商事ホールディングス	172,000	328	56,416,000	
シップヘルスケアホールディングス	35,300	1,063	37,523,900	
富士興産	124,000	86	10,664,000	



協栄産業	39,000	148	5,772,000	
小野建	22,200	722	16,028,400	
佐島電機	20,200	510	10,302,000	
エコトレーディング	3,600	693	2,494,800	
伯東	15,000	821	12,315,000	
中山福	2,600	560	1,456,000	
ナガイレーベン	13,500	2,090	28,215,000	
菱食	25,000	1,625	40,625,000	
松田産業	19,100	1,237	23,626,700	
メディパルホールディングス	241,100	690	166,359,000	
アドヴァン	18,400	690	12,696,000	
S P K	5,800	1,186	6,878,800	
アズワン	17,100	1,641	28,061,100	
スズデン	6,500	468	3,042,000	
尾家産業	9,500	798	7,581,000	
シモジマ	17,300	947	16,383,100	
ドウシシャ	11,900	1,653	19,670,700	
高速	12,000	601	7,212,000	
黒田電気	34,400	921	31,682,400	
丸文	23,100	376	8,685,600	
ハピネット	6,000	972	5,832,000	
トーメンエレクトロニクス	10,700	1,087	11,630,900	
エクセル	12,700	924	11,734,800	
マルカキカイ	9,300	597	5,552,100	
ガリバーインターナショナル	7,430	3,155	23,441,650	
日本エム・ディ・エム	30,300	203	6,150,900	
進和	14,500	899	13,035,500	
エスケイジャパン	10,100	242	2,444,200	
ダイトエレクトロン	13,200	529	6,982,800	
シークス	17,100	1,091	18,656,100	
田中商事	10,100	399	4,029,900	
オーハシテクニカ	15,800	586	9,258,800	
マクニカ	12,300	1,848	22,730,400	
白銅	9,200	790	7,268,000	
伊藤忠商事	1,807,900	826	1,493,325,400	
丸紅	2,265,000	564	1,277,460,000	
高島	54,000	199	10,746,000	
F & A アクアホールディングス	19,500	677	13,201,500	
長瀬産業	144,000	945	136,080,000	
蝶理	179,000	94	16,826,000	
豊田通商	287,200	1,295	371,924,000	
三共生興	44,800	259	11,603,200	
兼松	594,000	77	45,738,000	
ツカモトコーポレーション	73,000	84	6,132,000	
三井物産	2,236,800	1,451	3,245,596,800	
日本紙パルプ商事	139,000	289	40,171,000	

日立ハイテクノロジーズ	79,500	1,580	125,610,000
カメイ	29,000	322	9,338,000
東都水産	56,000	126	7,056,000
スターゼン	77,000	238	18,326,000
山善	100,900	436	43,992,400
椿本興業	28,000	194	5,432,000
住友商事	1,427,000	1,114	1,589,678,000
内田洋行	60,000	252	15,120,000
三菱商事	2,074,900	2,241	4,649,850,900
第一実業	57,000	297	16,929,000
キヤノンマーケティングジャパン	87,400	977	85,389,800
西華産業	95,000	222	21,090,000
佐藤商事	25,000	467	11,675,000
菱洋エレクトロ	32,100	804	25,808,400
東京産業	17,000	251	4,267,000
ユアサ商事	280,000	95	26,600,000
神鋼商事	66,000	196	12,936,000
阪和興業	240,000	349	83,760,000
カナデン	24,000	510	12,240,000
菱電商事	35,000	501	17,535,000
フルサト工業	16,500	615	10,147,500
岩谷産業	284,000	272	77,248,000
すてきなイスグループ	121,000	196	23,716,000
昭光通商	100,000	108	10,800,000
ニチモウ	44,000	162	7,128,000
極東貿易	41,000	142	5,822,000
イワキ	35,000	191	6,685,000
三愛石油	59,000	422	24,898,000
稲畑産業	69,600	471	32,781,600
G S Iクレオス	73,000	106	7,738,000
明和産業	27,900	240	6,696,000
東邦ホールディングス	80,300	832	66,809,600
サンゲツ	45,600	1,879	85,682,400
ミツウロコ	39,900	466	18,593,400
シナネン	50,000	354	17,700,000
伊藤忠エネクス	53,300	453	24,144,900
サンリオ	73,600	2,313	170,236,800
サンワテクノス	14,600	622	9,081,200
リョーサン	40,800	1,847	75,357,600
新光商事	24,000	681	16,344,000
トーホー	45,000	299	13,455,000
三信電気	29,600	659	19,506,400
東陽テクニカ	36,200	747	27,041,400
モスフードサービス	30,700	1,484	45,558,800
加賀電子	25,600	902	23,091,200
ソーダニッカ	23,000	332	7,636,000

立花エレテック	15,000	773	11,595,000
P a l t a c	16,800	1,331	22,360,800
太平洋興発	116,000	79	9,164,000
ヤマタネ	140,000	123	17,220,000
丸紅建材リース	31,000	172	5,332,000
日鐵商事	60,000	230	13,800,000
トラスコ中山	31,600	1,354	42,786,400
オートバックスセブン	33,800	2,964	100,183,200
加藤産業	37,200	1,369	50,926,800
イエローハット	25,400	725	18,415,000
富士エレクトロニクス	15,300	1,376	21,052,800
J Kホールディングス	26,200	428	11,213,600
日伝	9,800	2,290	22,442,000
北沢産業	29,000	158	4,582,000
杉本商事	13,400	705	9,447,000
因幡電機産業	30,100	2,212	66,581,200
住金物産	121,000	186	22,506,000
ミスミグループ本社	88,300	1,962	173,244,600
アルテック	18,400	287	5,280,800
タキヒヨー	41,000	381	15,621,000
スズケン	107,200	2,027	217,294,400
ジェコス	19,100	387	7,391,700
ローソン	89,700	3,865	346,690,500
サンエー	8,500	3,095	26,307,500
キリン堂	7,600	407	3,093,200
ダイユーエイト	4,100	435	1,783,500
カワチ薬品	17,400	1,475	25,665,000
エービーシー・マート	31,300	2,866	89,705,800
ハードオフコーポレーション	7,400	398	2,945,200
アスクル	21,400	1,170	25,038,000
ゲオ	443	94,700	41,952,100
ポイント	21,600	3,665	79,164,000
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	27,000	102	2,754,000
くらコーポレーション	14,300	1,189	17,002,700
キャンドゥ	136	73,700	10,023,200
パル	8,200	2,655	21,771,000
エディオン	96,200	684	65,800,800
サーラコーポレーション	26,000	383	9,958,000
パルス	132	75,900	10,018,800
あみやき亭	47	246,900	11,604,300
ひらまつ	60	80,700	4,842,000
ハニーズ	25,170	803	20,211,510
アルペン	16,600	1,311	21,762,600
ビックカメラ	625	34,800	21,750,000
D C Mホールディングス	124,100	472	58,575,200
M o n o t a R O	7,200	942	6,782,400

ユニバース	1,600	1,230	1,968,000	
J・フロントリテイリング	612,000	326	199,512,000	
ドトール・日レスホールディングス	45,400	980	44,492,000	
マツモトキヨシホールディングス	48,300	1,583	76,458,900	
ココカラファイン	24,700	1,678	41,446,600	
三越伊勢丹ホールディングス	513,400	733	376,322,200	
クリエイトSDホールディングス	9,700	1,862	18,061,400	
CHIグループ	20,400	226	4,610,400	
ブックオフコーポレーション	17,000	566	9,622,000	
あさひ	11,500	1,528	17,572,000	
サークルKサンクス	56,400	1,190	67,116,000	
日本調剤	4,060	2,810	11,408,600	
コスモス薬品	13,400	3,550	47,570,000	
セブン&アイ・ホールディングス	1,084,400	2,065	2,239,286,000	
ツルハホールディングス	23,300	3,785	88,190,500	
サンマルクホールディングス	8,400	2,945	24,738,000	
フェリシモ	7,200	931	6,703,200	
トリドール	103	87,700	9,033,100	
メディカルシステムネットワーク	3,500	578	2,023,000	
総合メディカル	5,900	2,134	12,590,600	
はるやま商事	14,900	379	5,647,100	
カッパ・クリエイト	18,100	1,540	27,874,000	
ライトオン	23,900	380	9,082,000	
ジーンズメイト	14,700	233	3,425,100	
良品計画	30,300	3,305	100,141,500	
三城ホールディングス	32,500	760	24,700,000	
コナカ	36,200	358	12,959,600	
G-7ホールディングス	5,100	422	2,152,200	
イオン北海道	15,700	316	4,961,200	
コジマ	33,700	478	16,108,600	
コーナン商事	24,300	1,200	29,160,000	
エコス	11,700	423	4,949,100	
ワタミ	30,600	1,343	41,095,800	
マルシェ	4,300	662	2,846,600	
ドン・キホーテ	50,600	2,871	145,272,600	
メガネトップ	28,500	792	22,572,000	
西松屋チェーン	58,200	693	40,332,600	
ゼンショー	99,300	814	80,830,200	
幸楽苑	11,200	1,065	11,928,000	
ハークスレイ	5,700	473	2,696,100	
サイゼリヤ	34,600	1,455	50,343,000	
ポブラ	4,900	414	2,028,600	
ユナイテッドアローズ	26,300	1,231	32,375,300	
ハイデイ日高	9,800	1,255	12,299,000	
京都きもの友禅	15,600	896	13,977,600	
コロワイド	85,500	429	36,679,500	

壱番屋	9,800	2,377	23,294,600
トップカルチャー	3,600	344	1,238,400
スギホールディングス	41,600	1,945	80,912,000
スクロール	38,500	287	11,049,500
ファミリーマート	87,800	2,940	258,132,000
木曽路	27,600	1,622	44,767,200
千趣会	44,000	474	20,856,000
タカキュー	34,000	133	4,522,000
ケーヨー	43,900	402	17,647,800
上新電機	55,000	786	43,230,000
日本瓦斯	25,400	1,048	26,619,200
ベスト電器	88,000	231	20,328,000
マルエツ	52,000	303	15,756,000
ロイヤルホールディングス	38,500	809	31,146,500
東天紅	32,000	117	3,744,000
いなげや	24,000	845	20,280,000
島忠	50,300	1,769	88,980,700
チヨダ	34,400	1,110	38,184,000
ライフコーポレーション	16,200	1,250	20,250,000
カスミ	46,800	417	19,515,600
リンガーハット	20,900	1,022	21,359,800
さが美	40,000	98	3,920,000
MrMax	28,800	287	8,265,600
テナアライド	16,900	245	4,140,500
AOKIホールディングス	24,500	1,230	30,135,000
オークワ	35,000	819	28,665,000
コメリ	35,700	2,080	74,256,000
青山商事	66,700	1,266	84,442,200
しまむら	27,100	7,290	197,559,000
CFSコーポレーション	27,500	400	11,000,000
高島屋	351,000	532	186,732,000
松屋	51,900	436	22,628,400
エイチ・ツー・オー リテイリング	151,000	552	83,352,000
丸栄	69,000	93	6,417,000
ニッセンホールディングス	55,900	459	25,658,100
パルコ	66,800	789	52,705,200
丸井グループ	340,100	526	178,892,600
原信ナルスホールディングス	14,200	1,201	17,054,200
ダイエー	124,850	289	36,081,650
イズミヤ	90,000	347	31,230,000
イオン	913,600	922	842,339,200
ユニー	210,200	711	149,452,200
イズミ	71,400	1,134	80,967,600
東武ストア	19,000	237	4,503,000
平和堂	49,800	958	47,708,400
フジ	29,200	1,563	45,639,600

ヤオコー	10,700	2,400	25,680,000
ゼビオ	31,500	1,499	47,218,500
ケーズホールディングス	60,100	2,302	138,350,200
O l y m p i c	18,400	570	10,488,000
東日カーライフグループ	55,000	111	6,105,000
アインファーマシーズ	11,300	2,906	32,837,800
元気寿司	9,700	831	8,060,700
ヤマダ電機	118,470	5,510	652,769,700
アークランドサカモト	16,600	1,144	18,990,400
ニトリホールディングス	51,450	7,150	367,867,500
グルメ杵屋	21,000	469	9,849,000
愛眼	19,200	432	8,294,400
吉野家ホールディングス	697	98,800	68,863,600
松屋フーズ	9,500	1,475	14,012,500
サガミチェーン	35,000	467	16,345,000
ブレナス	32,600	1,235	40,261,000
ミニストップ	20,100	1,292	25,969,200
アークス	31,600	1,242	39,247,200
パロー	48,800	810	39,528,000
ベルク	9,200	975	8,970,000
大庄	14,100	920	12,972,000
ファーストリテイリング	60,700	11,760	713,832,000
サンドラッグ	49,400	2,267	111,989,800
ヤマザワ	5,500	1,101	6,055,500
やまや	2,000	661	1,322,000
ベルーナ	35,350	509	17,993,150
新生銀行	1,814,000	95	172,330,000
あおぞら銀行	955,000	183	174,765,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	19,613,700	397	7,786,638,900
りそなホールディングス	1,602,800	388	621,886,400
三井住友トラスト・ホールディングス	4,949,570	298	1,474,971,860
三井住友フィナンシャルグループ	1,959,800	2,565	5,026,887,000
第四銀行	348,000	259	90,132,000
北越銀行	300,000	166	49,800,000
西日本シティ銀行	920,000	235	216,200,000
札幌北洋ホールディングス	390,200	374	145,934,800
千葉銀行	1,025,000	464	475,600,000
横浜銀行	1,782,000	395	703,890,000
常陽銀行	1,002,000	329	329,658,000
群馬銀行	593,000	453	268,629,000
武蔵野銀行	42,800	2,634	112,735,200
千葉興業銀行	52,600	451	23,722,600
筑波銀行	125,800	230	28,934,000
東京都民銀行	50,500	1,010	51,005,000
七十七銀行	438,000	408	178,704,000
青森銀行	210,000	242	50,820,000

秋田銀行	172,000	239	41,108,000	
山形銀行	158,000	390	61,620,000	
岩手銀行	17,200	3,145	54,094,000	
東邦銀行	215,000	201	43,215,000	
東北銀行	141,000	113	15,933,000	
みちのく銀行	135,000	135	18,225,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	1,047,000	339	354,933,000	
静岡銀行	800,000	728	582,400,000	
十六銀行	323,000	251	81,073,000	
スルガ銀行	277,000	676	187,252,000	
八十二銀行	485,000	483	234,255,000	
山梨中央銀行	159,000	372	59,148,000	
大垣共立銀行	341,000	255	86,955,000	
福井銀行	229,000	241	55,189,000	
北國銀行	299,000	273	81,627,000	
清水銀行	8,200	3,310	27,142,000	
滋賀銀行	233,000	423	98,559,000	
南都銀行	242,000	385	93,170,000	
百五銀行	229,000	355	81,295,000	
京都銀行	460,000	733	337,180,000	
三重銀行	112,000	217	24,304,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	1,812,000	157	284,484,000	
広島銀行	771,000	350	269,850,000	
山陰合同銀行	152,000	595	90,440,000	
中国銀行	211,000	944	199,184,000	
鳥取銀行	72,000	163	11,736,000	
伊予銀行	277,000	670	185,590,000	
百十四銀行	293,000	294	86,142,000	
四国銀行	197,000	242	47,674,000	
阿波銀行	216,000	504	108,864,000	
鹿児島銀行	161,000	541	87,101,000	
大分銀行	170,000	263	44,710,000	
宮崎銀行	172,000	185	31,820,000	
肥後銀行	208,000	458	95,264,000	
佐賀銀行	158,000	224	35,392,000	
十八銀行	171,000	217	37,107,000	
沖縄銀行	19,200	3,140	60,288,000	
琉球銀行	55,500	928	51,504,000	
みずほ信託銀行	2,481,000	71	176,151,000	
八千代銀行	14,100	2,561	36,110,100	
みずほフィナンシャルグループ	31,866,300	132	4,206,351,600	
紀陽ホールディングス	1,029,000	114	117,306,000	
山口フィナンシャルグループ	254,000	766	194,564,000	
長野銀行	98,000	172	16,856,000	
名古屋銀行	229,000	250	57,250,000	
愛知銀行	8,500	4,795	40,757,500	

第三銀行	159,000	204	32,436,000	
中京銀行	104,000	180	18,720,000	
東日本銀行	134,000	165	22,110,000	
大光銀行	95,000	254	24,130,000	
愛媛銀行	165,000	218	35,970,000	
トマト銀行	118,000	156	18,408,000	
みなと銀行	277,000	137	37,949,000	
京葉銀行	217,000	406	88,102,000	
関西アーバン銀行	382,000	141	53,862,000	
栃木銀行	129,000	340	43,860,000	
北日本銀行	8,400	1,832	15,388,800	
東和銀行	306,000	91	27,846,000	
トモニホールディングス	200,600	275	55,165,000	
フィデアホールディングス	152,500	209	31,872,500	
池田泉州ホールディングス	740,100	119	88,071,900	
S B Iホールディングス	31,063	8,740	271,490,620	
ジャフコ	36,100	2,060	74,366,000	
大和証券グループ本社	2,577,000	370	953,490,000	
野村ホールディングス	5,467,100	424	2,318,050,400	
みずほ証券	679,000	211	143,269,000	
みずほインベスターズ証券	619,000	73	45,187,000	
岡三証券グループ	217,000	290	62,930,000	
丸三証券	75,000	357	26,775,000	
東洋証券	95,000	116	11,020,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	289,000	251	72,539,000	
光世証券	78,000	73	5,694,000	
水戸証券	76,000	117	8,892,000	
いちよし証券	54,900	500	27,450,000	
松井証券	155,300	413	64,138,900	
だいこう証券ビジネス	19,500	272	5,304,000	
マネックスグループ	1,630	17,910	29,193,300	
カブドットコム証券	113,800	258	29,360,400	
極東証券	32,600	523	17,049,800	
岩井コスモホールディングス	26,500	418	11,077,000	
N K S Jホールディングス	2,180,000	533	1,161,940,000	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	777,600	1,878	1,460,332,800	
ソニーフィナンシャルホールディングス	248,800	1,510	375,688,000	
第一生命保険	10,444	127,500	1,331,610,000	
東京海上ホールディングス	986,800	2,302	2,271,613,600	
T & Dホールディングス	475,300	2,005	952,976,500	
クレディセゾン	198,900	1,283	255,188,700	
セディナ	167,800	153	25,673,400	
芙蓉総合リース	25,600	2,414	61,798,400	
興銀リース	36,900	1,898	70,036,200	
東京センチュリーリース	62,900	1,319	82,965,100	
日本証券金融	116,100	513	59,559,300	



大阪証券金融	56,600	146	8,263,600	
ポケットカード	34,300	235	8,060,500	
リコーリース	19,600	1,851	36,279,600	
イオンクレジットサービス	117,900	1,028	121,201,200	
アコム	55,020	1,030	56,670,600	
プロミス	106,200	557	59,153,400	
ジャックス	197,000	199	39,203,000	
日立キャピタル	63,000	1,031	64,953,000	
オリックス	135,210	7,630	1,031,652,300	
三菱UFJリース	66,700	3,125	208,437,500	
アサックス	65	107,500	6,987,500	
NECキャピタルソリューション	9,300	1,238	11,513,400	
日本駐車場開発	3,495	3,405	11,900,475	
昭栄	49,200	737	36,260,400	
東京建物不動産販売	12,000	250	3,000,000	
野村不動産ホールディングス	110,400	1,182	130,492,800	
常和ホールディングス	4,000	1,322	5,288,000	
ヒューリック	75,700	672	50,870,400	
パーク24	124,400	801	99,644,400	
三井不動産	1,223,000	1,409	1,723,207,000	
三菱地所	1,815,000	1,388	2,519,220,000	
平和不動産	246,500	180	44,370,000	
東京建物	535,000	288	154,080,000	
ダイビル	78,800	684	53,899,200	
サンケイビル	52,700	454	23,925,800	
東急不動産	525,000	343	180,075,000	
京阪神不動産	31,900	400	12,760,000	
住友不動産	622,000	1,616	1,005,152,000	
東宝不動産	32,200	465	14,973,000	
大京	316,000	120	37,920,000	
テーオーシー	106,100	299	31,723,900	
東京楽天地	47,000	258	12,126,000	
レオパレス21	33,400	118	3,941,200	
フジ住宅	31,200	353	11,013,600	
空港施設	34,600	316	10,933,600	
住友不動産販売	10,080	3,145	31,701,600	
ゴールドクレスト	25,190	1,496	37,684,240	
東栄住宅	21,800	883	19,249,400	
日本エスリード	15,000	698	10,470,000	
東急リバブル	30,000	694	20,820,000	
飯田産業	31,200	717	22,370,400	
日神不動産	18,700	438	8,190,600	
アーネストワン	49,600	738	36,604,800	
サンヨーハウジング名古屋	115	75,200	8,648,000	
イオンモール	119,100	1,848	220,096,800	
タクトホーム	156	72,000	11,232,000	

エヌ・ティ・ティ都市開発	1,914	66,600	127,472,400
ランドビジネス	344	15,250	5,246,000
日本空港ビルデング	84,300	984	82,951,200
日本工営	89,000	290	25,810,000
ネクスト	127	56,000	7,112,000
日本M&Aセンター	64	400,500	25,632,000
ノバレーゼ	53	55,800	2,957,400
アコーディア・ゴルフ	816	54,800	44,716,800
パソナグループ	292	71,400	20,848,800
リンクアンドモチベーション	56	46,900	2,626,400
テンプホールディングス	38,000	730	27,740,000
学情	15,600	287	4,477,200
スタジオアリス	11,300	846	9,559,800
シミック	11,000	1,288	14,168,000
NECフィールディング	20,800	911	18,948,800
総合警備保障	98,400	907	89,248,800
カカコム	192	430,500	82,656,000
ルネサンス	10,100	294	2,969,400
新日本科学	23,100	320	7,392,000
エムスリー	110	496,000	54,560,000
ベストプライダル	46	70,800	3,256,800
ディー・エヌ・エー	107,600	2,871	308,919,600
博報堂DYホールディングス	37,810	4,185	158,234,850
ぐるなび	16,800	947	15,909,600
一休	254	33,000	8,382,000
ジャパンベストレスキューシステム	37	64,500	2,386,500
ジェイコムホールディングス	34	187,400	6,371,600
PGMホールディングス	604	44,600	26,938,400
イービーエス	151	183,900	27,768,900
アミューズ	4,000	869	3,476,000
TAC	16,700	301	5,026,700
ケネディクス	3,196	14,500	46,342,000
電通	249,300	2,121	528,765,300
テイクアンドギヴ・ニーズ	1,616	5,510	8,904,160
ぴあ	12,200	789	9,625,800
イオンファンタジー	9,100	852	7,753,200
みらかホールディングス	66,800	3,125	208,750,000
アルプス技研	13,800	619	8,542,200
サニックス	53,500	242	12,947,000
オリエンタルランド	74,000	6,770	500,980,000
ダスキン	75,900	1,585	120,301,500
明光ネットワークジャパン	22,000	702	15,444,000
ファルコSDホールディングス	13,200	646	8,527,200
秀英予備校	7,600	333	2,530,800
田谷	3,100	634	1,965,400
ラウンドワン	75,600	459	34,700,400

リゾートトラスト	43,600	1,023	44,602,800	
ビー・エム・エル	15,600	2,361	36,831,600	
ワタベウェディング	8,900	709	6,310,100	
もしもしホットライン	17,600	1,507	26,523,200	
東急コミュニティー	5,600	2,289	12,818,400	
リソー教育	3,368	3,900	13,135,200	
ウェアハウス	10,100	248	2,504,800	
ユー・エス・エス	35,620	6,160	219,419,200	
東京個別指導学院	26,400	173	4,567,200	
カルチュア・コンビニエンス・クラブ	146,300	594	86,902,200	
テー・オー・ダブリュー	3,800	481	1,827,800	
セントラルスポーツ	6,000	875	5,250,000	
リゾートソリューション	34,000	129	4,386,000	
エイチ・アイ・エス	29,900	1,735	51,876,500	
共立メンテナンス	12,300	1,132	13,923,600	
イチネンホールディングス	23,600	391	9,227,600	
建設技術研究所	15,700	518	8,132,600	
燦ホールディングス	1,300	1,263	1,641,900	
東京テアトル	117,000	105	12,285,000	
ホリプロ	8,900	707	6,292,300	
よみうりランド	65,000	269	17,485,000	
東京都競馬	197,000	101	19,897,000	
常磐興産	90,000	94	8,460,000	
カナモト	35,000	577	20,195,000	
東京ドーム	206,000	175	36,050,000	
トランス・コスモス	36,700	702	25,763,400	
乃村工藝社	57,000	238	13,566,000	
藤田観光	70,000	295	20,650,000	
日本管財	10,000	1,347	13,470,000	
白洋舎	26,000	186	4,836,000	
セコム	285,100	4,030	1,148,953,000	
セントラル警備保障	9,200	804	7,396,800	
丹青社	32,000	310	9,920,000	
メイテック	41,300	1,505	62,156,500	
アサツー ディ・ケイ	44,700	2,126	95,032,200	
応用地質	25,500	791	20,170,500	
船井総合研究所	24,300	511	12,417,300	
進学会	9,800	304	2,979,200	
ベネッセホールディングス	86,600	3,400	294,440,000	
イオンディライト	30,600	1,302	39,841,200	
ナック	6,200	1,325	8,215,000	
ニチイ学館	48,600	622	30,229,200	
ダイセキ	41,900	1,571	65,824,900	
合計	397,863,535		297,711,795,325	

差入委託証拠金代用有価証券1,800,000株

## (b) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

## 1【財務諸表】

## 【スミセイ・DCバランスファンド（機動的資産配分型）】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第2期 (平成22年4月13日現在)	第3期 (平成23年4月13日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	34,876	395,899
親投資信託受益証券	68,614,750	128,447,120
未収入金	-	70,000
流動資産合計	68,649,626	128,913,019
資産合計	68,649,626	128,913,019
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	-	69,780
未払受託者報酬	9,105	17,153
未払委託者報酬	170,089	320,247
その他未払費用	1,452	2,803
流動負債合計	180,646	409,983
負債合計	180,646	409,983
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	70,731,031	135,988,910
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,262,051	7,485,874
元本等合計	68,468,980	128,503,036
純資産合計	68,468,980	128,503,036
負債純資産合計	68,649,626	128,913,019

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第 2 期	第 3 期
	自 平成21年 4 月14日 至 平成22年 4 月13日	自 平成22年 4 月14日 至 平成23年 4 月13日
<b>営業収益</b>		
受取利息	9	8
有価証券売買等損益	4,228,065	674,630
営業収益合計	4,228,074	674,622
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	15,371	29,783
委託者報酬	287,041	555,872
その他費用	2,441	4,852
営業費用合計	304,853	590,507
営業利益又は営業損失（ ）	3,923,221	1,265,129
経常利益又は経常損失（ ）	3,923,221	1,265,129
当期純利益又は当期純損失（ ）	3,923,221	1,265,129
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（ ）	81,188	183,961
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,976,237	2,262,051
剰余金増加額又は欠損金減少額	309,697	439,501
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	309,697	439,501
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,437,544	4,582,156
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,437,544	4,582,156
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,262,051	7,485,874

**（3）【注記表】**

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項 目	第 2 期	第 3 期
	自 平成21年 4 月14日 至 平成22年 4 月13日	自 平成22年 4 月14日 至 平成23年 4 月13日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券（売買目的有価証券） 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価 評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に 基づいて評価しております。	親投資信託受益証券（売買目的有価証券） 同 左

（貸借対照表に関する注記）

項 目	第 2 期	第 3 期
	（平成22年 4 月13日現在）	（平成23年 4 月13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 70,731,031口	当計算期間の末日における受益権の総数 135,988,910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 2,262,051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 7,485,874円
3．1単位当たり純資産額	0.9680円 （1万口=9,680円）	0.9450円 （1万口=9,450円）

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項 目	第 2 期	第 3 期
	自 平成21年 4 月14日 至 平成22年 4 月13日	自 平成22年 4 月14日 至 平成23年 4 月13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（ 926,885円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証 券売買等損益（2,915,148円）、収益調整金（1,583,276 円）、および分配準備積立金（455,752円）より、分配 対象収益は5,881,061円（1万口当たり831.46円）であ りますが、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（ 1,458,891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（7,476,921円）、お よび分配準備積立金（3,960,981円）より、分配対象収 益は12,896,793円（1万口当たり948.37円）でありま 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 2 期 自 平成21年 4 月14日 至 平成22年 4 月13日	第 3 期 自 平成22年 4 月14日 至 平成23年 4 月13日
	（追加情報） 当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年 3 月10日）および「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年 3 月10日）を適用しております。	
1．金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第 2 条第 4 項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。	同 左
2．金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	（1）金融商品の内容 1）有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。 2）デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。当ファンドにおけるデリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 3）コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 （2）金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。	（1）金融商品の内容 1）有価証券 同 左 2）デリバティブ取引 同 左 3）コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 （2）金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 同 左



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

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期 (平成22年4月13日現在)	第3期 (平成23年4月13日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。	(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 同左 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） 同左 (3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 同左

## (有価証券に関する注記)

## 売買目的有価証券

## 第2期（自平成21年4月14日至平成22年4月13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	3,926,596円
合計	3,926,596円

## 第3期（自平成22年4月14日至平成23年4月13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	222,620円
合計	222,620円

## (デリバティブ取引に関する注記)

## 第2期（平成22年4月13日現在）

第2期末現在、デリバティブ取引は行っておりません。

## 第3期（平成23年4月13日現在）

第3期末現在、デリバティブ取引は行っておりません。

( 関連当事者との取引に関する注記 )

第 2 期 ( 自 平成21年 4 月14日 至 平成22年 4 月13日 )

該当事項はありません。

第 3 期 ( 自 平成22年 4 月14日 至 平成23年 4 月13日 )

該当事項はありません。

(その他の注記)

項目	第2期	第3期
	(平成22年4月13日現在)	(平成23年4月13日現在)
期首元本額	18,662,629円	70,731,031円
期中追加設定元本額	55,385,703円	74,934,583円
期中一部解約元本額	3,317,301円	9,676,704円

## (4)【附属明細表】

有価証券明細表

(a)株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

種類	銘柄名	元本額	評価額	
			単価	金額
親投資信託 受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド (B号)	22,488,660円	1.1208円	25,205,290円
親投資信託 受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	58,855,881円	1.0808円	63,611,436円
親投資信託 受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	11,035,600円	1.3889円	15,327,344円
親投資信託 受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	15,500,975円	1.1574円	17,940,828円
親投資信託 受益証券	マネーインカム・マザーファンド	6,309,225円	1.0084円	6,362,222円
合計		114,190,341円		128,447,120円

(参考情報)

[「国内株式インデックス・マザーファンド\(B号\)」の状況へ](#)[「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](#)

[「マネーインカム・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】

平成23年 5月31日現在

資産総額	142,792,029 円
負債総額	108,226 円
純資産総額( - )	142,683,803 円
発行済口数	151,279,286 口
1口当たり純資産額( / )	0.9432 円
( 1万口当たり純資産額	9,432 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。



## 「国内債券パッシブ・マザーファンド」の状況

## (1) 貸借対照表

対象年月日	(平成22年4月13日現在)	(平成23年4月13日現在)
科目	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,565,069,993	2,294,911,264
国債証券	378,192,699,380	373,701,066,270
地方債証券	33,864,446,895	33,434,852,030
特殊債券	57,716,041,325	54,214,059,889
社債券	44,178,581,000	41,186,861,400
未収入金	96,260,000	-
未収利息	1,453,627,999	1,385,969,753
前払費用	43,721,209	58,667,060
流動資産合計	517,110,447,801	506,276,387,666
資産合計	517,110,447,801	506,276,387,666
負債の部		
流動負債		
未払金	610,840,000	1,449,131,000
未払解約金	6,027,093	-
流動負債合計	616,867,093	1,449,131,000
負債合計	616,867,093	1,449,131,000
純資産の部		
元本等		
元本		
元本	483,635,046,295	467,076,484,703
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	32,858,534,413	37,750,771,963
元本等合計	516,493,580,708	504,827,256,666
純資産合計	516,493,580,708	504,827,256,666
負債純資産合計	517,110,447,801	506,276,387,666

(注) 「国内債券パッシブ・マザーファンド」は、毎年5月25日(ただし、休業日の場合は翌営業日)に決算を行います。上記の貸借対照表は平成22年4月13日ならびに平成23年4月13日現在における同マザーファンドの状況です。

## (2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自平成21年4月14日 至平成22年4月13日	自平成22年4月14日 至平成23年4月13日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券および社債券（売買目的有価証券） 個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。	国債証券、地方債証券、特殊債券および社債券（売買目的有価証券） 同左

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成22年4月13日現在)	(平成23年4月13日現在)
1. 受益権総数	平成22年4月13日現在における受益権の総数 483,635,046,295口	平成23年4月13日現在における受益権の総数 467,076,484,703口
2. 1単位当たり純資産額	1.0679円 (1万口 = 10,679円)	1.0808円 (1万口 = 10,808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21年4月14日 至平成22年4月13日	自平成22年4月14日 至平成23年4月13日
	(追加情報) 当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）および「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券、地方債証券、特殊債券および社債券を組み入れております。	(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 同左

<p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。当ファンドにおけるデリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、および価格変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>	<p>2) デリバティブ取引 同 左</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 同 左</p>
--	--

