

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成24年7月12日

【発行者名】 三井住友アセットマネジメント株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 前田 良治

【本店の所在の場所】 東京都港区愛宕二丁目5番1号

【事務連絡者氏名】 三島 克哉

【電話番号】 03-5405-0228

**【届出の対象とした募集内国投資信託受益証 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	http://www.smam-jp.com

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

（５）【申込手数料】

無手数料です。

（６）【申込単位】

1円以上1円単位

（７）【申込期間】

平成24年7月13日から平成25年7月11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經由して、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
追 加 型	海 外	債 券
	内 外	不 動 産 投 信
		そ の 他 資 産
		(資 産 複 合)

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

《属性区分表》

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株 式	年 1 回	グ ローバル (日本を含む)		
一 般 大 型 株 中 小 型 株	年 2 回	日 本		
債 券	年 4 回	北 米	ファミリーファンド	あ り
一 般 公 債 社 債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回(隔月)	欧 州		
	年12回(毎月)	ア ジ ア		
	日 々	オセアニア		
不動産投信	そ の 他 ()	中 南 米	ファンド・オブ・ファンズ	な し
その他資産 (投資信託(資産収会)株式、債券、 円振替金融資産)資産区分変更型)		ア フ リ カ		
資産複合 ()		中近東(中東)		
資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング		

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

(2) 【ファンドの沿革】

平成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。

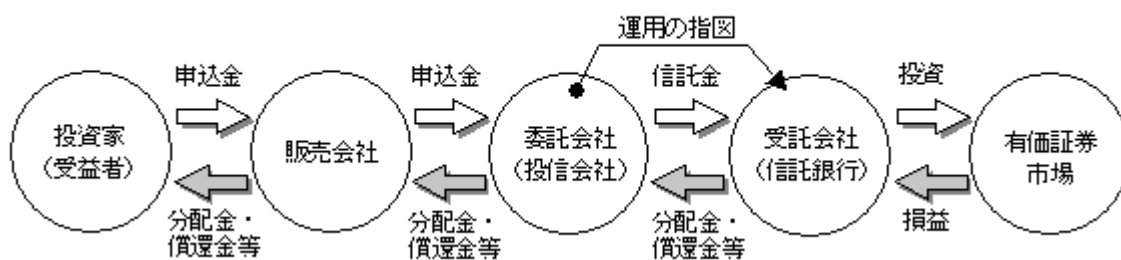
（ロ）受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

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

（ハ）販売会社

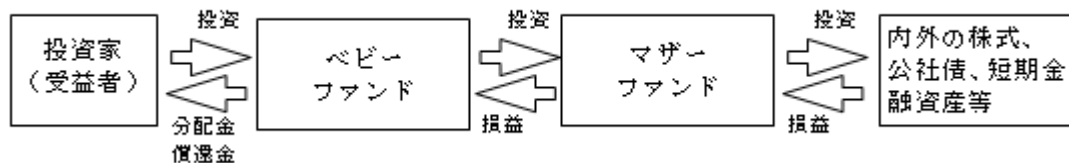
委託会社との間で締結される販売契約（名称の如何を問いません。）に基づき、当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書（目論見書）の提供、受益者からの一部解約実行請求の受付、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を行います。

運営の仕組み



当ファンドの運用は、「ファミリーファンド方式」で行われます。

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



ロ 委託会社の概況

（イ）資本金の額

2,000百万円（平成24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

(八) 大株主の状況

(平成24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。

(ニ) 実質外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

(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、原則として対円での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、

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

〔各マザーファンドの運用プロセス〕**国内株式インデックス・マザーファンド（B号）**

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

国内債券パッシブ・マザーファンド

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

外国株式インデックス・マザーファンド

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

外国債券パッシブ・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。

ハ 投資対象とする金融商品

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

とができます。

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

（3）【運用体制】

イ 運用体制

当ファンドの運用は、次のプロセスに基づいて行われます。

（イ）計画（Plan）

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

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

（ロ）実行（Do）

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

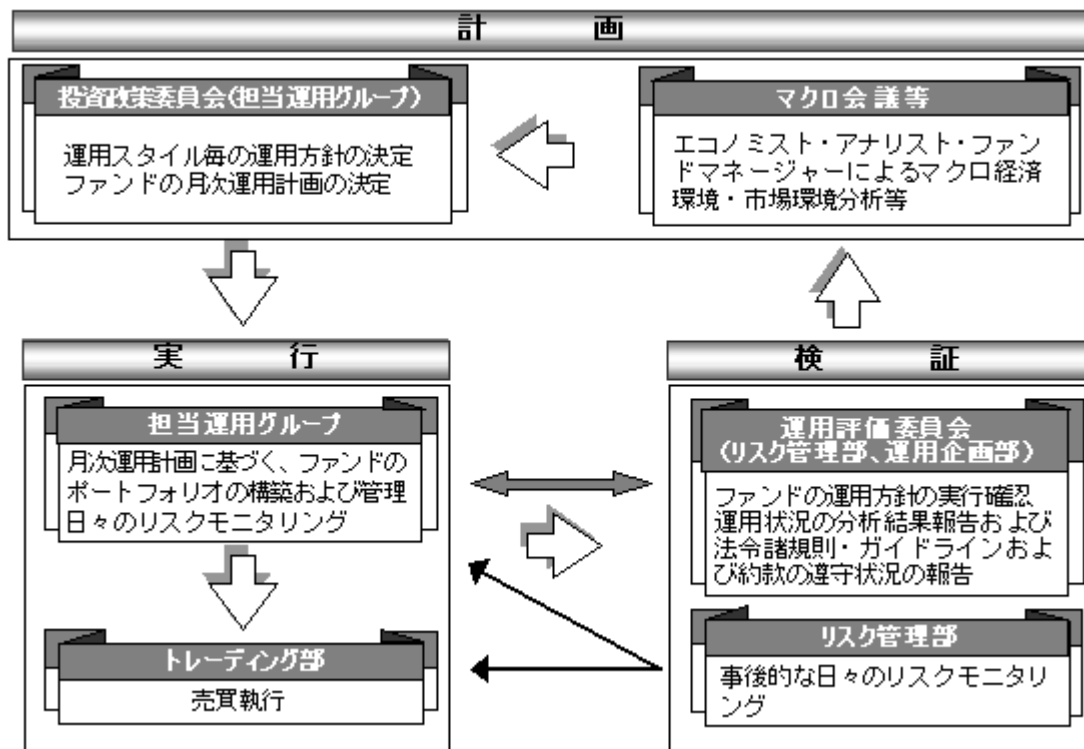
売買執行については、組織的に分離されたトレーディング部が、最良と思われる手法をもって売買を執行します。

（ハ）検証（Check）

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

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

【ファンドの運用体制】



リスク管理部は7名程度、運用企画部は10名程度で構成されています。

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

□ 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

（４）【分配方針】

毎年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もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- ハ 留保益の運用については、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るものとします。
- (ロ) 信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額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。
- (ニ) 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。

ハ 先物取引等の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、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。

ニ スワップ取引の指図

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

ヘ 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ます。

(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。

(ニ) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

法令に基づく投資制限

イ 同一法人の発行する株式への投資制限（投資信託及び投資法人に関する法律第9条）

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、信託財産として有する当該株式にかかる議決権の総数（株主総会において決議をすることができる事項の全部につき議決権を行使することができない株式についての議決権を除き、会社法第879条第3項の規定により議決権を有するものとみなされる株式についての議決権を含みます。）が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、信託財産をもって当該株式を取得することを受託会社に指図することが禁じられています。

ロ デリバティブ取引にかかる投資制限（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号）

委託会社は、信託財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的方法により算出した額が当該信託財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引（新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含みます。）を行い、または継続することを受託会社に指図しないものとします。

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

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

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

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

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

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ロ 投資対象とする有価証券」において記載したベビーファンドが投資対象とする有価証券の各号のうち、第1号、第2号、第4号、第10号、第13号、第18号および第19号に掲げるもの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 - KOKUSAIインデックス(円ベース)と連動する投資成果を目指して運用を行います。

ロ 投資態度

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

(ロ) 外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行わないものとします。

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

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 ロ 投資対象とする有価証券」において記載したベビーファンドが投資対象とする有価証券の各号のうち、第1号、第2号、第4号、第5号、第10号から第21号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、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

（ホ）公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

（ヘ）資金動向、市況動向等の急変により上記の運用が困難となった場合、暫定的に上記と異なる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。

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。

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

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

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

（イ）株式市場リスク

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

（ロ）債券市場リスク

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

（ハ）為替変動リスク

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

（ニ）信用リスク

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

（ホ）カントリーリスク

海外に投資を行う場合には、投資する有価証券の発行者に起因するリスクのほか、投資先の国の政治・経済・社会状況の不安定化や混乱などによって投資した資金の回収が困難になることや、その影響により投資する有価証券の価格が大きく変動することがあり、基準価額が下落する要因となります。

（ヘ）市場流動性リスク

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

（ト）収益分配金に関する留意事項

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

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

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

（チ）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。

□ 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な金額を認識するものがあったりすることから、あらかじめ具体的に記載することはできません。

（５）【課税上の取扱い】

イ 個別元本について

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

ロ 一部解約時および償還時の課税について

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

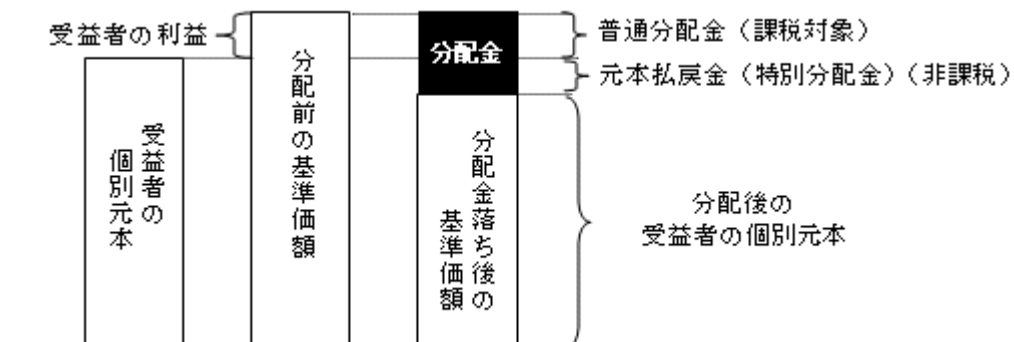
八 収益分配金の課税について

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

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



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



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

二 個人、法人別の課税の取扱いについて

(イ) 個人の受益者に対する課税

. 収益分配時

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、以下の税率による源泉徴収が行われ、申告不要制度が適用されます。確定申告による総合課税または申告分離課税の選択も可能です。

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

. 一部解約時および償還時

一部解約時および償還時の譲渡益については、以下の税率による申告分離課税が適用されます。ただし、特定口座（源泉徴収選択口座）の利用も可能です。

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

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

(ロ) 法人の受益者に対する課税

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに一部解約時および償還時の個別元本超過額については、以下の税率で源泉徴収されます。

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

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

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24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24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	47,110,144	21.50
国内債券パッシブ・マザーファンド受益証券	日本	100,418,064	45.83
外国株式インデックス・マザーファンド受益証券	日本	21,566,014	9.84
外国債券パッシブ・マザーファンド受益証券	日本	35,732,232	16.31
マネーインカム・マザーファンド受益証券	日本	14,293,463	6.52
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		12,766	0.01
合計(純資産総額)		219,107,151	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24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	89,023,107	1.1187 99,594,230	1.1280 100,418,064	45.83
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）	48,160,033	1.1045 53,194,057	0.9782 47,110,144	21.50
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	32,055,470	1.1624 37,263,191	1.1147 35,732,232	16.31
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	18,095,330	1.3143 23,783,548	1.1918 21,566,014	9.84
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	14,156,149	1.0096 14,292,406	1.0097 14,293,463	6.52