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

## ・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成22年4月13日現在)	(平成23年4月13日現在)
----	----------------	----------------

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

（デリバティブ取引に関する注記）

（平成22年4月13日現在）

平成22年4月13日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（平成23年4月13日現在）

平成23年4月13日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（関連当事者との取引に関する注記）

（自 平成21年4月14日 至 平成22年4月13日）

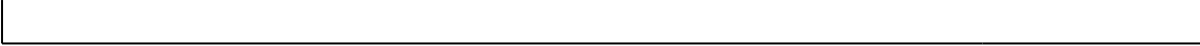
該当事項はありません。

（自 平成22年4月14日 至 平成23年4月13日）

該当事項はありません。

(その他の注記)

(平成22年4月13日現在)	
本有価証券報告書における開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	250,471,635,464円
同期中における追加設定元本額	250,463,404,925円
同期中における一部解約元本額	17,299,994,094円
平成22年4月13日現在における元本の内訳	
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	768,939,695円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,606,105,756円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	323,668,967円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	31,710,901円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	7,374,023円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	561,475円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	2,976,380円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	360,281円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	170,157円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	625,337円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	51,226,932,121円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	13,883,950,287円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	31,415,444,970円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	592,464,622円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	839,237,551円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	207,311,452円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	409,425,545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>	137,626,758円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	3,430,261,206円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	4,346,399,194円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	8,180,482,274円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	24,226,238,933円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,475,988,511円
三井住友・国内債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	9,644,593,671円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	70,240,957,667円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	993,721,714円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	13,516,228,619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)	224,654,008,375円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	1,454,236,844円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	341,999,565円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	66,469,866円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	4,859,563,152円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	5,782,406,786円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	4,399,383,938円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	426,008,453円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	85,941,963円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	9,568,046円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	106,121,062円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	3,939,580,178円
合計	483,635,046,295円



(平成23年4月13日現在)

本有価証券報告書における開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	483,635,046,295円
同期中における追加設定元本額	38,622,736,175円
同期中における一部解約元本額	55,181,297,767円
平成23年4月13日現在における元本の内訳	
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	998,184,464円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,915,941,199円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	390,479,674円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	58,855,881円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	11,977,444円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	3,338,796円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	4,173,972円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	1,520,106円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	588,344円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	1,423,266円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	8,841,303,616円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	46,785,286,819円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	12,262,780,666円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	27,989,945,264円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	565,905,923円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	770,198,015円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	185,436,498円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	374,486,813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>	128,240,480円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	2,913,080,423円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	3,554,485,495円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	7,534,195,403円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	20,826,669,964円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,354,788,147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)	10,648,817,134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)	66,791,628,423円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	943,139,590円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	11,912,642,399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)	210,646,327,919円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	1,384,690,912円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	326,800,067円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	57,753,106円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	4,390,638,463円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	5,255,868,342円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	4,203,833,364円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	1,421,761,174円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	278,926,205円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	29,696,883円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	655,887,203円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	9,656,280,101円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	970,549,567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 >	16,332,559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 >	11,624,620円
合 計	467,076,484,703円

## (3) 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第1回利付国債(40年)	800,000,000	807,104,000	
	第2回利付国債(40年)	752,000,000	721,423,680	
	第3回利付国債(40年)	940,000,000	900,350,800	
	第239回利付国債(10年)	2,698,000,000	2,737,309,860	
	第242回利付国債(10年)	4,310,000,000	4,373,701,800	
	第243回利付国債(10年)	6,050,000,000	6,130,828,000	
	第244回利付国債(10年)	11,392,000,000	11,549,779,200	
	第247回利付国債(10年)	14,085,000,000	14,249,371,950	
	第250回利付国債(10年)	9,465,000,000	9,524,345,550	
	第253回利付国債(10年)	9,910,000,000	10,236,039,000	
	第256回利付国債(10年)	8,110,000,000	8,357,679,400	
	第258回利付国債(10年)	11,553,000,000	11,894,275,620	
	第260回利付国債(10年)	11,585,000,000	12,052,570,600	
	第263回利付国債(10年)	11,092,000,000	11,559,195,040	
	第265回利付国債(10年)	10,650,000,000	11,078,130,000	
	第268回利付国債(10年)	10,415,000,000	10,846,701,750	
	第270回利付国債(10年)	11,387,000,000	11,783,381,470	
	第272回利付国債(10年)	9,645,000,000	10,029,449,700	
	第274回利付国債(10年)	9,605,000,000	10,043,660,350	
	第277回利付国債(10年)	10,025,000,000	10,536,776,250	
	第280回利付国債(10年)	5,017,000,000	5,354,945,120	
	第282回利付国債(10年)	4,400,000,000	4,655,464,000	
	第284回利付国債(10年)	4,367,000,000	4,622,949,870	
	第285回利付国債(10年)	4,188,000,000	4,434,882,600	
	第286回利付国債(10年)	4,330,000,000	4,610,454,100	
	第288回利付国債(10年)	4,505,000,000	4,765,839,500	
	第289回利付国債(10年)	4,884,000,000	5,098,944,840	
	第290回利付国債(10年)	5,097,000,000	5,280,186,180	
	第293回利付国債(10年)	4,460,000,000	4,736,832,200	
	第296回利付国債(10年)	4,293,000,000	4,459,825,980	
	第297回利付国債(10年)	4,623,000,000	4,759,840,800	
	第299回利付国債(10年)	1,150,000,000	1,173,161,000	
	第300回利付国債(10年)	2,000,000,000	2,070,340,000	
	第301回利付国債(10年)	5,345,000,000	5,521,866,050	
	第303回利付国債(10年)	6,195,000,000	6,335,812,350	
	第305回利付国債(10年)	6,090,000,000	6,162,044,700	
	第306回利付国債(10年)	6,050,000,000	6,157,387,500	
	第308回利付国債(10年)	5,150,000,000	5,183,938,500	

第309回利付国債(10年)	2,200,000,000	2,176,416,000	
第310回利付国債(10年)	6,700,000,000	6,547,709,000	
第312回利付国債(10年)	5,670,000,000	5,623,676,100	
第313回利付国債(10年)	3,300,000,000	3,295,644,000	
第2回利付国債(30年)	570,000,000	599,970,600	
第4回利付国債(30年)	300,000,000	339,438,000	
第5回利付国債(30年)	290,000,000	295,138,800	
第7回利付国債(30年)	549,000,000	565,870,770	
第9回利付国債(30年)	100,000,000	87,361,000	
第10回利付国債(30年)	945,000,000	774,654,300	
第12回利付国債(30年)	540,000,000	535,102,200	
第14回利付国債(30年)	1,000,000,000	1,043,990,000	
第16回利付国債(30年)	825,000,000	874,747,500	
第18回利付国債(30年)	920,000,000	940,313,600	
第19回利付国債(30年)	875,000,000	893,742,500	
第21回利付国債(30年)	605,000,000	617,638,450	
第22回利付国債(30年)	635,000,000	672,153,850	
第23回利付国債(30年)	679,000,000	718,395,580	
第24回利付国債(30年)	680,000,000	719,712,000	
第25回利付国債(30年)	810,000,000	825,317,100	
第26回利付国債(30年)	813,000,000	844,015,950	
第27回利付国債(30年)	1,060,000,000	1,121,564,800	
第28回利付国債(30年)	1,326,000,000	1,401,542,220	
第29回利付国債(30年)	1,212,000,000	1,255,607,760	
第30回利付国債(30年)	1,820,000,000	1,848,264,600	
第31回利付国債(30年)	2,010,000,000	1,999,507,800	
第32回利付国債(30年)	1,550,000,000	1,574,598,500	
第33回利付国債(30年)	2,060,000,000	1,958,421,400	
第34回利付国債(30年)	600,000,000	596,232,000	
第32回利付国債(20年)	70,000,000	80,743,600	
第35回利付国債(20年)	170,000,000	195,683,600	
第37回利付国債(20年)	302,000,000	345,711,480	
第39回利付国債(20年)	458,000,000	511,050,140	
第40回利付国債(20年)	390,000,000	427,401,000	
第42回利付国債(20年)	480,000,000	536,164,800	
第43回利付国債(20年)	1,370,000,000	1,564,951,000	
第46回利付国債(20年)	775,000,000	841,154,000	
第48回利付国債(20年)	955,000,000	1,060,336,500	
第50回利付国債(20年)	918,000,000	967,691,340	
第52回利付国債(20年)	990,000,000	1,061,745,300	
第54回利付国債(20年)	1,265,000,000	1,367,857,150	
第56回利付国債(20年)	1,448,000,000	1,534,894,480	
第59回利付国債(20年)	1,095,000,000	1,122,320,250	
第61回利付国債(20年)	1,615,000,000	1,528,694,400	
第64回利付国債(20年)	1,525,000,000	1,584,734,250	
第65回利付国債(20年)	1,630,000,000	1,689,527,600	

	第70回利付国債(20年)	1,540,000,000	1,679,508,600	
	第72回利付国債(20年)	1,453,000,000	1,529,892,760	
	第74回利付国債(20年)	2,054,000,000	2,158,322,660	
	第75回利付国債(20年)	1,510,000,000	1,583,325,600	
	第78回利付国債(20年)	1,550,000,000	1,581,790,500	
	第82回利付国債(20年)	1,750,000,000	1,824,742,500	
	第84回利付国債(20年)	1,920,000,000	1,972,569,600	
	第85回利付国債(20年)	2,050,000,000	2,127,326,000	
	第88回利付国債(20年)	2,027,000,000	2,152,917,240	
	第90回利付国債(20年)	1,980,000,000	2,070,604,800	
	第92回利付国債(20年)	1,849,000,000	1,904,007,750	
	第93回利付国債(20年)	2,137,000,000	2,167,088,960	
	第95回利付国債(20年)	2,040,000,000	2,147,589,600	
	第97回利付国債(20年)	2,027,000,000	2,101,796,300	
	第99回利付国債(20年)	1,688,000,000	1,724,190,720	
	第100回利付国債(20年)	1,387,000,000	1,433,838,990	
	第101回利付国債(20年)	635,000,000	674,789,100	
	第102回利付国債(20年)	2,182,000,000	2,315,756,600	
	第105回利付国債(20年)	2,360,000,000	2,398,232,000	
	第107回利付国債(20年)	2,448,000,000	2,481,586,560	
	第109回利付国債(20年)	2,270,000,000	2,228,277,400	
	第111回利付国債(20年)	2,496,000,000	2,559,123,840	
	第113回利付国債(20年)	3,802,000,000	3,832,530,060	
	第114回利付国債(20年)	2,383,000,000	2,399,085,250	
	第116回利付国債(20年)	2,900,000,000	2,961,306,000	
	第118回利付国債(20年)	350,000,000	345,922,500	
	第119回利付国債(20年)	860,000,000	823,045,800	
	第120回利付国債(20年)	1,180,000,000	1,091,889,400	
	第121回利付国債(20年)	2,450,000,000	2,379,097,000	
	第122回利付国債(20年)	1,250,000,000	1,194,962,500	
	第123回利付国債(20年)	1,240,000,000	1,242,591,600	
	第124回利付国債(20年)	1,150,000,000	1,133,980,500	
	第125回利付国債(20年)	1,490,000,000	1,515,181,000	
	国債証券 小計	363,121,000,000	373,701,066,270	
地方債証券	第1回東京都公募公債(20年)	100,000,000	98,958,000	
	第1回東京都公募公債(30年)	100,000,000	97,593,000	
	第2回東京都公募公債(3年)	200,000,000	200,856,000	
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	102,060,000	
	第7回東京都公募公債(20年)	100,000,000	103,475,000	
	第8回東京都公募公債(20年)	100,000,000	105,536,000	
	第8回東京都公募公債(30年)	400,000,000	384,684,000	
	第577回東京都公募公債	100,000,000	100,530,000	
	第579回東京都公募公債	100,000,000	100,670,000	
	第582回東京都公募公債	100,000,000	101,104,000	
	第583回東京都公募公債	648,500,000	656,320,910	

第584回東京都公募公債	100,000,000	101,200,000	
第588回東京都公募公債	100,000,000	101,428,000	
第596回東京都公募公債	100,000,000	100,828,000	
第598回東京都公募公債	200,000,000	200,830,000	
第602回東京都公募公債	200,000,000	205,376,000	
第603回東京都公募公債	200,000,000	206,048,000	
第604回東京都公募公債	100,000,000	103,091,000	
第608回東京都公募公債	600,000,000	621,150,000	
第610回東京都公募公債	100,000,000	104,434,000	
第613回東京都公募公債	100,000,000	103,755,000	
第623回東京都公募公債	200,000,000	206,300,000	
第628回東京都公募公債	100,000,000	104,556,000	
第629回東京都公募公債	100,000,000	103,919,000	
第634回東京都公募公債	106,000,000	112,434,200	
第642回東京都公募公債	200,000,000	212,238,000	
第643回東京都公募公債	100,000,000	105,330,000	
第646回東京都公募公債	100,000,000	107,048,000	
第652回東京都公募公債	200,000,000	210,032,000	
第653回東京都公募公債	200,000,000	208,140,000	
第660回東京都公募公債	700,000,000	728,196,000	
第662回東京都公募公債	100,000,000	104,423,000	
第668回東京都公募公債	200,000,000	206,276,000	
平成13年度第1回北海道公募公債	113,800,000	114,241,544	
平成16年度第3回北海道公募公債	100,000,000	103,364,000	
平成17年度第4回北海道公募公債	100,000,000	102,605,000	
平成17年度第9回北海道公募公債	100,000,000	103,589,000	
平成18年度第8回北海道公募公債(5年)	100,000,000	100,745,000	
平成19年度第2回北海道公募公債	100,000,000	105,403,000	
平成19年度第7回北海道公募公債	100,000,000	105,040,000	
平成20年度第4回北海道公募公債	100,000,000	105,780,000	
平成20年度第9回北海道公募公債(5年)	300,000,000	309,453,000	
平成20年度第12回北海道公募公債	100,000,000	103,702,000	
平成20年度第15回北海道公募公債(5年)	200,000,000	204,196,000	
第1回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	109,275,000	
第3回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	102,978,000	
第7回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	102,596,000	
第25回神奈川県公募公債(5年)	400,000,000	404,036,000	
第26回神奈川県公募公債(5年)	100,000,000	101,491,000	
第27回神奈川県公募公債(5年)	100,000,000	101,319,000	
第122回神奈川県公募公債	200,000,000	206,184,000	
第129回神奈川県公募公債	100,000,000	103,919,000	
第143回神奈川県公募公債	100,000,000	105,679,000	
第144回神奈川県公募公債	300,000,000	318,018,000	
第147回神奈川県公募公債	100,000,000	106,926,000	
第149回神奈川県公募公債	100,000,000	106,071,000	
第157回神奈川県公募公債	115,600,000	119,739,636	

第3回大阪府公募公債(7年)	200,000,000	206,920,000	
第26回大阪府公募公債(5年)	200,000,000	201,402,000	
第31回大阪府公募公債(5年)	100,000,000	101,562,000	
第52回大阪府公募公債(5年)	400,000,000	404,704,000	
第261回大阪府公募公債(10年)	105,000,000	107,970,450	
第262回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,623,000	
第267回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,421,000	
第277回大阪府公募公債(10年)	600,000,000	618,312,000	
第299回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	211,752,000	
第303回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	106,058,000	
第306回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	210,708,000	
第313回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,978,000	
平成14年度第2回京都府公募公債	300,000,000	303,657,000	
平成19年度第1回京都府公募公債	130,260,000	137,826,803	
平成14年度第5回兵庫県公募公債	100,000,000	100,848,000	
平成15年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	101,603,000	
平成16年度第12回兵庫県公募公債	100,000,000	103,040,000	
平成17年度第2回兵庫県公募公債	200,000,000	206,266,000	
平成17年度第6回兵庫県公募公債	101,000,000	103,811,840	
平成19年度第8回兵庫県公募公債(5年)	100,000,000	101,345,000	
平成20年度第5回兵庫県公募公債	100,000,000	105,880,000	
平成21年度第3回兵庫県公募公債	200,000,000	205,902,000	
平成21年度第11回兵庫県公募公債	200,000,000	206,392,000	
平成21年度第23回兵庫県公募公債	200,000,000	201,078,000	
平成18年度第2回静岡県公募公債	100,000,000	106,717,000	
平成18年度第3回静岡県公募公債(5年)	100,000,000	100,405,000	
平成18年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	106,064,000	
平成19年度第7回静岡県公募公債	100,000,000	105,757,000	
平成20年度第1回静岡県公募公債	200,000,000	207,170,000	
平成20年度第7回静岡県公募公債	100,000,000	104,510,000	
平成21年度第5回静岡県公募公債	300,000,000	302,898,000	
平成14年度第2回愛知県公募公債(10年)	110,000,000	111,718,200	
平成17年度第2回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,042,000	
平成18年度第4回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	105,799,000	
平成19年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	106,358,000	
平成20年度第5回愛知県公募公債(5年)	500,000,000	509,240,000	
平成21年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,465,000	
平成21年度第7回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	205,254,000	
平成19年度第3回広島県公募公債	200,000,000	208,954,000	
平成20年度第1回広島県公募公債	100,000,000	105,457,000	
平成15年度第3回埼玉県公募公債	205,670,000	212,002,579	
平成16年度第3回埼玉県公募公債	100,000,000	104,817,000	
平成16年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	103,313,000	
平成17年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	104,536,000	
平成18年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	106,131,000	
平成19年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	106,622,000	

平成21年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	102,869,000	
平成21年度第4回埼玉県公募公債	200,000,000	204,156,000	
平成18年度第1回福岡県公募公債	100,000,000	107,325,000	
平成19年度第2回福岡県公募公債	100,000,000	107,103,000	
平成20年度第9回福岡県公募公債	200,000,000	202,742,000	
平成16年度第9回千葉県公募公債	100,000,000	103,771,000	
平成18年度第1回千葉県公募公債	200,000,000	213,364,000	
平成18年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	105,795,000	
平成19年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	105,657,000	
平成21年度第2回千葉県公募公債	345,000,000	355,750,200	
平成13年度第1回新潟県公募公債	155,000,000	155,979,600	
平成14年度第1回新潟県公募公債	240,000,000	243,144,000	
平成17年度第1回新潟県公募公債	200,000,000	206,092,000	
平成19年度第1回岐阜県公募公債(10年)	200,000,000	212,238,000	
第1回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,808,000	
第2回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,608,000	
第4回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,766,000	
第6回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,150,000	
第7回共同発行市場公募地方債	319,400,000	327,902,428	
第12回共同発行市場公募地方債	437,000,000	449,987,640	
第15回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,709,000	
第20回共同発行市場公募地方債	300,000,000	310,830,000	
第21回共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,810,000	
第22回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,602,000	
第23回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,959,000	
第27回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,080,000	
第29回共同発行市場公募地方債	300,000,000	310,590,000	
第30回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,252,000	
第31回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,022,000	
第32回共同発行市場公募地方債	300,000,000	313,536,000	
第33回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,548,000	
第35回共同発行市場公募地方債	400,000,000	418,356,000	
第36回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,627,000	
第38回共同発行市場公募地方債	200,000,000	213,364,000	
第40回共同発行市場公募地方債	300,000,000	321,816,000	
第46回共同発行市場公募地方債	200,000,000	211,702,000	
第55回共同発行市場公募地方債	200,000,000	212,118,000	
第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,186,000	
第57回共同発行市場公募地方債	300,000,000	314,124,000	
第62回共同発行市場公募地方債	200,000,000	210,194,000	
第64回共同発行市場公募地方債	300,000,000	315,819,000	
第65回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,065,000	
第73回共同発行市場公募地方債	300,000,000	310,050,000	
第75回共同発行市場公募地方債	900,000,000	932,337,000	
第77回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,328,000	
平成13年度第2回大阪市公募公債	100,000,000	100,225,000	

	平成14年度第11回大阪市公募公債	100,000,000	100,785,000	
	平成18年度第2回大阪市公募公債	200,000,000	212,280,000	
	平成18年度第3回大阪市公募公債	100,000,000	106,708,000	
	平成18年度第6回大阪市公募公債	300,000,000	318,807,000	
	平成19年度第5回大阪市公募公債	100,000,000	106,278,000	
	平成19年度第10回大阪市公募公債	100,000,000	104,572,000	
	平成21年度第4回大阪市公募公債	300,000,000	307,242,000	
	第1回名古屋市公募公債(20年)	200,000,000	206,376,000	
	第3回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	101,965,000	
	第11回名古屋市公募公債(5年)	300,000,000	305,415,000	
	第12回ひ号名古屋市公募公債	100,000,000	103,094,000	
	第455回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	106,217,000	
	第1回京都市公募公債(30年)	100,000,000	102,422,000	
	第7回京都市公募公債(20年)	100,000,000	103,379,000	
	平成18年度第3回京都市公募公債	200,000,000	212,586,000	
	平成15年度第1回神戸市公募公債	100,000,000	100,526,000	
	平成19年度第10回神戸市公募公債	100,000,000	104,368,000	
	第4回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	102,280,000	
	第9回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	104,996,000	
	第14回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	103,135,000	
	平成17年度第4回横浜市公募公債	200,000,000	208,396,000	
	平成17年度第3回横浜市公募公債	100,000,000	104,441,000	
	平成18年度第4回横浜市公募公債	300,000,000	318,930,000	
	平成18年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	106,165,000	
	平成18年度第3回横浜市公募公債	200,000,000	212,448,000	
	平成20年度第6回横浜市公募公債	200,000,000	205,774,000	
	第22回横浜市公募公債	100,000,000	101,556,000	
	平成13年度第2回札幌市公募公債	200,000,000	201,298,000	
	平成18年度第4回札幌市公募公債	200,000,000	211,442,000	
	第2回川崎市15年公募公債	100,000,000	102,546,000	
	第4回川崎市15年公募公債	100,000,000	105,960,000	
	第19回川崎市公募公債(5年)	100,000,000	102,355,000	
	平成15年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	103,019,000	
	平成19年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	104,379,000	
	平成18年度第4回福岡市公募公債	100,000,000	105,688,000	
	平成18年度第5回福岡市公募公債(5年)	100,000,000	100,657,000	
	平成20年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	103,413,000	
	平成21年度第7回福岡市公募公債	200,000,000	200,470,000	
	平成19年度第1回広島市公募公債	100,000,000	105,018,000	
	平成21年度第1回千葉市公募公債	200,000,000	206,550,000	
	地方債証券 小計	32,332,230,000	33,434,852,030	
特殊債券	第27回韓国産業銀行円貨債券(2007)	100,000,000	101,351,000	
	第1回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	103,981,000	
	第2回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	204,898,000	
	第3回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	210,206,000	



第5回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	102,171,000	
第9回日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,848,000	
第10回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,687,000	
第15回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	105,434,000	
第16回日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,340,000	
第20回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	105,075,000	
第20回日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,369,000	
第23回政府保証日本政策投資銀行債券	400,000,000	416,824,000	
第24回日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,330,000	
第27回日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,301,000	
第30回日本政策投資銀行債券	100,000,000	105,366,000	
第36回日本政策投資銀行債券	100,000,000	100,360,000	
第51回日本政策投資銀行債券	100,000,000	105,174,000	
第1回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	144,000,000	150,164,640	
第2回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	208,430,000	
第4回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	304,629,000	
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	165,568,200	
第7回道路債券	100,000,000	110,432,000	
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	104,826,000	
第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,816,000	
第9回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,921,000	
第9回道路債券	100,000,000	106,416,000	
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	106,888,000	
第13回道路債券	300,000,000	318,183,000	
第16回道路債券	200,000,000	202,380,000	
第17回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	102,000,000	109,172,640	
第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	98,466,000	
第21回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,306,000	
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	281,772,000	
第23回道路債券	200,000,000	205,986,000	
第23回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,046,000	
第25回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	318,222,000	
第26回道路債券	300,000,000	310,044,000	
第27回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	500,000,000	530,455,000	
第27回道路債券	100,000,000	106,229,000	
第29回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,336,000	
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	211,012,000	
第30回道路債券	100,000,000	103,807,000	
第34回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,497,000	
第36回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	153,000,000	163,260,180	
第37回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	320,079,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,234,000	
第39回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,382,000	
第40回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	319,944,000	
第40回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,242,000	
第41回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	421,596,000	

第4 2 回道路債券	100,000,000	102,849,000	
第4 4 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,564,000	
第4 5 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,964,000	
第4 7 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,070,000	
第4 8 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	415,240,000	
第4 9 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,923,000	
第5 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	209,172,000	
第5 6 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,294,000	
第5 8 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	500,000,000	525,590,000	
第6 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,740,000	
第6 2 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,992,000	
第6 7 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	208,132,000	
第6 9 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,993,000	
第8 1 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	199,872,000	
第8 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	99,327,000	
第9 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	299,031,000	
第3 1 3 回政府保証道路債券	200,000,000	203,098,000	
第3 2 5 回政府保証道路債券	100,000,000	102,755,000	
第3 2 7 回政府保証道路債券	552,000,000	570,955,680	
第3 2 9 回政府保証道路債券	300,000,000	311,541,000	
第3 3 0 回政府保証道路債券	100,000,000	104,550,000	
第3 3 5 回政府保証道路債券	100,000,000	103,418,000	
第3 3 6 回政府保証道路債券	200,000,000	206,934,000	
第3 3 7 回政府保証道路債券	100,000,000	103,120,000	
第3 3 8 回政府保証道路債券	200,000,000	207,874,000	
第3 3 9 回政府保証道路債券	100,000,000	103,585,000	
第3 4 0 回政府保証道路債券	100,000,000	103,699,000	
第3 4 1 回政府保証道路債券	100,000,000	103,213,000	
第3 4 6 回政府保証道路債券	301,000,000	312,230,310	
第1 回政府保証地方公営企業等金融機構債券	300,000,000	312,354,000	
第1 回政府保証地方公共団体金融機構債券	300,000,000	308,529,000	
第1 回公営企業債券(5年)	500,000,000	507,130,000	
第2 回地方公営企業等金融機構債券(20年)	100,000,000	101,822,000	
第3 回公営企業債券(20年)	100,000,000	93,686,000	
第5 回公営企業債券(20年)	100,000,000	104,692,000	
第6 回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	101,571,000	
第6 回公営企業債券	100,000,000	100,636,000	
第7 回政府保証地方公営企業等金融機構債券	500,000,000	511,045,000	
第7 回公営企業債券	400,000,000	410,460,000	
第1 0 回公営企業債券	100,000,000	104,179,000	
第1 1 回公営企業債券(20年)	100,000,000	103,113,000	
第1 2 回公営企業債券	100,000,000	103,545,000	
第1 5 回公営企業債券	100,000,000	103,105,000	
第1 6 回公営企業債券(20年)	100,000,000	102,177,000	
第1 7 回公営企業債券	100,000,000	104,227,000	
第1 7 回公営企業債券(20年)	100,000,000	105,644,000	

第18回公営企業債券(20年)	100,000,000	107,886,000	
第20回公営企業債券	100,000,000	106,862,000	
第22回公営企業債券(20年)	100,000,000	103,594,000	
第24回公営企業債券	100,000,000	106,520,000	
第24回公営企業債券(20年)	200,000,000	205,026,000	
第30回公営企業債券	100,000,000	106,503,000	
第809回政府保証公営企業債券	202,000,000	203,696,800	
第810回政府保証公営企業債券	200,000,000	201,920,000	
第813回政府保証公営企業債券	201,000,000	203,454,210	
第815回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,317,000	
第818回政府保証公営企業債券	102,000,000	103,496,340	
第821回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,404,000	
第823回政府保証公営企業債券	200,000,000	202,020,000	
第824回政府保証公営企業債券	600,000,000	606,276,000	
第825回政府保証公営企業債券	500,000,000	505,385,000	
第826回政府保証公営企業債券	300,000,000	302,661,000	
第827回政府保証公営企業債券	200,000,000	201,390,000	
第829回政府保証公営企業債券	500,000,000	509,225,000	
第833回政府保証公営企業債券	200,000,000	206,182,000	
第834回政府保証公営企業債券	200,000,000	206,368,000	
第836回政府保証公営企業債券	300,000,000	308,280,000	
第838回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,434,000	
第840回政府保証公営企業債券	200,000,000	207,648,000	
第841回政府保証公営企業債券	100,000,000	104,535,000	
第843回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,668,000	
第844回政府保証公営企業債券	400,000,000	416,256,000	
第846回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,432,000	
第847回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,464,000	
第849回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,918,000	
第851回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,204,000	
第852回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,237,000	
第858回政府保証公営企業債券	200,000,000	208,562,000	
第861回政府保証公営企業債券	300,000,000	314,424,000	
第863回政府保証公営企業債券	100,000,000	106,874,000	
第865回政府保証公営企業債券	300,000,000	320,886,000	
第866回政府保証公営企業債券	200,000,000	214,026,000	
第875回政府保証公営企業債券	200,000,000	210,974,000	
第883回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,218,000	
第884回政府保証公営企業債券	300,000,000	309,432,000	
第885回政府保証公営企業債券	200,000,000	210,210,000	
第886回政府保証公営企業債券	200,000,000	211,504,000	
第3回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	101,929,000	
第187回政府保証首都高速道路債券	193,000,000	199,062,130	
第195回政府保証首都高速道路債券	400,000,000	413,768,000	
第197回政府保証首都高速道路債券	300,000,000	311,718,000	
第199回政府保証首都高速道路債券	200,000,000	207,384,000	

第4回阪神高速道路債券	200,000,000	202,108,000	
第17回中小企業債券	100,000,000	100,633,000	
第23回中小企業債券	100,000,000	101,937,000	
第165回政府保証中小企業債券	100,000,000	101,190,000	
第2回日本鉄道建設債券	100,000,000	101,626,000	
第6回国際協力銀行債券	100,000,000	101,261,000	
第10回国際協力銀行債券	300,000,000	308,370,000	
第15回国際協力銀行債券	200,000,000	207,842,000	
第21回国際協力銀行債券	100,000,000	104,029,000	
第27回国際協力銀行債券	100,000,000	105,249,000	
第8回都市再生債券	200,000,000	207,284,000	
第17回政府保証都市再生債券	500,000,000	501,640,000	
第18回政府保証都市再生債券	400,000,000	400,956,000	
第19回都市再生債券	100,000,000	106,319,000	
第27回都市再生債券	300,000,000	304,776,000	
第3回本州四国連絡橋債券	100,000,000	104,608,000	
第7回本州四国連絡橋債券	100,000,000	103,100,000	
第332回東京交通債券	100,000,000	110,383,000	
第342回東京交通債券	100,000,000	107,386,000	
第35回政府保証電源開発債券	600,000,000	603,198,000	
第13回関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,747,000	
第16回関西国際空港株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,481,000	
第38回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	101,367,000	
第51回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	106,193,000	
第14回独立行政法人福祉医療機構債券	200,000,000	212,966,000	
第17回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	106,210,000	
第127回政府保証預金保険機構債券	100,000,000	100,589,000	
第143回政府保証預金保険機構債券	100,000,000	100,902,000	
第153回政府保証預金保険機構債券	100,000,000	101,447,000	
第1回貸付債権担保住宅金融公庫債券	52,150,000	53,523,109	
第1回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	82,662,000	82,776,073	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	116,144,000	119,133,546	
第2回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	85,230,000	85,607,568	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	178,860,000	185,506,437	
第3回貸付債権担保住宅金融公庫債券	30,861,000	31,656,287	
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	42,836,000	43,554,788	
第4回貸付債権担保住宅金融公庫債券	34,841,000	35,577,190	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,341,000	75,372,087	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	192,186,000	196,231,515	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	47,486,000	47,948,513	
第6回貸付債権担保住宅金融公庫債券	76,522,000	78,542,180	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	51,062,000	53,049,333	
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	156,000,000	161,731,440	
第7回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	66,624,000	67,828,561	
第8回貸付債権担保住宅金融公庫債券	39,702,000	40,072,419	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	158,877,000	163,924,522	

第8回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,891,000	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	106,408,000	110,009,910	
第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	70,821,000	73,192,795	
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券	41,649,000	41,379,114	
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	164,097,000	169,430,152	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	75,046,000	76,815,584	
第11回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	75,207,000	77,044,307	
第12回貸付債権担保住宅金融公庫債券	47,364,000	47,563,402	
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	76,531,000	78,199,375	
第14回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	211,062,000	
第16回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	157,772,000	160,678,160	
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	162,582,000	165,853,149	
第19回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,796,000	85,360,192	
第21回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,639,000	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	169,308,000	176,603,481	
第25回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	207,342,000	
第26回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	253,104,000	260,484,512	
第27回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,497,000	87,402,728	
第28回貸付債権担保住宅金融公庫債券	60,771,000	61,051,762	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,898,000	90,323,034	
第29回貸付債権担保住宅金融公庫債券	64,072,000	64,475,653	
第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,401,000	90,526,558	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,558,000	91,041,080	
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券	67,275,000	67,092,012	
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	68,970,000	68,781,022	
第32回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	183,454,000	184,077,743	
第33回貸付債権担保住宅金融公庫債券	68,818,000	68,550,297	
第34回貸付債権担保住宅金融公庫債券	141,048,000	141,883,004	
第35回貸付債権担保住宅金融公庫債券	70,203,000	70,426,947	
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,780,000	95,384,696	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	68,504,000	69,297,961	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,173,000	95,426,160	
第38回貸付債権担保住宅金融公庫債券	137,030,000	138,812,760	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	68,606,000	68,969,611	
第40回貸付債権担保住宅金融公庫債券	135,300,000	137,348,442	
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	70,186,000	71,867,656	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	137,164,000	142,842,589	
第43回貸付債権担保住宅金融公庫債券	135,754,000	140,924,869	
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,608,000	96,701,907	
第44回貸付債権担保住宅金融公庫債券	67,398,000	69,878,246	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	198,596,000	197,499,750	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,776,000	99,734,094	
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	70,652,000	72,734,114	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	71,911,000	73,440,546	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	144,866,000	149,417,689	
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	144,698,000	149,724,808	