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24年5月31日現在

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.01
合計	100.01

【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
第4期(平成24年4月13日)(分配落)	220,003,408	9,507
第4期(平成24年4月13日)(分配付)	220,003,408	9,507
平成23年5月末日	142,683,803	9,432
平成23年6月末日	154,609,694	9,444
平成23年7月末日	159,515,846	9,347
平成23年8月末日	160,149,178	9,112
平成23年9月末日	168,046,370	9,021
平成23年10月末日	174,895,364	9,149
平成23年11月末日	178,330,909	8,951
平成23年12月末日	188,491,103	9,010
平成24年1月末日	197,032,124	9,124
平成24年2月末日	220,242,245	9,556
平成24年3月末日	225,680,262	9,655
平成24年4月末日	220,258,345	9,507
平成24年5月末日	219,107,151	9,117

【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
第4期(平成23年4月14日～平成24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
第4期	0.6

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

(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

第4期	108,988,282	13,561,540
-----	-------------	------------

(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24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	266,790,307,730	98.20
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,900,262,129	1.80
合計(純資産総額)		271,690,569,859	100.00

株価指数先物取引の買建て 1.79%

（2）投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成24年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〕	3,520,900	2,541.51 8,948,411,180	3,040.00 10,703,536,000	3.94
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ 〔銀行業〕	20,288,300	329.23 6,679,656,516	340.00 6,898,022,000	2.54
日本	株式	本田技研工業 〔輸送用機器〕	2,290,400	2,400.02 5,497,023,732	2,512.00 5,753,484,800	2.12
日本	株式	キヤノン 〔電気機器〕	1,686,700	3,414.01 5,758,415,676	3,150.00 5,313,105,000	1.96
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ 〔銀行業〕	2,034,600	2,104.00 4,280,808,988	2,289.00 4,657,199,400	1.71
日本	株式	日本電信電話 〔情報・通信業〕	1,234,000	3,757.10 4,636,264,940	3,380.00 4,170,920,000	1.54
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ 〔銀行業〕	34,471,500	100.97 3,480,856,015	115.00 3,964,222,500	1.46
日本	株式	ファナック 〔電気機器〕	282,700	12,343.26 3,489,441,810	13,520.00 3,822,104,000	1.41
日本	株式	武田薬品工業 〔医薬品〕	1,065,300	3,154.40 3,360,384,077	3,275.00 3,488,857,500	1.28
日本	株式	三菱商事 〔卸売業〕	1,951,900	1,552.86 3,031,029,359	1,535.00 2,996,166,500	1.10
日本	株式	ソフトバンク 〔情報・通信業〕	1,214,900	2,532.90 3,077,226,596	2,450.00 2,976,505,000	1.10
日本	株式	日本たばこ産業 〔食料品〕	6,750	368,879.23 2,489,934,841	437,000.00 2,949,750,000	1.09
日本	株式	日立製作所 〔電気機器〕	6,258,000	427.65 2,676,262,080	449.00 2,809,842,000	1.03
日本	株式	エヌ・ティ・ティ・ドコモ 〔情報・通信業〕	22,071	134,587.21 2,970,474,518	125,100.00 2,761,082,100	1.02
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス 〔小売業〕	1,121,500	2,141.27 2,401,436,986	2,359.00 2,645,618,500	0.97

日本	株式	日産自動車 〔輸送用機器〕	3,454,400	693.06 2,394,106,765	758.00 2,618,435,200	0.96
日本	株式	三井物産 〔卸売業〕	2,313,900	1,179.19 2,728,548,216	1,104.00 2,554,545,600	0.94
日本	株式	小松製作所 〔機械〕	1,326,400	1,897.43 2,516,751,470	1,878.00 2,490,979,200	0.92
日本	株式	三菱地所 〔不動産業〕	1,877,000	1,261.39 2,367,638,770	1,219.00 2,288,063,000	0.84
日本	株式	東日本旅客鉄道 〔陸運業〕	472,500	4,693.21 2,217,545,596	4,665.00 2,204,212,500	0.81
日本	株式	信越化学工業 〔化学〕	510,200	3,821.08 1,949,515,388	4,030.00 2,056,106,000	0.76
日本	株式	K D D I 〔情報・通信業〕	4,162	504,629.72 2,100,268,916	484,500.00 2,016,489,000	0.74
日本	株式	アステラス製薬 〔医薬品〕	631,200	2,947.76 1,860,626,595	3,080.00 1,944,096,000	0.72
日本	株式	伊藤忠商事 〔卸売業〕	2,138,200	768.55 1,643,314,350	859.00 1,836,713,800	0.68
日本	株式	ソニー 〔電気機器〕	1,695,100	1,356.26 2,299,009,980	1,050.00 1,779,855,000	0.66
日本	株式	東京海上ホールディングス 〔保険業〕	1,017,300	1,829.97 1,861,634,180	1,707.00 1,736,531,100	0.64
日本	株式	東芝 〔電気機器〕	5,720,000	344.48 1,970,466,250	295.00 1,687,400,000	0.62
日本	株式	三菱電機 〔電気機器〕	2,717,000	707.32 1,921,810,780	617.00 1,676,389,000	0.62
日本	株式	国際石油開発帝石 〔鉱業〕	3,698	501,754.85 1,855,489,471	453,000.00 1,675,194,000	0.62
日本	株式	住友商事 〔卸売業〕	1,582,000	1,010.61 1,598,790,232	1,053.00 1,665,846,000	0.61

□ 種類別・業種別の投資比率

平成24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	0.10	株式（国内）	精密機器	1.44
	鉱業	0.70		その他製品	1.46
	建設業	2.36		電気・ガス業	2.96
	食料品	3.90		陸運業	4.09
	繊維製品	0.92		海運業	0.39
	パルプ・紙	0.33		空運業	0.29
	化学	5.77		倉庫・運輸関連業	0.23
	医薬品	5.00		情報・通信業	6.37
	石油・石炭製品	0.79		卸売業	5.56
	ゴム製品	0.78		小売業	4.47
	ガラス・土石製品	1.00		銀行業	9.20
	鉄鋼	1.69		証券、商品先物取引業	1.00
	非鉄金属	1.11		保険業	2.08
	金属製品	0.68		その他金融業	0.81
	機械	4.97		不動産業	2.42
	電気機器	12.88		サービス業	1.95
	輸送用機器	10.50		合計	98.20

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

平成24年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	680	4,904,621,450	4,875,600,000	1.79

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については以下のように評価しております。

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

〔国内債券パッシブ・マザーファンド〕

(1) 投資状況

平成24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	367,254,610,660	75.99
地方債証券	日本	30,602,096,955	6.33
特殊債券	日本	49,770,472,626	10.30
	韓国	100,429,000	0.02
	小計	49,870,901,626	10.32
社債券	日本	28,642,996,500	5.93
	アメリカ	1,908,547,000	0.39
	オーストラリア	601,854,000	0.12
	イギリス	699,900,000	0.14
	オランダ	296,784,000	0.06
	韓国	202,354,000	0.04
	小計	32,352,435,500	6.69
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,191,150,733	0.66
合計(純資産総額)		483,271,195,474	100.00

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成24年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268回利付国債(10年)	13,845,000,000	103.92 14,387,724,000	103.89 14,384,539,650	1.5 2015/3/20	2.98
日本	国債証券	第265回利付国債(10年)	12,040,000,000	103.57 12,470,670,800	103.55 12,467,901,600	1.5 2014/12/20	2.58
日本	国債証券	第263回利付国債(10年)	11,072,000,000	103.46 11,455,091,200	103.43 11,452,323,200	1.6 2014/9/20	2.37
日本	国債証券	第260回利付国債(10年)	10,695,000,000	103.08 11,024,833,800	103.05 11,022,160,050	1.6 2014/6/20	2.28
日本	国債証券	第277回利付国債(10年)	10,375,000,000	105.49 10,944,587,500	105.56 10,952,472,500	1.6 2016/3/20	2.27
日本	国債証券	第284回利付国債(10年)	9,987,000,000	106.73 10,659,324,840	106.82 10,668,912,360	1.7 2016/12/20	2.21
日本	国債証券	第282回利付国債(10年)	9,990,000,000	106.45 10,635,154,200	106.54 10,644,045,300	1.7 2016/9/20	2.20
日本	国債証券	第280回利付国債(10年)	9,867,000,000	106.97 10,555,589,900	107.05 10,563,116,850	1.9 2016/6/20	2.19
日本	国債証券	第274回利付国債(10年)	9,805,000,000	104.87 10,282,993,750	104.90 10,286,229,400	1.5 2015/12/20	2.13
日本	国債証券	第272回利付国債(10年)	9,865,000,000	104.25 10,284,332,500	104.25 10,284,558,450	1.4 2015/9/20	2.13

日本	国債証券	第270回利付国債（10年）	7,517,000,000	103.66 7,792,129,200	103.64 7,790,693,970	1.3 2015/6/20	1.61
日本	国債証券	第286回利付国債（10年）	6,380,000,000	107.81 6,878,559,000	107.85 6,881,085,200	1.8 2017/6/20	1.42
日本	国債証券	第310回利付国債（10年）	6,450,000,000	102.51 6,611,895,000	102.99 6,643,371,000	1 2020/9/20	1.37
日本	国債証券	第256回利付国債（10年）	6,490,000,000	102.02 6,621,487,400	102.00 6,620,124,500	1.4 2013/12/20	1.37
日本	国債証券	第315回利付国債（10年）	6,330,000,000	103.51 6,552,183,000	104.03 6,585,162,300	1.2 2021/6/20	1.36
日本	国債証券	第305回利付国債（10年）	5,920,000,000	105.33 6,235,536,000	105.77 6,262,057,600	1.3 2019/12/20	1.30
日本	国債証券	第285回利付国債（10年）	5,843,000,000	106.99 6,251,425,700	107.09 6,257,502,420	1.7 2017/3/20	1.29
日本	国債証券	第306回利付国債（10年）	5,850,000,000	106.00 6,201,351,000	106.47 6,228,495,000	1.4 2020/3/20	1.29
日本	国債証券	第313回利付国債（10年）	5,900,000,000	104.58 6,170,220,000	105.09 6,200,841,000	1.3 2021/3/20	1.28
日本	国債証券	第258回利付国債（10年）	5,573,000,000	102.16 5,693,383,300	102.14 5,692,596,580	1.3 2014/3/20	1.18
日本	国債証券	第312回利付国債（10年）	5,420,000,000	103.95 5,634,306,800	104.45 5,661,298,400	1.2 2020/12/20	1.17
日本	国債証券	第290回利付国債（10年）	5,217,000,000	106.05 5,533,075,290	106.26 5,543,688,540	1.4 2018/3/20	1.15
日本	国債証券	第320回利付国債（10年）	4,780,000,000	101.32 4,843,382,800	101.86 4,869,051,400	1 2021/12/20	1.01
日本	国債証券	第303回利付国債（10年）	4,455,000,000	106.12 4,727,824,200	106.56 4,747,248,000	1.4 2019/9/20	0.98
日本	国債証券	第308回利付国債（10年）	4,330,000,000	105.09 4,550,786,700	105.57 4,571,310,900	1.3 2020/6/20	0.95
日本	国債証券	第297回利付国債（10年）	3,923,000,000	106.12 4,163,099,600	106.41 4,174,542,760	1.4 2018/12/20	0.86
日本	国債証券	第296回利付国債（10年）	3,603,000,000	106.73 3,845,806,170	107.01 3,855,858,540	1.5 2018/9/20	0.80
日本	国債証券	第288回利付国債（10年）	3,555,000,000	107.43 3,819,207,600	107.57 3,824,397,900	1.7 2017/9/20	0.79
日本	国債証券	第322回利付国債（10年）	3,750,000,000	100.74 3,778,012,500	100.67 3,775,462,500	0.9 2022/3/20	0.78
日本	国債証券	第253回利付国債（10年）	3,590,000,000	101.96 3,660,434,000	101.94 3,659,681,900	1.6 2013/9/20	0.76

□ 種類別の投資比率

平成24年5月31日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	75.99
地方債証券	6.33
特殊債券	10.32
社債券	6.69
合計	99.34

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

〔外国株式インデックス・マザーファンド〕

(1) 投資状況

平成24年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	112,382,807,036	55.65
	カナダ	10,693,944,907	5.30
	ドイツ	7,094,034,561	3.51
	イタリア	1,688,330,929	0.84
	フランス	7,222,996,218	3.58
	オーストラリア	6,865,896,106	3.40
	イギリス	19,337,222,831	9.58
	スイス	8,301,796,800	4.11
	バミューダ	610,118,807	0.30
	香港	2,198,455,685	1.09
	シンガポール	1,512,566,278	0.75
	ニュージーランド	110,907,579	0.05
	オランダ	2,271,442,268	1.12
	スペイン	2,069,135,972	1.02
	ベルギー	917,228,130	0.45
	スウェーデン	2,623,675,432	1.30
	ノルウェー	744,575,853	0.37
	オーストリア	197,609,306	0.10
	ルクセンブルク	378,406,522	0.19
	フィンランド	673,498,115	0.33
	デンマーク	1,036,197,132	0.51
	アイルランド	1,361,192,731	0.67
	ギリシャ	51,894,408	0.03
	イスラエル	537,055,903	0.27
	ポルトガル	152,991,600	0.08
	ケイマン諸島	215,557,433	0.11
	モーリシャス	32,171,009	0.02
	リベリア	34,313,489	0.02
ジャージー	730,467,830	0.36	
ガーンジー	40,183,301	0.02	
アンティル	832,451,883	0.41	
マン島	69,848,385	0.03	
小計	192,988,974,439	95.57	
投資証券	アメリカ	2,828,735,051	1.40
	カナダ	48,462,149	0.02
	フランス	228,798,261	0.11
	オーストラリア	675,351,312	0.33
	イギリス	234,367,200	0.12
	香港	82,781,140	0.04
	シンガポール	91,773,358	0.05
	オランダ	27,734,755	0.01
	小計	4,218,003,226	2.09
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,733,120,008	2.34
合計(純資産総額)		201,940,097,673	100.00

海外金融先物取引の買建て 2.32%

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成24年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	APPLE INC 〔テクノロジー・ハードウェアおよび機器〕	113,874	29,722.92 3,384,668,281	45,708.09 5,204,963,769	2.58
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION 〔エネルギー〕	587,196	6,079.26 3,569,721,753	6,297.02 3,697,588,948	1.83
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP 〔ソフトウェア・サービス〕	144,416	14,303.48 2,065,652,499	15,352.30 2,217,118,854	1.10
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP 〔ソフトウェア・サービス〕	927,565	1,966.75 1,824,292,305	2,315.51 2,147,788,630	1.06
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO 〔資本財〕	1,293,245	1,183.91 1,531,096,742	1,502.63 1,943,277,528	0.96
アメリカ	株式	AT&T INC 〔電気通信サービス〕	726,124	2,222.30 1,613,667,748	2,670.65 1,939,225,093	0.96
アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION 〔エネルギー〕	244,035	7,692.48 1,877,235,731	7,704.95 1,880,279,815	0.93
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED 〔食品・飲料・タバコ〕	404,390	4,126.72 1,668,806,626	4,502.91 1,820,932,583	0.90
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO 〔家庭用品・パーソナル用品〕	337,175	4,935.67 1,664,187,847	4,918.29 1,658,325,914	0.82
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〕	334,498	4,957.05 1,658,123,961	4,909.61 1,642,255,796	0.81
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〕	942,001	1,534.80 1,445,786,742	1,739.39 1,638,513,524	0.81
アメリカ	株式	WELLS FARGO & COMPANY 〔銀行〕	613,619	1,912.21 1,173,373,789	2,501.76 1,535,129,923	0.76
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE 〔食品・飲料・タバコ〕	250,387	5,237.38 1,311,373,146	5,923.73 1,483,226,285	0.73
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A 〔ソフトウェア・サービス〕	31,371	46,061.55 1,444,996,993	46,423.11 1,456,339,434	0.72
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC. 〔食品・飲料・タバコ〕	212,850	5,891.33 1,253,970,069	6,698.72 1,425,824,595	0.71
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC 〔銀行〕	2,188,461	594.33 1,300,688,500	614.82 1,345,518,016	0.67
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC 〔電気通信サービス〕	6,157,697	206.41 1,271,016,368	209.84 1,292,168,299	0.64
アメリカ	株式	INTEL CORP 〔半導体・半導体製造装置〕	623,639	1,864.50 1,162,779,762	2,062.17 1,286,055,623	0.64
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO 〔各種金融〕	465,685	2,265.67 1,055,089,167	2,601.20 1,211,341,312	0.60
アメリカ	株式	WAL-MART STORES INC 〔食品・生活必需品小売り〕	232,158	4,596.05 1,067,011,944	5,164.52 1,198,985,748	0.59
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〕	285,958	3,969.72 1,135,174,419	4,108.70 1,174,916,778	0.58

アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC 〔電気通信サービス〕	346,917	2,897.46 1,005,179,912	3,268.86 1,134,025,324	0.56
イギリス	株式	BP PLC 〔エネルギー〕	2,322,750	535.35 1,243,502,284	486.36 1,129,702,282	0.56
アメリカ	株式	MERCK & CO. INC. 〔医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス〕	373,622	2,726.69 1,018,752,779	2,951.60 1,102,785,684	0.55
イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS 〔エネルギー〕	446,313	2,613.18 1,166,298,665	2,428.15 1,083,718,190	0.54
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〕	619,033	1,670.20 1,033,909,708	1,720.52 1,065,064,785	0.53
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN 〔医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス〕	86,075	11,527.44 992,224,670	12,362.68 1,064,118,369	0.53
アメリカ	株式	PEPSICO INC 〔食品・飲料・タバコ〕	191,597	5,029.28 963,595,737	5,383.92 1,031,543,380	0.51
アメリカ	株式	ORACLE CORPORATION 〔ソフトウェア・サービス〕	494,647	2,344.45 1,159,678,006	2,065.33 1,021,612,454	0.51
オーストラリア	株式	BHP BILLITON LTD 〔素材〕	393,857	2,673.81 1,053,098,897	2,462.29 969,790,861	0.48

□ 種類別・業種別の投資比率

平成24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	11.23	株式（外国）	ヘルスケア機器・サービス	2.87
	素材	6.66		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.76
	資本財	7.19		銀行	6.82
	商業・専門サービス	0.89		各種金融	4.25
	運輸	1.76		保険	3.80
	自動車・自動車部品	1.30		不動産	0.62
	耐久消費財・アパレル	1.37		ソフトウェア・サービス	6.03
	消費者サービス	1.68		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.09
	メディア	2.63		電気通信サービス	4.00
	小売	2.99		公益事業	3.76
	食品・生活必需品小売り	2.33		半導体・半導体製造装置	1.55
	食品・飲料・タバコ	7.15		投資証券	2.09
	家庭用品・パーソナル用品	1.83		合計	97.66

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

平成24年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 12 / 06	買建	124	3,303,149,800	3,201,516,072	1.59
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 12 / 06	買建	84	566,174,982	542,351,565	0.27
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 12 / 06	買建	454	987,801,942	936,027,417	0.46

(注) 時価の算定方法

海外金融先物取引の時価については以下のように評価しております。

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

〔外国債券バッシブ・マザーファンド〕

(1) 投資状況

平成24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	101,771,338,196	42.30
	カナダ	6,953,514,911	2.89
	ドイツ	21,585,497,290	8.97
	イタリア	19,924,030,112	8.28
	フランス	22,503,110,253	9.35
	オーストラリア	3,614,761,888	1.50
	イギリス	19,071,874,059	7.93
	スイス	911,982,732	0.38
	シンガポール	1,033,939,438	0.43
	マレーシア	1,208,484,558	0.50
	オランダ	6,241,804,930	2.59
	スペイン	9,449,938,186	3.93
	ベルギー	5,910,981,779	2.46
	スウェーデン	1,373,678,444	0.57
	ノルウェー	763,764,390	0.32
	オーストリア	4,072,820,026	1.69
	フィンランド	1,459,775,896	0.61
	デンマーク	2,060,759,951	0.86
	メキシコ	2,078,188,581	0.86
	アイルランド	1,505,810,628	0.63
ポーランド	1,665,777,262	0.69	
	小計	235,161,833,510	97.74
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,447,889,771	2.26
合計(純資産総額)		240,609,723,281	100.00

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成24年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	8,518.42 1,533,316,950	8,695.38 1,565,168,575	2.625 2020/11/15	0.65
アメリカ	国債証券	US T 0.375% 150415	17,000,000	7,891.48 1,341,553,222	7,893.84 1,341,954,453	0.375 2015/4/15	0.56
アメリカ	国債証券	US T 3.625% 20/02/15	14,000,000	9,186.28 1,286,080,320	9,319.34 1,304,707,911	3.625 2020/2/15	0.54
アメリカ	国債証券	US T 4.75% 41/02/15	11,000,000	10,950.15 1,204,516,500	11,246.71 1,237,138,826	4.75 2041/2/15	0.51
アメリカ	国債証券	US T 3.625% 21/02/15	13,000,000	9,181.84 1,193,640,337	9,339.68 1,214,159,537	3.625 2021/2/15	0.50