第3回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	60,900,000	62,483,400	
第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	73,215,000	75,434,146	
第5回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	130,136,000	132,209,066	
第15回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	154,464,000	157,432,798	
第36回国民生活債券	100,000,000	101,496,000	
第6回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	103,605,000	
第10回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	107,676,000	
第1回新東京国際空港債券	300,000,000	301,809,000	
第3回新東京国際空港債券	100,000,000	101,661,000	
第4回政府保証新東京国際空港債券	100,000,000	101,844,000	
第5回新東京国際空港債券	100,000,000	103,374,000	
第7回日本学生支援債券	300,000,000	301,746,000	
第3回沖縄振興開発金融公庫債券	200,000,000	206,686,000	
第5回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	102,940,000	
い第682号商工債	300,000,000	302,901,000	
い第687号商工債	200,000,000	203,528,000	
い第703号商工債	200,000,000	205,594,000	
い第711号商工債	100,000,000	101,641,000	
い第712号商工債	100,000,000	101,119,000	
い第675号農林債	100,000,000	100,485,000	
い第679号農林債	200,000,000	201,600,000	
い第681号農林債	100,000,000	100,926,000	
い第682号農林債	200,000,000	201,818,000	
い第684号農林債	100,000,000	101,111,000	
い第687号農林債	100,000,000	101,694,000	
い第690号農林債	400,000,000	406,004,000	
い第695号農林債	200,000,000	203,028,000	
い第696号農林債	500,000,000	510,405,000	
い第697号農林債	200,000,000	204,742,000	
い第698号農林債	100,000,000	102,443,000	
い第704号農林債	200,000,000	204,628,000	
い第707号農林債	100,000,000	102,553,000	
い第708号農林債	300,000,000	305,895,000	
い第712号農林債	300,000,000	303,354,000	
い第713号農林債	100,000,000	100,763,000	
い第714号農林債	400,000,000	404,400,000	
第597回あおぞら債	100,000,000	101,210,000	
第240回信金中金債(5年)	200,000,000	202,486,000	
第243回信金中金債(5年)	100,000,000	100,435,000	
第203回信金中金債(5年)	100,000,000	100,649,000	
第209回信金中金債(5年)	100,000,000	101,086,000	
第215回信金中金債(5年)	200,000,000	203,594,000	
第216回信金中金債(5年)	200,000,000	203,134,000	
第218回信金中金債(5年)	300,000,000	304,578,000	
第221回信金中金債(5年)	100,000,000	101,596,000	
第225回信金中金債(5年)	500,000,000	510,690,000	

	第227回信金中金債(5年)	100,000,000	102,508,000	
	第228回信金中金債(5年)	400,000,000	410,852,000	
	第229回信金中金債(5年)	300,000,000	307,908,000	
	第230回信金中金債(5年)	100,000,000	102,289,000	
	第231回信金中金債(5年)	100,000,000	102,613,000	
	第233回信金中金債(5年)	500,000,000	513,380,000	
	第236回信金中金債(5年)	200,000,000	202,582,000	
	第104号商工債(3年)	500,000,000	502,160,000	
	第108号商工債(3年)	500,000,000	503,255,000	
	第110号商工債(3年)	200,000,000	201,648,000	
	第113号商工債(3年)	300,000,000	301,947,000	
	第2回韓国中小企業銀行	100,000,000	100,582,000	
	第1回政府保証東日本高速道路債券	137,000,000	143,407,490	
	第3回政府保証東日本高速道路債券	100,000,000	106,860,000	
	第5回東日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,706,000	
	第1回政府保証中日本高速道路債券	250,000,000	261,692,500	
	第1回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	103,138,000	
	第3回政府保証中日本高速道路債券	163,000,000	170,758,800	
	第5回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	209,948,000	
	第6回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	103,875,000	
	第10回政府保証中日本高速道路債券	100,000,000	106,007,000	
	第12回政府保証中日本高速道路債券	103,000,000	109,233,560	
	第14回政府保証中日本高速道路債券	100,000,000	106,663,000	
	第19回政府保証中日本高速道路債券	124,000,000	128,847,160	
	第21回政府保証中日本高速道路債券	200,000,000	210,208,000	
	第25回政府保証中日本高速道路債券	200,000,000	205,610,000	
	第5回西日本高速道路株式会社社債	100,000,000	100,353,000	
	第8回政府保証西日本高速道路債券	233,000,000	245,768,400	
	第15回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	105,744,000	
	第19回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	102,172,000	
	第5回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	206,406,000	
	第18回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	202,660,000	
	第1回緑資源債券	100,000,000	101,170,000	
	第3回東京地下鉄株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	211,272,000	
	特殊債券 小計	52,720,751,000	54,214,059,889	
社債券	第9回株式会社ポスコ円貨社債(2006)	200,000,000	203,846,000	
	第1回メリルリンチ・アンド・カンパニー・インク	200,000,000	198,652,000	
	第14回メリルリンチ・アンド・カンパニー・インク	100,000,000	100,622,000	
	第7回ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポレーション	200,000,000	202,018,000	
	第11回ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポレーション	100,000,000	100,309,000	
	第18回ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポレーション	100,000,000	102,989,000	
	第1回ジェイ・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニー	100,000,000	101,870,000	
	第2回ジェイ・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニー	100,000,000	101,511,000	
	第3回ジェイ・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニー	300,000,000	303,714,000	
	第4回ジェイ・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニー	100,000,000	100,220,000	

第8回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク	100,000,000	100,692,000	
第9回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク	100,000,000	103,484,000	
第10回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク	100,000,000	97,239,000	
第11回シティグループ・インク円貨社債(2003)	200,000,000	199,310,000	
第17回シティグループ・インク円貨債券	100,000,000	94,542,000	
第22回シティグループ・インク円貨債券	300,000,000	308,307,000	
第7回ザ・ベアー・スターンズ・カンパニーズ・インク	200,000,000	201,242,000	
第3回バンク・オブ・アメリカ・コーポレーション	200,000,000	202,882,000	
第5回バンク・オブ・アメリカ・コーポレーション	100,000,000	100,863,000	
第6回バンク・オブ・アメリカ・コーポレーション	100,000,000	100,517,000	
第4回パークレイズ・バンク・ピーエルシー円貨社債(2010)	300,000,000	300,741,000	
第1回テレフォニカ・エセ・アー保証テレフォニカ・ヨーロッパ・ビー・ヴィ	100,000,000	100,022,000	
第4回ウォルマート・ストアーズ・インク円貨社債(2010)	100,000,000	100,245,000	
H S B C 銀行 P L C 第1回円貨社債	200,000,000	203,208,000	
H S B C 銀行 P L C 第2回円貨社債	200,000,000	199,034,000	
第1回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	303,750,000	
第7回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	201,512,000	
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	101,763,000	
第19回味の素株式会社無担保社債	100,000,000	102,381,000	
第4回日本たばこ産業株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	203,338,000	
第1回株式会社三越伊勢丹ホールディングス無担保社債	200,000,000	199,056,000	
第6回株式会社日本製紙グループ本社無担保社債	100,000,000	100,669,000	
第25回住友化学工業株式会社無担保社債	100,000,000	102,735,000	
第38回住友化学株式会社無担保社債	100,000,000	103,088,000	
第33回三菱化学株式会社無担保社債	200,000,000	209,964,000	
第35回三菱化学株式会社無担保社債	100,000,000	105,323,000	
第35回三井化学株式会社無担保社債	100,000,000	105,271,000	
第26回新日本石油株式会社無担保社債	200,000,000	212,484,000	
第4回株式会社ブリヂストン無担保社債	200,000,000	201,674,000	
第16回住友ゴム工業株式会社無担保社債	100,000,000	105,805,000	
第12回旭硝子株式会社無担保社債	200,000,000	207,708,000	
第30回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	112,457,000	
第48回新日本製鐵株式会社無担保社債	200,000,000	202,726,000	
第49回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	100,696,000	
第55回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	102,844,000	
第47回住友金属工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,614,000	
第52回住友金属工業株式会社無担保社債	100,000,000	102,005,000	
第4回株式会社神戸製鋼所無担保社債	100,000,000	101,991,000	
第46回株式会社神戸製鋼所無担保社債	100,000,000	103,877,000	
第9回ジェイ エフ イー ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,471,000	
第11回ジェイ エフ イー ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,862,000	
第11回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	101,223,000	
第15回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	103,925,000	
第18回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	105,328,000	
第7回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	101,872,000	
第12回株式会社日立製作所無担保社債	200,000,000	200,376,000	



第50回株式会社東芝無担保社債	100,000,000	98,270,000	
第38回日本電気株式会社無担保社債	100,000,000	101,814,000	
第6回パナソニック株式会社無担保社債	300,000,000	302,130,000	
第7回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	204,866,000	
第10回パナソニック株式会社無担保社債	300,000,000	298,092,000	
第21回シャープ株式会社無担保社債	100,000,000	100,750,000	
第24回シャープ株式会社無担保社債	200,000,000	201,450,000	
第12回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	100,505,000	
第21回ソニー株式会社無担保社債	200,000,000	201,102,000	
第22回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	102,286,000	
第26回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	103,989,000	
第20回三洋電機株式会社無担保社債	200,000,000	208,758,000	
第5回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	102,315,000	
第20回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,493,000	
第22回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	105,542,000	
第7回トヨタ自動車株式会社無担保社債	400,000,000	408,908,000	
第9回トヨタ自動車株式会社無担保社債	300,000,000	304,578,000	
第5回アイシン精機株式会社無担保社債	100,000,000	102,360,000	
第3回凸版印刷株式会社無担保社債	100,000,000	102,358,000	
第43回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	106,113,000	
第56回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	98,594,000	
第57回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	100,963,000	
第63回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	101,200,000	
第70回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	102,939,000	
第61回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	104,022,000	
第63回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	100,588,000	
第23回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,372,000	
第25回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,545,000	
第30回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,683,000	
第67回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,654,000	
第69回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	104,554,000	
第72回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,020,000	
第32回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	100,815,000	
第38回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	98,315,000	
第2回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	104,520,000	
第3回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	300,000,000	301,899,000	
第4回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	200,000,000	201,698,000	
第6回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	200,000,000	203,168,000	
第7回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	200,000,000	213,814,000	
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	103,721,000	
第15回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	200,000,000	204,818,000	
第16回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	400,000,000	408,828,000	
株式会社東京三菱銀行第8回無担保社債	100,000,000	103,543,000	
第9回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	110,924,000	
第11回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	200,000,000	213,558,000	
株式会社三菱東京UFJ銀行第12回無担保社債	200,000,000	212,476,000	

第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	300,000,000	290,601,000	
第56回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	101,552,000	
第72回株式会社東京三菱銀行無担保社債	100,000,000	102,810,000	
第85回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	100,709,000	
第90回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	101,614,000	
第92回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	400,000,000	407,076,000	
第95回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	101,466,000	
第100回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	200,000,000	204,476,000	
第103回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	200,000,000	201,446,000	
第104回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	102,670,000	
第105回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	100,371,000	
第110回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	101,381,000	
第4回株式会社りそな銀行無担保社債	200,000,000	214,326,000	
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	101,540,000	
第11回株式会社静岡銀行無担保社債	100,000,000	102,550,000	
第7回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	104,269,000	
第8回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	99,336,000	
第11回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	98,253,000	
中央三井信託銀行第3回無担保社債	100,000,000	104,168,000	
第5回株式会社三井住友銀行無担保社債	300,000,000	307,632,000	
第7回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	103,916,000	
第8回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	104,284,000	
第9回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	103,998,000	
第20回株式会社三井住友銀行無担保社債	300,000,000	316,398,000	
第37回株式会社三井住友銀行無担保社債	200,000,000	201,232,000	
第39回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	101,042,000	
第42回株式会社三井住友銀行無担保社債	200,000,000	202,732,000	
第43回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	101,658,000	
第45回株式会社三井住友銀行無担保社債	200,000,000	204,490,000	
第8回株式会社みずほ銀行無担保社債	200,000,000	209,002,000	
第9回株式会社みずほ銀行無担保社債	100,000,000	100,191,000	
第10回株式会社みずほ銀行無担保社債	100,000,000	104,542,000	
第32回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	101,530,000	
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	197,840,000	
第11回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,418,000	
第17回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	101,829,000	
第21回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	105,771,000	
第26回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	101,152,000	
第34回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	201,260,000	
第111回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,806,000	
第113回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	101,506,000	
第115回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,975,000	
第118回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	103,483,000	
第129回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	103,658,000	
第130回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	105,589,000	
第6回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,908,000	

第6回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	101,160,000	
第5回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	201,800,000	
第7回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	101,557,000	
第13回野村ホールディングス株式会社無担保社債	500,000,000	507,440,000	
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	311,448,000	
第28回三井不動産株式会社無担保社債	300,000,000	308,121,000	
第58回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	103,926,000	
第65回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	89,809,000	
第66回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	100,704,000	
第87回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	103,826,000	
第53回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,699,000	
第58回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	100,432,000	
第63回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	105,553,000	
第28回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	103,812,000	
第41回小田急電鉄株式会社無担保社債	200,000,000	213,374,000	
第42回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	105,231,000	
第2回東日本旅客鉄道株式会社社債	200,000,000	232,316,000	
第7回東日本旅客鉄道株式会社社債	200,000,000	228,284,000	
第9回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	113,102,000	
第15回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	110,255,000	
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	200,000,000	214,168,000	
第34回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,554,000	
第52回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	103,438,000	
第3回西日本旅客鉄道株式会社社債	200,000,000	228,454,000	
第5回西日本旅客鉄道株式会社社債	200,000,000	225,228,000	
第3回東海旅客鉄道株式会社普通社債	100,000,000	111,351,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	105,570,000	
第11回東海旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	94,280,000	
第19回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	202,620,000	
第21回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	104,465,000	
第28回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	105,588,000	
第41回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	98,688,000	
第42回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	201,342,000	
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	96,642,000	
第48回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	103,469,000	
第51回日本電信電話株式会社電信電話債券	300,000,000	319,140,000	
第53回日本電信電話株式会社電信電話債券	300,000,000	309,573,000	
第56回日本電信電話株式会社電信電話債券	300,000,000	304,257,000	
第6回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	102,289,000	
第8回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	102,297,000	
第15回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	103,851,000	
第15回株式会社エヌ・ティ・ティ・ドコモ無担保社債	200,000,000	210,328,000	
第425回東京電力株式会社社債	100,000,000	99,256,000	
第506回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	92,866,000	
第514回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	91,458,000	
第515回東京電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	180,472,000	

第516回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	89,965,000	
第522回東京電力株式会社社債(一般担保付)	300,000,000	269,241,000	
第524回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	87,100,000	
第526回東京電力株式会社社債(一般担保付)	300,000,000	260,811,000	
第527回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	92,391,000	
第528回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	83,175,000	
第532回東京電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	171,712,000	
第533回東京電力株式会社社債(一般担保付)	500,000,000	457,060,000	
第535回東京電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	170,966,000	
第537回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	80,622,000	
第541回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	94,005,000	
第544回東京電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	172,474,000	
第545回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	85,222,000	
第546回東京電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	184,008,000	
第547回東京電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	161,194,000	
第552回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	92,330,000	
第406回中部電力株式会社社債	200,000,000	225,028,000	
第408回中部電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	113,472,000	
第409回中部電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	231,050,000	
第469回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,882,000	
第471回中部電力株式会社社債	300,000,000	307,467,000	
第474回中部電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	104,308,000	
第475回中部電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	212,086,000	
第486回中部電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	206,978,000	
第432回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	101,289,000	
第433回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,334,000	
第440回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,370,000	
第449回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	106,839,000	
第451回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	105,211,000	
第453回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	105,246,000	
第459回関西電力株式会社社債(一般担保付)	300,000,000	304,224,000	
第465回関西電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	206,402,000	
第466回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,196,000	
第467回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,282,000	
第472回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	104,005,000	
第306回中国電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	229,230,000	
第310回中国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	113,487,000	
第340回中国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	100,359,000	
第349回中国電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	210,362,000	
第273回北陸電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,452,000	
第279回北陸電力株式会社社債(一般担保付)	30,000,000	31,103,400	
第284回北陸電力株式会社社債(一般担保付)	400,000,000	412,888,000	
第286回北陸電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	105,111,000	
第368回東北電力株式会社社債(一般担保付)	450,000,000	505,089,000	
第372回東北電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	230,586,000	
第376回東北電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	112,560,000	

第408回東北電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	101,031,000	
第431回東北電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	105,234,000	
第444回東北電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	101,431,000	
第445回東北電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,909,000	
第229回四国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	114,879,000	
第245回四国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,514,000	
第253回四国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	91,344,000	
第268回四国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,308,000	
第346回九州電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	105,564,000	
第372回九州電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	201,128,000	
第380回九州電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,786,000	
第384回九州電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,955,000	
第394回九州電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	105,181,000	
第400回九州電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,736,000	
第405回九州電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	104,019,000	
第408回九州電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,642,000	
第258回北海道電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	231,550,000	
第299回北海道電力株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	203,592,000	
第300回北海道電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,434,000	
第11回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,327,000	
第14回電源開発株式会社無担保社債	200,000,000	206,924,000	
第19回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	105,562,000	
第21回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	103,917,000	
第23回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	104,500,000	
第17回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	220,764,000	
第25回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	103,253,000	
第18回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	195,530,000	
第22回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	105,099,000	
第27回東邦瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	93,516,000	
第30回東邦瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	106,244,000	
第20回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	500,000,000	507,090,000	
社債券 小計	40,380,000,000	41,186,861,400	
合計		502,536,839,589	

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### イ 資本金の額および株式数

	平成23年5月31日現在
資本金の額	2,000百万円
会社が発行する株式の総数	60,000株
発行済株式総数	17,640株

##### ロ 最近5年間における資本金の額の増減

該当ありません。

##### ハ 会社の機構

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

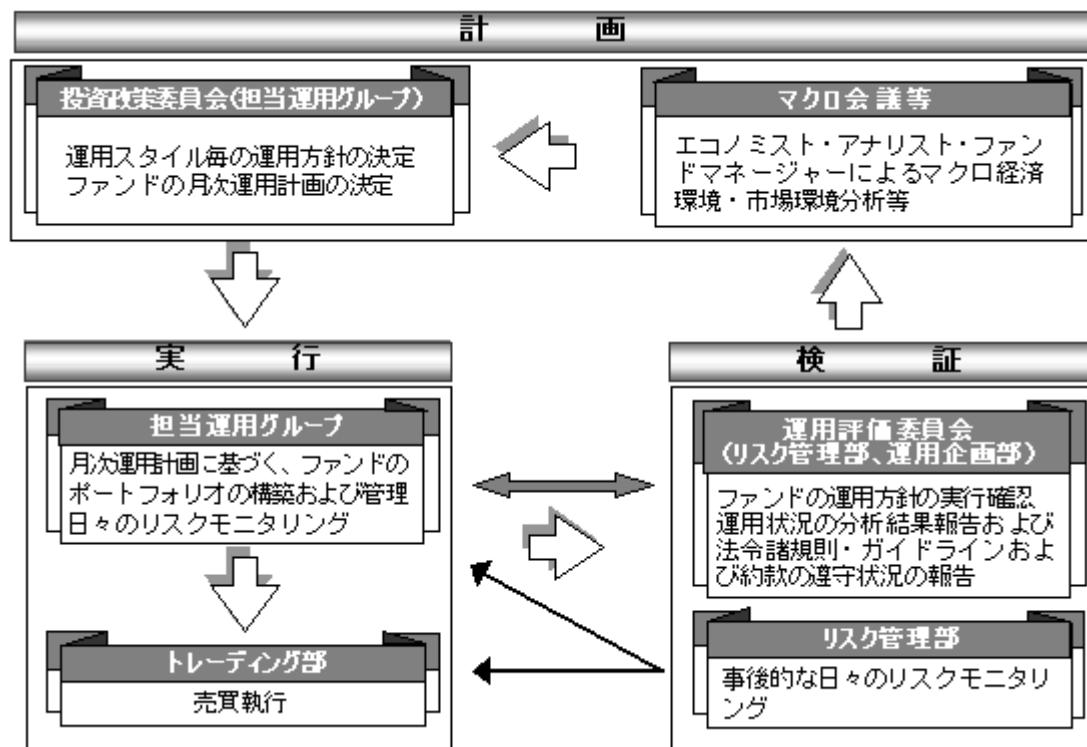
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役を若干名を選定します。

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

##### ニ 投資信託の運用の流れ



## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成23年5月31日現在、委託会社が運用を行っている投資信託（親投資信託は除きます）は、以下の通りです。

（平成23年5月31日現在、単位：百万円）

		本数	純資産総額
株式投資信託	単位型	57 ( 1)	94,125 ( 188)
	追加型	274 ( 132)	4,936,683 ( 3,165,150)
	計	331 ( 133)	5,030,808 ( 3,165,338)
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		331 ( 133)	5,030,808 ( 3,165,338)

( )内は、私募投資信託分であり、内書き表記しております。

### 3【委託会社等の経理状況】

- 1 当社の財務諸表は、第25期（平成21年4月1日から平成22年3月31日まで）については、改正前の「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しており、第26期（平成22年4月1日から平成23年3月31日まで）については、改正後の「財務諸表等規則」並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
- 2 当社は、第25期（平成21年4月1日から平成22年3月31日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、あずさ監査法人の監査を受けており、第26期（平成22年4月1日から平成23年3月31日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の監査を受けております。  
なお、あずさ監査法人は、監査法人の種類の変更により平成22年7月1日付をもって、名称を有限責任 あずさ監査法人に変更しております。



## (1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

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

	第 25 期 (平成22年 3月31日現在)	第 26 期 (平成23年 3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	46,362	47,190
未払金		
未払収益分配金	943	681
未払償還金	18,453	21,638
未払手数料	2 1,523,402	1,971,626
その他未払金	71,728	64,551
未払費用	869,497	824,240
未払消費税等	74,053	126,666
未払法人税等	1,264,485	1,004,164
賞与引当金	293,651	327,914
流動負債計	4,162,578	4,388,674
固定負債		
退職給付引当金	1,137,766	1,310,821
固定負債計	1,137,766	1,310,821
負債合計	5,300,344	5,699,496
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	8,628,984	8,628,984
資本剰余金合計	8,628,984	8,628,984
利益剰余金		
利益準備金	284,245	284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金	60,000	60,000
別途積立金	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金	14,172,932	15,381,398
利益剰余金合計	15,994,137	17,202,602
株主資本計	26,623,121	27,831,586
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	82,556	110,498
評価・換算差額等計	82,556	110,498
純資産合計	26,705,677	27,942,085
負債・純資産合計	32,006,022	33,641,581

## （２）【損益計算書】

（単位：千円）

	第 25 期 （自 平成21年 4 月 1 日 至 平成22年 3 月31日）	第 26 期 （自 平成22年 4 月 1 日 至 平成23年 3 月31日）
営業収益		
委託者報酬	21,113,167	27,350,519
運用受託報酬	2,492,177	2,113,027
投資助言報酬	1,893,038	1,828,087
その他営業収益		
情報提供コンサルタント業務報酬	5,000	5,000
投資法人運用受託報酬	43,853	35,635
サービス支援手数料	-	234,885
その他	12,348	26,930
営業収益計	25,559,586	31,594,086
営業費用		
支払手数料	9,706,627	14,161,927
広告宣伝費	420,508	482,728
公告費	2,339	4,634
調査費		
調査費	579,477	537,254
委託調査費	1,556,961	2,115,042
営業雑経費		
通信費	31,515	34,433
印刷費	278,539	266,803
協会費	19,271	23,235
諸会費	12,955	11,346
情報機器関連費	2,005,507	2,066,205
販売促進費	13,183	27,670
その他	66,833	79,571
営業費用計	14,693,722	19,810,852
一般管理費		
給料		
役員報酬	155,835	155,867
給料・手当	4,192,414	4,342,937
賞与	719,290	983,434
賞与引当金繰入額	293,651	327,914
交際費	19,087	21,460
寄付金	23	31
事務委託費	195,150	220,738
旅費交通費	197,842	219,278
租税公課	86,095	87,674
不動産賃借料	714,209	677,468
退職給付費用	197,352	199,545
固定資産減価償却費	97,916	100,356
諸経費	280,916	250,817
一般管理費計	7,149,786	7,587,526

営業利益

3,716,077

4,195,707

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

## （ 3 ） 【 株主資本等変動計算書 】

（ 単位：千円 ）

	第 25 期 （ 自 平成21年 4 月 1 日 至 平成22年 3 月31日 ）	第 26 期 （ 自 平成22年 4 月 1 日 至 平成23年 3 月31日 ）
株主資本		
資本金		
前期末残高	2,000,000	2,000,000
当期末残高	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金		
前期末残高	8,628,984	8,628,984
当期末残高	8,628,984	8,628,984
資本剰余金合計		
前期末残高	8,628,984	8,628,984
当期末残高	8,628,984	8,628,984
利益剰余金		
利益準備金		
前期末残高	284,245	284,245
当期末残高	284,245	284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金		
前期末残高	60,000	60,000
当期末残高	60,000	60,000
別途積立金		
前期末残高	1,476,959	1,476,959
当期末残高	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金		
前期末残高	12,356,655	14,172,932
当期変動額		
剰余金の配当	846,720	1,323,000
当期純利益	2,662,997	2,531,465
当期変動額合計	1,816,277	1,208,465
当期末残高	14,172,932	15,381,398
利益剰余金合計		
前期末残高	14,177,860	15,994,137
当期変動額		
剰余金の配当	846,720	1,323,000
当期純利益	2,662,997	2,531,465
当期変動額合計	1,816,277	1,208,465
当期末残高	15,994,137	17,202,602
株主資本合計		
前期末残高	24,806,844	26,623,121
当期変動額		
剰余金の配当	846,720	1,323,000
当期純利益	2,662,997	2,531,465

当期変動額合計

1,816,277

1,208,465

当期末残高

26,623,121

27,831,586

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



## 重要な会計方針

項目	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)
1 有価証券の評価基準及び評価方法	満期保有目的の債券 償却原価法 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法 其他有価証券 時価のあるもの 決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 時価のないもの 移動平均法による原価法	満期保有目的の債券 同左 子会社株式及び関連会社株式 同左 其他有価証券 時価のあるもの 同左 時価のないもの 同左
2 固定資産の減価償却の方法	有形固定資産 定率法によっております。但し、建物(建物附属設備を除く)については、定額法によっております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。  建物 3～50年 器具備品 3～20年  無形固定資産 定額法によっております。	有形固定資産 同左     無形固定資産 同左
3 引当金の計上基準 (1) 賞与引当金  (2) 退職給付引当金	従業員賞与の支給に充てるため、将来の支給見込額のうち当事業年度の負担額を計上しております。  従業員の退職金支給に備えるため、当事業年度末における退職給付債務に基づき計上しております。 過去勤務債務については、その発生時において一時に費用処理しております。 数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。 (会計方針の変更) 当事業年度より、「退職給付に係る会計基準」の一部改正(その3)(企業会計基準第19号平成20年7月31日)を適用しております。この変更が当事業年度の損益に与える影響はありません。また、本会計基準の適用に伴い発生する退職給付債務の差額ははありません。	同左  従業員の退職金支給に備えるため、当事業年度末における退職給付債務に基づき計上しております。 過去勤務債務については、その発生時において一時に費用処理しております。 数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。
4 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理は税抜方式によっております。	同左

## 会計方針の変更

## （会計処理の変更）

第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)
-	資産除去債務に関する会計基準 企業会計基準第18号「資産除去債務に関する会計基準」（平成20年3月31日 企業会計基準委員会）及び企業会計基準適用指針第21号「資産除去債務に関する会計基準の適用指針」（同前）が平成22年4月1日以後開始する事業年度から適用されることになったことに伴い、当事業年度から同会計基準及び適用指針を適用しております。 これによる損益の影響はありません。

## 注記事項

## （貸借対照表関係）

第25期 (平成22年3月31日現在)	第26期 (平成23年3月31日現在)
1 有形固定資産の減価償却累計額 建物 172,855千円 器具備品 863,358千円 無形固定資産の減価償却累計額 電話加入権 83千円 商標権 13,282千円	1 有形固定資産の減価償却累計額 建物 191,415千円 器具備品 774,482千円 無形固定資産の減価償却累計額 電話加入権 95千円 商標権 15,226千円
2 関係会社に対する債権債務 現金及び預金 10,591,647千円 未収投資助言報酬 295,911千円 未払手数料 441,536千円	2 関係会社に対する債権債務 現金及び預金 11,201,422千円 未収投資助言報酬 293,061千円 未払手数料 469,104千円
3 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座貸越契約を締結しております。 当事業年度末における当座貸越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。 当座貸越極度額の総額 10,000,000千円 借入実行残高 - 千円 差引額 10,000,000千円	3 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座貸越契約を締結しております。 当事業年度末における当座貸越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。 当座貸越極度額の総額 10,000,000千円 借入実行残高 - 千円 差引額 10,000,000千円
4 当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York)Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成27年6月までの賃借料総額102,815千円の支払保証を行っております。	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。

## (損益計算書関係)

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

## (株主資本等変動計算書関係)

第25期(自平成21年4月1日至平成22年3月31日)

## 1.発行済株式数に関する事項

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

## 2.剰余金の配当に関する事項

## (1)配当金支払額等

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

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

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

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

第26期(自平成22年4月1日至平成23年3月31日)

## 1.発行済株式数に関する事項

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

## 2.剰余金の配当に関する事項

## (1)配当金支払額等

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

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

平成23年6月24日開催の第26回定時株主総会において次の通り付議いたします。

決議	株式の種類	配当の原資	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成23年6月24日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	1,252,440	71,000	平成23年 3月31日	平成23年 6月27日

## （リース取引関係）

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

## （金融商品関係）

第25期(自平成21年4月1日至平成22年3月31日)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

営業債務である未払手数料は、すべて1年以内の支払期日であります。

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

## 信用リスクの管理

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

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

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

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

## 市場リスクの管理

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

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

## (4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

（単位：千円）

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

## （注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資 産

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

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

## (5) 有価証券及び投資有価証券

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

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

## (6) 長期差入保証金

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

負 債

## (1) 未払金

## 未払手数料

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位:千円)

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

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

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

(注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位:千円)

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

(追加情報)

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

第26期(自平成22年4月1日至平成23年3月31日)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

### (1) 金融商品に対する取組方針

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

### (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

営業債務である未払手数料は、すべて1年以内の支払期日であります。

### (3) 金融商品に係るリスク管理体制

#### 信用リスクの管理

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

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

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

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

#### 市場リスクの管理

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

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

### (4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

（単位：千円）

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

（注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資産

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

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

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

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

(6) 長期差入保証金

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

負債

(1) 未払金

未払手数料

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



(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位:千円)

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

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

子会社株式については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるものであることから、時価開示の対象とはしておりません。また、上記の表中にある「貸借対照表計上額」は、減損処理後の帳簿価額です。当事業年度における減損処理額は、1,256千円です。

(注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位:千円)

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

## （有価証券関係）

第25期（平成22年3月31日現在）

## 1．満期保有目的の債券

（単位：千円）

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

## 2．子会社株式及び関連会社株式

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

## 3．その他有価証券

（単位：千円）

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

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

## 4．当事業年度中に売却したその他有価証券

（単位：千円）

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

第26期(平成23年3月31日現在)

## 1. 満期保有目的の債券

(単位：千円)

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)貸借対照表日の時価が貸借対照表計上額を超えるもの	-	-	-
小計	-	-	-
(2)貸借対照表日の時価が貸借対照表計上額を超えないもの	3,999,722	3,999,600	122
小計	3,999,722	3,999,600	122
合計	3,999,722	3,999,600	122

## 2. 子会社株式及び関連会社株式

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

## 3. その他有価証券

(単位：千円)

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

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

## 4. 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
4,845,387	71,400	20,822

## (デリバティブ取引関係)

第25期(自平成21年4月1日至平成22年3月31日)

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

第26期(自平成22年4月1日至平成23年3月31日)

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

## (退職給付関係)

第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)																																						
<p>1. 採用している退職給付制度の概要 当社は、確定給付型の制度として、退職一時金制度を設けております。</p> <p>2. 退職給付債務の額 (単位：千円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">退職給付債務</td> <td style="text-align: right;">1,137,766</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td style="text-align: right;"><u>1,137,766</u></td> </tr> </table> <p>3. 退職給付費用の額 (単位：千円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 60%;">勤務費用</td> <td style="width: 20%; text-align: right;">154,625</td> <td style="width: 20%;"></td> </tr> <tr> <td>利息費用</td> <td style="text-align: right;">14,583</td> <td></td> </tr> <tr> <td>数理計算上の差異の費用処理額</td> <td style="text-align: right;">12,466</td> <td></td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;"><u>15,677</u></td> <td></td> </tr> <tr> <td>退職給付費用</td> <td style="text-align: right;"><u>197,352</u></td> <td></td> </tr> </table> <p>(注) その他は、その他の関係会社からの出向者の年金掛金負担分と退職給付引当額相当額負担分になります。</p> <p>4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項 退職給付見込額の期間配分方法 勤務期間を基準とする方法 割引率 1.5% 過去勤務債務の額の処理年数 1年(発生時において費用処理する方法) 数理計算上の差異の処理年数 1年(発生時において費用処理する方法)</p>	退職給付債務	1,137,766	退職給付引当金	<u>1,137,766</u>	勤務費用	154,625		利息費用	14,583		数理計算上の差異の費用処理額	12,466		その他	<u>15,677</u>		退職給付費用	<u>197,352</u>		<p>1. 採用している退職給付制度の概要 当社は、確定給付型の制度として、退職一時金制度を設けております。</p> <p>2. 退職給付債務の額 (単位：千円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">退職給付債務</td> <td style="text-align: right;">1,310,821</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td style="text-align: right;"><u>1,310,821</u></td> </tr> </table> <p>3. 退職給付費用の額 (単位：千円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 60%;">勤務費用</td> <td style="width: 20%; text-align: right;">160,751</td> <td style="width: 20%;"></td> </tr> <tr> <td>利息費用</td> <td style="text-align: right;">17,066</td> <td></td> </tr> <tr> <td>数理計算上の差異の費用処理額</td> <td style="text-align: right;">6,439</td> <td></td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;"><u>15,287</u></td> <td></td> </tr> <tr> <td>退職給付費用</td> <td style="text-align: right;"><u>199,545</u></td> <td></td> </tr> </table> <p>(注) その他は、その他の関係会社からの出向者の年金掛金負担分と退職給付引当額相当額負担分になります。</p> <p>4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項 退職給付見込額の期間配分方法 勤務期間を基準とする方法 割引率 1.5% 過去勤務債務の額の処理年数 1年(発生時において費用処理する方法) 数理計算上の差異の処理年数 1年(発生時において費用処理する方法)</p>	退職給付債務	1,310,821	退職給付引当金	<u>1,310,821</u>	勤務費用	160,751		利息費用	17,066		数理計算上の差異の費用処理額	6,439		その他	<u>15,287</u>		退職給付費用	<u>199,545</u>	
退職給付債務	1,137,766																																						
退職給付引当金	<u>1,137,766</u>																																						
勤務費用	154,625																																						
利息費用	14,583																																						
数理計算上の差異の費用処理額	12,466																																						
その他	<u>15,677</u>																																						
退職給付費用	<u>197,352</u>																																						
退職給付債務	1,310,821																																						
退職給付引当金	<u>1,310,821</u>																																						
勤務費用	160,751																																						
利息費用	17,066																																						
数理計算上の差異の費用処理額	6,439																																						
その他	<u>15,287</u>																																						
退職給付費用	<u>199,545</u>																																						

## （税効果会計関係）

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

## （資産除去債務関係）

第26期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

該当事項はありません。

## （セグメント情報等）

第26期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

## 1. セグメント情報

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

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

## 2. 関連情報

## (1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

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

## (2) 地域ごとの情報

## 売上高

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## （追加情報）

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

## (関連当事者情報)

第25期(自平成21年4月1日至平成22年3月31日)

## 1. 親会社及び主要株主(会社等の場合に限る。)等

(単位:千円)

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

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

## 2. その他の関係会社の子会社等

(単位:千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の関係会社の子会社	日興コーディアル証券(株)	東京都千代田区	10,000,000	証券業	- %	投信の販売委託	委託販売手数料	1,019,546	未払手数料	238,828

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

第26期(自平成22年4月1日至平成23年3月31日)

## 1. 親会社及び主要株主(会社等の場合に限る。)等

(単位:千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の関係会社	住友生命保険(相)	大阪府大阪市中央区	210,000,000	生命保険業	(被所有)% 直接 40	当社の主要顧客	投資助言報酬	1,130,782	未収投資助言報酬	293,061
その他の関係会社	(株)三井住友銀行	東京都千代田区	1,770,996,505	銀行業	(被所有)% 直接 27.5	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	4,558,604	未払手数料	374,320

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

## 2. その他の関係会社の子会社等

(単位:千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の関係会社の子会社	日興コーディアル証券(株)	東京都千代田区	10,000,000	証券業	- %	投信の販売委託	委託販売手数料	2,174,385	未払手数料	110,182

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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



## （ 1株当たり情報 ）

第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)
1株当たり純資産額 1,513,927円30銭 1株当たり当期純利益 150,963円55銭	1株当たり純資産額 1,584,018円42銭 1株当たり当期純利益 143,507円12銭
なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	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 26,705,677千円 普通株式に係る純資産額 26,705,677千円 普通株式の発行済株式数 17,640株 1株当たり純資産額の算定に用いられた普通株式の数 17,640株	(1株当たり純資産額の算定上の基礎) 貸借対照表の純資産の部の合計額 27,942,085千円 普通株式に係る純資産額 27,942,085千円 普通株式の発行済株式数 17,640株 1株当たり純資産額の算定に用いられた普通株式の数 17,640株
(1株当たり当期純利益の算定上の基礎) 損益計算書上の当期純利益 2,662,997千円 普通株式に係る当期純利益 2,662,997千円 普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。 普通株式の期中平均株式数 17,640株	(1株当たり当期純利益の算定上の基礎) 損益計算書上の当期純利益 2,531,465千円 普通株式に係る当期純利益 2,531,465千円 普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。 普通株式の期中平均株式数 17,640株

## （ 重要な後発事象 ）

第25期(自平成21年4月1日至平成22年3月31日)

該当事項はありません。

第26期(自平成22年4月1日至平成23年3月31日)

該当事項はありません。

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

#### 5【その他】

イ 定款の変更、その他の重要事項

平成23年6月24日に開催された定時株主総会において、監査体制の見直しにより監査役の員数を1名減員し4名以内とする定款の変更が決議されました。

- ロ 訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実  
該当ありません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

イ 受託会社

（イ）名称 住友信託銀行株式会社

（ロ）資本金の額 342,037百万円（平成23年3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23年3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 住友生命保険相互会社

（ロ）資本金の額 439,000百万円（平成23年3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。）

（ハ）事業の内容 保険業法に基づき、保険業を営んでいます。

### 2【関係業務の概要】

イ 受託会社

信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

ロ 販売会社

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

### 3【資本関係】

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

### 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。

「外国株式インデックス・マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

対象年月日	(平成22年4月13日現在)	(平成23年4月13日現在)
科目	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	512,715,987	1,006,822,930
コール・ローン	429,019,179	620,514,645
株式	256,497,951,064	236,971,201,683
投資証券	4,168,153,684	3,963,481,308
派生商品評価勘定	40,405,524	1,582,293
未収入金	1,631,208	2,616,494
未収配当金	343,282,051	364,134,855
未収利息	587	850
差入委託証拠金	955,043,890	614,038,852
流動資産合計	262,948,203,174	243,544,393,910
資産合計	262,948,203,174	243,544,393,910
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	18,886,957
未払解約金	335,681,723	450,803,843
流動負債合計	335,681,723	469,690,800
負債合計	335,681,723	469,690,800
純資産の部		
元本等		
元本		
元本	192,707,244,458	175,017,042,490
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	69,905,276,993	68,057,660,620

元本等合計	262,612,521,451	243,074,703,110
純資産合計	262,612,521,451	243,074,703,110
負債純資産合計	262,948,203,174	243,544,393,910

（注）「外国株式インデックス・マザーファンド」は、毎年11月30日（ただし、休業日の場合は翌営業日）に決算を行います。上記の貸借対照表は平成22年4月13日ならびに平成23年4月13日現在における同マザーファンドの状況です。

## (2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自平成21年4月14日 至平成22年4月13日	自平成22年4月14日 至平成23年4月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式、新株予約権証券および投資証券（売買目的有価証券） 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、取引所もしくは店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）または金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお売買停止措置がとられている銘柄について、必要であると判断された場合は、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。	株式、新株予約権証券および投資証券（売買目的有価証券） 同左
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。	(1)先物取引 同左  (2)為替予約取引 同左
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、その金額が確定しているものについては当該金額、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。	受取配当金の計上基準 同左
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。	外貨建資産等の会計処理 同左

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成22年4月13日現在)	(平成23年4月13日現在)
----	----------------	----------------

1. 受益権総数	平成22年4月13日現在における受益権の総数 192,707,244,458口	平成23年4月13日現在における受益権の総数 175,017,042,490口
2. 1単位当たり純資産額	1.3628円 (1万口 = 13,628円)	1.3889円 (1万口 = 13,889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21年4月14日 至平成22年4月13日	自平成22年4月14日 至平成23年4月13日
	<p>（追加情報） 当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）および「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。</p>	
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>	同左
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>（1）金融商品の内容 1）有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、新株予約権証券および投資証券を組み入れております。 2）デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。当ファンドにおけるデリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、先物取引および為替予約取引を行っております。 3）コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 （2）金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>	<p>（1）金融商品の内容 1）有価証券 同左 2）デリバティブ取引 同左 3）コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 （2）金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 同左</p>

<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・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。リスクを管理する部署では、各種リスクごとに定められた頻度で、測定項目が上下限值（リミットあるいは注意レベル）内に収まっているかどうかのモニタリングを行っております。上下限値を越えていることが発見された場合は、原則として速やかに修正を行うよう、リスク管理を行う部署から関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われます。また、是正勧告あるいは報告を受けた関連運用グループでは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、リスク管理を行う部署は、上下限値に抵触した事実ならびにその後の対処結果あるいは関連運用グループの対処方針の決定に関し、必要に応じて、リスク管理を行う部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告する体制となっております。</p>	<p>同 左</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>	<p>同 左</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成22年4月13日現在)	(平成23年4月13日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（株式、新株予約権証券および投資証券） 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1) 有価証券（株式、新株予約権証券および投資証券） 同左</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） 同左</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 同左</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成22年4月13日現在)

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建				
	SP500	1,166,371,125 (12,541,625米ドル)	( )	1,192,301,850 (12,820,450米ドル)	25,930,725 (278,825米ドル)
	DJ EUR	474,436,430 (3,758,210ユーロ)	( )	484,877,740 (3,840,920ユーロ)	10,441,310 (82,710ユーロ)
	FTSE	233,334,937 (1,634,685英ポンド)	( )	237,356,636 (1,662,860英ポンド)	4,021,699 (28,175英ポンド)
	買建 合計	1,874,142,492		1,914,536,226	40,393,734

（注）時価の算定方法

- 1．株価指数先物取引の時価については以下のように評価しております。  
原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。  
このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
- 2．株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
- 3．契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

## 通貨関連

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場外取引	為替予約取引				
	売 建				
	ユーロ	37,871,160	-	37,869,000	2,160
	英ポンド	42,821,340	-	42,819,000	2,340
	オーストラリアドル	68,911,200	-	68,904,000	7,200
	ニュージーランドドル	1,326,690	-	1,326,600	90
	売建 合計	150,930,390	-	150,918,600	11,790

(注) 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法について

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

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

(平成23年4月13日現在)

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建				
	SP500	1,084,800,128 (12,912,750米ドル)	( )	1,071,625,259 (12,755,925米ドル)	13,174,869 ( 156,825米ドル)
	DJ EUR	454,505,214 (3,737,400ユーロ)	( )	451,513,608 (3,712,800ユーロ)	2,991,606 ( 24,600ユーロ)
	FTSE	219,711,015 (1,607,720英ポンド)	( )	218,584,936 (1,599,480英ポンド)	1,126,079 ( 8,240英ポンド)
	買建 合計	1,759,016,357		1,741,723,803	17,292,554

(注) 時価の算定方法

1. 株価指数先物取引の時価については以下のように評価しております。

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

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

#### 通貨関連

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場外取引	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	168,000,400	-	168,000,000	400
	ユーロ	36,478,050	-	36,480,000	1,950
	英ポンド	54,656,720	-	54,660,000	3,280
	スイスフラン	74,823,680	-	74,824,000	320
	デンマーククローネ	16,300,000	-	16,300,000	-
オーストラリアドル	70,409,040	-	70,416,000	6,960	

	売建 合計	420,667,890	-	420,680,000	12,110

（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21年 4月14日 至 平成22年 4月13日）

該当事項はありません。

（自 平成22年 4月14日 至 平成23年 4月13日）

該当事項はありません。

(その他の注記)

(平成22年4月13日現在)	
本有価証券報告書における開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	198,715,843,917円
同期中における追加設定元本額	43,790,153,324円
同期中における一部解約元本額	49,798,752,783円
平成22年4月13日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	2,059,807,945円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	121,578,534円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	584,569,674円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	347,941,507円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	6,695,387円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	1,260,739円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	208,291円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	2,022,524円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	307,131円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	169,360円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	769,708円
外国株式指数ファンド	62,211,301円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	40,317,784,305円
バランスファンドVA(安定運用型)<適格機関投資家限定>	499,925,866円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	23,380,371,305円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	10,800,599,339円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	6,869,677,038円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	26,473,328,544円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	82,389,992円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	356,511,892円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	75,053,763円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	2,793,025,237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>	174,465,464円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	674,724,688円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	3,429,164,574円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	4,598,470,940円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	8,668,656,399円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,260,322,794円
三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	2,136,667,100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)	9,765,547,573円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	611,332,491円



SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	2,806,914,802円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	42,102,403,181円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	97,451,371円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	58,721,176円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	24,153,726円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	288,763,640円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	661,182,172円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	512,092,985円
合計	192,707,244,458円

(平成23年4月13日現在)

本有価証券報告書における開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	192,707,244,458円
同期中における追加設定元本額	18,057,521,529円
同期中における一部解約元本額	35,747,723,497円
平成23年4月13日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	3,183,174,901円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	148,012,808円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	663,698,853円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	420,161,092円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	11,035,600円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	1,774,617円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	998,810円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	2,735,461円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	1,199,558円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	571,692円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	1,670,829円
外国株式指数ファンド	167,120,752円
S M A M ・ 外国株式バッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	36,184,918,197円
バランスファンドVA(安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	321,200,602円
S M A M ・ バランスファンドVA安定成長型 < 適格機関投資家限定 >	21,241,761,961円
S M A M ・ バランスファンドVA25 < 適格機関投資家専用 >	9,637,571,508円
S M A M ・ バランスファンドVA37.5 < 適格機関投資家専用 >	5,845,182,923円
S M A M ・ バランスファンドVA50 < 適格機関投資家専用 >	23,072,107,718円
S M A M ・ バランスファンドVL30 < 適格機関投資家限定 >	76,391,191円
S M A M ・ バランスファンドVL50 < 適格機関投資家限定 >	324,893,014円
世界6資産バランスファンドVA < 適格機関投資家限定 >	65,318,587円
S M A M ・ バランスファンドVA75 < 適格機関投資家専用 >	2,456,997,870円
S M A M ・ バランスファンドVL国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	160,510,809円
S M A M ・ インデックス・バランスVA25 < 適格機関投資家専用 >	599,735,836円
S M A M ・ インデックス・バランスVA50 < 適格機関投資家専用 >	3,002,061,379円
S M A M ・ バランスファンドVA40 < 適格機関投資家専用 >	4,145,190,129円
S M A M ・ バランスファンドVA35 < 適格機関投資家専用 >	7,287,256,183円
S M A M ・ バランスVA株40T < 適格機関投資家限定 >	1,120,838,652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)	3,226,070,553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)	9,109,743,669円
S M A M ・ グローバルバランス40VA < 適格機関投資家限定 >	577,260,050円
S M A M ・ バランスファンドVA20 < 適格機関投資家専用 >	2,442,800,517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 )	38,049,916,486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 >	87,582,196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 >	54,322,075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 >	20,535,269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 >	248,717,493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 >	560,467,062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 >	473,052,967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 >	13,073,644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 >	9,408,977円
合 計	175,017,042,490円

## (3) 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

銘柄	株数	評価額 単価	評価額 金額	備考
米ドル				
ALPHA NATURAL RESOURCES INC	15,280	54.02	825,425.60	
ANADARKO PETROLEUM CORP	61,164	77.43	4,735,928.52	
APACHE CORPORATION	47,367	122.40	5,797,720.80	
ARCH COAL INC	20,777	33.04	686,472.08	
BAKER HUGHES INC	53,773	67.55	3,632,366.15	
CABOT OIL & GAS CORPORATION	12,620	50.94	642,862.80	
CAMERON INTERNATIONAL CORP	30,612	52.85	1,617,844.20	
CHESAPEAKE ENERGY CORPORATION	81,815	31.93	2,612,352.95	
CHEVRON CORPORATION	249,557	104.18	25,998,848.26	
CIMAREX ENERGY CO	10,750	107.98	1,160,785.00	
CONCHO RESOURCES INC	11,800	98.85	1,166,430.00	
CONOCOPHILLIPS	172,946	77.16	13,344,513.36	
CONSOL ENERGY INC	27,962	48.89	1,367,062.18	
DENBURY RESOURCES INC	47,454	22.42	1,063,918.68	
DEVON ENERGY CORPORATION	50,594	85.98	4,350,072.12	
DIAMOND OFFSHORE DRILLING, INC.	8,156	76.08	620,508.48	
EL PASO CORPORATION	85,820	16.96	1,455,507.20	
EOG RESOURCES INC	31,258	109.23	3,414,311.34	
EXXON MOBIL CORPORATION	625,193	83.18	52,003,553.74	
FMC TECHNOLOGIES INC	29,190	45.25	1,320,847.50	
HALLIBURTON CO	113,181	45.34	5,131,626.54	
HELMERICH & PAYNE INC	12,600	64.71	815,346.00	
HESS CORPORATION	37,437	80.31	3,006,565.47	
KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	10,448	65.33	682,567.84	
MARATHON OIL CORP	87,723	50.18	4,401,940.14	

MURPHY OIL CORPORATION	22,697	73.06	1,658,242.82
NABORS INDUSTRIES LTD	35,784	29.42	1,052,765.28
NATIONAL-OILWELL VARCO INC.	51,653	74.64	3,855,379.92
NEWFIELD EXPLORATION CO	16,187	70.49	1,141,021.63
NOBLE CORPORATION	30,518	43.23	1,319,293.14
NOBLE ENERGY INC	21,811	91.59	1,997,669.49
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	100,742	96.90	9,761,899.80
PEABODY ENERGY CORP	33,853	64.34	2,178,102.02
PETROHAWK ENERGY CORP	37,322	23.20	865,870.40
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	14,615	97.19	1,420,431.85
PLAINS EXPLORATION & PRODUCTION COMPANY	17,100	33.90	579,690.00
PRIDE INTERNATIONAL INC	21,300	42.18	898,434.00
RANGE RESOURCES CORPORATION	20,071	54.03	1,084,436.13
ROWAN COMPANIES INC	15,745	40.63	639,719.35
SCHLUMBERGER LTD	169,134	86.24	14,586,116.16
SOUTHWESTERN ENERGY COMPANY	43,761	38.02	1,663,793.22
SPECTRA ENERGY CORPORATION	80,463	26.87	2,162,040.81
SUNOCO INC	14,794	42.89	634,514.66
ULTRA PETROLEUM CORP	19,548	47.75	933,417.00
VALERO ENERGY CORP	69,195	27.16	1,879,336.20
WEATHERFORD INTL LTD	92,945	21.06	1,957,421.70
WILLIAMS COS INC	72,511	30.42	2,205,784.62
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	26,565	89.78	2,385,005.70
AIRGAS INC	9,700	66.37	643,789.00
ALCOA INC	124,995	16.70	2,087,416.50
ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	10,880	64.17	698,169.60
BALL CORPORATION	20,806	36.03	749,640.18
CELANESE CORPORATION	19,323	44.17	853,496.91
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	9,020	133.82	1,207,056.40
CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	16,670	93.36	1,556,311.20
CROWN HOLDINGS INC	19,100	38.03	726,373.00

DOW CHEMICAL	143,984	36.96	5,321,648.64
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	112,458	53.75	6,044,617.50
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	8,927	96.37	860,294.99
ECOLAB INC	28,997	50.78	1,472,467.66
FMC CORPORATION	8,300	83.72	694,876.00
FREEMONT-MCMORAN COPPER-B	116,282	53.70	6,244,343.40
INTERNATIONAL PAPER CO	52,575	28.80	1,514,160.00
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	10,392	62.30	647,421.60
LYONDELLBASELL INDU-CL A	35,600	40.53	1,442,868.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,943	88.00	522,984.00
MEADWESTVACO CORP	20,415	31.11	635,110.65
MONSANTO CO	66,457	69.25	4,602,147.25
MOSAIC CO/THE	19,443	76.67	1,490,694.81
NEWMONT MINING CORP	60,688	57.24	3,473,781.12
NUCOR CORP	38,906	45.21	1,758,940.26
OWENS-ILLINOIS INC	21,339	29.62	632,061.18
PPG INDUSTRIES INC	20,223	93.76	1,896,108.48
PRAXAIR INC	38,370	100.53	3,857,336.10
SEALED AIR CORP	21,138	25.87	546,840.06
SIGMA-ALDRICH	15,456	63.85	986,865.60
THE LUBRIZOL CORPORATION	8,200	134.07	1,099,374.00
UNITED STATES STEEL CORPORATION	17,609	50.52	889,606.68
VULCAN MATERIALS CO	15,053	43.95	661,579.35
WEYERHAEUSER CO	66,499	22.56	1,500,217.44
3M COMPANY	84,179	92.37	7,775,614.23
AGCO CORP	12,100	50.88	615,648.00
AMETEK INC	20,640	42.33	873,691.20
BOEING CO	86,486	73.08	6,320,396.88
BUCYRUS INTERNATIONAL INC-A	9,900	91.30	903,870.00
CATERPILLAR INC	78,640	106.57	8,380,664.80
COOPER INDUSTRIES PLC-CL-A	20,552	66.16	1,359,720.32

CUMMINS INC	23,048	105.72	2,436,634.56
DANAHER CORP	68,784	51.60	3,549,254.40
DEERE & CO	52,524	93.45	4,908,367.80
DOVER CORP	23,074	64.47	1,487,580.78
EATON CORP	40,252	52.50	2,113,230.00
EMERSON ELECTRIC CO	93,438	57.16	5,340,916.08
FASTENAL COMPANY	16,034	64.54	1,034,834.36
FIRST SOLAR,INC.	6,770	143.65	972,510.50
FLOWERVE CORPORATION	6,919	127.12	879,543.28
FLUOR CORP	21,936	67.92	1,489,893.12
FOSTER WHEELER AG	15,796	34.80	549,700.80
GENERAL DYNAMICS CORP	39,671	72.92	2,892,809.32
GENERAL ELECTRIC CO	1,321,243	20.01	26,438,072.43
GOODRICH CORPORATION	15,937	83.59	1,332,173.83
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	91,412	57.53	5,258,932.36
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES	5,818	38.05	221,374.90
ILLINOIS TOOL WORKS	52,660	53.60	2,822,576.00
INGERSOLL-RAND PLC	39,703	47.07	1,868,820.21
ITT CORPORATION	21,466	58.59	1,257,692.94
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	15,890	48.32	767,804.80
JOY GLOBAL INC	13,059	93.39	1,219,580.01
KBR,INC.	18,785	35.78	672,127.30
L-3 COMMUNICATIONS HLDGS INC	14,010	78.55	1,100,485.50
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	38,227	80.37	3,072,303.99
MASCO CORP	43,766	13.28	581,212.48
NORTHROP GRUMMAN CORP	34,908	62.84	2,193,618.72
PACCAR INC	40,716	50.31	2,048,421.96
PALL CORPORATION	14,276	57.14	815,730.64
PARKER HANNIFIN CORPORATIOM	19,679	93.37	1,837,428.23
PENTAIR INC	12,050	38.01	458,020.50
PRECISION CASTPARTS CORP	17,800	144.01	2,563,378.00

QUANTA SERVICES INC	25,859	21.98	568,380.82
RAYTHEON COMPANY	45,381	50.14	2,275,403.34
ROCKWELL AUTOMATION INC	17,498	91.74	1,605,266.52
ROCKWELL COLLINS INC.	19,964	63.49	1,267,514.36
ROPER INDUSTRIES INC	11,400	84.60	964,440.00
SPX CORP	5,868	78.97	463,395.96
TEXTRON INC	34,318	26.88	922,467.84
TYCO INTERNATIONAL LTD	61,470	52.33	3,216,725.10
UNITED TECHNOLOGIES CORP	108,433	83.98	9,106,203.34
URS CORPORATION	10,900	44.21	481,889.00
WW GRAINGER INC	7,000	141.96	993,720.00
AVERY DENNISON CORP	11,362	41.30	469,250.60
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3,750	274.30	1,028,625.00
CINTAS CORP	16,913	29.91	505,867.83
DUN & BRADSTREET CORP	6,001	81.13	486,861.13
EQUIFAX INC	15,542	37.46	582,203.32
IHS INC-CLASS A	5,400	85.67	462,618.00
IRON MOUNTAIN INC	22,122	32.83	726,265.26
MANPOWER INC	10,692	61.11	653,388.12
NETFLIX INC	5,430	233.92	1,270,185.60
PITNEY BOWES INC	25,773	24.99	644,067.27
REPUBLIC SERVICES INC	46,594	30.07	1,401,081.58
ROBERT HALF INTL INC	17,091	29.94	511,704.54
RR DONNELLEY & SONS CO	25,698	19.36	497,513.28
STERICYCLE,INC.	10,400	90.43	940,472.00
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	14,200	32.62	463,204.00
WASTE MANAGEMENT INC	55,224	37.67	2,080,288.08
C.H.ROBINSON WORLDWIDE,INC.	20,960	74.24	1,556,070.40
CSX CORP	45,906	75.37	3,459,935.22
DELTA AIR LINES INC	21,200	9.90	209,880.00
EXPEDITORS INTL WASH INC	25,678	50.49	1,296,482.22



FEDEX CORP	37,141	94.08	3,494,225.28
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	11,300	44.81	506,353.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	45,377	67.77	3,075,199.29
SOUTHWEST AIRLINES	24,000	11.84	284,160.00
UNION PACIFIC CORP	60,760	96.54	5,865,770.40
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	11,000	21.71	238,810.00
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	90,136	73.23	6,600,659.28
AUTOLIV INC	11,200	69.00	772,800.00
BORGWARNER INC	13,900	72.06	1,001,634.00
FORD MOTOR COMPANY	379,689	14.91	5,661,162.99
GENERAL MOTORS CO	65,600	31.15	2,043,440.00
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	27,034	15.02	406,050.68
HARLEY-DAVIDSON INC	28,986	39.47	1,144,077.42
JOHNSON CONTROLS INC	83,583	39.31	3,285,647.73
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	12,400	50.26	623,224.00
COACH INC	36,345	52.08	1,892,847.60
D.R.HORTON INC	33,948	11.66	395,833.68
FORTUNE BRANDS INC	18,802	63.00	1,184,526.00
GARMIN LTD	15,016	33.76	506,940.16
HASBRO INC	15,114	45.67	690,256.38
LEGGETT & PLATT INC	17,215	22.80	392,502.00
MATTEL INC	45,782	25.32	1,159,200.24
MOHAWK INDUSTRIES INC	6,883	60.16	414,081.28
NEWELL RUBBERMAID INC	34,244	18.80	643,787.20
NIKE INC -CL B	46,102	78.20	3,605,176.40
POLO RALPH LAUREN CORPORATION	7,838	124.31	974,341.78
PULTE GROUP INC	43,751	7.70	336,882.70
STANLEY BLACK & DECKER INC	20,028	73.96	1,481,270.88
TOLL BROTHERS INC	16,939	20.24	342,845.36
VF CORP	11,065	99.35	1,099,307.75
WHIRLPOOL CORP	9,384	84.34	791,446.56

APOLLO GROUP INC-CL A	15,673	41.11	644,317.03
CARNIVAL CORP	56,188	38.43	2,159,304.84
DARDEN RESTAURANTS INC	15,640	46.86	732,890.40
DEVRY INC	7,200	53.22	383,184.00
H&R BLOCK INC	37,192	17.31	643,793.52
INTL GAME TECHNOLOGY	37,160	15.38	571,520.80
LAS VEGAS SANDS CORP	42,900	43.46	1,864,434.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	36,837	34.33	1,264,614.21
MCDONALD'S CORPORATION	131,038	76.66	10,045,373.08
MGM MIRAGE	44,000	12.61	554,840.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	17,471	40.11	700,761.81
STARBUCKS CORP	91,757	35.77	3,282,147.89
STARWOOD HOTELS & RESORTS	23,964	57.00	1,365,948.00
WYNN RESORTS LTD	9,821	130.14	1,278,104.94
YUM! BRANDS INC	57,704	49.86	2,877,121.44
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	30,320	33.55	1,017,236.00
CBS CORP-CL B	77,493	24.31	1,883,854.83
COMCAST CORP-CL A	255,889	24.31	6,220,661.59
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	90,989	22.91	2,084,557.99
DIRECTV-CLASS A	103,510	46.48	4,811,144.80
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-A	16,630	40.01	665,366.30
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-C	18,230	35.66	650,081.80
DISH NETWORK CORP.	25,464	23.28	592,801.92
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	62,125	11.93	741,151.25
LIBERTY GLOBAL INC-A	14,140	42.48	600,667.20
LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	12,963	41.22	534,334.86
MCGRAW-HILL COMPANIES INC	38,251	38.99	1,491,406.49
NEWS CORP-CL A	226,722	17.11	3,879,213.42
NEWS CORPORATION-CLASS B	55,331	18.06	999,277.86
OMNICOM GROUP	37,169	48.07	1,786,713.83
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	11,100	49.39	548,229.00

THE WALT DISNEY CO.	223,229	41.63	9,293,023.27
TIME WARNER CABLE,INC.	43,900	72.14	3,166,946.00
TIME WARNER INC	137,150	35.45	4,861,967.50
VIACOM INC-CLASS B	69,088	47.42	3,276,152.96
VIRGIN MEDIA INC	37,877	27.33	1,035,178.41
WASHINGTON POST CO B	667	441.31	294,353.77
ABERCROMBIE & FITCH CO -CL A	10,371	67.93	704,502.03
ADVANCE AUTO PARTS	10,038	65.64	658,894.32
AMAZON.COM INC	44,482	180.48	8,028,111.36
AMERICAN EAGLE OUTFITTERS INC	24,500	15.74	385,630.00
AUTOZONE INC	3,458	277.77	960,528.66
BED BATH & BEYOND INC	31,549	54.06	1,705,538.94
BEST BUY COMPANY INC	43,226	30.39	1,313,638.14
CARMAX INC	28,322	31.87	902,622.14
DOLLAR GENERAL CORP	12,000	31.81	381,720.00
DOLLAR TREE INC	15,550	55.96	870,178.00
EXPEDIA INC	26,283	24.21	636,311.43
FAMILY DOLLAR STORES	15,236	51.85	789,986.60
GAMESTOP CORP-CL A	18,147	23.80	431,898.60
GAP INC/THE	55,171	22.17	1,223,141.07
GENUINE PARTS CO	19,884	53.94	1,072,542.96
HOME DEPOT INC	206,066	37.76	7,781,052.16
J.C.PENNEY CO INC (HLDG CO)	27,397	37.77	1,034,784.69
KOHL'S CORP	36,157	54.34	1,964,771.38
LIBERTY MEDIA-INTERACTIVE A	72,707	16.67	1,212,025.69
LIMITED BRANDS	34,993	37.16	1,300,339.88
LOWE'S COMPANIES INC	170,525	27.09	4,619,522.25
MACY'S INC	53,048	24.71	1,310,816.08
NORDSTROM INC	21,935	45.84	1,005,500.40
O'REILLY AUTOMOTIVE INC NEW	17,800	56.05	997,690.00
PETSMART INC	15,091	41.38	624,541.03

PRICELINE.COM INC	6,152	512.14	3,150,685.28
ROSS STORES INC	14,936	71.22	1,063,741.92
SEARS HOLDINGS CORP	5,310	78.94	419,171.40
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	11,290	83.88	947,005.20
STAPLES INC	89,776	19.97	1,792,826.72
TARGET CORP	83,119	50.44	4,192,522.36
TIFFANY & CO	15,207	61.48	934,926.36
TJX COMPANIES INC	48,895	51.06	2,496,578.70
URBAN OUTFITTERS,INC.	16,700	31.56	527,052.00
COSTCO WHOLESALE CORP	54,104	76.45	4,136,250.80
CVS CAREMARK CORPORATION	167,953	36.11	6,064,782.83
KROGER CO	74,369	24.11	1,793,036.59
SAFEWAY INC	48,149	24.00	1,155,576.00
SYSCO CORP	72,885	28.45	2,073,578.25
WAL-MART STORES INC	242,740	53.52	12,991,444.80
WALGREEN CO	114,056	41.27	4,707,091.12
WHOLE FOODS MARKET INC	18,000	62.90	1,132,200.00
ALTRIA GROUP INC	258,556	26.70	6,903,445.20
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	78,692	35.54	2,796,713.68
BROWN-FORMAN CORPORATION	10,115	69.53	703,295.95
BUNGE LIMITED	16,738	71.72	1,200,449.36
CAMPBELL SOUP CO	25,579	33.73	862,779.67
COCA-COLA CO/THE	259,237	66.90	17,342,955.30
COCA-COLA ENTERPRISES INC	41,904	27.62	1,157,388.48
CONAGRA FOODS INC	55,563	23.62	1,312,398.06
CONSTELLATION BRANDS INC-A	24,323	21.60	525,376.80
DR.PEPPER SNAPPLE GROUP,INC	27,537	38.67	1,064,855.79
GENERAL MILLS INC	78,914	36.59	2,887,463.26
HANSEN NATURAL CORPORATION	9,600	61.85	593,760.00
HJ HEINZ CO	39,219	49.75	1,951,145.25
HORMEL FOODS CORPORATION	17,400	27.62	480,588.00

JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	14,300	73.83	1,055,769.00
KELLOGG CO	32,134	54.65	1,756,123.10
KRAFT FOODS INC-A	217,511	32.14	6,990,803.54
LORILLARD INC	18,145	97.43	1,767,867.35
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	14,830	47.49	704,276.70
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	24,800	59.39	1,472,872.00
MOLSON COORS BREWING COMPANY	19,925	46.63	929,102.75
PEPSICO INC	196,474	66.57	13,079,274.18
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	225,002	66.04	14,859,132.08
RALCORP HOLDINGS INC	6,450	68.71	443,179.50
REYNOLDS AMERICAN INC	43,544	35.99	1,567,148.56
SARA LEE CORP	75,211	18.38	1,382,378.18
THE HERSHEY COMPANY	20,410	56.30	1,149,083.00
TYSON FOODS INC-CL A	36,900	19.50	719,550.00
AVON PRODUCTS INC	54,213	27.96	1,515,795.48
CHURCH & DWIGHT CO INC	9,200	79.88	734,896.00
CLOROX COMPANY	16,861	70.14	1,182,630.54
COLGATE-PALMOLIVE CO	60,185	82.54	4,967,669.90
ENERGIZER HOLDINGS INC	8,277	69.98	579,224.46
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	14,262	94.50	1,347,759.00
KIMBERLY-CLARK CORP	50,780	65.70	3,336,246.00
PROCTER & GAMBLE CO	347,270	62.89	21,839,810.30
AETNA INC	49,502	37.67	1,864,740.34
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	11,200	98.88	1,107,456.00
AMERISOURCEBERGEN CORP	33,818	39.60	1,339,192.80
BARD(C.R.) INC	11,510	100.50	1,156,755.00
BAXTER INTERNATIONAL INC	72,966	54.32	3,963,513.12
BECKMAN COULTER INC	8,891	83.02	738,130.82
BECTON DICKINSON & CO	28,966	81.37	2,356,963.42
BOSTON SCIENTIFIC CORP	186,125	7.10	1,321,487.50
CARDINAL HEALTH INC	43,190	41.19	1,778,996.10

CAREFUSION CORPORATION	26,745	27.41	733,080.45
CERNER CORP	8,680	108.91	945,338.80
CIGNA CORP	34,411	44.65	1,536,451.15
COVENTRY HEALTH CARE INC	18,113	32.03	580,159.39
COVIDIEN PLC	61,675	52.48	3,236,704.00
DAVITA INC	12,008	86.44	1,037,971.52
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	16,609	36.12	599,917.08
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	14,160	83.26	1,178,961.60
EXPRESS SCRIPTS INC	61,324	56.05	3,437,210.20
HENRY SCHEIN INC	11,150	68.51	763,886.50
HOLOGIC INC	31,080	21.69	674,125.20
HOSPIRA INC	20,233	56.16	1,136,285.28
HUMANA INC.	21,043	70.58	1,485,214.94
INTUITIVE SURGICAL INC	4,949	366.76	1,815,095.24
LABORATORY CRP OF AMR HLDGS	12,996	93.68	1,217,465.28
MCKESSON CORP	31,367	77.60	2,434,079.20
MEDCO HEALTH SOLUTIONS INC	53,322	55.54	2,961,503.88
MEDTRONIC INC	133,854	40.27	5,390,300.58
OMNICARE INC	15,500	30.74	476,470.00
PATTERSON COS INC	10,732	32.95	353,619.40
QUEST DIAGNOSTICS	19,399	57.92	1,123,590.08
ST JUDE MEDICAL INC	43,120	52.12	2,247,414.40
STRYKER CORP	37,053	59.69	2,211,693.57
UNITEDHEALTH GROUP INC	136,552	44.81	6,118,895.12
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	14,767	69.33	1,023,796.11
WELLPOINT INC	49,360	69.74	3,442,366.40
ZIMMER HOLDINGS INC	24,497	59.66	1,461,491.02
ABBOTT LABORATORIES	190,894	51.03	9,741,320.82
ALLERGAN INC	38,708	74.82	2,896,132.56
AMGEN INC	116,493	54.62	6,362,847.66
BIOGEN IDEC INC	30,097	78.19	2,353,284.43

BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	211,939	27.44	5,815,606.16	
CELGENE CORP	58,972	55.35	3,264,100.20	
CEPHALON INC	9,463	76.34	722,405.42	
COVANCE INC	8,500	60.36	513,060.00	
ELI LILLY & CO	127,473	35.84	4,568,632.32	
FOREST LABORATORIES,INC.	35,530	33.90	1,204,467.00	
GILEAD SCIENCES INC	100,114	41.14	4,118,689.96	
HUMAN GENOME SCIENCES INC	23,800	29.41	699,958.00	
ILLUMINA INC	15,900	67.31	1,070,229.00	
JOHNSON & JOHNSON	340,576	59.94	20,414,125.44	
LIFE TECHNOLOGIES CORPORATION	23,215	52.51	1,219,019.65	
MERCK & CO. INC.	381,811	33.56	12,813,577.16	
MYLAN INC	52,900	23.48	1,242,092.00	
PERRIGO CO	10,200	85.40	871,080.00	
PFIZER INC	993,066	20.46	20,318,130.36	
PHARMACEUTICAL PRODUCT DEVELOPMENT INC	14,700	30.78	452,466.00	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	49,126	55.44	2,723,545.44	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	24,808	47.97	1,190,039.76	
WARNER CHILCOTT PLC	16,000	23.74	379,840.00	
WATERS CORP	11,321	87.16	986,738.36	
WATSON PHARMACEUTICALS INC	15,900	57.69	917,271.00	
BB & T CORPORATION	85,063	27.27	2,319,668.01	
COMERICA INC	22,150	38.44	851,446.00	
FIFTH THIRD BANCORP	115,838	13.66	1,582,347.08	
HUDSON CITY BANCORP INC	59,969	9.80	587,696.20	
KEYCORP	114,915	8.77	1,007,804.55	
M & T BANK CORP	10,228	87.16	891,472.48	
MARSHALL & ILSLEY CORPORATION	59,652	7.94	473,636.88	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	52,300	17.14	896,422.00	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	45,000	12.85	578,250.00	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	64,701	63.13	4,084,574.13	

REGIONS FINANCIAL CORPORATION	157,470	7.27	1,144,806.90
SUNTRUST BANKS INC	66,603	29.60	1,971,448.80
US BANCORP	237,090	26.36	6,249,692.40
WELLS FARGO & COMPANY	618,432	31.40	19,418,764.80
AMERICAN EXPRESS COMPANY	134,177	46.02	6,174,825.54
AMERIPRISE FINANCIAL INC	30,751	62.05	1,908,099.55
BANK OF AMERICA CORP	1,250,579	13.47	16,845,299.13
BANK OF NEW YORK MELLON CORP(THE)	154,701	29.96	4,634,841.96
BLACKROCK INC	11,100	194.78	2,162,058.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	57,386	51.62	2,962,265.32
CIT GROUP INC	23,700	40.12	950,844.00
CITIGROUP INC	3,601,518	4.55	16,386,906.90
CME GROUP INC.	8,330	301.67	2,512,911.10
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	66,681	24.06	1,604,344.86
EATON VANCE CORP	15,000	32.60	489,000.00
FRANKLIN RESOURCES INC	19,375	124.08	2,404,050.00
GOLDMAN SACHS GROUP INC	60,169	160.42	9,652,310.98
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	7,708	120.48	928,659.84
INVESCO LIMITED	57,239	24.84	1,421,816.76
JEFFERIES GROUP INC	13,400	24.66	330,444.00
JPMORGAN CHASE & CO	484,863	46.64	22,614,010.32
LEGG MASON INC	18,803	36.83	692,514.49
LEUCADIA NATIONAL CORPORATION	24,856	36.40	904,758.40
MOODY'S CORP	25,616	35.20	901,683.20
MORGAN STANLEY	169,305	26.81	4,539,067.05
NASDAQ STOCK MARKET INC	16,080	27.79	446,863.20
NORTHERN TRUST CORP	27,505	51.96	1,429,159.80
NYSE EURONEXT	32,129	37.85	1,216,082.65
SCHWAB (CHARLES) CORP	126,052	18.25	2,300,449.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	17,324	23.17	401,397.08
SLM CORPORATION	58,561	14.74	863,189.14



STATE STREET CORP	63,067	46.16	2,911,172.72
T ROWE PRICE GROUP INC	31,262	66.52	2,079,548.24
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	28,294	21.59	610,867.46
ACE LIMITED	42,608	66.61	2,838,118.88
AFLAC INC	58,445	53.12	3,104,598.40
ALLSTATE CORP	63,433	31.61	2,005,117.13
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	10,500	34.08	357,840.00
AON CORPORATION	37,439	52.21	1,954,690.19
ARCH CAPITAL GROUP LTD.	5,700	101.79	580,203.00
ASSURANT INC	13,289	37.73	501,393.97
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	14,803	36.30	537,348.90
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	109,000	81.68	8,903,120.00
CHUBB CORP	37,391	61.73	2,308,146.43
CINCINNATI FINANCIAL CORP	20,333	32.47	660,212.51
EVEREST RE GROUP LTD	6,903	91.14	629,139.42
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL INC-CL A	24,561	14.76	362,520.36
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	60,800	12.68	770,944.00
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	51,486	26.73	1,376,220.78
LINCOLN NATIONAL CORP	39,427	29.61	1,167,433.47
LOEWS CORPORATION	41,710	42.51	1,773,092.10
MARSH & MCLENNAN COS	66,156	29.29	1,937,709.24
METLIFE INC	130,063	44.77	5,822,920.51
OLD REPUBLIC INTL CORP	32,961	12.98	427,833.78
PARTNERRE LTD	9,068	80.84	733,057.12
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	39,900	31.46	1,255,254.00
PROGRESSIVE CORP	76,883	21.38	1,643,758.54
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	59,464	61.57	3,661,198.48
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	6,763	70.77	478,617.51
TORCHMARK CORPORATION	9,939	66.90	664,919.10
TRANSATLANTIC HOLDINGS INC	8,000	49.20	393,600.00
TRAVELERS COS INC(THE)	56,528	59.69	3,374,156.32

UNUM GROUP	38,870	26.28	1,021,503.60
VALIDUS HOLDINGS LTD	7,600	33.60	255,360.00
W.R.BERKLEY CORPORATION	17,343	31.72	550,119.96
WHITE MOUNTAINS INSURANCE GROUP LTD.	830	374.99	311,241.70
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	20,198	40.22	812,363.56
XL GROUP PLC	39,300	24.83	975,819.00
CB RICHARD ELLIS GROUP INC-A	36,000	27.47	988,920.00
ACCENTURE PLC-CL A	78,823	55.84	4,401,476.32
ACTIVISION BLIZZARD INC	69,020	11.02	760,600.40
ADOBE SYSTEMS INC	63,216	34.09	2,155,033.44
AKAMAI TECHNOLOGIES	21,706	36.98	802,687.88
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	5,950	83.80	498,610.00
AUTODESK INC	28,034	42.36	1,187,520.24
AUTOMATIC DATA PROCESSING	60,776	52.04	3,162,783.04
BMC SOFTWARE INC	22,078	50.17	1,107,653.26
CA INC	50,913	23.83	1,213,256.79
CITRIX SYSTEMS INC	22,998	73.65	1,693,802.70
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATION	37,205	79.92	2,973,423.60
COMPUTER SCIENCES CORP	19,862	48.72	967,676.64
EBAY INC	146,231	30.70	4,489,291.70
ELECTRONIC ARTS INC	42,181	19.74	832,652.94
F5 NETWORKS INC	10,240	93.77	960,204.80
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	30,712	33.00	1,013,496.00
FISERV INC	18,876	61.97	1,169,745.72
GOOGLE INC-CL A	30,811	570.61	17,581,064.71
INTL BUSINESS MACHINES CORP	154,026	163.25	25,144,744.50
INTUIT INC	37,122	52.78	1,959,299.16
LENDER PROCESSING SERVICES,INC.	11,400	31.19	355,566.00
MASTERCARD INC-CL A	13,724	262.96	3,608,863.04
MICROSOFT CORP	954,602	25.64	24,475,995.28
NUANCE COMMUNICATIONS INC	30,500	19.17	584,685.00

ORACLE CORPORATION	498,829	33.40	16,660,888.60
PAYCHEX INC	39,344	32.27	1,269,630.88
RED HAT INC	23,300	44.59	1,038,947.00
SAIC INC	37,400	17.32	647,768.00
SALESFORCE.COM,INC.	14,485	132.82	1,923,897.70
SYMANTEC CORPORATION	96,613	18.25	1,763,187.25
SYNOPSYS INC	18,684	26.92	502,973.28
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	21,919	18.27	400,460.13
VERISIGN INC	22,318	36.85	822,418.30
VISA INC	61,316	77.03	4,723,171.48
VMWARE INC	9,400	84.91	798,154.00
WESTERN UNION COMPANY	83,446	20.68	1,725,663.28
YAHOO! INC	152,510	16.36	2,495,063.60
AGILENT TECHNOLOGIES INC	42,658	44.94	1,917,050.52
AMPHENOL CORPORATION -CL A	22,144	52.07	1,153,038.08
APPLE INC	113,737	332.40	37,806,178.80
ARROW ELECTRONICS INC	14,290	41.91	598,893.90
AVAGO TECHNOLOGIES LTD.	22,900	31.37	718,373.00
AVNET INC	18,700	33.21	621,027.00
CISCO SYSTEMS INC	686,731	17.44	11,976,588.64
CORNING INC	193,702	19.18	3,715,204.36
DELL INC	216,852	14.70	3,187,724.40
DOLBY LABORATORIES INC-CL A	5,800	50.27	291,566.00
EMC CORP/MASS	254,903	25.85	6,589,242.55
FLEXTRONICS INTL LTD	90,331	6.96	628,703.76
FLIR SYSTEMS INC	18,640	33.24	619,593.60
HARRIS CORP	16,650	50.22	836,163.00
HEWLETT-PACKARD CO	281,394	41.08	11,559,665.52
JUNIPER NETWORKS INC	65,123	37.85	2,464,905.55
MOTOROLA MOBILITY HOLDINGS INC	33,197	23.26	772,162.22
MOTOROLA SOLUTIONS INC	40,297	43.85	1,767,023.45

NETAPP INC	43,944	47.83	2,101,841.52
QUALCOMM INC	200,520	52.25	10,477,170.00
SANDISK CORP	29,500	46.01	1,357,295.00
SEAGATE TECHNOLOGY	59,968	16.10	965,484.80
TE CONNECTIVITY LTD	55,629	33.70	1,874,697.30
TERADATA CORP	20,077	49.49	993,610.73
WESTERN DIGITAL CORP	29,223	38.13	1,114,272.99
XEROX CORP	172,540	10.76	1,856,530.40
AMERICAN TOWER CORPORATION -CL A	50,109	49.63	2,486,909.67
AT&T INC	733,151	30.47	22,339,110.97
CENTURYLINK INC	74,241	39.83	2,957,019.03
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	35,522	42.48	1,508,974.56
FRONTIER COMMUNICATIONS CORPORATION	120,980	7.99	966,630.20
METROPCS COMMUNICATIONS INC.	32,700	16.75	547,725.00
NII HOLDINGS INC	21,479	39.07	839,184.53
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	13,000	38.55	501,150.00
SPRINT NEXTEL CORP	363,323	4.80	1,743,950.40
TELEPHONE AND DATA SYSTEMS	6,500	32.90	213,850.00
VERIZON COMMUNICATIONS INC	350,520	37.64	13,193,572.80
WINDSTREAM CORPORATION	58,500	12.51	731,835.00
AES CORPORATION	85,066	12.64	1,075,234.24
ALLIANT ENERGY CORP	14,248	38.20	544,273.60
AMEREN CORPORATION	29,424	28.21	830,051.04
AMERICAN ELECTRIC POWER	60,050	34.59	2,077,129.50
AMERICAN WATER WORKS CO INC	21,800	27.90	608,220.00
CALPINE CORP	43,100	16.04	691,324.00
CENTERPOINT ENERGY INC	49,409	17.23	851,317.07
CONSOLIDATED EDISON INC	36,147	49.97	1,806,265.59
CONSTELLATION ENERGY GROUP	24,023	32.92	790,837.16
DOMINION RESOURCES INC/VA	71,225	43.60	3,105,410.00
DTE ENERGY COMPANY	21,673	48.35	1,047,889.55

DUKE ENERGY CORP	164,369	17.99	2,956,998.31
EDISON INTERNATIONAL	38,953	37.92	1,477,097.76
ENERGEN CORPORATION	8,700	59.90	521,130.00
ENTERGY CORP	22,679	65.36	1,482,299.44
EQT CORPORATION	18,180	46.63	847,733.40
EXELON CORP	82,556	39.77	3,283,252.12
FIRSTENERGY CORP	52,276	37.00	1,934,212.00
INTEGRYS ENERGY GROUP,INC.	10,400	49.39	513,656.00
MDU RESOURCES GROUP INC	23,200	22.58	523,856.00
NEXTERA ENERGY INC	48,360	55.12	2,665,603.20
NISOURCE INC	33,692	18.73	631,051.16
NORTHEAST UTILITIES	21,800	34.07	742,726.00
NRG ENERGY INC	29,725	21.34	634,331.50
NSTAR	12,000	44.50	534,000.00
ONEOK INC	12,400	64.40	798,560.00
P G & E CORPORATION	49,074	43.74	2,146,496.76
PEPCO HOLDINGS INC	28,834	18.21	525,067.14
PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	13,444	42.08	565,723.52
PPL CORPORATION	58,844	26.88	1,581,726.72
PROGRESS ENERGY INC	36,876	45.27	1,669,376.52
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	61,548	30.58	1,882,137.84
QEP RESOURCES INC	22,311	38.03	848,487.33
SCANA CORP	14,663	38.62	566,285.06
SEMPRA ENERGY	28,661	52.57	1,506,708.77
SOUTHERN CO	102,118	37.48	3,827,382.64
WISCONSIN ENERGY CORP	27,832	29.60	823,827.20
XCEL ENERGY INC	55,812	23.47	1,309,907.64
ADVANCED MICRO DEVICES	73,485	8.26	606,986.10
ALTERA CORPORATION	38,570	41.69	1,607,983.30
ANALOG DEVICES	37,305	37.75	1,408,263.75
APPLIED MATERIALS INC	167,129	15.03	2,511,948.87

BROADCOM CORP-CL A	56,122	38.10	2,138,248.20	
CREE INC	12,500	42.98	537,250.00	
INTEL CORP	691,922	19.76	13,672,378.72	
KLA-TENCOR CORPORATION	20,924	42.36	886,340.64	
LAM RESEARCH CORP	14,764	51.94	766,842.16	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	28,658	32.57	933,391.06	
LSI CORPORATION	78,857	6.47	510,204.79	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	68,074	15.85	1,078,972.90	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	36,400	24.66	897,624.00	
MEMC ELECTRONIC MATERIALS	26,206	11.90	311,851.40	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	22,608	37.09	838,530.72	
MICRON TECHNOLOGY INC	113,241	10.53	1,192,427.73	
NATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	28,892	24.13	697,163.96	
NVIDIA CORP	70,194	17.37	1,219,269.78	
TEXAS INSTRUMENTS INC	145,741	34.14	4,975,597.74	
XILINX INC	32,753	30.64	1,003,551.92	
米ドル 小計	40,355,567		1,516,409,099.48	
( 邦貨換算額 )			(127,393,528,447)	( 単位：円 )
カナダドル				
ARC RESOURCES LTD	36,000	25.06	902,160.00	
ATHABASCA OIL SANDS CORP	26,000	15.82	411,320.00	
BAYTEX ENERGY CORPORATION	14,600	56.24	821,104.00	
BONAVISTA ENERGY CORPORATION	17,300	28.58	494,434.00	
CAMECO CORP	49,060	27.16	1,332,469.60	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	134,490	44.34	5,963,286.60	
CANADIAN OIL SANDS LTD	60,059	31.02	1,863,030.18	
CENOVUS ENERGY INC	93,348	36.11	3,370,796.28	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	29,900	44.37	1,326,663.00	
ENBRIDGE INC	44,429	59.46	2,641,748.34	
ENCANA CORP	91,448	31.60	2,889,756.80	

ENERPLUS CORP	21,790	29.51	643,022.90
HUSKY ENERGY INC	30,742	27.80	854,627.60
IMPERIAL OIL LTD	36,464	50.05	1,825,023.20
MEG ENERGY CORPORATION	5,100	47.67	243,117.00
NEXEN INC	64,408	22.62	1,456,908.96
NIKO RESOURCES LTD	5,880	88.76	521,908.80
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORPORATION	31,100	28.27	879,197.00
PENGROWTH ENERGY CORPORATION	42,200	13.04	550,288.00
PENN WEST PETROLEUM LTD	56,767	25.18	1,429,393.06
PETROBAKKEN ENERGY LTD-A	11,100	17.70	196,470.00
PROGRESS ENERGY RESOURCES CORP	21,400	13.11	280,554.00
SUNCOR ENERGY INC	193,392	42.05	8,132,133.60
TALISMAN ENERGY INC	127,532	22.33	2,847,789.56
TRANSCANADA CORP	85,877	39.37	3,380,977.49
VERMILION ENERGY INC	10,500	49.89	523,845.00
AGNICO-EAGLE MINES	20,650	62.61	1,292,896.50
AGRIUM INC	19,223	85.69	1,647,218.87
BARRICK GOLD CORP	121,739	50.35	6,129,558.65
CENTERRA GOLD INC	21,000	17.26	362,460.00
ELDORADO GOLD CORPORATION	70,500	16.68	1,175,940.00
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	10,700	124.90	1,336,430.00
FRANCO-NEVADA CORPORATION	15,500	35.15	544,825.00
GOLDCORP INC	98,099	50.98	5,001,087.02
IAMGOLD CORP	43,500	21.08	916,980.00
INMET MINING CORPORATION	6,322	70.64	446,586.08
IVANHOE MINES LTD	39,400	25.95	1,022,430.00
KINROSS GOLD CORP	141,424	15.09	2,134,088.16
OSISKO MINING CORPORATION	43,000	12.42	534,060.00
PAN AMERICAN SILVER CORP	11,972	38.69	463,196.68
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	110,664	53.99	5,974,749.36
SHERRITT INTERNATIONAL CORPORATION	36,500	7.75	282,875.00

SILVER WHEATON CORPORATION	40,600	40.84	1,658,104.00
SINO-FOREST CORPORATION-CL A	30,871	23.91	738,125.61
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	72,117	51.87	3,740,708.79
YAMANA GOLD INC	90,570	12.12	1,097,708.40
BOMBARDIER INC 'B'	173,959	6.77	1,177,702.43
CAE INC	32,014	12.36	395,693.04
FINNING INTERNATIONAL INC	21,750	28.40	617,700.00
SNC-LAVALIN GROUP INC	18,381	53.40	981,545.40
RITCHIE BROS. AUCTIONEERS	12,400	26.50	328,600.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	57,434	70.94	4,074,367.96
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	21,286	60.12	1,279,714.32
MAGNA INTERNATIONAL INC	27,412	43.66	1,196,807.92
GILDAN ACTIVEWEAR INC	13,400	32.80	439,520.00
TIM HORTONS INC	21,500	44.85	964,275.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	43,506	20.57	894,918.42
THOMSON REUTERS CORP	45,378	37.82	1,716,195.96
YELLOW MEDIA INC	69,500	4.81	334,295.00
CANADIAN TIRE CORP -CL A	9,758	61.80	603,044.40
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B	16,600	25.65	425,790.00
EMPIRE CO LTD A	3,200	53.61	171,552.00
LOBLAW COMPANIES LTD	14,333	38.69	554,543.77
METRO INC -A	12,500	45.85	573,125.00
SHOPPERS DRUG MART CORP	27,620	40.70	1,124,134.00
WESTON (GEORGE) LTD	6,480	67.07	434,613.60
SAPUTO INC	17,240	41.93	722,873.20
VITERRA INC	45,000	11.58	521,100.00
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	34,793	50.64	1,761,917.52
BANK OF MONTREAL	70,479	61.90	4,362,650.10
BANK OF NOVA SCOTIA	133,451	57.50	7,673,432.50
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	48,822	83.20	4,061,990.40
NATIONAL BANK OF CANADA	20,561	76.14	1,565,514.54



ROYAL BANK OF CANADA	176,632	59.80	10,562,593.60	
TORONTO-DOMINION BANK	108,283	82.67	8,951,755.61	
CI FINANCIAL CORP	19,200	22.72	436,224.00	
IGM FINANCIAL INC	14,001	47.70	667,847.70	
ONEX CORPORATION	10,723	33.03	354,180.69	
TMX GROUP INC	9,421	39.84	375,332.64	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,560	380.60	974,336.00	
GREAT-WEST LIFECO INC	34,904	26.43	922,512.72	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANC	11,000	41.20	453,200.00	
INTACT FINANCIAL CORPORATION	13,900	50.40	700,560.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	218,745	16.46	3,600,542.70	
POWER CORP OF CANADA	42,760	28.13	1,202,838.80	
POWER FINANCIAL CORP	31,786	30.54	970,744.44	
SUN LIFE FINANCIAL INC	70,583	29.71	2,097,020.93	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	69,193	30.44	2,106,234.92	
BROOKFIELD PROPERTIES CORP	32,363	17.91	579,621.33	
CGI GROUP INC - CL A	27,587	20.21	557,533.27	
OPEN TEXT CORPORATION	7,500	58.78	440,850.00	
RESEARCH IN MOTION	58,301	51.63	3,010,080.63	
BCE INC	31,120	35.61	1,108,183.20	
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	53,100	35.04	1,860,624.00	
TELUS CORPORATION	4,400	48.71	214,324.00	
TELUS CORPORATION -NON VOTE	20,897	46.59	973,591.23	
CANADIAN UTILITIES LIMITED	10,800	52.69	569,052.00	
FORTIS INC	20,940	32.00	670,080.00	
TRANSALTA CORP	27,268	20.32	554,085.76	
カナダドル 小計	4,531,961		166,153,619.74	
( 邦貨換算額 )			(14,510,195,611)	( 単位 : 円 )
ユーロ				
COMPAGNIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE-VERITA	17,550	23.51	412,688.25	

ENI SPA	322,483	17.31	5,582,180.73
FUGRO NV-CVA	8,345	61.95	516,972.75
GALP ENERGIA SGPS S.A	27,000	15.25	411,750.00
NESTE OIL OYJ	16,085	13.89	223,420.65
OMV AG	18,889	31.14	588,203.46
REPSOL YPF SA	90,590	23.83	2,159,212.65
SAIPEM	33,320	37.07	1,235,172.40
SBM OFFSHORE NV	20,087	19.68	395,412.59
TECHNIP S.A.	12,569	75.49	948,833.81
TENARIS S.A.	57,769	17.00	982,073.00
TOTAL SA	261,796	41.94	10,979,724.24
ACERINOX SA	13,536	13.51	182,871.36
AIR LIQUIDE	34,958	94.01	3,286,401.58
AKZO NOBEL	28,416	49.63	1,410,286.08
ARCELOR MITTAL	107,548	24.72	2,658,586.56
BASF SE	113,763	62.59	7,120,426.17
CIMPOR-CIMENTOS DE PORTUGAL	20,500	4.97	102,069.50
CRH PLC	92,080	15.97	1,470,517.60
ERAMET	570	259.75	148,057.50
HEIDELBERGCEMENT AG	17,500	48.43	847,612.50
IMERYS SA	4,515	52.97	239,159.55
K+S AG	18,120	53.30	965,796.00
KONINKLIJKE DSM NV	19,481	43.19	841,481.79
LAFARGE SA	25,332	44.72	1,132,973.70
LANXESS	10,000	55.73	557,300.00
LINDE AG	20,831	113.85	2,371,609.35
OUTOKUMPU OYJ	15,029	11.99	180,197.71
RAUTARUUKKI OYJ	9,673	16.81	162,603.13
SALZGITTER AG	5,570	54.93	305,960.10
SOLVAY SA	7,035	89.26	627,944.10
STORA ENSO OYJ-R SHS	72,712	8.44	614,052.84

THYSSENKRUPP AG	42,158	29.40	1,239,655.99
UMICORE	14,450	35.34	510,735.25
UPM-KYMMENE OYJ	63,776	14.66	934,956.16
VOESTALPINE AG	13,753	32.73	450,135.69
WACKER CHEMIE AG	1,800	162.90	293,220.00
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	18,235	32.45	591,725.75
ALSTOM RGPT	24,913	43.43	1,082,096.15
BEKAERT NV	5,000	77.40	387,000.00
BOSKALIS WESTMINSTER NV	8,800	36.07	317,416.00
BOUYGUES	29,131	33.45	974,431.95
BRENNTAG AG	3,800	80.90	307,420.00
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	48,823	44.67	2,180,923.41
EIFFAGE SA	5,600	42.82	239,820.00
EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	51,080	20.65	1,055,057.40
FINMECCANICA SPA	49,089	8.80	432,228.64
FOMENTO DE CONSTRUC Y CONTRA	5,502	23.34	128,416.68
GEA GROUP AG	20,300	23.18	470,554.00
HOCHTIEF AG	5,337	65.06	347,225.22
KONE OYJ-B	19,300	41.34	797,862.00
LEGRAND SA	20,100	28.55	573,855.00
MAN SE	13,493	88.62	1,195,749.66
METSO OYJ	16,471	36.00	592,956.00
PHILIPS ELECTRONICS NV	121,845	21.31	2,596,516.95
PRYSMIAN SPA	25,400	15.32	389,128.00
SAFRAN SA	21,277	23.18	493,307.24
SCHNEIDER ELECTRIC SA	30,307	112.90	3,421,660.30
SIEMENS AG-REG	101,951	93.01	9,482,462.51
THALES SA	10,475	28.38	297,332.87
VALLOUREC	13,900	81.51	1,132,989.00
VINCI S.A.	54,463	42.79	2,330,744.08
WARTSILA OYJ-B SHARES	19,702	26.38	519,738.76

ZARDOYA OTIS SA	19,500	11.46	223,470.00
BIC	3,400	60.58	205,972.00
BUREAU VERITAS SA	5,720	55.43	317,059.60
EDENRED	19,367	20.46	396,248.82
RANDSTAD HOLDING NV	14,298	37.29	533,172.42
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	36,110	15.50	559,705.00
AEROPORTS DE PARIS (ADP)	3,800	61.31	232,978.00
AIR FRANCE-KLM	14,827	11.56	171,400.12
ATLANTIA SPA	36,826	15.82	582,587.32
BRISA	26,718	4.75	126,910.50
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	28,179	14.88	419,303.52
DEUTSCHE POST AG-REG	103,648	12.74	1,320,993.76
FERROVIAL SA	54,368	8.99	489,094.52
FRAPORT AG	5,000	50.60	253,000.00
GROUPE EUROTUNNEL SA	66,000	7.06	466,488.00
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP	109,344	2.53	276,968.35
RYANAIR HOLDINGS PLC	1,656	3.44	5,696.64
TNT NV	46,593	16.50	768,784.50
VOPAK	9,100	34.05	309,855.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	41,246	56.64	2,336,173.44
BAYERISCHE MOTOREN WERKE(BMW)AG-PFD	7,041	38.80	273,190.80
CONTINENTAL AG	6,500	59.50	386,750.00
DAIMLER AG	111,623	50.47	5,633,612.81
FIAT INDUSTRIAL SPA	97,516	9.67	943,467.30
FIAT SPA	97,516	6.43	627,515.46
MICHELIN (CGDE)-B	21,845	59.59	1,301,743.55
NOKIAN RENKAAT OYJ	13,997	32.30	452,103.10
PEUGEOT SA	19,655	27.53	541,200.42
PIRELLI & C.	24,852	6.34	157,561.68
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PREF	18,865	43.34	817,609.10
RENAULT SA	24,225	37.75	914,493.75

VOLKSWAGEN AG	3,444	102.15	351,804.60
VOLKSWAGEN AG PFD	21,225	108.65	2,306,096.25
ADIDAS AG	25,924	45.13	1,170,079.74
CHRISTIAN DIOR SA	8,080	97.10	784,568.00
LUXOTTICA GROUP SPA	15,130	21.81	329,985.30
LVMH MOET HENNESSY LOUI V SA	30,388	109.80	3,336,602.40
PUMA AG	666	200.00	133,200.00
ACCOR SA	18,267	30.18	551,298.06
AUTOGRILL SPA	13,200	9.63	127,182.00
OPAP SA	26,506	15.00	397,590.00
SODEXO	12,086	51.81	626,175.66
TUI AG	15,500	8.64	134,044.00
AXEL SPRINGER AG	1,800	114.10	205,380.00
EUTELSAT COMMUNICATIONS	11,600	28.06	325,496.00
GESTEVISION TELECINCO SA	22,600	8.08	182,608.00
JC DECAUX S.A.	7,300	22.95	167,535.00
KABEL DEUTSCHLAND HOLDINGS AG	6,800	38.80	263,840.00
LAGARDERE S.C.A.	14,571	30.07	438,149.97
M6-METROPOLE TELEVISION	8,300	18.10	150,230.00
MEDIASET SPA	86,634	4.46	386,560.90
PAGESJAUNES SA	19,000	7.01	133,361.00
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-PFD	10,000	18.95	189,500.00
PUBLICIS GROUPE	15,200	38.22	581,020.00
REED ELSEVIER NV	86,196	8.97	773,781.49
SANOMA OYJ	10,500	14.02	147,210.00
SES	37,296	18.24	680,465.52
TELEVISION FRANCAISE (T.F.1)	13,376	12.96	173,419.84
VIVENDI SA	152,577	20.51	3,130,117.15
WOLTERS KLUWER-CVA	35,542	16.27	578,446.05
INDITEX	27,253	58.95	1,606,564.35
PPR	9,266	112.70	1,044,278.20