アメリカ	国債証券	US T 4.375% 40/05/15	11,000,000	10,318.79 1,135,066,900	10,617.20 1,167,892,687	4.375 2040/5/15	0.49
アメリカ	国債証券	US T 3.5% 20/05/15	12,500,000	9,106.57 1,138,322,350	9,250.28 1,156,285,903	3.5 2020/5/15	0.48
アメリカ	国債証券	US T 4.25% 40/11/15	11,000,000	10,131.35 1,114,449,050	10,419.90 1,146,189,687	4.25 2040/11/15	0.48
アメリカ	国債証券	US T 1.375% 190228	14,000,000	7,889.85 1,104,579,969	8,086.21 1,132,070,411	1.375 2019/2/28	0.47
アメリカ	国債証券	US T 2.625% 20/8/15	13,000,000	8,535.19 1,109,575,740	8,707.09 1,131,922,431	2.625 2020/8/15	0.47
アメリカ	国債証券	US T 3.875% 40/8/15	11,000,000	9,519.72 1,047,169,750	9,804.57 1,078,503,456	3.875 2040/8/15	0.45
イギリス	国債証券	UKT 2% 16/01/22	8,000,000	12,808.36 1,024,668,969	12,870.44 1,029,635,427	2 2016/1/22	0.43
アメリカ	国債証券	US T 0.25% 15/01/15	13,000,000	7,881.90 1,024,647,427	7,873.50 1,023,555,406	0.25 2015/1/15	0.43
アメリカ	国債証券	US T 3.375% 19/11/15	11,000,000	9,030.17 993,319,181	9,168.28 1,008,511,281	3.375 2019/11/15	0.42
アメリカ	国債証券	US T 3.125% 21/05/15	11,000,000	8,824.24 970,666,675	9,005.51 990,606,306	3.125 2021/5/15	0.41
アメリカ	国債証券	US T 4.375% 39/11/15	9,000,000	10,315.09 928,358,156	10,609.19 954,827,187	4.375 2039/11/15	0.40
フランス	国債証券	FRTR 3.0% 15/10/25	9,000,000	10,224.86 920,237,675	10,464.18 941,776,259	3 2015/10/25	0.39
アメリカ	国債証券	US T 2.125% 21/08/15	11,000,000	8,106.56 891,722,012	8,308.79 913,967,587	2.125 2021/8/15	0.38
アメリカ	国債証券	US T 3.125% 19/05/15	10,000,000	8,868.24 886,824,040	9,017.84 901,784,312	3.125 2019/5/15	0.37
アメリカ	国債証券	US T 1% 14/05/15	11,000,000	8,028.01 883,081,889	8,001.74 880,192,293	1 2014/5/15	0.37
アメリカ	国債証券	US T 0.875% 16/12/31	11,000,000	7,962.68 875,895,724	7,978.31 877,615,062	0.875 2016/12/31	0.36
フランス	国債証券	FRANCE 3.75% 17/04/25	8,000,000	10,510.72 840,857,679	10,870.18 869,614,579	3.75 2017/4/25	0.36
アメリカ	国債証券	US T 2.125% 14/11/30	10,500,000	8,300.78 871,582,002	8,241.59 865,367,052	2.125 2014/11/30	0.36
フランス	国債証券	FRTR 5% 16/10/25	7,600,000	11,087.97 842,685,906	11,355.93 863,051,391	5 2016/10/25	0.36
フランス	国債証券	FRTR 3.75% 21/04/25	7,700,000	10,340.39 796,210,684	10,877.30 837,552,754	3.75 2021/4/25	0.35
アメリカ	国債証券	US T 2.5% 15/04/30	10,000,000	8,437.65 843,765,785	8,373.53 837,353,535	2.5 2015/4/30	0.35
アメリカ	国債証券	US T 3.625% 19/08/15	9,000,000	9,163.35 824,701,668	9,299.61 836,965,100	3.625 2019/8/15	0.35
アメリカ	国債証券	US T 2.25% 15/01/31	10,000,000	8,347.63 834,763,972	8,285.98 828,598,347	2.25 2015/1/31	0.34
アメリカ	国債証券	US T 2.375% 14/09/30	10,000,000	8,337.15 833,715,812	8,268.71 826,871,972	2.375 2014/9/30	0.34

アメリカ	国債証券	US T 1% 170331	10,000,000	7,970.85 797,085,757	8,017.77 801,777,875	1 2017/3/31	0.33
------	------	----------------	------------	-------------------------	-------------------------	----------------	------

□ 種類別の投資比率

平成24年5月31日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	97.74
合計	97.74

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24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	1,696,099,430	98.64
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		23,403,492	1.36
合計(純資産総額)		1,719,502,922	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24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241回利付国債(10年)	844,500,000	100.42 848,057,030	100.35 847,489,530	1.3 2012/9/20	49.29
日本	国債証券	第247回利付国債(10年)	281,500,000	100.62 283,260,770	100.55 283,056,695	0.8 2013/3/20	16.46
日本	国債証券	第244回利付国債(10年)	281,500,000	100.59 283,166,150	100.49 282,879,350	1 2012/12/20	16.45
日本	国債証券	第250回利付国債(10年)	281,500,000	100.42 282,710,175	100.41 282,673,855	0.5 2013/6/20	16.44

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24年5月31日現在

種類	投資比率(%)
国債証券	98.64
合計	98.64

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

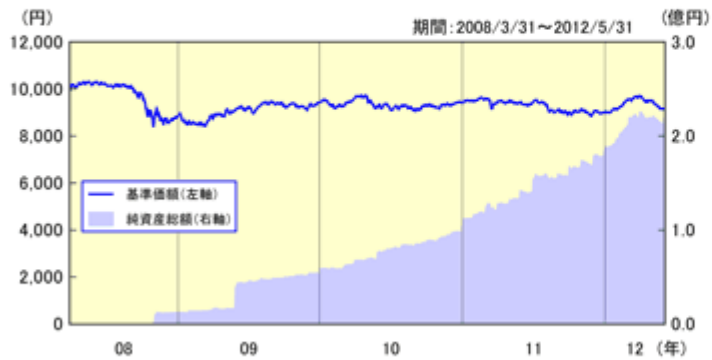
該当事項はありません。

〔参考情報〕

基準日2012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	9,117円
純資産総額	2億円

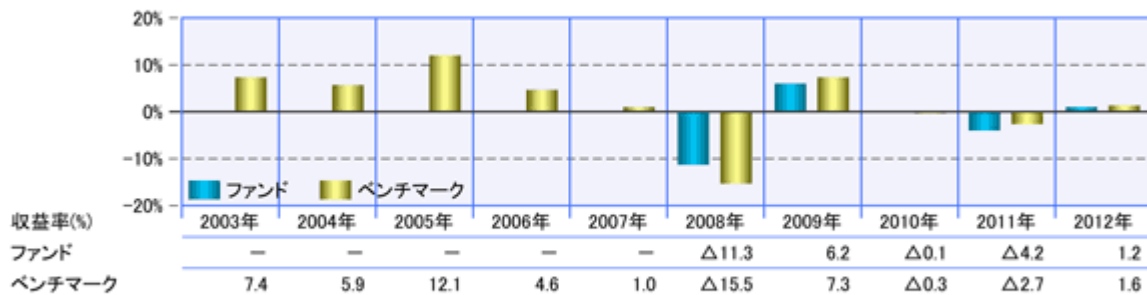
分配の推移

決算期	分配金
2012年4月	0円
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1万口当たり、税引前です。

※基準価額は、1万口当たり、信託報酬控除後です。

年間収益率の推移（暦年ベース）



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。
 2012年の収益率は、年初から2012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	http://www.smam-jp.com

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

ヘ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

ト 払込期日

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

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

2【換金（解約）手続等】

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

お買付けの販売会社にお申し出ください。

解約請求のお申込みに関しては、原則として午後3時まで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、当ファンドの知っている受益者に対し、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、これを行行使うことができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っ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。
- (二) 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い
- a. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。また、受託会社はその任務に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場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- b. 分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日の翌営業日に再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(ロ) 償還金

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

八 信託約款の変更等

- (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、当ファンドの知っている受益者に対し、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、これを行行使うことができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っ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。
- (二) 書面決議は議決権を行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

す。)

(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。

ニ 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。

ハ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

ト 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

チ 運用にかかる報告書の開示方法

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

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

4【受益者の権利等】

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

イ 分配金請求権

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

当ファンドは、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4期(平成23年4月14日から平成24年4月13日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

（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23年4月13日現在）	（平成24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	4,774,138,718	1,235,879,662
株式	297,711,795,325	285,252,885,760
派生商品評価勘定	35,939,500	271,850
未収配当金	3,314,174,910	3,349,948,146
未収利息	6,539	1,692
前払金	384,403,000	253,805,000
差入委託証拠金	67,410,000	22,475,000
流動資産合計	306,287,867,992	290,115,267,110
資産合計	306,287,867,992	290,115,267,110
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	421,206,650	254,158,750
未払解約金	12,207,740	12,211,243
流動負債合計	433,414,390	266,369,993
負債合計	433,414,390	266,369,993
純資産の部		
元本等		
元本		
元本	272,894,945,293	261,559,293,680
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	32,959,508,309	28,289,603,437
元本等合計	305,854,453,602	289,848,897,117
純資産合計	305,854,453,602	289,848,897,117
負債純資産合計	306,287,867,992	290,115,267,110

（注）「国内株式インデックス・マザーファンド（B号）」は、毎年11月30日（ただし、休業日の場合は翌営業日）に決算を行います。上記の貸借対照表は平成23年4月13日ならびに平成24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

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成23年4月14日 至平成24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。
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。
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。

(追加情報)

自平成23年4月14日 至平成24年4月13日
当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成23年4月13日現在)	(平成24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 border="0" style="margin-left: auto; margin-right: auto;"> <tr> <td style="text-align: center;"><u>担保資産</u></td> <td style="text-align: center;"><u>金額</u></td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">株式</td> <td style="text-align: right;">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	代用として、担保に供している資産は次の通りであります。 <table border="0" style="margin-left: auto; margin-right: auto;"> <tr> <td style="text-align: center;"><u>担保資産</u></td> <td style="text-align: center;"><u>金額</u></td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">株式</td> <td style="text-align: right;">5,985,000,000円</td> </tr> </table>	<u>担保資産</u>	<u>金額</u>	株式	5,985,000,000円
<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	5,985,000,000円									
2. 受益権総数	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	平成24年4月13日現在における受益権の総数 261,559,293,680口								
3. 1単位当たり純資産額	1.1208円 (1万口 = 11,208円)	1.1082円 (1万口 = 11,082円)								

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

項目	自平成22年4月14日 至平成23年4月13日	自平成23年4月14日 至平成24年4月13日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。当ファンドにおけるデリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、および価格変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、先物取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>	<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理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23年4月13日現在）	（平成24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） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<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場で評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

なお、（ ）内は手数料相当額を含んだ場合の金額を表わしています。

4. 株価指数先物取引の取引市場は、東京証券取引所です。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

(平成24年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	4,852,905,000	-	4,599,100,000	253,805,000
		(4,852,986,900)	(-)		(253,886,900)
	買建 合計	4,852,905,000	-	4,599,100,000	253,805,000
		(4,852,986,900)	(-)		(253,886,900)

(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ん。

なお、()内は手数料相当額を含んだ場合の金額を表わしています。

4. 株価指数先物取引の取引市場は、東京証券取引所です。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

(自平成22年4月14日 至 平成23年4月13日)

該当事項はありません。

(自平成23年4月14日 至 平成24年4月13日)

該当事項はありません。

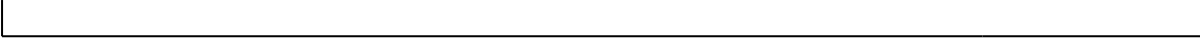
(その他の注記)

(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

(平成24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	272,894,945,293円
同期中における追加設定元本額	32,882,435,835円
同期中における一部解約元本額	44,218,087,448円
平成24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	8,778,276,405円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	442,880,130円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,206,635,657円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	1,482,859,041円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	44,485,704円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	4,840,491円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	5,800,204円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	5,321,194円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	6,383,960円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	5,705,797円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	4,010,171円
国内株式指数ファンド(TOPIX)	692,778,051円
三井住友・DC日本株式インデックスファンドS	17,787,504円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	61,690,647,654円
バランスファンドVA(安定運用型)<適格機関投資家限定>	690,838,041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>	48,247,841,514円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	16,192,302,112円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	7,224,906,684円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	25,130,221,112円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	173,737,468円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	540,652,567円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	87,658,147円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	2,438,875,534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>	124,197,132円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	975,558,607円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	3,075,556,252円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	4,759,687,195円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	10,269,367,005円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,265,979,855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)	10,332,030,577円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	211,195,545円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	2,773,261,851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)	43,577,792,287円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	298,692,609円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	154,092,418円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	54,819,085円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	788,848,847円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	1,391,109,898円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	525,789,689円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	349,290,702円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	154,589,617円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	31,614,573円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	327,447,982円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	3,319,404,539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)	533,590,331円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	120,821,931円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定>	21,808,802円
SMAM・FGグローバルバランス25VA<適格機関投資家限定>	7,301,209円
合計	261,559,293,680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	107,000	188	20,116,000	
日本水産	338,600	264	89,390,400	
マルハニチロホールディングス	575,000	139	79,925,000	
サカタのタネ	40,500	1,109	44,914,500	
ホクト	28,600	1,711	48,934,600	
住石ホールディングス	106,700	89	9,496,300	
日鉄鉱業	73,000	363	26,499,000	
三井松島産業	189,000	163	30,807,000	
国際石油開発帝石	3,488	523,000	1,824,224,000	
日本海洋掘削	8,100	2,485	20,128,500	
関東天然瓦斯開発	24,000	423	10,152,000	
石油資源開発	40,300	3,615	145,684,500	
ショーボンドホールディングス	24,500	1,972	48,314,000	
ミライト・ホールディングス	79,000	577	45,583,000	
ダイセキ環境ソリューション	34	166,900	5,674,600	
間組	109,800	222	24,375,600	
東急建設	101,310	199	20,160,690	
コムシスホールディングス	138,400	837	115,840,800	
ミサワホーム	29,700	1,042	30,947,400	
高松コンストラクショングループ	21,500	1,320	28,380,000	
東建コーポレーション	10,510	3,095	32,528,450	
ヤマウラ	15,000	234	3,510,000	
大成建設	1,451,000	209	303,259,000	
大林組	861,000	357	307,377,000	
清水建設	877,000	316	277,132,000	
長谷工コーポレーション	1,823,000	61	111,203,000	
松井建設	31,000	311	9,641,000	
鹿島建設	1,349,000	242	326,458,000	
不動テトラ	208,000	149	30,992,000	
鉄建建設	168,000	126	21,168,000	
安藤建設	108,000	119	12,852,000	
太平工業	52,000	430	22,360,000	
西松建設	381,000	181	68,961,000	
三井住友建設	211,400	70	14,798,000	
大豊建設	87,000	115	10,005,000	
前田建設工業	179,000	354	63,366,000	
佐田建設	122,000	75	9,150,000	
ナカノフドー建設	29,500	170	5,015,000	
奥村組	269,000	304	81,776,000	
大和小田急建設	19,500	195	3,802,500	

東鉄工業	37,000	916	33,892,000	
イチケン	43,000	167	7,181,000	
浅沼組	112,000	68	7,616,000	
戸田建設	303,000	263	79,689,000	
熊谷組	224,000	88	19,712,000	
青木あすなる建設	19,500	447	8,716,500	
北野建設	63,000	172	10,836,000	
植木組	42,000	186	7,812,000	
三井ホーム	32,000	415	13,280,000	
矢作建設工業	37,000	411	15,207,000	
ピーエス三菱	21,400	406	8,688,400	
大東建託	109,100	7,290	795,339,000	
新日本建設	37,900	218	8,262,200	
N I P P O	66,000	841	55,506,000	
東亜道路工業	59,000	248	14,632,000	
前田道路	81,000	964	78,084,000	
日本道路	87,000	330	28,710,000	
東亜建設工業	252,000	143	36,036,000	
若築建設	173,000	103	17,819,000	
東洋建設	462,000	83	38,346,000	
五洋建設	369,000	244	90,036,000	
大林道路	38,000	255	9,690,000	
世紀東急工業	103,000	62	6,386,000	
福田組	49,000	275	13,475,000	
住友林業	196,800	714	140,515,200	
日本基礎技術	37,100	309	11,463,900	
日成ビルド工業	98,000	183	17,934,000	
エス・バイ・エル	149,000	195	29,055,000	
巴コーポレーション	39,800	322	12,815,600	
パナホーム	105,000	542	56,910,000	
大和ハウス工業	716,000	1,060	758,960,000	
ライト工業	61,500	460	28,290,000	
積水ハウス	806,000	772	622,232,000	
日特建設	89,000	120	10,680,000	
北陸電気工事	16,000	223	3,568,000	
ユアテック	40,000	402	16,080,000	
西部電気工業	18,000	343	6,174,000	
四電工	23,000	327	7,521,000	
中電工	39,300	810	31,833,000	
関電工	130,000	385	50,050,000	
きんでん	187,000	589	110,143,000	
東京エネシス	33,000	481	15,873,000	
トーエネック	41,000	445	18,245,000	
住友電設	19,300	616	11,888,800	
日本電設工業	51,000	802	40,902,000	
協和エクシオ	92,800	736	68,300,800	

新日本空調	21,900	463	10,139,700
日本電話施設	47,000	252	11,844,000
九電工	50,000	484	24,200,000
三機工業	63,000	437	27,531,000
日揮	267,000	2,413	644,271,000
中外炉工業	96,000	268	25,728,000
ヤマト	27,000	304	8,208,000
太平電業	39,000	631	24,609,000
高砂熱学工業	80,200	639	51,247,800
三晃金属工業	38,000	247	9,386,000
朝日工業社	30,000	331	9,930,000
大氣社	43,400	1,648	71,523,200
ダイダン	39,000	482	18,798,000
日比谷総合設備	33,600	864	29,030,400
東芝プラントシステム	46,000	925	42,550,000
東洋エンジニアリング	155,000	380	58,900,000
千代田化工建設	229,000	1,000	229,000,000
新興プランテック	59,000	660	38,940,000
日本製粉	170,000	367	62,390,000
日清製粉グループ本社	260,000	973	252,980,000
日東富士製粉	22,000	296	6,512,000
昭和産業	107,000	251	26,857,000
鳥越製粉	20,900	662	13,835,800
協同飼料	120,000	91	10,920,000
中部飼料	25,000	514	12,850,000
日本配合飼料	110,000	107	11,770,000
東洋精糖	67,000	97	6,499,000
日本甜菜製糖	160,000	168	26,880,000
三井製糖	109,000	265	28,885,000
森永製菓	273,000	186	50,778,000
中村屋	70,000	388	27,160,000
江崎グリコ	104,000	956	99,424,000
名糖産業	14,200	1,001	14,214,200
不二家	181,000	188	34,028,000
山崎製パン	210,000	1,186	249,060,000
第一屋製パン	77,000	91	7,007,000
モロゾフ	45,000	272	12,240,000
カルビー	16,100	4,730	76,153,000
森永乳業	247,000	302	74,594,000
ヤクルト本社	154,700	2,740	423,878,000
明治ホールディングス	85,200	3,555	302,886,000
雪印メグミルク	62,800	1,503	94,388,400
プリマハム	173,000	151	26,123,000
日本ハム	218,000	999	217,782,000
伊藤ハム	162,000	310	50,220,000
林兼産業	135,000	78	10,530,000

丸大食品	139,000	313	43,507,000	
米久	25,900	702	18,181,800	
S Foods	16,000	666	10,656,000	
サッポロホールディングス	476,000	286	136,136,000	
アサヒグループホールディングス	538,300	1,806	972,169,800	
麒麟ホールディングス	1,153,000	1,019	1,174,907,000	
宝ホールディングス	244,000	536	130,784,000	
オエノンホールディングス	75,000	193	14,475,000	
養命酒製造	23,000	743	17,089,000	
三国コカ・コーラボトリング	21,100	703	14,833,300	
コカ・コーラウエスト	97,400	1,431	139,379,400	
コカ・コーラ セントラル ジャパン	30,700	1,042	31,989,400	
ダイトードリンコ	12,700	3,190	40,513,000	
伊藤園	79,700	1,454	115,883,800	
キーコーヒー	21,900	1,451	31,776,900	
ジャパンフーズ	3,700	870	3,219,000	
日清オイリオグループ	110,000	326	35,860,000	
不二製油	69,700	1,140	79,458,000	
J - オイルミルズ	107,000	222	23,754,000	
キッコーマン	235,000	929	218,315,000	
味の素	757,000	1,029	778,953,000	
キューピー	142,900	1,187	169,622,300	
ハウス食品	100,000	1,367	136,700,000	
カゴメ	110,200	1,602	176,540,400	
焼津水産化学工業	12,200	792	9,662,400	
アリアケジャパン	26,800	1,590	42,612,000	
ニチレイ	323,000	368	118,864,000	
東洋水産	124,000	2,108	261,392,000	
日清食品ホールディングス	111,700	3,025	337,892,500	
永谷園	25,000	880	22,000,000	
フジッコ	28,000	984	27,552,000	
ロック・フィールド	12,700	1,648	20,929,600	
日本たばこ産業	6,368	466,000	2,967,488,000	
わらべや日洋	16,600	1,385	22,991,000	
なとり	8,600	870	7,482,000	
ミヨシ油脂	109,000	106	11,554,000	
片倉工業	34,500	720	24,840,000	
グンゼ	190,000	222	42,180,000	
東洋紡績	1,129,000	111	125,319,000	
ユニチカ	610,000	50	30,500,000	
富士紡ホールディングス	119,000	179	21,301,000	
日清紡ホールディングス	170,000	729	123,930,000	
倉敷紡績	270,000	151	40,770,000	
シキボウ	195,000	99	19,305,000	
日本毛織	90,000	606	54,540,000	
トーア紡コーポレーション	162,000	61	9,882,000	

ダイドーリミテッド	33,100	655	21,680,500
帝国繊維	28,000	645	18,060,000
帝人	1,100,000	270	297,000,000
東レ	1,948,000	604	1,176,592,000
サカイオーベックス	92,000	131	12,052,000
住江織物	75,000	161	12,075,000
日本フェルト	9,500	402	3,819,000
イチカワ	23,000	163	3,749,000
日本バイリーン	36,000	360	12,960,000
日東製網	49,000	165	8,085,000
芦森工業	79,000	108	8,532,000
アツギ	206,000	99	20,394,000
ダイニック	53,000	174	9,222,000
セーレン	67,100	577	38,716,700
小松精練	40,000	396	15,840,000
ワコールホールディングス	158,000	929	146,782,000
ホギメディカル	16,400	3,455	56,662,000
レナウン	78,100	128	9,996,800
クラウディア	3,300	1,083	3,573,900
T S Iホールディングス	123,000	497	61,131,000
三陽商会	135,000	207	27,945,000
オンワードホールディングス	166,000	612	101,592,000
ルック	52,000	234	12,168,000
ゴールドウイン	62,000	470	29,140,000
デサント	66,000	508	33,528,000
ヤマトインターナショナル	14,300	378	5,405,400
特種東海製紙	177,000	179	31,683,000
王子製紙	1,179,000	371	437,409,000
三菱製紙	394,000	75	29,550,000
北越紀州製紙	165,000	511	84,315,000
中越パルプ工業	103,000	161	16,583,000
巴川製紙所	56,000	167	9,352,000
大王製紙	119,000	456	54,264,000
日本製紙グループ本社	130,000	1,620	210,600,000
レンゴー	216,000	574	123,984,000
トーモク	82,000	232	19,024,000
ザ・バック	14,700	1,361	20,006,700
クラレ	425,400	1,121	476,873,400
旭化成	1,562,000	494	771,628,000
共和レザー	18,000	293	5,274,000
コープケミカル	61,000	112	6,832,000
昭和電工	1,672,000	185	309,320,000
住友化学	1,847,000	338	624,286,000
日本化成	65,000	135	8,775,000
住友精化	53,000	347	18,391,000
日産化学工業	202,900	735	149,131,500