CARREFOUR SA	75,116	31.00	2,328,596.00
CASINO GUICHARD PERRACHON	6,840	70.32	480,988.80
COLRUYT NV	8,945	37.60	336,376.72
DELHAIZE GROUP	12,078	59.03	712,964.34
JERONIMO MARTINS SGPS S.A.	27,800	11.08	308,024.00
KESKO OYJ-B SHS	8,334	31.60	263,354.40
KONINKLIJKE AHOLD NV	148,797	9.62	1,432,617.51
METRO AG	16,429	48.87	802,967.37
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	90,444	40.93	3,701,872.92
COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	22,629	19.50	441,265.50
DANONE	71,960	46.25	3,328,509.80
HEINEKEN HOLDING NV	13,939	34.52	481,174.28
HEINEKEN NV	31,500	39.09	1,231,335.00
KERRY GROUP PLC-A	21,598	26.75	577,854.49
PARMALAT SPA	215,000	2.28	490,630.00
PERNOD-RICARD SA	24,577	64.56	1,586,691.12
SUEDZUCKER AG	8,500	20.23	171,955.00
UNILEVER NV-CVA	203,320	22.18	4,510,654.20
BEIERSDORF AG	12,440	43.29	538,527.60
HENKEL AG & CO KGAA	15,800	36.48	576,463.00
HENKEL AG & CO KGAA	21,478	43.45	933,219.10
L'OREAL	29,550	82.26	2,430,783.00
BIOMERIEUX	1,100	71.80	78,980.00
CELESIO AG	9,104	16.75	152,492.00
ESSILOR INTERNATIONAL	25,503	53.78	1,371,551.34
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	24,440	48.80	1,192,794.20
FRESENIUS SE & CO KGAA	13,120	67.51	885,731.20
BAYER AG	102,503	54.75	5,612,039.25
ELAN CORPORATION PLC	76,166	5.23	398,348.18
GRIFOLS S.A.	16,200	12.65	204,930.00
MERCK KGAA	8,381	65.45	548,536.45

ORION OYJ	11,098	16.11	178,788.78
QIAGEN N.V.	27,400	13.81	378,531.00
SANOFI-AVENTIS	130,036	51.19	6,656,542.84
UCB SA	11,497	28.07	322,720.79
ALPHA BANK A.E.	58,321	4.53	264,194.13
ANGLO IRISH BANK CORPORATION PLC	96,000	0.00	96.00
BANCA CARIGE S.P.A	84,000	1.72	144,900.00
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	258,414	0.96	248,465.06
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	535,084	8.71	4,662,186.89
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA-RTS	535,084	0.14	78,657.34
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	308,402	0.58	181,031.97
BANCO DE SABADELL SA	134,475	3.15	423,730.72
BANCO DE VALENCIA SA	30,520	3.09	94,459.40
BANCO ESPIRITO SANTO,S.A(BES)	72,900	2.90	211,920.30
BANCO POPOLARE SPA	202,182	2.15	436,308.75
BANCO POPULAR ESPANOL	113,047	4.36	493,224.06
BANCO SANTANDER SA	1,027,841	8.52	8,766,455.88
BANK OF CYPRUS PUBLIC CO LTD	112,500	2.46	276,750.00
BANKINTER,S.A.	37,500	5.38	201,750.00
BANKINTER,S.A.-RTS	37,500	0.01	562.50
BNP PARIBAS	118,803	53.39	6,342,892.17
COMMERZBANK AG	101,843	4.93	502,493.36
CREDIT AGRICOLE SA	118,690	11.70	1,388,673.00
DEXIA	57,950	2.88	166,896.00
EFG EUROBANK ERGASIAS	44,991	4.10	184,463.10
ERSTE GROUP BANK AG	24,013	35.41	850,300.33
INTESA SANPAOLO	946,490	2.25	2,129,602.50
INTESA SANPAOLO-RNC	108,503	1.96	213,208.39
KBC GROUPE SA	20,251	27.98	566,622.98
NATIONAL BANK OF GREECE S,A.	120,339	5.96	717,220.44
NATIXIS	103,000	4.08	420,652.00

RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	5,750	39.00	224,250.00
SOCIETE GENERALE	78,679	46.45	3,655,032.94
UNICREDIT SPA	1,662,241	1.76	2,935,517.60
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	78,394	6.18	484,474.92
AGEAS	283,000	2.12	599,960.00
CNP-CIE NATL A PORTEFEUILLE	3,700	48.85	180,745.00
CRITERIA CAIXACORP SA	103,507	5.04	521,675.28
DEUTSCHE BANK AG -REG	115,626	42.00	4,856,292.00
DEUTSCHE BOERSE AG	23,997	54.35	1,304,236.95
EURAZEO	3,400	55.74	189,516.00
EXOR SPA	7,897	21.79	172,075.63
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	9,955	67.04	667,383.20
ING GROEP NV-CVA	475,942	9.07	4,316,793.94
MEDIOBANCA SPA	58,668	7.84	460,250.46
POHJOLA BANK PLC	17,903	10.12	181,178.36
AEGON NV	213,788	5.45	1,165,358.38
ALLIANZ SE-REG	56,329	103.55	5,832,867.95
ASSICURAZIONI GENERALI	145,651	16.05	2,337,698.55
AXA SA	212,394	15.55	3,302,726.70
CNP ASSURANCES	19,484	15.72	306,385.90
DELTA LLOYD NV	9,600	17.53	168,336.00
HANNOVER RUECKVERSICHERUNGS AG	7,400	40.25	297,850.00
MAPFRE SA	93,649	2.75	258,002.99
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	23,434	115.40	2,704,283.60
SAMPO OYJ-A SHS	51,654	23.68	1,223,166.72
SCOR SE	20,958	19.32	404,908.56
VIENNA INSURANCE GROUP AG WIENER VERSICH	4,800	41.33	198,384.00
IMMOFINANZ AG	125,000	3.10	387,500.00
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	23,700	13.68	324,334.50
ATOS ORIGIN	5,731	41.05	235,286.20
CAP GEMINI SA	18,304	40.87	748,176.00



DASSAULT SYSTEMES SA	7,233	53.24	385,084.92
INDRA SISTEMAS SA	11,128	14.41	160,410.12
SAP AG	106,120	43.50	4,616,220.00
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	15,500	12.36	191,657.50
ALCATEL-LUCENT	287,916	3.76	1,084,003.74
NEOPOST SA	3,718	60.38	224,492.84
NOKIA OYJ	464,267	6.08	2,825,064.69
BELGACOM SA	19,531	27.40	535,149.40
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	350,942	11.02	3,867,380.84
ELISA OYJ	14,722	15.70	231,135.40
FRANCE TELECOM SA	229,920	15.69	3,607,444.80
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	26,349	7.78	204,995.22
ILIAD SA	2,000	86.70	173,400.00
KONINKLIJKE KPN NV	195,875	11.72	2,296,634.37
MOBISTAR SA	3,264	49.64	162,041.28
PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	73,352	8.17	599,285.84
TELECOM ITALIA SPA	1,155,901	1.06	1,226,410.96
TELECOM ITALIA-RNC	762,811	0.94	719,330.77
TELEFONICA S.A.	509,272	18.05	9,194,905.96
TELEKOM AUSTRIA AG	42,826	10.18	435,968.68
A2A S.P.A.	131,000	1.16	152,222.00
ACCIONA S.A.	3,430	77.81	266,888.30
E.ON AG	223,082	22.35	4,986,998.11
EDP RENOVAVEIS SA	27,000	5.17	139,806.00
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	238,624	2.76	658,602.24
ELECTRICITE DE FRANCE(EDF)	31,149	27.61	860,179.63
ENAGAS	21,000	16.09	337,890.00
ENEL GREEN POWER SPA	213,000	2.02	430,686.00
ENEL SPA	812,547	4.54	3,690,588.47
FORTUM OYJ	55,281	23.42	1,294,681.02
GAS NATURAL SDG SA	42,046	13.62	572,666.52

GDF SUEZ	153,405	27.21	4,174,150.05	
IBERDROLA RENOVABLES	99,000	3.08	305,316.00	
IBERDROLA SA	469,845	6.24	2,934,182.02	
PUBLIC POWER CORP	16,106	11.67	187,957.02	
RED ELECTRICA CORPORATION S.A.	13,100	39.92	523,017.50	
RWE AG	52,030	46.75	2,432,402.50	
RWE AG-NON VTG PFD	4,813	44.66	214,948.58	
SNAM RETE GAS	179,283	4.03	723,944.75	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	33,900	14.50	491,550.00	
TERNA SPA	164,846	3.39	559,487.32	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	43,830	22.00	964,260.00	
VERBUND AG	7,970	30.89	246,193.30	
ASML HOLDING NV	53,482	29.41	1,573,173.03	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	137,000	7.01	960,370.00	
STMICROELECTRONICS NV	82,805	8.25	683,555.27	
ユーロ 小計	22,764,466		308,248,480.01	
( 邦貨換算額 )			(37,486,097,654)	( 単位 : 円 )
英ポンド				
AMEC PLC	38,935	11.69	455,150.15	
BG GROUP PLC	419,545	14.88	6,242,829.60	
BP PLC	2,332,084	4.61	10,759,069.53	
CAIRN ENERGY PLC	176,000	4.44	781,440.00	
ESSAR ENERGY PLC	42,000	4.56	191,646.00	
PETROFAC LIMITED	32,500	15.27	496,275.00	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	439,806	22.29	9,805,474.77	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	334,280	22.08	7,380,902.40	
TULLOW OIL PLC	110,200	14.13	1,557,126.00	
ANGLO AMERICAN PLC	162,891	31.87	5,191,336.17	
ANTOFAGASTA PLC	50,670	14.11	714,953.70	
BHP BILLITON PLC	273,697	25.44	6,962,851.68	

EURASIAN NATURAL RESOURCES CORPORATION	33,700	9.29	313,241.50	
FRESNILLO PLC	22,200	15.76	349,872.00	
JOHNSON MATTHEY PLC	26,901	18.73	503,855.73	
KAZAKHMYS PLC	26,200	14.19	371,778.00	
LONMIN PLC	19,256	16.88	325,041.28	
RANDGOLD RESOURCES LTD	10,822	52.00	562,744.00	
REXAM PLC	114,549	3.72	426,580.47	
RIO TINTO PLC	179,593	44.03	7,907,479.79	
VEDANTA RESOURCES PLC	14,400	23.53	338,832.00	
XSTRATA PLC	257,617	14.65	3,775,377.13	
BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	42,000	6.04	253,680.00	
BAE SYSTEMS PLC	422,735	3.34	1,413,625.84	
BALFOUR BEATTY PLC	86,839	3.26	283,181.97	
BUNZL PLC	40,808	7.26	296,470.12	
COBHAM PLC	145,074	2.32	337,732.27	
INVENSYS PLC	101,258	3.25	329,594.79	
ROLLS-ROYCE GROUP PLC	236,693	6.19	1,466,313.13	
SMITHS GROUP PLC	47,166	13.30	627,307.80	
WEIR GROUP PLC/THE	26,000	17.29	449,540.00	
WOLSELEY PLC	35,832	21.36	765,371.52	
AGGREKO PLC	31,100	16.11	501,021.00	
CAPITA GROUP PLC	74,599	7.14	533,009.85	
EXPERIAN PLC	122,894	7.68	944,440.39	
G4S PLC	180,927	2.61	472,762.25	
INTERTEK GROUP PLC	19,700	20.07	395,379.00	
SERCO GROUP PLC	61,528	5.42	333,481.76	
FIRSTGROUP PLC	63,315	3.17	201,088.44	
BURBERRY GROUP PLC	53,437	11.32	604,906.84	
CARNIVAL PLC	21,767	24.76	538,950.92	
COMPASS GROUP PLC	236,378	5.54	1,310,716.01	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	35,349	12.57	444,336.93	

THOMAS COOK GROUP PLC	116,000	1.69	196,504.00
TUI TRAVEL PLC	62,000	2.32	144,088.00
WHITBREAD PLC	21,356	16.63	355,150.28
BRITISH SKY BROADCASTING PLC	138,855	8.29	1,151,107.95
ITV PLC	480,000	0.75	361,440.00
PEARSON PLC	99,153	10.87	1,077,793.11
REED ELSEVIER PLC	154,148	5.35	824,691.80
WPP PLC	158,167	7.35	1,162,527.45
HOME RETAIL GROUP	108,094	2.08	224,835.52
KINGFISHER PLC	301,840	2.60	785,085.84
MARKS & SPENCER GROUP PLC	191,199	3.60	689,463.59
NEXT PLC	22,344	20.98	468,777.12
SAINSBURY (J) PLC	149,638	3.38	505,776.44
TESCO PLC	994,082	3.98	3,956,943.40
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	271,792	2.83	770,258.52
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	43,000	10.08	433,440.00
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	247,026	24.94	6,160,828.44
DIAGEO PLC	310,210	11.86	3,679,090.60
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	127,370	19.78	2,519,378.60
SABMILLER PLC	117,010	22.16	2,593,526.65
UNILEVER PLC	157,897	19.15	3,023,727.55
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	76,863	32.30	2,482,674.90
SMITH & NEPHEW PLC	111,783	6.83	764,036.80
ASTRAZENECA PLC	175,521	29.82	5,234,036.22
GLAXOSMITHKLINE PLC	643,443	12.34	7,940,086.62
SHIRE PLC	68,700	18.41	1,264,767.00
BARCLAYS PLC	1,439,627	3.04	4,378,625.52
HSBC HOLDINGS PLC	2,193,303	6.54	14,363,941.34
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,037,754	0.60	3,038,773.21
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	2,200,954	0.43	963,797.75
STANDARD CHARTERED PLC	289,543	16.48	4,771,668.64

3I GROUP PLC	119,000	2.63	312,970.00	
ICAP PLC	71,716	5.09	365,393.02	
INVESTEC PLC	56,000	4.85	271,880.00	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	18,902	8.79	166,148.58	
MAN GROUP PLC	211,945	2.39	508,456.05	
SCHRODERS PLC	14,200	18.14	257,588.00	
ADMIRAL GROUP PLC	25,200	16.08	405,216.00	
AVIVA PLC	348,434	4.43	1,546,001.65	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	743,491	1.20	893,676.18	
OLD MUTUAL PLC	690,324	1.44	999,589.15	
PRUDENTIAL PLC	316,553	7.32	2,318,750.72	
RESOLUTION LTD	183,068	3.05	558,540.46	
RSA INSURANCE GROUP PLC	431,885	1.32	573,543.28	
STANDARD LIFE PLC	292,048	2.12	620,894.04	
AUTONOMY CORP PLC	27,400	15.40	421,960.00	
SAGE GROUP PLC (THE)	163,063	2.68	437,498.02	
ARM HOLDINGS PLC	166,000	5.60	929,600.00	
BT GROUP PLC	949,899	1.89	1,798,158.80	
CABLE & WIRELESS WORLDWIDE	351,018	0.50	178,668.16	
INMARSAT PLC	54,000	6.07	327,780.00	
VODAFONE GROUP PLC	6,470,538	1.75	11,355,794.19	
CENTRICA PLC	636,735	3.21	2,047,739.76	
INTERNATIONAL POWER PLC	194,253	3.15	613,450.97	
NATIONAL GRID PLC	436,617	5.86	2,558,575.62	
SCOTTISH & SOUTHERN ENERGY	115,908	13.11	1,519,553.88	
SEVERN TRENT PLC	27,794	14.39	399,955.66	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	86,391	6.01	519,209.91	
英ボンド 小計	36,914,299		187,110,202.69	
( 邦貨換算額 )			(25,570,480,299)	( 単位 : 円 )
スイスフラン				

TRANSOCEAN LTD	39,800	71.90	2,861,620.00
GIVAUDAN-REG	1,050	925.00	971,250.00
HOLCIM LTD-REG	30,497	70.85	2,160,712.45
SIKA AG	248	2,218.00	550,064.00
SYNGENTA AG	11,651	301.50	3,512,776.50
ABB LTD	272,003	21.70	5,902,465.10
GEBERIT AG-REG	4,750	198.90	944,775.00
SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,500	112.20	280,500.00
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	6,210	110.10	683,721.00
ADECCO SA-REG	15,534	58.35	906,408.90
SGS SA	667	1,646.00	1,097,882.00
KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	6,855	129.30	886,351.50
CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-BR A	64,577	51.20	3,306,342.40
THE SWATCH GROUP AG-B	3,869	393.00	1,520,517.00
THE SWATCH GROUP AG-REG	5,200	70.90	368,680.00
ARYZTA AG	9,700	46.40	450,080.00
LINDT & SPRUENGLI AG	116	2,784.00	322,944.00
LINDT & SPRUENGLI AG-REG	13	30,835.00	400,855.00
NESTLE SA-REGISTERED	429,900	52.55	22,591,245.00
SONOVA HOLDING AG	5,942	86.65	514,874.30
STRAUMANN HOLDING AG-REG	970	236.00	228,920.00
SYNTHESES INC	7,510	128.90	968,039.00
ACTELION LTD	13,016	51.20	666,419.20
LONZA GROUP AG-REG	5,652	77.15	436,051.80
NOVARTIS AG-REG SHS	261,483	49.59	12,966,941.97
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	86,980	133.60	11,620,528.00
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	141,126	40.10	5,659,152.60
GAM HOLDING LTD	27,273	17.15	467,731.95
JULIUS BAER GROUP LTD	25,573	39.55	1,011,412.15
PARGESA HOLDING SA-BR	3,200	86.35	276,320.00
UBS AG-REGISTERED	449,825	16.71	7,516,575.75

BALOISE HOLDING AG	6,200	92.05	570,710.00	
SWISS LIFE HOLDING AG	3,670	158.40	581,328.00	
SWISS RE-REG	43,700	54.45	2,379,465.00	
ZURICH FINANCIAL SERVICES AG	17,968	241.40	4,337,475.20	
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	21,482	12.77	274,325.14	
SWISSCOM AG-REG	2,977	404.10	1,203,005.70	
スイスフラン 小計	2,029,687		101,398,465.61	
( 邦貨換算額 )			(9,484,812,473)	( 単位：円 )
スウェーデンクローナ				
BOLIDEN AB	34,000	135.70	4,613,800.00	
HOLMEN AB-B SHARES	6,133	221.50	1,358,459.50	
SSAB AB-A SHARES	22,942	102.10	2,342,378.20	
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	70,742	96.15	6,801,843.30	
ALFA LAVAL AB	41,552	132.10	5,489,019.20	
ASSA ABLOY AB-B	39,466	174.70	6,894,710.20	
ATLAS COPCO AB-A SHS	82,232	161.80	13,305,137.60	
ATLAS COPCO AB-B SHS	49,796	146.90	7,315,032.40	
HEXAGON AB-B SHS	31,400	145.30	4,562,420.00	
SANDVIK AB	125,454	117.80	14,778,481.20	
SCANIA AB-B SHS	38,132	142.30	5,426,183.60	
SKANSKA AB-B SHS	48,690	128.00	6,232,320.00	
SKF AB-B SHARES	49,648	179.60	8,916,780.80	
VOLVO AB-B SHS	169,250	107.00	18,109,750.00	
SECURITAS AB-B SHS	42,457	76.05	3,228,854.85	
ELECTROLUX AB-SER B	30,083	154.30	4,641,806.90	
HUSQVARNA AB-B SHS	49,983	49.04	2,451,166.32	
MODERN TIMES GROUP-B SHS	6,300	468.30	2,950,290.00	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	125,694	218.60	27,476,708.40	
SWEDISH MATCH AB	27,471	209.10	5,744,186.10	
GETINGE AB-B SHS	25,538	160.10	4,088,633.80	

NORDEA BANK AB	326,129	71.95	23,464,981.55	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A	175,023	58.55	10,247,596.65	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	60,608	213.50	12,939,808.00	
SWEDBANK AB - A SHARES	90,260	116.20	10,488,212.00	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	13,000	113.00	1,469,000.00	
INVESTOR AB-B SHS	57,949	151.90	8,802,453.10	
KINNEVIK INVESTMENT AB-B	27,000	147.40	3,979,800.00	
RATOS AB-B SHS	12,200	239.50	2,921,900.00	
ERICSSON LM-B SHS	373,223	80.05	29,876,501.15	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	9,440	602.50	5,687,600.00	
TELE2 AB -B SHS	35,273	149.40	5,269,786.20	
TELIASONERA AB	289,271	49.98	14,457,764.58	
TELIASONERA AB-RTS	10,000	0.42	4,200.00	
スウェーデンクローナ 小計	2,596,339		286,337,565.60	
( 邦貨換算額 )			(3,819,743,125)	( 単位 : 円 )
ノルウェークローネ				
AKER SOLUTIONS ASA	20,600	120.90	2,490,540.00	
SEADRILL LID	33,745	188.50	6,360,932.50	
STATOIL ASA	139,364	152.80	21,294,819.20	
SUBSEA7 SA	34,000	140.00	4,760,000.00	
NORSK HYDRO ASA	111,797	46.70	5,220,919.90	
YARA INTERNATIONAL ASA	24,105	280.10	6,751,810.50	
ORKLA ASA	93,950	54.15	5,087,392.50	
RENEWABLE ENERGY CORP AS	50,670	18.16	920,167.20	
DNB NOR ASA	122,019	87.65	10,694,965.35	
TELENOR ASA	103,592	90.85	9,411,333.20	
ノルウェークローネ 小計	733,842		72,992,880.35	
( 邦貨換算額 )			(1,121,900,570)	( 単位 : 円 )
デンマーククローネ				



NOVOZYMES A/S-B SHARES	5,703	826.50	4,713,529.50	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	24,562	200.00	4,912,400.00	
A P MOLLER - MAERSK A/S	166	48,680.00	8,080,880.00	
A P MOLLER-MAERSK A/S-A	68	47,800.00	3,250,400.00	
DSV A/S	26,280	125.30	3,292,884.00	
PANDORA A/S	7,300	236.80	1,728,640.00	
CARLSBERG AS-B	13,116	570.00	7,476,120.00	
COLOPLAST-B	2,952	770.00	2,273,040.00	
WILLIAM DEMANT HOLDING	2,860	460.80	1,317,888.00	
NOVO NORDISK A/S-B	51,823	655.50	33,969,976.50	
DANSKE BANK A/S	75,398	125.00	9,424,750.00	
TRYG A/S	3,368	325.00	1,094,600.00	
デンマーククローネ 小計	213,596		81,535,108.00	
( 邦貨換算額 )			(1,329,837,611)	( 単位 : 円 )
オーストラリアドル				
CALTEX AUSTRALIA LIMITED	18,000	14.85	267,300.00	
ORIGIN ENERGY LIMITED	131,881	16.95	2,235,382.95	
PALADIN ENERGY LIMITED	88,000	3.53	310,640.00	
SANTOS LTD	105,511	15.74	1,660,743.14	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	76,976	46.83	3,604,786.08	
WORLEY PARSONS LIMITED	23,400	31.88	745,992.00	
ALUMINA LTD	296,977	2.53	751,351.81	
AMCOR LIMITED	153,527	7.27	1,116,141.29	
BHP BILLITON LTD	416,430	48.89	20,359,262.70	
BLUESCOPE STEEL LTD	234,327	1.91	448,736.20	
BORAL LIMITED	94,596	4.97	470,142.12	
FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	156,000	6.54	1,020,240.00	
INCITEC PIVOT LTD	200,000	4.30	860,000.00	
JAMES HARDIE INDUSTRIES SE	56,003	5.74	321,457.22	
MACARTHUR COAL LIMITED	22,400	11.85	265,440.00	

NEWCREST MINING LIMITED	95,578	41.10	3,928,255.80
ONESTEEL LIMITED	152,695	2.35	358,833.25
ORICA LIMITED	44,423	27.18	1,207,417.14
OZ MINERALS LIMITED	386,524	1.62	626,168.88
RIO TINTO LIMITED	54,081	87.00	4,705,047.00
SIMS METAL MANAGEMENT LTD	22,195	17.00	377,315.00
CSR LIMITED	69,313	3.20	221,801.60
LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	16,905	28.94	489,230.70
BRAMBLES LIMITED	174,532	7.18	1,253,139.76
ASCIANO LTD	364,000	1.68	611,520.00
QANTAS AIRWAYS LIMITED	133,138	2.12	282,252.56
QR NATIONAL LTD	215,000	3.37	724,550.00
TOLL HOLDINGS LIMITED	80,620	5.73	461,952.60
BILLABONG INTERNATIONAL LTD	23,211	7.19	166,887.09
CROWN LTD	54,965	8.30	456,209.50
TABCORP HOLDINGS LIMITED	83,545	7.24	604,865.80
TATTS GROUP LTD	147,000	2.28	335,160.00
FAIRFAX MEDIA LTD	265,729	1.30	346,776.34
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	78,432	2.85	223,531.20
METCASH LTD	104,000	4.11	427,440.00
WESFARMERS LIMITED	124,184	32.62	4,050,882.08
WESFARMERS LIMITED-PPP	18,754	33.03	619,444.62
WOOLWORTHS LIMITED	151,698	26.91	4,082,193.18
COCA-COLA AMATIL LIMITED	69,917	11.90	832,012.30
FOSTER'S GROUP LTD	232,619	5.70	1,325,928.30
GOODMAN FIELDER LIMITED	167,000	1.22	203,740.00
COCHLEAR LIMITED	7,203	83.03	598,065.09
RAMSAY HEALTH CARE LTD	15,000	18.80	282,000.00
SONIC HEALTHCARE LTD	43,526	12.58	547,557.08
CSL LIMITED	69,314	35.99	2,494,610.86
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	317,792	24.11	7,661,965.12

BENDIGO AND ADELAIDE BANK	47,400	9.47	448,878.00	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	192,068	52.54	10,091,252.72	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	264,811	26.26	6,953,936.86	
WESTPAC BANKING CORPORATION	370,577	24.54	9,093,959.58	
ASX LTD	21,410	33.12	709,099.20	
MACQUARIE GROUP LTD	41,932	34.50	1,446,654.00	
AMP LIMITED	350,039	5.70	1,995,222.30	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	249,006	3.50	871,521.00	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	132,473	18.74	2,482,544.02	
SUNCORP GROUP LTD	160,481	8.25	1,323,968.25	
COMPUTERSHARE LIMITED	55,029	9.09	500,213.61	
TELSTRA CORPORATION LIMITED	543,187	2.80	1,520,923.60	
AGL ENERGY LIMITED	62,769	14.27	895,713.63	
オーストラリアドル 小計	8,348,103		113,278,255.13	
( 邦貨換算額 )			(9,973,017,581)	( 単位 : 円 )
ニュージーランドドル				
FLETCHER BUILDING LTD	71,957	9.38	674,956.66	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	130,557	2.15	281,350.33	
SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP	82,890	3.47	287,628.30	
TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	216,909	1.98	429,479.82	
CONTACT ENERGY LIMITED	35,256	5.76	203,074.56	
ニュージーランドドル 小計	537,569		1,876,489.67	
( 邦貨換算額 )			(123,885,848)	( 単位 : 円 )
香港ドル				
HUTCHISON WHAMPOA LTD	261,000	91.70	23,933,700.00	
NWS HOLDINGS LTD	160,500	11.98	1,922,790.00	
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	142,000	19.36	2,749,120.00	
MTR CORPORATION	183,500	28.85	5,293,975.00	
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	31,000	81.60	2,529,600.00	

YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	96,000	26.35	2,529,600.00
SANDS CHINA LTD	312,000	18.90	5,896,800.00
SHANGRI-LA ASIA LTD.	166,000	20.50	3,403,000.00
SJM HOLDINGS LIMITED	185,000	15.50	2,867,500.00
WYNN MACAU LTD	202,000	24.55	4,959,100.00
ESPRIT HOLDINGS LTD	141,927	35.15	4,988,734.05
LI & FUNG LTD	355,600	40.00	14,224,000.00
LIFESTYLE INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED	73,000	20.00	1,460,000.00
BANK OF EAST ASIA	183,620	32.85	6,031,917.00
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	453,500	24.70	11,201,450.00
HANG SENG BANK LTD	93,200	122.50	11,417,000.00
WING HANG BANK LIMITED	22,000	89.50	1,969,000.00
HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	126,200	181.20	22,867,440.00
AIA GROUP LTD	980,000	24.05	23,569,000.00
CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	172,000	127.90	21,998,800.00
HANG LUNG GROUP LTD	97,000	52.25	5,068,250.00
HANG LUNG PROPERTIES LTD	310,000	35.50	11,005,000.00
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	140,000	54.75	7,665,000.00
HOPEWELL HOLDINGS LTD	72,000	23.20	1,670,400.00
HYSAN DEVELOPMENT CO	75,000	34.25	2,568,750.00
KERRY PROPERTIES LTD	91,500	39.45	3,609,675.00
NEW WORLD DEVELOPMENT	324,000	14.10	4,568,400.00
SINO LAND CO	312,000	14.14	4,411,680.00
SUN HUNG KAI PROPERTIES	175,000	125.60	21,980,000.00
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	97,000	119.00	11,543,000.00
WHARF HOLDINGS LTD	189,000	56.15	10,612,350.00
WHEELOK&COMPANY LTD	115,000	31.40	3,611,000.00
FOXCONN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	208,000	4.71	979,680.00
PCCW LIMITED	510,000	3.20	1,632,000.00
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	49,000	36.50	1,788,500.00
CLP HOLDINGS LTD	238,100	63.75	15,178,875.00

HONG KONG & CHINA GAS	529,765	18.82	9,970,177.30	
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	178,500	52.90	9,442,650.00	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	25,500	100.80	2,570,400.00	
香港ドル 小計	8,076,412		305,688,313.35	
( 邦貨換算額 )			(3,304,490,667)	( 単位 : 円 )
シンガポールドル				
COSCO CORP SINGAPORE LTD	95,000	2.24	212,800.00	
FRASER & NEAVE LTD	114,000	6.24	711,360.00	
KEPPEL CORP LTD	161,000	12.50	2,012,500.00	
NOBLE GROUP LTD	469,400	2.17	1,018,598.00	
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	123,820	5.31	657,484.20	
SEMBCORP MARINE LTD	103,400	5.87	606,958.00	
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG	206,000	3.24	667,440.00	
YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	245,000	1.88	460,600.00	
COMFORTDELGRO CORP LTD	258,000	1.56	402,480.00	
NEPTUNE ORIENT LINES LTD	140,000	1.95	273,000.00	
SINGAPORE AIRLINES LTD	67,266	13.44	904,055.04	
GENTING SINGAPORE PLC	731,000	2.08	1,520,480.00	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	185,250	3.96	733,590.00	
CYCLE & CARRIAGE LTD	14,000	36.82	515,480.00	
OLAM INTERNATIONAL LTD	141,000	2.95	415,950.00	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	891,600	0.70	628,578.00	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	238,000	5.23	1,244,740.00	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	216,000	14.64	3,162,240.00	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	311,000	9.55	2,970,050.00	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	155,000	19.40	3,007,000.00	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	104,000	8.23	855,920.00	
CAPITALAND LTD	301,000	3.39	1,020,390.00	
CAPITAMALLS ASIA LTD	190,000	1.85	351,500.00	
CITY DEVELOPMENTS LTD	70,000	11.70	819,000.00	

GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LIMITED	168,000	1.97	330,960.00	
KEPPEL LAND LTD	90,000	4.39	395,100.00	
UOL GROUP LIMITED	62,000	4.91	304,420.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	981,015	3.01	2,952,855.15	
STARHUB LIMITED	80,000	2.80	224,000.00	
シンガポールドル 小計	6,911,751		29,379,528.39	
( 邦貨換算額 )			(1,963,433,882)	( 単位：円 )
イスラエルシュケル				
DELEK GROUP LTD	530	922.60	488,978.00	
ISRAEL CHEMICALS LIMITED	55,000	60.60	3,333,000.00	
ISRAEL CORPORATION LTD/THE	255	4,350.00	1,109,250.00	
MAKHTESHIM-AGAN INDUSTRIES LTD	32,000	18.29	585,280.00	
ELBIT SYSTEMS LTD	3,000	193.70	581,100.00	
TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	115,900	169.00	19,587,100.00	
BANK HAPOALIM BM	120,000	18.20	2,184,000.00	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	156,000	18.19	2,837,640.00	
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	70,000	7.40	518,000.00	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	16,000	38.50	616,000.00	
NICE SYSTEMS LTD	8,200	129.20	1,059,440.00	
BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	211,000	10.14	2,139,540.00	
CELLCOM ISRAEL LTD	6,700	107.30	718,910.00	
PARTNER COMMUNICATIONS COMPANY LTD	11,000	64.37	708,070.00	
イスラエルシュケル 小計	805,585		36,466,308.00	
( 邦貨換算額 )			(889,777,915)	( 単位：円 )
合計	134,819,177		236,971,201,683	単位：円
( 外貨建有価証券邦貨換算額合計 )			(236,971,201,683)	( 単位：円 )

(注)