クレハ	176,000	385	67,760,000
テイカ	50,000	280	14,000,000
石原産業	475,000	79	37,525,000
片倉チッカリン	24,000	212	5,088,000
日本曹達	160,000	348	55,680,000
東ソー	720,000	211	151,920,000
トクヤマ	423,000	247	104,481,000
セントラル硝子	259,000	334	86,506,000
東亜合成	333,000	346	115,218,000
ダイソー	108,000	245	26,460,000
関東電化工業	67,000	269	18,023,000
電気化学工業	562,000	310	174,220,000
信越化学工業	481,200	4,580	2,203,896,000
日本カーバイド工業	98,000	128	12,544,000
堺化学工業	82,000	285	23,370,000
エア・ウォーター	217,000	994	215,698,000
大陽日酸	353,000	552	194,856,000
日本化学工業	116,000	134	15,544,000
日本パーカライジング	64,000	1,191	76,224,000
高圧ガス工業	41,000	483	19,803,000
チタン工業	35,000	315	11,025,000
四国化成工業	40,000	473	18,920,000
戸田工業	38,000	540	20,520,000
ステラ ケミファ	13,500	1,841	24,853,500
保土谷化学工業	61,000	258	15,738,000
日本触媒	195,000	905	176,475,000
大日精化工業	97,000	366	35,502,000
カネカ	332,000	470	156,040,000
三菱瓦斯化学	463,000	528	244,464,000
三井化学	1,142,000	238	271,796,000
J S R	244,500	1,611	393,889,500
東京応化工業	47,800	1,764	84,319,200
三菱ケミカルホールディングス	1,676,000	416	697,216,000
日本合成化学工業	55,000	469	25,795,000
ダイセル	349,000	526	183,574,000
住友ベークライト	232,000	422	97,904,000
積水化学工業	557,000	714	397,698,000
日本ゼオン	251,000	708	177,708,000
アイカ工業	68,900	1,150	79,235,000
宇部興産	1,126,000	215	242,090,000
積水樹脂	36,000	805	28,980,000
タキロン	61,000	275	16,775,000
旭有機材工業	88,000	219	19,272,000
日立化成工業	115,700	1,437	166,260,900
ニチバン	20,000	259	5,180,000
リケンテクノス	45,000	245	11,025,000

大倉工業	69,000	246	16,974,000
積水化成品工業	70,000	289	20,230,000
群栄化学工業	77,000	210	16,170,000
タイガースポリマー	17,300	334	5,778,200
日本カーリット	20,600	400	8,240,000
日本化薬	185,000	801	148,185,000
日本精化	20,600	542	11,165,200
A D E K A	114,800	746	85,640,800
日油	211,000	388	81,868,000
ハリマ化成	25,700	568	14,597,600
花王	712,200	2,157	1,536,215,400
第一工業製薬	52,000	244	12,688,000
三洋化成工業	82,000	515	42,230,000
大日本塗料	179,000	87	15,573,000
日本ペイント	253,000	613	155,089,000
関西ペイント	303,000	857	259,671,000
中国塗料	83,000	468	38,844,000
日本特殊塗料	23,700	325	7,702,500
藤倉化成	34,700	451	15,649,700
太陽ホールディングス	21,800	2,046	44,602,800
D I C	1,032,000	158	163,056,000
サカタインクス	46,000	394	18,124,000
東洋インキS Cホールディングス	235,000	323	75,905,000
富士フイルムホールディングス	573,000	1,748	1,001,604,000
資生堂	446,500	1,432	639,388,000
ライオン	304,000	465	141,360,000
高砂香料工業	86,000	380	32,680,000
マンダム	26,700	2,017	53,853,900
ミルボン	13,600	2,349	31,946,400
ファンケル	66,200	1,046	69,245,200
コーセー	42,800	1,815	77,682,000
ドクターシーラボ	165	379,000	62,535,000
ポーラ・オルビスホールディングス	28,000	2,413	67,564,000
エステー	18,600	1,011	18,804,600
コニシ	19,200	1,069	20,524,800
長谷川香料	33,700	1,133	38,182,100
小林製薬	37,000	3,955	146,335,000
荒川化学工業	21,100	694	14,643,400
メック	25,700	313	8,044,100
日本高純度化学	75	200,800	15,060,000
荏原ユーザライト	4,400	2,265	9,966,000
アース製薬	16,900	2,911	49,195,900
イハラケミカル工業	48,000	311	14,928,000
北興化学工業	30,000	237	7,110,000
大成ラミック	6,300	2,426	15,283,800
クミアイ化学工業	66,000	314	20,724,000

日本農業	61,000	371	22,631,000	
アキレス	213,000	113	24,069,000	
有沢製作所	50,600	302	15,281,200	
日東電工	221,600	3,335	739,036,000	
レック	10,000	1,210	12,100,000	
きもと	24,200	503	12,172,600	
藤森工業	19,500	1,351	26,344,500	
前澤化成工業	19,400	945	18,333,000	
J S P	17,900	1,114	19,940,600	
エフピコ	11,900	5,120	60,928,000	
天馬	22,600	899	20,317,400	
信越ポリマー	53,500	396	21,186,000	
東リ	74,000	167	12,358,000	
ニフコ	59,600	2,103	125,338,800	
日本バルカー工業	105,000	221	23,205,000	
ユニ・チャーム	147,900	4,385	648,541,500	
協和発酵キリン	364,000	859	312,676,000	
武田薬品工業	1,005,700	3,460	3,479,722,000	
アステラス製薬	596,300	3,305	1,970,771,500	
大日本住友製薬	189,900	808	153,439,200	
塩野義製薬	419,700	1,046	439,006,200	
田辺三菱製薬	267,900	1,098	294,154,200	
わかもと製薬	41,000	237	9,717,000	
あすか製薬	33,000	473	15,609,000	
日本新薬	55,000	1,012	55,660,000	
中外製薬	311,500	1,425	443,887,500	
科研製薬	104,000	985	102,440,000	
エーザイ	330,400	3,125	1,032,500,000	
ロート製薬	113,000	1,003	113,339,000	
小野薬品工業	130,800	4,475	585,330,000	
久光製薬	82,700	3,485	288,209,500	
有機合成薬品工業	28,000	233	6,524,000	
持田製薬	91,000	949	86,359,000	
参天製薬	90,200	3,395	306,229,000	
扶桑薬品工業	93,000	219	20,367,000	
日本ケミファ	46,000	435	20,010,000	
ツムラ	73,400	2,172	159,424,800	
日医工	46,500	1,678	78,027,000	
キッセイ薬品工業	48,700	1,498	72,952,600	
生化学工業	48,900	871	42,591,900	
栄研化学	20,900	1,063	22,216,700	
日水製薬	7,600	718	5,456,800	
鳥居薬品	17,600	1,552	27,315,200	
東和薬品	13,900	3,850	53,515,000	
沢井製薬	17,800	8,540	152,012,000	
ゼリア新薬工業	38,000	1,429	54,302,000	

第一三共	903,000	1,407	1,270,521,000	
キョーリン製薬ホールディングス	65,000	1,483	96,395,000	
大幸薬品	14,300	795	11,368,500	
ダイト	9,300	1,218	11,327,400	
大塚ホールディングス	532,400	2,360	1,256,464,000	
大正製薬ホールディングス	64,500	6,610	426,345,000	
日本コークス工業	228,500	116	26,506,000	
昭和シェル石油	237,200	499	118,362,800	
コスモ石油	737,000	220	162,140,000	
ニチレキ	37,000	400	14,800,000	
東燃ゼネラル石油	403,000	739	297,817,000	
ユシロ化学工業	16,800	876	14,716,800	
ビーピー・カストロール	9,800	338	3,312,400	
AOCホールディングス	63,800	467	29,794,600	
MORESCO	7,700	830	6,391,000	
出光興産	31,600	7,600	240,160,000	
JXホールディングス	2,976,000	482	1,434,432,000	
横浜ゴム	324,000	583	188,892,000	
東洋ゴム工業	205,000	213	43,665,000	
ブリヂストン	841,400	1,887	1,587,721,800	
住友ゴム工業	209,200	1,097	229,492,400	
藤倉ゴム工業	17,900	290	5,191,000	
オカモト	93,000	326	30,318,000	
フコク	11,300	907	10,249,100	
ニッタ	27,100	1,466	39,728,600	
東海ゴム工業	50,000	975	48,750,000	
三ツ星ベルト	69,000	441	30,429,000	
バンドー化学	99,000	297	29,403,000	
日東紡績	203,000	298	60,494,000	
旭硝子	1,320,000	627	827,640,000	
日本板硝子	1,158,000	118	136,644,000	
石塚硝子	35,000	146	5,110,000	
日本山村硝子	100,000	191	19,100,000	
日本電気硝子	516,000	671	346,236,000	
オハラ	11,100	897	9,956,700	
住友大阪セメント	548,000	240	131,520,000	
太平洋セメント	1,584,000	187	296,208,000	
デイ・シイ	21,000	326	6,846,000	
日本ヒューム	24,000	350	8,400,000	
日本コンクリート工業	37,000	265	9,805,000	
東海カーボン	232,000	413	95,816,000	
日本カーボン	124,000	217	26,908,000	
東洋炭素	13,500	2,914	39,339,000	
ノリタケカンパニーリミテド	137,000	235	32,195,000	
TOTO	412,000	589	242,668,000	
日本碍子	350,000	985	344,750,000	

日本特殊陶業	231,000	1,127	260,337,000
MARUWA	8,100	3,520	28,512,000
品川リフラクトリーズ	65,000	211	13,715,000
黒崎播磨	53,000	245	12,985,000
東京窯業	34,000	192	6,528,000
ニッカトー	10,200	483	4,926,600
フジミインコーポレーテッド	25,100	962	24,146,200
エーアンドエーマテリアル	70,000	87	6,090,000
ニチアス	119,000	432	51,408,000
ニチハ	30,700	1,026	31,498,200
新日本製鐵	7,044,000	205	1,444,020,000
住友金属工業	4,978,000	150	746,700,000
神戸製鋼所	3,732,000	120	447,840,000
日新製鋼	959,000	119	114,121,000
中山製鋼所	166,000	75	12,450,000
合同製鐵	159,000	191	30,369,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	636,200	1,617	1,028,735,400
東京製鐵	138,100	678	93,631,800
共英製鋼	29,500	1,548	45,666,000
大和工業	61,500	2,252	138,498,000
東京鐵鋼	59,000	280	16,520,000
大阪製鐵	17,100	1,550	26,505,000
淀川製鋼所	190,000	328	62,320,000
東洋鋼鈑	61,000	314	19,154,000
住友鋼管	16,600	820	13,612,000
丸一鋼管	81,800	1,846	151,002,800
モリ工業	45,000	281	12,645,000
大同特殊鋼	449,000	512	229,888,000
日本高周波鋼業	128,000	98	12,544,000
日本冶金工業	94,500	127	12,001,500
山陽特殊製鋼	134,000	409	54,806,000
愛知製鋼	144,000	381	54,864,000
日立金属	176,000	977	171,952,000
日本金属	81,000	145	11,745,000
大平洋金属	187,000	419	78,353,000
日本電工	99,000	380	37,620,000
栗本鐵工所	137,000	195	26,715,000
日本鑄鐵管	39,000	213	8,307,000
三菱製鋼	165,000	274	45,210,000
日亜鋼業	44,000	205	9,020,000
日本精線	21,000	399	8,379,000
シンニッタン	26,800	505	13,534,000
新家工業	71,000	125	8,875,000
日本輕金属	613,000	116	71,108,000
大紀アルミニウム工業所	51,000	239	12,189,000
三井金属鋳業	728,000	206	149,968,000

東邦亜鉛	149,000	333	49,617,000
三菱マテリアル	1,669,000	242	403,898,000
住友金属鉱山	695,000	1,066	740,870,000
DOWAホールディングス	320,000	516	165,120,000
古河機械金属	459,000	75	34,425,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	27,300	2,774	75,730,200
東邦チタニウム	45,600	1,184	53,990,400
住友軽金属工業	663,000	79	52,377,000
古河スカイ	113,000	251	28,363,000
古河電気工業	846,000	219	185,274,000
住友電気工業	946,500	1,068	1,010,862,000
フジクラ	401,000	247	99,047,000
昭和電線ホールディングス	356,000	75	26,700,000
タツタ電線	52,000	455	23,660,000
日立電線	212,000	198	41,976,000
平河ヒューテック	5,800	748	4,338,400
リョービ	149,000	291	43,359,000
アサヒホールディングス	37,300	1,580	58,934,000
稲葉製作所	11,400	1,064	12,129,600
宮地エンジニアリンググループ	93,000	152	14,136,000
三協・立山ホールディングス	375,000	165	61,875,000
トーカロ	16,300	1,509	24,596,700
アルファC o	9,500	1,029	9,775,500
SUMCO	149,200	834	124,432,800
川田テクノロジーズ	6,400	1,194	7,641,600
東洋製罐	188,000	1,094	205,672,000
ホッカンホールディングス	62,000	230	14,260,000
コロナ	14,000	1,183	16,562,000
横河ブリッジホールディングス	56,000	576	32,256,000
日本橋梁	13,550	335	4,539,250
駒井ハルテック	59,000	251	14,809,000
高田機工	31,000	218	6,758,000
三和ホールディングス	271,000	312	84,552,000
文化シャッター	77,000	291	22,407,000
住生活グループ	349,900	1,556	544,444,400
日本ファイルコン	25,000	377	9,425,000
ノーリツ	53,500	1,434	76,719,000
長府製作所	24,400	1,913	46,677,200
リンナイ	43,000	5,740	246,820,000
ダイニチ工業	16,000	766	12,256,000
日東精工	40,000	238	9,520,000
三洋工業	46,000	171	7,866,000
岡部	52,800	540	28,512,000
東プレ	52,400	805	42,182,000
高周波熱錬	37,200	726	27,007,200
東京製綱	178,000	159	28,302,000

パイオラックス	11,300	2,039	23,040,700
日本発條	194,700	857	166,857,900
中央発條	37,000	314	11,618,000
三益半導体工業	24,400	774	18,885,600
アタカ大機	17,000	273	4,641,000
日本製鋼所	415,000	523	217,045,000
日立ツール	14,800	815	12,062,000
三浦工業	39,100	2,093	81,836,300
タクマ	95,000	358	34,010,000
ツガミ	71,000	901	63,971,000
オークマ	162,000	652	105,624,000
東芝機械	148,000	425	62,900,000
アマダ	377,000	566	213,382,000
アイダエンジニアリング	70,800	452	32,001,600
牧野フライス製作所	136,000	643	87,448,000
オーエスジー	118,500	1,275	151,087,500
ダイジェット工業	43,000	175	7,525,000
旭ダイヤモンド工業	66,600	910	60,606,000
森精機製作所	142,500	830	118,275,000
ディスコ	27,300	4,735	129,265,500
日東工器	14,600	1,757	25,652,200
豊和工業	171,000	89	15,219,000
大阪機工	106,000	111	11,766,000
津田駒工業	75,000	189	14,175,000
島精機製作所	34,800	1,429	49,729,200
日阪製作所	34,000	875	29,750,000
やまびこ	11,200	1,350	15,120,000
ペガサスミシン製造	32,700	208	6,801,600
ナブテスコ	111,400	1,684	187,597,600
三井海洋開発	22,400	1,604	35,929,600
レオン自動機	28,000	196	5,488,000
S M C	80,100	13,320	1,066,932,000
新川	24,500	424	10,388,000
ホソカワミクロン	45,000	475	21,375,000
ユニオンツール	13,600	1,428	19,420,800
オイレス工業	29,400	1,591	46,775,400
サトーホールディングス	27,500	1,158	31,845,000
日本エアーテック	10,000	366	3,660,000
日精樹脂工業	25,400	421	10,693,400
ワイエイシイ	13,900	628	8,729,200
小松製作所	1,251,000	2,369	2,963,619,000
住友重機械工業	684,000	424	290,016,000
日立建機	136,700	1,804	246,606,800
日工	39,000	293	11,427,000
巴工業	10,000	1,765	17,650,000
井関農機	275,000	200	55,000,000

TOWA	26,700	435	11,614,500	
丸山製作所	69,000	171	11,799,000	
北川鉄工所	130,000	154	20,020,000	
クボタ	1,228,000	780	957,840,000	
荏原実業	5,100	1,252	6,385,200	
三菱化工機	85,000	155	13,175,000	
月島機械	40,000	699	27,960,000	
帝国電機製作所	9,600	1,554	14,918,400	
新東工業	58,800	872	51,273,600	
澁谷工業	17,700	890	15,753,000	
アイチ コーポレーション	47,800	353	16,873,400	
小森コーポレーション	77,300	701	54,187,300	
鶴見製作所	21,000	660	13,860,000	
住友精密工業	41,000	465	19,065,000	
酒井重工業	57,000	291	16,587,000	
荏原製作所	440,000	293	128,920,000	
石井鐵工所	45,000	183	8,235,000	
西島製作所	30,400	1,042	31,676,800	
ダイキン工業	326,700	2,133	696,851,100	
オルガノ	51,000	531	27,081,000	
トーヨーカネツ	150,000	187	28,050,000	
栗田工業	147,500	1,948	287,330,000	
椿本チエイン	136,000	509	69,224,000	
大同工業	59,000	143	8,437,000	
日本コンベヤ	106,000	80	8,480,000	
木村化工機	27,300	342	9,336,600	
アネスト岩田	43,000	380	16,340,000	
ダイフク	116,500	467	54,405,500	
加藤製作所	63,000	402	25,326,000	
油研工業	58,000	169	9,802,000	
タダノ	127,000	574	72,898,000	
フジテック	76,000	495	37,620,000	
シーケーディ	72,400	627	45,394,800	
キトー	132	69,400	9,160,800	
平和	55,500	1,715	95,182,500	
理想科学工業	19,000	1,190	22,610,000	
SANKYO	77,600	3,900	302,640,000	
日本金銭機械	24,000	755	18,120,000	
マースエンジニアリング	14,300	1,824	26,083,200	
福島工業	7,100	1,140	8,094,000	
ダイコク電機	12,800	1,150	14,720,000	
アマノ	73,900	712	52,616,800	
JUKI	66,000	162	10,692,000	
サンデン	138,000	243	33,534,000	
蛇の目ミシン工業	275,000	64	17,600,000	
マックス	38,000	1,000	38,000,000	

グローリー	75,900	1,787	135,633,300
大和冷機工業	36,000	409	14,724,000
セガサミーホールディングス	276,200	1,720	475,064,000
日本ピストンリング	104,000	184	19,136,000
リケン	93,000	337	31,341,000
T P R	29,000	1,345	39,005,000
ホシザキ電機	50,600	1,919	97,101,400
大豊工業	18,300	1,019	18,647,700
日本精工	569,000	578	328,882,000
N T N	595,000	326	193,970,000
ジェイテクト	244,700	898	219,740,600
不二越	260,000	441	114,660,000
日本トムソン	83,000	473	39,259,000
T H K	170,900	1,615	276,003,500
ユーシン精機	13,000	1,715	22,295,000
前澤給装工業	7,700	1,129	8,693,300
イーグル工業	33,000	791	26,103,000
日本ピラー工業	27,000	678	18,306,000
キッツ	108,800	327	35,577,600
日立工機	64,700	706	45,678,200
マキタ	167,100	3,185	532,213,500
日立造船	1,014,500	104	105,508,000
三菱重工業	4,292,000	387	1,661,004,000
I H I	1,747,000	193	337,171,000
イビデン	168,500	1,917	323,014,500
コニカミノルタホールディングス	676,500	665	449,872,500
ブラザー工業	330,700	1,104	365,092,800
ミネベア	384,000	345	132,480,000
日立製作所	5,752,000	522	3,002,544,000
東芝	5,395,000	340	1,834,300,000
三菱電機	2,562,000	671	1,719,102,000
富士電機	775,000	204	158,100,000
東洋電機製造	54,000	303	16,362,000
安川電機	302,000	740	223,480,000
シンフォニアテクノロジー	163,000	165	26,895,000
明電舎	253,000	271	68,563,000
オリジン電気	42,000	356	14,952,000
デンヨー	24,800	1,045	25,916,000
東芝テック	158,000	308	48,664,000
芝浦メカトロニクス	52,000	215	11,180,000
マブチモーター	34,100	3,545	120,884,500
日本電産	138,600	7,370	1,021,482,000
高岳製作所	106,000	229	24,274,000
ダイヘン	154,000	272	41,888,000
J V C ケンウッド	159,300	335	53,365,500
第一精工	6,700	1,992	13,346,400

日新電機	53,000	462	24,486,000	
大崎電気工業	38,000	822	31,236,000	
オムロン	285,600	1,602	457,531,200	
日東工業	38,400	1,036	39,782,400	
I D E C	34,100	788	26,870,800	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	492,000	420	206,640,000	
サクサホールディングス	73,000	156	11,388,000	
メルコホールディングス	14,700	1,882	27,665,400	
日本電気	3,528,000	156	550,368,000	
富士通	2,468,000	400	987,200,000	
沖電気工業	1,001,000	128	128,128,000	
岩崎通信機	132,000	75	9,900,000	
電気興業	82,000	375	30,750,000	
サンケン電気	135,000	352	47,520,000	
ナカヨ通信機	27,000	354	9,558,000	
アイホン	14,200	1,456	20,675,200	
ルネサスエレクトロニクス	68,700	504	34,624,800	
セイコーエプソン	174,500	1,109	193,520,500	
ワコム	514	173,600	89,230,400	
アルバック	52,300	785	41,055,500	
アクセル	11,800	1,915	22,597,000	
ナナオ	21,900	1,684	36,879,600	
日本信号	61,600	475	29,260,000	
京三製作所	54,000	339	18,306,000	
能美防災	34,000	536	18,224,000	
ホーチキ	23,000	386	8,878,000	
日本無線	65,000	193	12,545,000	
パナソニック	2,927,100	650	1,902,615,000	
シャープ	1,241,000	514	637,874,000	
アンリツ	124,000	1,043	129,332,000	
富士通ゼネラル	61,000	586	35,746,000	
日立国際電気	59,000	732	43,188,000	
ソニー	1,599,000	1,444	2,308,956,000	
T D K	134,500	4,320	581,040,000	
帝国通信工業	72,000	138	9,936,000	
ミツミ電機	92,700	668	61,923,600	
タムラ製作所	88,000	205	18,040,000	
アルプス電気	203,000	736	149,408,000	
パイオニア	367,400	393	144,388,200	
日本電波工業	20,800	1,108	23,046,400	
日本トリム	2,750	2,028	5,577,000	
ローランド ディー . ジー .	11,200	956	10,707,200	
フォスター電機	24,500	1,077	26,386,500	
クラリオン	74,000	219	16,206,000	
S M K	83,000	259	21,497,000	
ヨコオ	20,900	493	10,303,700	