1. 合計金額欄の ( ) 内は、外貨建有価証券にかかるもので、内書きであります。
2. 米ドル表示の株式については、568銘柄、信託財産純資産総額に対する比率52.4%、合計に対する比率53.8%です。

カナダドル表示の株式については、99銘柄、信託財産純資産総額に対する比率6.0%、合計に対する比率6.1%です。

ユーロ表示の株式については、264銘柄、信託財産純資産総額に対する比率15.4%、合計に対する比率15.8%です。

英ポンド表示の株式については、101銘柄、信託財産純資産総額に対する比率10.5%、合計に対する比率10.8%です。

スイスフラン表示の株式については、37銘柄、信託財産純資産総額に対する比率3.9%、合計に対する比率4.0%です。

スウェーデンクローナ表示の株式については、34銘柄、信託財産純資産総額に対する比率1.6%、合計に対する比率1.6%です。

ノルウェークローネ表示の株式については、10銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.5%、合計に対する比率0.5%です。

デンマーククローネ表示の株式については、12銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.5%、合計に対する比率0.6%です。

オーストラリアドル表示の株式については、59銘柄、信託財産純資産総額に対する比率4.1%、合計に対する比率4.2%です。

ニュージーランドドル表示の株式については、5銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.1%、合計に対する比率0.1%です。

香港ドル表示の株式については、39銘柄、信託財産純資産総額に対する比率1.4%、合計に対する比率1.4%です。

シンガポールドル表示の株式については、29銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.8%、合計に対する比率0.8%です。

イスラエルシェケル表示の株式については、14銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.4%、合計に対する比率0.4%です。

## (b) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	口数	評価額	備考
投資証券	米ドル			
	AMB PROPERTY CORP	20,450	719,226.50	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	97,400	1,675,280.00	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	10,857	1,285,468.80	
	BOSTON PROPERTIES INC	17,279	1,631,828.76	
	DUKE REALTY CORP	31,773	434,972.37	
	EQUITY RESIDENTIAL	35,586	1,981,428.48	
	FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	7,804	634,933.44	
	GENERAL GROWTH PROPERTIES	55,155	822,912.60	
	HCP,INC.	49,757	1,838,521.15	
	HEALTH CARE REIT INC	21,100	1,093,191.00	

	HOST HOTELS AND RESORTS INC	81,351	1,365,069.78	
	HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	650,000	637,000.00	
	KIMCO REALTY CORPORATION	49,732	868,320.72	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	15,247	504,828.17	
	MACERICH COMPANY/THE	16,900	810,355.00	
	PLUM CREEK TIMBER COMPANY	20,607	872,088.24	
	PROLOGIS	71,852	1,123,046.76	
	PUBLIC STORAGE	17,793	1,924,846.74	
	RAYONIER INC	9,600	583,200.00	
	REGENCY CENTERS CORP	9,600	402,240.00	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	36,542	3,828,139.92	
	VENTAS INC	18,879	1,028,527.92	
	VORNADO REALTY TRUST	20,771	1,831,379.07	
	米ドル 小計	1,366,035	27,896,805.42	
	( 邦貨換算額 )		(2,343,610,623)	( 単位 : 円 )
	カナダドル			
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	14,700	366,765.00	
	カナダドル 小計	14,700	366,765.00	
	( 邦貨換算額 )		(32,029,587)	( 単位 : 円 )
	ユーロ			
	CORIO NV	6,948	339,548.76	
	FONCIERE DES REGIONS	3,200	232,768.00	
	GECINA SA	2,430	230,242.50	
	ICADE	2,770	235,643.90	
	KLEPIERRE	12,532	327,147.86	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	11,511	1,758,880.80	
	ユーロ 小計	39,391	3,124,231.82	
	( 邦貨換算額 )		(379,937,831)	( 単位 : 円 )



英ポンド				
BRITISH LAND CO PLC	110,305	603,919.87		
CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP PLC	65,855	255,188.12		
HAMMERSON PLC	85,497	378,067.73		
LAND SECURITIES GROUP PLC	96,227	707,749.58		
SEGRO PLC	86,434	268,377.57		
英ポンド 小計	444,318	2,213,302.87		
( 邦貨換算額 )		(302,469,970)	( 単位 : 円 )	
オーストラリアドル				
CFS RETAIL PROPERTY TRUST	265,612	483,413.84		
DEXUS PROPERTY GROUP	599,804	509,833.40		
GOODMAN GROUP	760,000	516,800.00		
GPT GROUP	223,494	677,186.82		
LEND LEASE GROUP	64,872	570,873.60		
MAP GROUP	51,000	148,410.00		
MIRVAC GROUP	436,710	545,887.50		
SP AUSNET	90,000	78,750.00		
STOCKLAND	303,614	1,138,552.50		
TRANSURBAN GROUP	153,123	806,958.21		
WESTFIELD GROUP	270,993	2,436,227.07		
WESTFIELD RETAIL TRUST	346,993	891,772.01		
オーストラリアドル 小計	3,566,215	8,804,664.95		
( 邦貨換算額 )		(775,162,702)	( 単位 : 円 )	
香港ドル				
LINK REIT	273,500	6,646,050.00		
香港ドル 小計	273,500	6,646,050.00		
( 邦貨換算額 )		(71,843,800)	( 単位 : 円 )	
シンガポールドル				

	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	178,000	350,660.00	
	CAPITAMALL TRUST	280,000	523,600.00	
	シンガポールドル 小計	458,000	874,260.00	
	( 邦貨換算額 )		(58,426,795)	( 単位 : 円 )
	合 計		3,963,481,308	単位 : 円
	( 外貨建有価証券邦貨換算額合計 )		(3,963,481,308)	( 単位 : 円 )

( 注 )

1. 合計金額欄の ( ) 内は、外貨建有価証券にかかるもので、内書きであります。
2. 米ドル表示の投資証券については、23銘柄、信託財産純資産総額に対する比率1.0%、合計に対する比率59.1%です。  
カナダドル表示の投資証券については、1銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.0%、合計に対する比率0.8%です。  
ユーロ表示の投資証券については、6銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.2%、合計に対する比率9.6%です。  
英ポンド表示の投資証券については、5銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.1%、合計に対する比率7.6%です。  
オーストラリアドル表示の投資証券については、12銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.3%、合計に対する比率19.6%です。  
香港ドル表示の投資証券については、1銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.0%、合計に対する比率1.8%です。  
シンガポールドル表示の投資証券については、2銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.0%、合計に対する比率1.5%です。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

「外国債券パッシブ・マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

対象年月日	(平成22年4月13日現在)	(平成23年4月13日現在)
科目	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金	1,143,244,171	1,161,738,581
コール・ローン	1,087,322,711	652,878,598
国債証券	259,505,207,724	259,537,988,320
派生商品評価勘定	1,158,363	-
未収利息	3,596,242,584	3,431,191,043
前払費用	202,744,883	182,805,635
流動資産合計	265,535,920,436	264,966,602,177
資産合計	265,535,920,436	264,966,602,177
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,583,741	89,607,454
流動負債合計	1,583,741	89,607,454
負債合計	1,583,741	89,607,454
純資産の部		
元本等		
元本		
元本	218,330,196,293	228,852,611,475
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	47,204,140,402	36,024,383,248
元本等合計	265,534,336,695	264,876,994,723
純資産合計	265,534,336,695	264,876,994,723
負債純資産合計	265,535,920,436	264,966,602,177

(注) 「外国債券パッシブ・マザーファンド」は、毎年12月17日(ただし、休業日の場合は翌営業日)に決算を

行います。上記の貸借対照表は平成22年4月13日ならびに平成23年4月13日現在における同マザーファンドの状況です。

## (2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自平成21年4月14日 至平成22年4月13日	自平成22年4月14日 至平成23年4月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券（売買目的有価証券） 個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。	国債証券（売買目的有価証券） 同左
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。	為替予約取引 同左
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。	外貨建資産等の会計処理 同左

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成22年4月13日現在)	(平成23年4月13日現在)
1. 受益権総数	平成22年4月13日現在における受益権の総数 218,330,196,293口	平成23年4月13日現在における受益権の総数 228,852,611,475口
2. 1単位当たり純資産額	1.2162円 (1万口 = 12,162円)	1.1574円 (1万口 = 11,574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21年4月14日 至平成22年4月13日	自平成22年4月14日 至平成23年4月13日
	<p>（追加情報） 当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）および「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。</p>	
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>	同左
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>（1）金融商品の内容 1）有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。 2）デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。当ファンドにおけるデリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。 3）コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 （2）金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>	<p>（1）金融商品の内容 1）有価証券 同左 2）デリバティブ取引 同左 3）コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 （2）金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 同左</p>

<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・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。リスクを管理する部署では、各種リスクごとに定められた頻度で、測定項目が上下限值（リミットあるいは注意レベル）内に収まっているかどうかのモニタリングを行っております。上下限値を越えていることが発見された場合は、原則として速やかに修正を行うよう、リスク管理を行う部署から関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われます。また、是正勧告あるいは報告を受けた関連運用グループでは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、リスク管理を行う部署は、上下限値に抵触した事実ならびにその後の対処結果あるいは関連運用グループの対処方針の決定に関し、必要に応じて、リスク管理を行う部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告する体制となっております。</p>	<p>同 左</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>	<p>同 左</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成22年4月13日現在)	(平成23年4月13日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(国債証券) 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1) 有価証券(国債証券) 同左</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) 同左</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 同左</p>



（デリバティブ取引に関する注記）

（平成22年4月13日現在）

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

通貨関連

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場外取引	為替予約取引				
	買建				
	米ドル	183,196,022	-	183,641,351	445,329
	ユーロ	255,858,176	-	256,305,691	447,515
	英ポンド	150,480,631	-	150,746,150	265,519
	買建 合計	589,534,829	-	590,693,192	1,158,363

（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23年4月13日現在）

平成23年4月13日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（関連当事者との取引に関する注記）

（自 平成21年4月14日 至 平成22年4月13日）

該当事項はありません。

（自 平成22年4月14日 至 平成23年4月13日）

該当事項はありません。

(その他の注記)

(平成22年4月13日現在)	
本有価証券報告書における開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	151,497,648,151円
同期中における追加設定元本額	69,521,995,410円
同期中における一部解約元本額	2,689,447,268円
平成22年4月13日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	1,545,582,372円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	125,548,246円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	402,983,239円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	189,923,691円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	6,813,547円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	2,408,710円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	268,526円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	2,005,469円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	273,794円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	148,874円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	433,348円
SMAM・年金外国債券バッシブファンド<適格機関投資家限定>	5,314,027,567円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	11,648,080,707円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	40,356,560,721円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	13,522,977,374円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	28,388,134,178円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	85,063,627円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	184,534,055円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	52,430,229円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	1,493,369,206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>	182,579,547円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	2,608,619,428円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	3,826,214,969円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	7,314,529,946円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	18,834,160,186円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,289,878,560円
SMAM・外国債券バッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	8,588,365,960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)	1,527,455,644円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	10,399,713,387円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	447,114,953円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	11,857,402,694円

三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	44,140,833,782円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	297,019,628円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	89,446,385円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	24,483,112円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	438,898,912円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	1,574,737,694円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	399,449,669円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	86,775,824円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	22,664,879円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	3,703,780円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	1,054,579,874円
合計	218,330,196,293円

(平成23年4月13日現在)

本有価証券報告書における開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	218,330,196,293円
同期中における追加設定元本額	20,766,176,716円
同期中における一部解約元本額	10,243,761,534円
平成23年4月13日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	2,274,235,766円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	180,898,385円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	538,752,618円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	255,963,885円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	15,500,975円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	4,228,057円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	1,652,720円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	3,030,230円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	1,241,802円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	550,120円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	1,186,066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>	5,426,691,449円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	12,526,169,077円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	39,967,665,787円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	13,002,971,068円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	27,325,373,658円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	92,428,597円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	193,564,179円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	51,989,072円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	1,478,106,423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>	191,039,306円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	2,489,167,607円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	3,471,376,411円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	7,370,735,765円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	17,439,570,487円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,325,297,882円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	15,529,248,686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)	2,213,488,415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)	10,925,593,765円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	462,032,167円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	11,644,748,481円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	46,118,063,889円

SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	314,237,578円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	96,118,436円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	24,165,327円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	448,009,371円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	1,567,247,121円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	426,332,871円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	307,067,769円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	79,786,006円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	12,121,729円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	2,814,853,566円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	99,155,865円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定>	95,387,123円
SMAM・FGグローバルバランス25VA<適格機関投資家限定>	45,565,918円
合計	228,852,611,475円

## (3) 附属明細表

## 有価証券明細表

## (a) 株式

該当事項はありません。

## (b) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル			
	US T 0.375% 12/08/31	9,000,000.00	8,993,671.92	
	US T 0.375% 12/09/30	9,000,000.00	8,988,046.92	
	US T 0.375% 12/10/31	5,000,000.00	4,988,671.90	
	US T 0.5% 12/11/30	8,000,000.00	7,990,000.00	
	US T 0.5% 13/10/15	5,000,000.00	4,936,718.75	
	US T 0.5% 13/11/15	7,000,000.00	6,901,015.66	
	US T 0.625% 12/07/31	10,000,000.00	10,032,031.30	
	US T 0.625% 12/12/31	7,500,000.00	7,499,414.10	
	US T 0.625% 2012/06/30	10,000,000.00	10,030,468.80	
	US T 0.75% 13/08/15	8,000,000.00	7,967,500.00	
	US T 0.75% 13/09/15	6,000,000.00	5,969,062.50	
	US T 0.75% 13/12/15	7,000,000.00	6,935,468.75	
	US T 0.75% 2012/05/31	10,000,000.00	10,046,093.80	
	US T 1 14/01/15	3,000,000.00	2,988,046.89	
	US T 1% 12/03/31	11,000,000.00	11,073,906.25	
	US T 1% 12/04/30	10,000,000.00	10,069,531.30	
	US T 1% 13/07/15	8,000,000.00	8,020,000.00	
	US T 1.125% 12/12/15	9,000,000.00	9,081,562.50	
	US T 1.125% 2013/06/15	6,000,000.00	6,032,343.78	
	US T 1.25% 15/08/31	8,000,000.00	7,763,125.04	
	US T 1.25% 15/09/30	7,000,000.00	6,776,875.00	
	US T 1.25% 15/10/31	5,000,000.00	4,828,906.25	
	US T 1.375% 12/03/15	7,000,000.00	7,070,000.00	

US T 1.375% 12/04/15	8,000,000.00	8,086,875.04
US T 1.375% 12/05/15	8,500,000.00	8,596,953.12
US T 1.375% 12/09/15	7,000,000.00	7,091,875.00
US T 1.375% 12/10/15	8,000,000.00	8,104,375.04
US T 1.375% 12/11/15	10,000,000.00	10,129,687.50
US T 1.375% 13/02/15	10,000,000.00	10,122,656.30
US T 1.375% 13/03/15	8,000,000.00	8,095,625.04
US T 1.375% 13/05/15	8,000,000.00	8,089,375.04
US T 1.375% 15/11/30	5,000,000.00	4,845,703.15
US T 1.375% 2013/01/15	10,000,000.00	10,125,000.00
US T 1.5% 12/07/15	9,000,000.00	9,130,078.17
US T 1.5% 13/12/31	7,000,000.00	7,071,640.66
US T 1.75% 12/08/15	10,000,000.00	10,179,687.50
US T 1.75% 13/04/15	10,000,000.00	10,191,406.30
US T 1.75% 14/01/31	6,500,000.00	6,605,625.00
US T 1.75% 14/03/31	8,000,000.00	8,117,500.00
US T 1.75% 15/7/31	5,000,000.00	4,967,187.50
US T 1.875% 12/06/15	8,000,000.00	8,145,625.04
US T 1.875% 14/02/28	6,000,000.00	6,114,375.00
US T 1.875% 14/04/30	8,000,000.00	8,141,250.00
US T 1.875% 17/08/31	3,000,000.00	2,844,375.00
US T 1.875% 17/09/30	6,000,000.00	5,675,625.00
US T 1.875% 17/10/31	6,000,000.00	5,668,125.00
US T 1.875% 2015/06/30	7,000,000.00	7,001,640.66
US T 11.25% 15/02/15	2,000,000.00	2,715,625.00
US T 2% 13/11/30	7,000,000.00	7,166,796.91
US T 2% 16/01/31	7,000,000.00	6,952,968.75
US T 2.125% 14/11/30	10,500,000.00	10,705,078.12
US T 2.125% 2015/05/31	8,000,000.00	8,095,000.00
US T 2.25% 14/05/31	5,000,000.00	5,141,015.65
US T 2.25% 15/01/31	10,000,000.00	10,217,187.50



	US T 2.25% 17/11/30	7,000,000.00	6,761,562.50	
	US T 2.375% 14/08/31	8,000,000.00	8,241,250.00	
	US T 2.375% 14/09/30	10,000,000.00	10,300,000.00	
	US T 2.375% 14/10/31	8,000,000.00	8,232,500.00	
	US T 2.375% 15/02/28	11,000,000.00	11,279,296.93	
	US T 2.375% 16/03/31	5,500,000.00	5,542,109.37	
	US T 2.375% 17/7/31	5,000,000.00	4,900,781.25	
	US T 2.5% 13/03/31	4,500,000.00	4,653,632.83	
	US T 2.5% 15/03/31	9,000,000.00	9,265,078.17	
	US T 2.5% 15/04/30	10,000,000.00	10,282,031.30	
	US T 2.50% 2017/06/30	5,000,000.00	4,948,437.50	
	US T 2.625% 14/06/30	9,000,000.00	9,354,375.00	
	US T 2.625% 14/07/31	10,000,000.00	10,390,625.00	
	US T 2.625% 16/02/29	5,000,000.00	5,106,250.00	
	US T 2.625% 16/04/30	5,000,000.00	5,090,625.00	
	US T 2.625% 20/11/15	18,000,000.00	16,731,562.50	
	US T 2.625% 20/8/15	15,000,000.00	14,013,281.25	
	US T 2.625% 2014/12/31	8,000,000.00	8,290,000.00	
	US T 2.75 17/12/31	4,000,000.00	3,981,875.00	
	US T 2.75% 13/02/28	3,700,000.00	3,842,796.87	
	US T 2.75% 13/10/31	5,500,000.00	5,738,046.87	
	US T 2.75% 16/11/30	7,000,000.00	7,099,531.25	
	US T 2.75% 19/02/15	13,000,000.00	12,679,062.50	
	US T 2.75% 2017/05/31	7,000,000.00	7,037,187.50	
	US T 2.875% 13/01/31	4,000,000.00	4,160,000.00	
	US T 3% 16/08/31	7,000,000.00	7,217,656.25	
	US T 3% 16/09/30	7,000,000.00	7,207,812.50	
	US T 3% 17/02/28	7,000,000.00	7,169,531.25	
	US T 3.125% 13/04/30	4,500,000.00	4,715,156.25	
	US T 3.125% 13/08/31	5,500,000.00	5,785,742.21	
	US T 3.125% 13/09/30	6,500,000.00	6,840,234.37	

	US T 3.125% 16/10/31	6,000,000.00	6,210,000.00	
	US T 3.125% 17/01/31	7,000,000.00	7,223,125.00	
	US T 3.125% 17/04/30	7,000,000.00	7,201,250.00	
	US T 3.125% 19/05/15	12,000,000.00	11,973,750.00	
	US T 3.25% 16/05/31	4,000,000.00	4,189,375.00	
	US T 3.25% 16/06/30	6,000,000.00	6,281,250.00	
	US T 3.25% 16/07/31	5,000,000.00	5,225,781.25	
	US T 3.25% 17/03/31	8,000,000.00	8,290,000.00	
	US T 3.25% 2016/12/31	6,000,000.00	6,238,125.00	
	US T 3.375% 12/11/30	3,000,000.00	3,139,453.14	
	US T 3.375% 13/06/30	5,000,000.00	5,276,953.15	
	US T 3.375% 13/07/31	5,500,000.00	5,815,390.62	
	US T 3.375% 19/11/15	15,000,000.00	15,112,500.00	
	US T 3.5% 13/05/31	5,000,000.00	5,283,593.75	
	US T 3.5% 18/02/15	8,500,000.00	8,841,328.12	
	US T 3.5% 20/05/15	15,000,000.00	15,140,625.00	
	US T 3.5% 39/02/15	6,000,000.00	4,974,375.00	
	US T 3.625 12/12/31	3,500,000.00	3,681,835.95	
	US T 3.625% 13/05/15	3,650,000.00	3,862,726.56	
	US T 3.625% 19/08/15	11,000,000.00	11,343,750.00	
	US T 3.625% 20/02/15	15,000,000.00	15,349,218.75	
	US T 3.625% 21/02/15	3,000,000.00	3,030,468.75	
	US T 3.75% 18/11/15	11,000,000.00	11,531,093.75	
	US T 3.875% 12/10/31	3,000,000.00	3,154,218.75	
	US T 3.875% 13/02/15	3,800,000.00	4,023,843.75	
	US T 3.875% 18/05/15	6,000,000.00	6,375,000.00	
	US T 3.875% 40/8/15	11,000,000.00	9,735,000.00	
	US T 4% 12/11/15	5,000,000.00	5,272,656.25	
	US T 4% 14/02/15	6,500,000.00	7,017,968.75	
	US T 4% 18/08/15	6,000,000.00	6,411,562.50	
	US T 4% 2015/02/15	7,700,000.00	8,367,734.37	

US T 4.125 15/05/15	7,200,000.00	7,858,125.00
US T 4.125% 12/08/31	2,500,000.00	2,627,929.70
US T 4.25% 12/09/30	3,000,000.00	3,163,593.75
US T 4.25% 13/08/15	7,000,000.00	7,541,406.25
US T 4.25% 13/11/15	6,900,000.00	7,469,250.00
US T 4.25% 14/08/15	5,400,000.00	5,904,562.50
US T 4.25% 14/11/15	6,100,000.00	6,682,359.37
US T 4.25% 15/08/15	7,600,000.00	8,343,375.00
US T 4.25% 17/11/15	5,000,000.00	5,446,875.00
US T 4.25% 39/05/15	7,000,000.00	6,644,531.25
US T 4.25% 40/11/15	11,000,000.00	10,410,468.75
US T 4.375% 12/08/15	3,700,000.00	3,896,562.50
US T 4.375% 38/02/15	4,200,000.00	4,087,125.00
US T 4.375% 39/11/15	11,000,000.00	10,652,812.50
US T 4.375% 40/05/15	11,000,000.00	10,640,781.25
US T 4.5 15/11/15	5,800,000.00	6,431,656.25
US T 4.5% 12/03/31	3,500,000.00	3,642,187.50
US T 4.5% 12/04/30	3,000,000.00	3,132,187.50
US T 4.5% 160215	5,400,000.00	5,994,000.00
US T 4.5% 17/05/15	5,000,000.00	5,535,937.50
US T 4.5% 36/02/15	5,500,000.00	5,494,843.75
US T 4.5% 38/05/15	4,500,000.00	4,466,250.00
US T 4.5% 39/08/15	9,000,000.00	8,904,375.00
US T 4.625% 12/02/29	2,500,000.00	2,596,093.75
US T 4.625% 12/07/31	3,000,000.00	3,165,703.14
US T 4.625% 16/11/15	5,200,000.00	5,795,562.50
US T 4.625% 17/02/15	5,000,000.00	5,567,187.50
US T 4.625% 40/02/15	10,000,000.00	10,087,500.00
US T 4.75% 12/05/31	3,500,000.00	3,676,367.20
US T 4.75% 14/05/15	6,400,000.00	7,078,000.00
US T 4.75% 17/08/15	5,000,000.00	5,606,250.00

US T 4.75% 37/02/15	4,000,000.00	4,140,625.00
US T 4.75% 41/02/15	3,000,000.00	3,083,906.25
US T 4.875% 12/06/30	3,500,000.00	3,693,046.87
US T 4.875% 16/08/15	4,900,000.00	5,530,109.37
US T 5% 37/05/15	4,000,000.00	4,297,500.00
US T 5.125% 16/05/15	5,700,000.00	6,493,546.87
US T 5.25% 28/11/15	3,000,000.00	3,350,625.00
US T 5.25% 29/02/15	2,000,000.00	2,233,750.00
US T 5.375% 31/02/15	3,020,000.00	3,423,453.12
US T 5.5% 28/08/15	2,000,000.00	2,295,937.50
US T 6% 26/02/15	3,000,000.00	3,623,906.25
US T 6.125% 27/11/15	4,000,000.00	4,903,125.00
US T 6.125% 29/08/15	2,420,000.00	2,978,868.75
US T 6.25% 23/08/15	4,500,000.00	5,553,984.37
US T 6.25% 30/05/15	3,000,000.00	3,750,937.50
US T 6.5% 26/11/15	2,000,000.00	2,535,625.00
US T 6.625% 27/02/15	2,000,000.00	2,567,500.00
US T 6.75% 26/08/15	1,000,000.00	1,296,718.75
US T 6.875% 25/08/15	2,000,000.00	2,613,125.00
US T 7.125% 23/02/15	2,400,000.00	3,165,375.00
US T 7.25% 16/05/15	4,000,000.00	4,970,625.00
US T 7.25% 22/08/15	2,500,000.00	3,321,484.37
US T 7.5% 16/11/15	3,400,000.00	4,306,843.75
US T 7.5% 24/11/15	2,000,000.00	2,741,562.50
US T 7.625% 25/02/15	2,000,000.00	2,772,812.50
US T 7.875% 21/02/15	2,000,000.00	2,740,937.50
US T 8% 21/11/15	2,800,000.00	3,890,250.00
US T 8.125% 19/08/15	3,300,000.00	4,514,296.87
US T 8.125% 21/05/15	1,000,000.00	1,393,750.00
US T 8.125% 21/08/15	2,000,000.00	2,796,250.00
US T 8.75% 17/05/15	3,000,000.00	4,050,468.75

	US T 8.75% 20/08/15	3,000,000.00	4,303,125.00	
	US T 8.875% 17/08/15	2,000,000.00	2,730,937.50	
	US T 8.875% 190215	2,100,000.00	2,961,656.25	
	米ドル 小計	1,139,290,000.00	1,179,120,908.98	
	( 邦貨換算額 )		(99,057,947,563)	( 単位 : 円 )
	カナダドル			
	CAN 1.5% 12/06/01	1,000,000.00	999,820.00	
	CAN 1.5% 12/12/01	3,000,000.00	2,986,920.00	
	CAN 1.5% 2012/03/01	1,000,000.00	1,000,810.00	
	CAN 1.75% 2013/03/01	4,000,000.00	3,991,000.00	
	CAN 2% 12/09/01	3,000,000.00	3,014,010.00	
	CAN 2% 14/12/01	4,000,000.00	3,932,880.00	
	CAN 2% 16/06/01	2,000,000.00	1,921,600.00	
	CAN 2.5% 13/09/01	2,000,000.00	2,020,040.00	
	CAN 2.5% 2015/06/01	1,000,000.00	995,510.00	
	CAN 3% 14/06/01	4,500,000.00	4,590,810.00	
	CAN 3% 15/12/01	2,000,000.00	2,022,760.00	
	CAN 3.25% 21/06/01	2,000,000.00	1,953,200.00	
	CAN 3.5% 13/06/01	4,500,000.00	4,643,730.00	
	CAN 3.5% 20/06/01	3,000,000.00	3,015,000.00	
	CAN 3.75% 12/06/01	2,000,000.00	2,049,920.00	
	CAN 3.75% 19/06/01	5,000,000.00	5,155,000.00	
	CAN 4% 16/06/01	3,000,000.00	3,169,620.00	
	CAN 4% 17/06/01	3,000,000.00	3,166,020.00	
	CAN 4% 41/06/01	4,000,000.00	4,124,000.00	
	CAN 4.25% 18/06/01	2,500,000.00	2,672,250.00	
	CAN 4.5% 15/06/01	3,000,000.00	3,221,700.00	
	CAN 5% 14/06/01	2,500,000.00	2,701,675.00	
	CAN 5% 37/06/01	4,000,000.00	4,739,080.00	
	CAN 5.25% 12/06/01	2,620,000.00	2,729,332.60	

	CAN 5.25% 13/06/01	2,000,000.00	2,136,820.00	
	CAN 5.75% 29/06/01	2,800,000.00	3,510,304.00	
	CAN 5.75% 33/06/01	3,000,000.00	3,841,800.00	
	CAN 8% 23/06/01	980,000.00	1,398,616.80	
	CAN 8% 27/06/01	2,000,000.00	3,023,960.00	
	CAN 9% 25/06/01	1,480,000.00	2,339,732.00	
	CANADA-GOV'T 1.25 111201	1,000,000.00	1,000,020.00	
	カナダドル 小計	81,880,000.00	88,067,940.40	
	( 邦貨換算額 )		(7,690,973,235)	( 単位 : 円 )
	メキシコペソ			
	MEX BONOS 8% 200611	50,000,000.00	52,505,000.00	
	MEX BONOS 8.5% 290531	50,000,000.00	52,010,700.00	
	MEX BONOS 8.5% 381118	50,000,000.00	50,829,250.00	
	MEX BONOS 9% 121220	100,000,000.00	106,090,000.00	
	MEX BONOS 9.5% 141218	80,000,000.00	88,440,000.00	
	メキシコペソ 小計	330,000,000.00	349,874,950.00	
	( 邦貨換算額 )		(2,480,613,395)	( 単位 : 円 )
	ユーロ			
	BGB 2.75% 16/03/28	2,000,000.00	1,935,400.00	
	BGB 3.25% 16/09/28	3,500,000.00	3,434,550.00	
	BGB 3.5% 15/03/28	1,500,000.00	1,515,600.00	
	BGB 3.5% 17/06/28	2,000,000.00	1,963,400.00	
	BGB 3.75% 15/09/28	3,300,000.00	3,352,140.00	
	BGB 3.75% 20/09/28	4,000,000.00	3,880,000.00	
	BGB 4% 13/03/28	2,800,000.00	2,892,400.00	
	BGB 4% 14/03/28	3,200,000.00	3,309,760.00	
	BGB 4% 17/03/28	2,500,000.00	2,530,750.00	
	BGB 4% 18/03/28	2,500,000.00	2,520,000.00	
	BGB 4% 19/03/28	3,000,000.00	3,002,400.00	

	BGB 4% 2022/03/28	3,000,000.00	2,943,900.00	
	BGB 4.25% 13/09/28	3,000,000.00	3,122,700.00	
	BGB 4.25% 14/09/28	3,500,000.00	3,641,400.00	
	BGB 4.25% 2041/03/28	1,000,000.00	924,500.00	
	BGB 4.25% 21/09/28	1,000,000.00	1,001,100.00	
	BGB 5% 12/09/28	3,700,000.00	3,858,360.00	
	BGB 5% 35/03/28	4,000,000.00	4,181,600.00	
	BGB 5.5% 17/09/28	1,740,000.00	1,904,082.00	
	BGB 5.5% 28/03/28	4,000,000.00	4,425,600.00	
	BGB 8% 12/12/24	1,600,000.00	1,754,400.00	
	BGB 8% 15/03/28	2,000,000.00	2,351,200.00	
	BKO 1% 12/12/14	5,000,000.00	4,936,000.00	
	BTNS 0.75% 12/09/20	2,700,000.00	2,664,630.00	
	BTNS 2% 15/07/12	6,000,000.00	5,798,700.00	
	BTNS 2.25% 16/02/25	4,000,000.00	3,872,000.00	
	BTNS 2.5% 14/01/12	6,500,000.00	6,534,125.00	
	BTNS 2.5% 15/01/15	4,500,000.00	4,468,725.00	
	BTNS 3% 14/07/12	4,500,000.00	4,580,100.00	
	BTNS 3.75% 13/01/12	7,000,000.00	7,218,820.00	
	BTNS 4.5% 12/07/12	5,900,000.00	6,090,216.00	
	BTNS 4.5% 13/07/12	5,500,000.00	5,792,050.00	
	BTPS 2% 12/12/15	5,000,000.00	4,966,250.00	
	BTPS 2% 13/06/01	4,000,000.00	3,935,200.00	
	BTPS 2.25% 13/11/01	3,000,000.00	2,943,000.00	
	BTPS 2.5% 12/07/01	4,000,000.00	4,015,600.00	
	BTPS 3% 12/03/01	1,000,000.00	1,010,050.00	
	BTPS 3% 15/04/15	5,000,000.00	4,896,500.00	
	BTPS 3% 15/06/15	4,000,000.00	3,906,400.00	
	BTPS 3% 15/11/01	3,000,000.00	2,911,200.00	
	BTPS 3.5% 14/06/01	5,000,000.00	5,034,000.00	
	BTPS 3.75% 13/12/15	5,000,000.00	5,087,500.00	

	BTPS 3.75% 15/08/01	7,200,000.00	7,246,080.00	
	BTPS 3.75% 16/08/01	6,000,000.00	6,000,000.00	
	BTPS 3.75% 21/03/01	6,000,000.00	5,595,600.00	
	BTPS 3.75% 21/08/01	6,300,000.00	5,904,990.00	
	BTPS 4% 12/04/15	4,500,000.00	4,589,550.00	
	BTPS 4% 17/02/01	6,000,000.00	6,036,000.00	
	BTPS 4% 20/09/01	5,500,000.00	5,282,200.00	
	BTPS 4% 37/02/01	6,500,000.00	5,331,950.00	
	BTPS 4.25 12/10/15	4,000,000.00	4,108,960.00	
	BTPS 4.25 13/08/01	5,810,000.00	5,988,948.00	
	BTPS 4.25 19/02/01	6,400,000.00	6,380,800.00	
	BTPS 4.25% 13/04/15	4,500,000.00	4,633,200.00	
	BTPS 4.25% 14/08/01	6,900,000.00	7,096,650.00	
	BTPS 4.25% 15/02/01	6,000,000.00	6,158,400.00	
	BTPS 4.25% 19/09/01	5,000,000.00	4,970,000.00	
	BTPS 4.25% 20/03/01	6,000,000.00	5,911,200.00	
	BTPS 4.5% 18/02/01	6,000,000.00	6,132,000.00	
	BTPS 4.5% 18/08/01	5,000,000.00	5,092,000.00	
	BTPS 4.5% 19/03/01	5,000,000.00	5,063,500.00	
	BTPS 4.5% 20/02/01	5,500,000.00	5,535,200.00	
	BTPS 4.5% 26/03/01	3,000,000.00	2,824,800.00	
	BTPS 4.75% 13/02/01	5,300,000.00	5,502,672.00	
	BTPS 4.75% 21/09/01	2,000,000.00	2,007,000.00	
	BTPS 4.75% 23/08/01	4,500,000.00	4,466,250.00	
	BTPS 5% 25/03/01	5,000,000.00	5,005,500.00	
	BTPS 5% 34/08/01	4,970,000.00	4,746,350.00	
	BTPS 5% 39/08/01	5,000,000.00	4,713,500.00	
	BTPS 5% 40/09/01	4,000,000.00	3,756,000.00	
	BTPS 5.25 17/08/01	5,000,000.00	5,329,000.00	
	BTPS 5.25% 29/11/01	7,200,000.00	7,224,480.00	
	BTPS 5.75% 33/02/01	3,700,000.00	3,875,750.00	



	BTPS 6% 31/05/01	7,900,000.00	8,508,300.00	
	BTPS 6.5% 27/11/01	5,960,000.00	6,788,440.00	
	BTPS 7.25% 26/11/01	2,000,000.00	2,439,400.00	
	BTPS 9.00% 23/11/01	3,000,000.00	4,119,000.00	
	BUNDESOLIGA 2% 16/02/26	5,000,000.00	4,829,500.00	
	BUNDESSCHATZ 0.5% 120615	2,500,000.00	2,469,625.00	
	BUNDESSCHATZ 0.75% 120914	4,000,000.00	3,948,680.00	
	BUNDESSCHATZ 1% 12/03/16	3,000,000.00	2,990,850.00	
	DBR 2.25% 20/09/04	4,000,000.00	3,628,800.00	
	DBR 2.5% 21/01/04	4,000,000.00	3,686,000.00	
	DBR 3% 20/07/04	5,000,000.00	4,841,000.00	
	DBR 3.25% 15/07/04	5,500,000.00	5,643,275.00	
	DBR 3.25% 20/01/04	5,500,000.00	5,450,500.00	
	DBR 3.25% 42/07/04	2,000,000.00	1,763,400.00	
	DBR 3.5% 160104	5,200,000.00	5,375,500.00	
	DBR 3.5% 19/07/04	6,000,000.00	6,072,600.00	
	DBR 3.75% 13/07/04	5,800,000.00	6,021,850.00	
	DBR 3.75% 15/01/04	6,000,000.00	6,269,400.00	
	DBR 3.75% 17/01/04	5,000,000.00	5,205,000.00	
	DBR 3.75% 19/01/04	6,000,000.00	6,195,600.00	
	DBR 4% 18/01/04	5,000,000.00	5,262,000.00	
	DBR 4% 37/01/04	6,200,000.00	6,221,700.00	
	DBR 4.00% 16/07/04	5,900,000.00	6,220,960.00	
	DBR 4.25% 14/01/04	5,700,000.00	6,017,775.00	
	DBR 4.25% 14/07/04	6,500,000.00	6,886,750.00	
	DBR 4.25% 17/07/04	5,000,000.00	5,338,000.00	
	DBR 4.25% 18/07/04	5,200,000.00	5,547,880.00	
	DBR 4.25% 39/07/04	3,500,000.00	3,663,100.00	
	DBR 4.5% 13/01/04	6,700,000.00	7,007,865.00	
	DBR 4.75% 28/07/04	3,000,000.00	3,291,000.00	
	DBR 4.75% 34/07/04	4,600,000.00	5,096,800.00	

	DBR 4.75% 40/07/04	4,000,000.00	4,532,400.00	
	DBR 5% 12/07/04	7,220,000.00	7,514,937.00	
	DBR 5.5% 31/01/04	4,300,000.00	5,162,150.00	
	DBR 5.625% 28/01/04	2,980,000.00	3,581,066.00	
	DBR 6% 16/06/20	890,000.00	1,019,406.00	
	DBR 6.25% 24/01/04	2,700,000.00	3,389,580.00	
	DBR 6.25% 300104	2,200,000.00	2,858,460.00	
	DBR 6.5% 27/07/04	3,000,000.00	3,918,600.00	
	FINNISH GO 1.75% 160415	1,000,000.00	942,400.00	
	FINNISH GO 3.875% 170915	2,000,000.00	2,066,000.00	
	FRANCE 3.75% 17/04/25	6,000,000.00	6,180,000.00	
	FRANCE 3.75% 19/10/25	5,000,000.00	5,055,000.00	
	FRANCE O.A.T.3.5% 150425	4,600,000.00	4,738,920.00	
	FRANCE O.A.T.3.5% 200425	7,000,000.00	6,914,600.00	
	FRANCE O.A.T.4% 600425	2,000,000.00	1,884,800.00	
	FRANCE O.A.T.5% 12/04/25	4,700,000.00	4,868,730.00	
	FRANCE OAT4% 141025	5,000,000.00	5,248,000.00	
	FRTR 2.5% 20/10/25	6,000,000.00	5,412,600.00	
	FRTR 3.0% 15/10/25	8,000,000.00	8,052,800.00	
	FRTR 3.25% 16/04/25	6,700,000.00	6,781,070.00	
	FRTR 3.5% 26/04/25	4,000,000.00	3,734,800.00	
	FRTR 3.75% 21/04/25	7,700,000.00	7,695,380.00	
	FRTR 4% 13/04/25	5,700,000.00	5,929,710.00	
	FRTR 4% 13/10/25	5,060,000.00	5,289,724.00	
	FRTR 4% 14/04/25	5,300,000.00	5,554,930.00	
	FRTR 4% 18/04/25	5,000,000.00	5,195,500.00	
	FRTR 4% 38/10/25	5,500,000.00	5,272,300.00	
	FRTR 4% 55/04/25	4,170,000.00	3,901,035.00	
	FRTR 4.25% 17/10/25	4,500,000.00	4,753,350.00	
	FRTR 4.25% 18/10/25	5,000,000.00	5,255,500.00	
	FRTR 4.25% 19/04/25	6,900,000.00	7,247,760.00	

FRTR 4.25% 23/10/25	7,000,000.00	7,223,300.00
FRTR 4.5% 41/04/25	3,000,000.00	3,110,700.00
FRTR 4.75% 12/10/25	5,800,000.00	6,059,840.00
FRTR 4.75% 35/04/25	4,600,000.00	4,942,240.00
FRTR 5% 16/10/25	6,200,000.00	6,795,820.00
FRTR 5.5% 29/04/25	5,000,000.00	5,833,000.00
FRTR 5.75% 32/10/25	4,700,000.00	5,702,510.00
FRTR 6.00% 25/10/25	3,500,000.00	4,264,400.00
FRTR 8.5% 12/12/26	1,000,000.00	1,111,300.00
FRTR 8.5% 19/10/25	2,550,000.00	3,474,630.00
FRTR 8.5% 23/04/25	3,200,000.00	4,634,880.00
IRISH 4% 14/01/15	2,500,000.00	2,174,000.00
IRISH 4.4% 19/06/18	1,500,000.00	1,099,500.00
IRISH 4.5% 18/10/18	2,000,000.00	1,509,200.00
IRISH 4.5% 20/04/18	2,490,000.00	1,784,085.00
IRISH 4.6% 16/04/18	2,800,000.00	2,294,880.00
IRISH 5% 13/04/18	2,000,000.00	1,894,000.00
IRISH 5% 2020/10/18	2,000,000.00	1,480,000.00
IRISH 5.4% 25/03/13	2,000,000.00	1,472,600.00
IRISH 5.9% 19/10/18	2,000,000.00	1,646,800.00
ITALY 5.75% 16/07/25	1,000,000.00	1,074,100.00
NETHER 1% 14/01/15	2,000,000.00	1,934,400.00
NETHERLANDS 2.75 150115	3,500,000.00	3,519,950.00
NETHERLANDS 3.25% 150715	3,100,000.00	3,166,650.00
NETHERLANDS 3.25% 210715	2,000,000.00	1,922,800.00
NETHERLANDS 3.5% 200715	4,000,000.00	3,966,800.00
NETHERLANDS 3.75% 140715	3,400,000.00	3,542,120.00
NETHERLANDS 3.75% 230115	2,000,000.00	1,991,200.00
NETHERLANDS 3.75% 420115	2,000,000.00	1,914,800.00
NETHERLANDS 4% 16/07/15	3,300,000.00	3,462,690.00
NETHERLANDS 4% 18/07/15	3,500,000.00	3,638,950.00

	NETHERLANDS 4% 19/07/15	2,500,000.00	2,589,250.00	
	NETHERLANDS 4.25% 130715	3,400,000.00	3,564,220.00	
	NETHERLANDS 4.5% 170715	3,600,000.00	3,861,360.00	
	NETHERLANDS 5% 12/07/15	4,000,000.00	4,165,600.00	
	NETHERLANDS 5.5% 280115	3,000,000.00	3,547,500.00	
	NETHERLANDS 7.5% 230115	1,000,000.00	1,354,100.00	
	NETHERLANDS G1.75% 130115	3,000,000.00	2,994,900.00	
	NETHERLANDS GOVT4%370115	3,000,000.00	2,981,700.00	
	OBL 1.75% 15/10/09	4,000,000.00	3,852,400.00	
	OBL 2.25% 14/04/11	4,000,000.00	4,012,200.00	
	OBL 2.25% 15/04/10	4,000,000.00	3,961,000.00	
	OBL 2.5% 14/10/10	4,000,000.00	4,017,600.00	
	OBL 2.5% 15/02/27	4,500,000.00	4,504,275.00	
	OBL 3.5% 13/04/12	4,500,000.00	4,641,300.00	
	OBL 4% 12/04/13	4,000,000.00	4,100,200.00	
	OBL 4% 13/10/11	4,000,000.00	4,189,400.00	
	OBL 4.25% 12/10/12	4,000,000.00	4,148,200.00	
	PGB 3.35% 15/10/15	3,000,000.00	2,388,000.00	
	PGB 3.6% 14/10/15	2,000,000.00	1,660,000.00	
	PGB 3.85% 21/04/15	2,000,000.00	1,377,600.00	
	PGB 4.10% 37/04/15	2,000,000.00	1,295,000.00	
	PGB 4.2% 16/10/15	1,000,000.00	790,000.00	
	PGB 4.35% 17/10/16	1,400,000.00	1,078,000.00	
	PGB 4.375% 14/06/16	2,000,000.00	1,742,000.00	
	PGB 4.45% 18/06/15	2,000,000.00	1,498,800.00	
	PGB 4.75% 19/06/14	2,000,000.00	1,518,000.00	
	PGB 4.8% 20/06/15	2,000,000.00	1,525,000.00	
	PGB 4.95% 23/10/25	2,000,000.00	1,403,200.00	
	PGB 5% 12/06/15	1,500,000.00	1,458,750.00	
	PGB 5.45% 13/09/23	2,000,000.00	1,875,000.00	
	RAGB 3.2% 17/02/20	1,000,000.00	996,500.00	

	RAGB 3.4% 14/10/20	3,000,000.00	3,072,000.00	
	RAGB 3.5% 15/07/15	3,200,000.00	3,272,000.00	
	RAGB 3.5% 21/09/15	3,000,000.00	2,910,000.00	
	RAGB 3.65% 22/04/20	1,000,000.00	978,000.00	
	RAGB 3.8% 13/10/20	3,000,000.00	3,111,000.00	
	RAGB 3.9% 20/07/15	3,500,000.00	3,533,250.00	
	RAGB 4% 16/09/15	3,000,000.00	3,115,500.00	
	RAGB 4.15% 37/03/15	2,000,000.00	1,946,000.00	
	RAGB 4.3% 14/07/15	2,400,000.00	2,526,000.00	
	RAGB 4.3% 17/09/15	1,500,000.00	1,575,000.00	
	RAGB 4.35% 19/03/15	2,200,000.00	2,307,800.00	
	RAGB 4.65% 18/01/15	3,000,000.00	3,210,000.00	
	RAGB 4.85% 26/03/15	2,000,000.00	2,147,000.00	
	RAGB 5% 12/07/15	3,000,000.00	3,117,000.00	
	RAGB 6.25% 27/07/15	2,000,000.00	2,476,000.00	
	RFGB 3.125% 14/09/15	1,500,000.00	1,531,800.00	
	RFGB 3.375% 20/04/15	2,000,000.00	1,957,400.00	
	RFGB 3.5% 21/04/15	1,000,000.00	978,300.00	
	RFGB 4% 25/07/04	1,000,000.00	1,008,000.00	
	RFGB 4.25% 12/09/15	2,000,000.00	2,066,000.00	
	RFGB 4.25% 15/07/04	1,300,000.00	1,375,660.00	
	RFGB 4.375% 19/07/04	1,000,000.00	1,057,500.00	
	RFGB 5.375% 13/07/04	1,500,000.00	1,605,000.00	
	SPGB 2.3% 2013/04/30	4,500,000.00	4,423,500.00	
	SPGB 2.5% 13/10/31	4,000,000.00	3,906,000.00	
	SPGB 2.75% 12/04/30	3,500,000.00	3,516,450.00	
	SPGB 3% 15/04/30	3,000,000.00	2,895,000.00	
	SPGB 3.15% 16/01/31	3,800,000.00	3,619,500.00	
	SPGB 3.25% 16/04/30	2,000,000.00	1,890,700.00	
	SPGB 3.3% 14/10/31	3,000,000.00	2,953,200.00	
	SPGB 3.8% 17/01/31	3,000,000.00	2,899,500.00	

	SPGB 3.9% 12/10/31	3,500,000.00	3,552,500.00	
	SPGB 4% 20/04/30	4,000,000.00	3,723,600.00	
	SPGB 4.1% 18/07/30	4,000,000.00	3,816,400.00	
	SPGB 4.2% 13/07/30	3,500,000.00	3,564,050.00	
	SPGB 4.2% 37/01/31	3,250,000.00	2,571,400.00	
	SPGB 4.25% 14/01/31	3,500,000.00	3,566,500.00	
	SPGB 4.3% 19/10/31	3,000,000.00	2,842,800.00	
	SPGB 4.4% 15/01/31	3,800,000.00	3,860,800.00	
	SPGB 4.6% 19/07/30	3,500,000.00	3,409,000.00	
	SPGB 4.65% 25/07/30	3,500,000.00	3,208,100.00	
	SPGB 4.7% 41/07/30	2,000,000.00	1,693,000.00	
	SPGB 4.75% 14/07/30	3,500,000.00	3,613,400.00	
	SPGB 4.8% 24/01/31	3,300,000.00	3,130,380.00	
	SPGB 4.85% 20/10/31	4,000,000.00	3,910,000.00	
	SPGB 4.9% 40/07/30	4,000,000.00	3,500,400.00	
	SPGB 5% 12/07/30	3,100,000.00	3,188,970.00	
	SPGB 5.5% 17/07/30	4,280,000.00	4,480,304.00	
	SPGB 5.5% 21/04/30	2,000,000.00	2,039,400.00	
	SPGB 5.75% 32/07/30	3,700,000.00	3,665,960.00	
	SPGB 5.9% 26/07/30	1,000,000.00	1,025,000.00	
	SPGB 6% 29/01/31	4,900,000.00	5,059,740.00	
	SPGB 6.15% 13/01/31	3,600,000.00	3,797,640.00	
	ユーロ 小計	940,870,000.00	952,299,500.00	
	( 邦貨換算額 )		(115,809,142,195)	( 単位 : 円 )
	英ポンド			
	UKT 2% 16/01/22	4,000,000.00	3,894,040.00	
	UKT 2.25% 14/03/07	7,000,000.00	7,097,370.00	
	UKT 2.75% 15/01/22	6,500,000.00	6,625,450.00	
	UKT 3.75% 19/09/07	6,000,000.00	6,093,000.00	
	UKT 3.75% 20/09/07	6,000,000.00	6,023,940.00	

	UKT 4% 16/09/07	4,800,000.00	5,105,568.00	
	UKT 4% 22/03/07	3,000,000.00	3,034,380.00	
	UKT 4% 60/01/22	2,000,000.00	1,872,400.00	
	UKT 4.25% 27/12/07	3,800,000.00	3,806,080.00	
	UKT 4.25% 32/06/07	3,800,000.00	3,747,978.00	
	UKT 4.25% 36/03/07	4,800,000.00	4,705,632.00	
	UKT 4.25% 39/09/07	3,500,000.00	3,435,810.00	
	UKT 4.25% 40/12/07	4,000,000.00	3,907,000.00	
	UKT 4.25% 46/12/07	3,900,000.00	3,850,665.00	
	UKT 4.25% 49/12/07	3,500,000.00	3,453,905.00	
	UKT 4.25% 55/12/07	5,000,000.00	4,956,200.00	
	UKT 4.5% 13/03/07	6,700,000.00	7,102,000.00	
	UKT 4.5% 19/03/07	5,200,000.00	5,581,024.80	
	UKT 4.5% 34/09/07	4,000,000.00	4,056,400.00	
	UKT 4.5% 42/12/07	5,000,000.00	5,108,500.00	
	UKT 4.75% 15/09/07	4,400,000.00	4,828,604.00	
	UKT 4.75% 20/03/07	5,200,000.00	5,647,772.00	
	UKT 4.75% 30/12/07	3,800,000.00	3,999,576.00	
	UKT 4.75% 38/12/07	4,500,000.00	4,782,735.00	
	UKT 5% 14/09/07	5,500,000.00	6,039,055.00	
	UKT 5% 18/03/07	3,500,000.00	3,899,840.00	
	UKT 5% 25/03/07	3,400,000.00	3,729,868.00	
	UKT 5.25% 12/06/07	5,500,000.00	5,773,350.00	
	UKT 6.0% 28/12/07	3,000,000.00	3,656,100.00	
	UKT 8% 13/09/27	2,500,000.00	2,901,250.00	
	UKT 8% 15/12/07	1,900,000.00	2,365,139.00	
	UKT 8% 21/06/07	2,620,000.00	3,561,104.00	
	UKT 8.75% 17/08/25	2,300,000.00	3,084,254.00	
	英債券 小計	140,620,000.00	147,725,989.80	
	(邦貨換算額)		(20,188,233,766)	(単位：円)

	スイスフラン			
	SWITZERLAND 2.5% 160312	2,000,000.00	2,098,200.00	
	SWITZERLAND 2.75% 120610	1,500,000.00	1,539,300.00	
	SWITZERLAND 3% 180108	1,000,000.00	1,078,600.00	
	SWITZERLAND 3% 19/05/12	2,000,000.00	2,156,200.00	
	SWITZERLAND 4% 13/02/11	2,000,000.00	2,116,000.00	
	SWITZERLAND 4% 280408	900,000.00	1,106,280.00	
	SWITZERLAND 4% 230211	2,000,000.00	2,372,000.00	
	SWITZERLAND 4.25% 140106	800,000.00	868,000.00	
	SWITZERLAND 4.25% 170605	2,000,000.00	2,299,000.00	
	スイスフラン 小計	14,200,000.00	15,633,580.00	
	( 邦貨換算額 )		(1,462,365,073)	( 単位 : 円 )
	スウェーデンクローナ			
	SGB 3% 16/07/12	17,000,000.00	16,845,300.00	
	SGB 3.5% 39/03/30	10,000,000.00	9,604,600.00	
	SGB 3.75% 17/08/12	13,200,000.00	13,552,440.00	
	SGB 4.25% 19/03/12	20,000,000.00	21,217,200.00	
	SGB 4.5% 15/08/12	13,000,000.00	13,759,200.00	
	SGB 5% 20/12/01	20,000,000.00	22,658,000.00	
	SGB 5.5% 12/10/08	16,000,000.00	16,732,800.00	
	SGB 6.75% 14/05/05	19,100,000.00	21,248,750.00	
	スウェーデンクローナ 小計	128,300,000.00	135,618,290.00	
	( 邦貨換算額 )		(1,809,147,988)	( 単位 : 円 )
	ノルウェークローネ			
	NORWAY GOV 4.25% 170519	10,000,000.00	10,378,000.00	
	NORWAY GOV 4.5% 19/05/22	6,000,000.00	6,301,200.00	
	NORWAY GOV 5% 150515	10,000,000.00	10,692,000.00	
	NORWAY GOV 6.5% 130515	16,000,000.00	17,201,600.00	
	ノルウェークローネ 小計	42,000,000.00	44,572,800.00	



	(邦貨換算額)		(685,083,936)	(単位：円)
	デンマーククローネ			
	DGB 4% 12/11/15	10,000,000.00	10,346,000.00	
	DGB 4% 15/11/15	16,000,000.00	16,779,200.00	
	DGB 4% 17/11/15	15,000,000.00	15,714,000.00	
	DGB 4% 19/11/15	21,000,000.00	21,756,000.00	
	DGB 4.5% 39/11/15	27,000,000.00	29,678,400.00	
	DGB 5% 13/11/15	20,820,000.00	22,235,760.00	
	DGB 6% 11/11/15	13,000,000.00	13,357,500.00	
	DGB 7% 24/11/10	5,080,000.00	6,785,864.00	
	デンマーククローネ 小計	127,900,000.00	136,652,724.00	
	(邦貨換算額)		(2,228,805,928)	(単位：円)
	ポーランドズロチ			
	POLGB 0% 11/07/25	5,000,000.00	4,938,000.00	
	POLGB 0% 12/01/25	5,000,000.00	4,830,000.00	
	POLGB 0% 12/10/25	6,000,000.00	5,580,000.00	
	POLGB 4.75% 12/04/25	7,000,000.00	7,000,000.00	
	POLGB 5.00% 13/10/24	6,500,000.00	6,454,500.00	
	POLGB 5.25% 13/04/25	5,000,000.00	5,005,000.00	
	POLGB 5.25% 17/10/25	8,000,000.00	7,745,600.00	
	POLGB 5.25% 2020/10/25	5,000,000.00	4,690,000.00	
	POLGB 5.5% 19/10/25	6,000,000.00	5,754,600.00	
	POLGB 5.5% 2015/04/25	5,000,000.00	4,980,000.00	
	POLGB 5.75% 14/04/25	8,000,000.00	8,080,000.00	
	POLGB 5.75% 22/09/23	10,200,000.00	9,771,600.00	
	POLGB 6.25% 15/10/24	7,500,000.00	7,654,500.00	
	ポーランドズロチ 小計	84,200,000.00	82,483,800.00	
	(邦貨換算額)		(2,514,931,062)	(単位：円)

	オーストラリアドル			
	ACGB 4.5% 14/10/21	2,000,000.00	1,950,200.00	
	ACGB 4.5% 20/04/15	3,000,000.00	2,771,991.00	
	ACGB 4.75% 12/11/15	2,000,000.00	1,993,100.00	
	ACGB 4.75% 16/06/15	2,000,000.00	1,945,778.00	
	ACGB 5.25% 19/03/15	3,000,000.00	2,942,808.00	
	ACGB 5.5% 13/12/15	2,000,000.00	2,023,600.00	
	ACGB 5.75% 11/06/15	2,000,000.00	2,003,214.00	
	ACGB 5.75% 12/04/15	3,000,000.00	3,020,100.00	
	ACGB 5.75% 21/05/15	3,000,000.00	3,025,200.00	
	ACGB 5.75% 22/07/15	2,000,000.00	2,008,800.00	
	ACGB 6% 17/02/15	3,300,000.00	3,393,696.90	
	ACGB 6.25% 14/06/15	3,000,000.00	3,095,715.00	
	ACGB 6.25% 15/04/15	3,000,000.00	3,108,822.00	
	ACGB 6.5% 13/05/15	3,540,000.00	3,642,939.66	
	オーストラリアドル 小計	36,840,000.00	36,925,964.56	
	(邦貨換算額)		(3,250,961,919)	(単位：円)
	シンガポールドル			
	SIGB 1.625% 130401	3,000,000.00	3,070,992.00	
	SIGB 2.25% 13/07/01	1,000,000.00	1,041,544.00	
	SIGB 3.125% 22/09/01	1,000,000.00	1,050,182.00	
	SIGB 3.25% 20/09/01	2,000,000.00	2,143,510.00	
	SIGB 3.5% 12/07/01	1,000,000.00	1,038,579.00	
	SIGB 3.5% 27/03/01	2,000,000.00	2,121,048.00	
	SIGB 3.625 140701	2,500,000.00	2,736,367.50	
	SIGB 3.75% 160901	1,000,000.00	1,128,107.00	
	SIGB 4% 18/09/01	1,200,000.00	1,366,590.00	
	シンガポールドル 小計	14,700,000.00	15,696,919.50	
	(邦貨換算額)		(1,049,025,130)	(単位：円)

	マレーシアリングット			
	MALAYSIAN 2.509 12/08/27	6,000,000.00	5,960,520.00	
	MALAYSIAN 3.502 27/05/31	4,000,000.00	3,553,612.00	
	MALAYSIAN 3.702 13/02/25	8,000,000.00	8,079,440.00	
	MALAYSIAN 3.718 12/06/15	8,000,000.00	8,071,064.00	
	MALAYSIAN 3.814% 17/02/15	2,000,000.00	2,013,086.00	
	MALAYSIAN 4.24 18/02/07	5,000,000.00	5,112,415.00	
	MALAYSIAN 4.262 16/09/15	3,000,000.00	3,091,353.00	
	MALAYSIAN 4.378 19/11/29	5,000,000.00	5,138,850.00	
	MALAYSIAN 5.094 14/04/30	6,000,000.00	6,299,412.00	
	マレーシアリングット 小計	47,000,000.00	47,319,752.00	
	(邦貨換算額)		(1,310,757,130)	(単位：円)
	合計		259,537,988,320	単位：円
	(外貨建有価証券邦貨換算額合計)		(259,537,988,320)	(単位：円)

(注)

- 合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券にかかるもので、内書きであります。
- 米ドル表示の債券については、181銘柄、信託財産純資産総額に対する比率37.4%、合計に対する比率38.2%です。  
カナダドル表示の債券については、31銘柄、信託財産純資産総額に対する比率2.9%、合計に対する比率3.0%です。  
メキシコペソ表示の債券については、5銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.9%、合計に対する比率1.0%です。  
ユーロ表示の債券については、250銘柄、信託財産純資産総額に対する比率43.7%、合計に対する比率44.6%です。  
英ポンド表示の債券については、33銘柄、信託財産純資産総額に対する比率7.6%、合計に対する比率7.8%です。  
スイスフラン表示の債券については、9銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.6%、合計に対する比率0.6%です。  
スウェーデンクローナ表示の債券については、8銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.7%、合計に対する比率0.7%です。  
ノルウェークローネ表示の債券については、4銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.3%、合計に対する比率0.3%です。

デンマーククローネ表示の債券については、8銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.8%、合計に対する比率0.9%です。

ポーランドズロチ表示の債券については、13銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.9%、合計に対する比率1.0%です。

オーストラリアドル表示の債券については、14銘柄、信託財産純資産総額に対する比率1.2%、合計に対する比率1.3%です。

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

マレーシアリングgit表示の債券については、9銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.5%、合計に対する比率0.5%です。

「マネーインカム・マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

対象年月日	(平成22年4月13日現在)	(平成23年4月13日現在)
科目	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	7,836,318	9,674,435
国債証券	166,173,620	591,152,160
未収入金	3,009,630	-
未収利息	470,775	857,080
前払費用	254,317	963,217
流動資産合計	177,744,660	602,646,892
資産合計	177,744,660	602,646,892
負債の部		
流動負債		
未払解約金	4,000,000	-
流動負債合計	4,000,000	-
負債合計	4,000,000	-
純資産の部		
元本等		
元本		
元本	172,477,387	597,626,140
剰余金		
剰余金又は欠損金( )	1,267,273	5,020,752
元本等合計	173,744,660	602,646,892
純資産合計	173,744,660	602,646,892
負債純資産合計	177,744,660	602,646,892

(注) 「マネーインカム・マザーファンド」は、毎年4月13日(ただし、休業日の場合は翌営業日)に決算を行います。上記の貸借対照表は平成22年4月13日ならびに平成23年4月13日現在における同マザーファンド

の状況です。

## (2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自平成21年4月14日 至平成22年4月13日	自平成22年4月14日 至平成23年4月13日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券（売買目的有価証券） 個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。	国債証券（売買目的有価証券） 同左

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成22年4月13日現在)	(平成23年4月13日現在)
1. 受益権総数	平成22年4月13日現在における受益権の総数 172,477,387口	平成23年4月13日現在における受益権の総数 597,626,140口
2. 1単位当たり純資産額	1.0073円 (1万口 = 10,073円)	1.0084円 (1万口 = 10,084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21年4月14日 至平成22年4月13日	自平成22年4月14日 至平成23年4月13日
	(追加情報) 当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）および「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。	同左

<p>2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク</p>	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。当ファンドにおけるデリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、および価格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>	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 同 左</p> <p>2) デリバティブ取引 同 左</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 同 左</p>
-------------------------------	---	--



<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・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。リスクを管理する部署では、各種リスクごとに定められた頻度で、測定項目が上下限值（リミットあるいは注意レベル）内に収まっているかどうかのモニタリングを行っております。上下限値を越えていることが発見された場合は、原則として速やかに修正を行うよう、リスク管理を行う部署から関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われます。また、是正勧告あるいは報告を受けた関連運用グループでは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、リスク管理を行う部署は、上下限値に抵触した事実ならびにその後の対処結果あるいは関連運用グループの対処方針の決定に関し、必要に応じて、リスク管理を行う部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告する体制となっております。</p>	<p>同 左</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>	<p>同 左</p>

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成22年4月13日現在）	（平成23年4月13日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（国債証券） 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1) 有価証券（国債証券） 同左</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） 同左</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 同左</p>

（デリバティブ取引に関する注記）

（平成22年4月13日現在）

平成22年4月13日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（平成23年4月13日現在）

平成23年4月13日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（関連当事者との取引に関する注記）

（自平成21年4月14日 至 平成22年4月13日）

該当事項はありません。

（自平成22年4月14日 至 平成23年4月13日）

該当事項はありません。

(その他の注記)

(平成22年4月13日現在)	
本有価証券報告書における開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	21,902,962円
同期中における追加設定元本額	210,827,154円
同期中における一部解約元本額	60,252,729円
平成22年4月13日現在における元本の内訳	
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	2,701,199円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	299,285円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	30,913円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	224,256円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	30,912円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	17,004円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	62,009円
三井住友・ロシア株式オープン	999,001円
S M A M円高期待ファンド(豪ドル安型)	5,363,658円
S M A M円高期待ファンド(米ドル安型)	9,335,951円
S M A M円高期待ファンド(ユーロ安型)	1,591,335円
S M A M・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	151,821,864円
合計	172,477,387円

(平成23年4月13日現在)	
本有価証券報告書における開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	172,477,387円
同期中における追加設定元本額	485,297,846円
同期中における一部解約元本額	60,149,093円
平成23年4月13日現在における元本の内訳	
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	6,309,225円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	1,162,865円

スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	176,772円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	327,478円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	134,103円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	58,686円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	152,304円
三井住友・ロシア株式オープン	999,001円
S M A M円高期待ファンド(豪ドル安型)	8,340,735円
S M A M円高期待ファンド(米ドル安型)	6,359,956円
S M A M円高期待ファンド(ユーロ安型)	6,056,607円
アジア高成長国C Bファンド	29,767,812円
S M A M・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定>	228,804,935円
S M A M・バランス先物ファンドV A 2 0 <適格機関投資家限定>	307,467,761円
S M A M・F GマネーファンドV A <適格機関投資家限定>	1,507,900円
合計	597,626,140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231回利付国債(10年)	300,000,000	300,612,000	
	第234回利付国債(10年)	96,000,000	96,519,360	
	第235回利付国債(10年)	96,000,000	96,816,960	
	第237回利付国債(10年)	96,000,000	97,203,840	
	国債証券 小計	588,000,000	591,152,160	
	合計		591,152,160	

## 独立監査人の監査報告書

平成23年6月14日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 鈴木 敏夫 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているスミセイ・DCバランスファンド（機動的資産配分型）の平成22年4月14日から平成23年4月13日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、スミセイ・DCバランスファンド（機動的資産配分型）の平成23年4月13日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

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

[委託会社の監査報告書（当期）へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成22年6月16日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

あずさ監査法人

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

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」に掲げられているスミセイ・DCバランスファンド（機動的資産配分型）の平成21年4月14日から平成22年4月13日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、スミセイ・DCバランスファンド（機動的資産配分型）の平成22年4月13日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

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

[委託会社の監査報告書（前期）へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成23年 6月17日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友アセットマネジメント株式会社の平成22年4月1日から平成23年3月31日までの第26期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友アセットマネジメント株式会社の平成23年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

---

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



## 独立監査人の監査報告書

平成22年 6月18日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

あずさ監査法人

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

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

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

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

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

以 上

---

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