東光	121,000	259	31,339,000	
ホシデン	69,600	563	39,184,800	
ヒロセ電機	44,500	8,250	367,125,000	
日本航空電子工業	59,000	679	40,061,000	
TOA	28,000	667	18,676,000	
ユニデン	79,000	306	24,174,000	
アルパイン	49,700	1,014	50,395,800	
スミダコーポレーション	17,600	514	9,046,400	
アイコム	13,600	1,898	25,812,800	
船井電機	23,800	1,577	37,532,600	
横河電機	279,300	774	216,178,200	
新電元工業	94,000	349	32,806,000	
アズビル	65,300	1,740	113,622,000	
日本光電工業	51,100	2,223	113,595,300	
チノー	47,000	216	10,152,000	
共和電業	29,000	257	7,453,000	
堀場製作所	47,300	2,756	130,358,800	
アドバンテスト	191,700	1,212	232,340,400	
小野測器	33,000	309	10,197,000	
エスベック	27,500	746	20,515,000	
パナソニック電工SUNX	24,400	386	9,418,400	
キーエンス	62,800	18,800	1,180,640,000	
日置電機	11,200	1,508	16,889,600	
シスメックス	89,900	3,125	280,937,500	
メガチップス	21,800	1,646	35,882,800	
OBARA GROUP	19,500	991	19,324,500	
日本電産コパル電子	25,900	457	11,836,300	
ミヤチテクノス	13,500	671	9,058,500	
東京電波	8,600	397	3,414,200	
コーセル	36,500	1,115	40,697,500	
日立メディコ	19,000	1,065	20,235,000	
オブテックス	17,200	1,095	18,834,000	
千代田インテグレ	12,100	1,017	12,305,700	
東光電気	20,000	316	6,320,000	
スタンレー電気	171,800	1,235	212,173,000	
岩崎電気	104,000	166	17,264,000	
ウシオ電機	155,100	1,075	166,732,500	
ヘリオス テクノ ホールディング	34,900	144	5,025,600	
日本セラミック	16,800	1,315	22,092,000	
日本デジタル研究所	21,900	810	17,739,000	
古河電池	20,000	433	8,660,000	
双信電機	15,600	342	5,335,200	
凶研	16,400	653	10,709,200	
日本電子	96,000	230	22,080,000	
カシオ計算機	244,900	562	137,633,800	
ファナック	266,700	15,010	4,003,167,000	

日本シイエムケイ	58,700	412	24,184,400	
エンブラス	13,600	2,150	29,240,000	
ローム	126,100	3,785	477,288,500	
浜松ホトニクス	99,100	3,140	311,174,000	
三井ハイテック	35,900	468	16,801,200	
新光電気工業	87,300	780	68,094,000	
京セラ	213,200	7,300	1,556,360,000	
太陽誘電	117,100	832	97,427,200	
村田製作所	269,000	4,705	1,265,645,000	
ユーシン	36,500	612	22,338,000	
双葉電子工業	42,600	1,184	50,438,400	
北陸電気工業	119,000	111	13,209,000	
ニチコン	81,300	950	77,235,000	
日本ケミコン	153,000	316	48,348,000	
K O A	32,000	833	26,656,000	
市光工業	69,000	159	10,971,000	
小糸製作所	128,000	1,282	164,096,000	
ミツバ	48,000	801	38,448,000	
スター精密	41,400	789	32,664,600	
大日本スクリーン製造	244,000	731	178,364,000	
キャノン電子	23,100	1,971	45,530,100	
キャノン	1,591,800	3,790	6,032,922,000	
リコー	771,000	749	577,479,000	
日本電産サンキョー	58,000	490	28,420,000	
MUTOHホールディングス	30,000	264	7,920,000	
東京エレクトロン	215,600	4,495	969,122,000	
トヨタ紡織	90,300	938	84,701,400	
鬼怒川ゴム工業	59,000	589	34,751,000	
ユニプレス	40,800	2,461	100,408,800	
豊田自動織機	231,200	2,329	538,464,800	
モリタホールディングス	40,000	530	21,200,000	
三櫻工業	31,300	631	19,750,300	
デンソー	633,300	2,546	1,612,381,800	
東海理化電機製作所	59,200	1,333	78,913,600	
三井造船	996,000	131	130,476,000	
佐世保重工業	174,000	126	21,924,000	
川崎重工業	1,865,000	237	442,005,000	
日本車輛製造	92,000	314	28,888,000	
日本輸送機	39,000	239	9,321,000	
近畿車輛	41,000	308	12,628,000	
日産自動車	3,259,500	825	2,689,087,500	
いすゞ自動車	1,621,000	464	752,144,000	
トヨタ自動車	3,322,200	3,325	11,046,315,000	1
日野自動車	365,000	559	204,035,000	
三菱自動車工業	5,742,000	90	516,780,000	
エフテック	9,900	1,628	16,117,200	

武蔵精密工業	24,600	1,814	44,624,400
日産車体	71,000	815	57,865,000
新明和工業	117,000	385	45,045,000
極東開発工業	45,400	791	35,911,400
日信工業	47,100	1,259	59,298,900
トピー工業	194,000	257	49,858,000
ティラド	95,000	318	30,210,000
曙ブレーキ工業	132,800	418	55,510,400
タチエス	32,700	1,580	51,666,000
N O K	124,000	1,692	209,808,000
フタバ産業	75,600	423	31,978,800
カヤバ工業	179,000	460	82,340,000
シロキ工業	60,000	262	15,720,000
大同メタル工業	40,000	962	38,480,000
プレス工業	120,000	485	58,200,000
カルソニックカンセイ	153,000	473	72,369,000
太平洋工業	53,000	514	27,242,000
ケーヒン	53,400	1,382	73,798,800
河西工業	33,000	414	13,662,000
アイシン精機	209,900	2,775	582,472,500
富士機工	34,000	291	9,894,000
マツダ	3,449,000	137	472,513,000
ダイハツ工業	237,000	1,448	343,176,000
今仙電機製作所	19,000	1,099	20,881,000
本田技研工業	2,161,300	2,925	6,321,802,500
スズキ	535,000	1,893	1,012,755,000
富士重工業	809,000	620	501,580,000
ヤマハ発動機	418,500	1,038	434,403,000
ショーワ	56,000	629	35,224,000
T B K	27,000	520	14,040,000
エクセディ	35,200	2,164	76,172,800
豊田合成	72,000	1,519	109,368,000
愛三工業	27,100	756	20,487,600
ヨロズ	15,300	1,635	25,015,500
エフ・シー・シー	41,700	1,794	74,809,800
シマノ	95,900	4,745	455,045,500
タカタ	46,500	2,050	95,325,000
テイ・エス テック	53,500	1,554	83,139,000
日本電産トーソク	13,100	881	11,541,100
テルモ	182,100	3,635	661,933,500
クリエートメディック	8,000	813	6,504,000
日機装	86,000	832	71,552,000
島津製作所	312,000	707	220,584,000
J M S	46,000	249	11,454,000
長野計器	21,900	729	15,965,100
バイ・テクノロジー	45	271,200	12,204,000

東京計器	109,000	173	18,857,000	
愛知時計電機	35,000	309	10,815,000	
東京精密	47,800	1,547	73,946,600	
ニコン	447,700	2,383	1,066,869,100	
トプコン	64,000	551	35,264,000	
オリンパス	256,300	1,291	330,883,300	
理研計器	24,600	572	14,071,200	
タムロン	22,800	2,451	55,882,800	
HOYA	625,300	1,818	1,136,795,400	
ノーリツ鋼機	29,200	414	12,088,800	
エー・アンド・デイ	24,800	307	7,613,600	
日本電産コパル	22,100	1,050	23,205,000	
シチズンホールディングス	311,700	501	156,161,700	
リズム時計工業	137,000	135	18,495,000	
大研医器	7,300	882	6,438,600	
セイコーホールディングス	161,000	197	31,717,000	
ニプロ	129,900	572	74,302,800	
パラマウントベッドホールディングス	21,300	2,362	50,310,600	
永大産業	37,000	349	12,913,000	
SRIスポーツ	14,300	1,071	15,315,300	
バンダイナムコホールディングス	265,700	1,184	314,588,800	
共立印刷	39,400	233	9,180,200	
フランスベッドホールディングス	180,000	157	28,260,000	
パイロットコーポレーション	217	150,300	32,615,100	
トッパン・フォームズ	54,600	733	40,021,800	
フジシールインターナショナル	28,900	1,472	42,540,800	
タカラトミー	83,600	597	49,909,200	
廣濟堂	27,200	285	7,752,000	
タカノ	10,100	456	4,605,600	
プロネクサス	27,100	453	12,276,300	
ホクシン	33,200	181	6,009,200	
ウッドワン	47,000	348	16,356,000	
大建工業	107,000	270	28,890,000	
凸版印刷	774,000	562	434,988,000	
大日本印刷	779,000	742	578,018,000	
図書印刷	54,000	147	7,938,000	
共同印刷	90,000	211	18,990,000	
日本写真印刷	44,700	932	41,660,400	
光村印刷	22,000	271	5,962,000	
宝印刷	8,900	636	5,660,400	
アシックス	240,200	851	204,410,200	
ツツミ	12,900	2,211	28,521,900	
ローランド	27,100	783	21,219,300	
小松ウオール工業	10,400	812	8,444,800	
ヤマハ	187,900	793	149,004,700	
河合楽器製作所	105,000	202	21,210,000	

クリナップ	31,900	605	19,299,500	
ビジョン	22,700	3,115	70,710,500	
兼松日産農林	53,000	164	8,692,000	
キングジム	21,800	679	14,802,200	
リンテック	48,900	1,472	71,980,800	
イトーキ	59,000	388	22,892,000	
任天堂	146,700	11,590	1,700,253,000	
三菱鉛筆	20,400	1,407	28,702,800	
タカラスタンダード	114,000	608	69,312,000	
コクヨ	125,900	589	74,155,100	
ナカバヤシ	62,000	185	11,470,000	
グローブライド	145,000	97	14,065,000	
岡村製作所	91,000	561	51,051,000	
美津濃	124,000	448	55,552,000	
アデランス	33,000	808	26,664,000	
東京電力	1,761,500	205	361,107,500	
中部電力	847,400	1,426	1,208,392,400	
関西電力	1,049,100	1,293	1,356,486,300	
中国電力	356,900	1,469	524,286,100	
北陸電力	253,300	1,470	372,351,000	
東北電力	644,800	900	580,320,000	
四国電力	237,200	2,336	554,099,200	
九州電力	570,200	1,158	660,291,600	
北海道電力	242,200	1,209	292,819,800	
沖縄電力	16,100	3,380	54,418,000	
電源開発	160,900	2,226	358,163,400	
東京瓦斯	3,102,000	387	1,200,474,000	
大阪瓦斯	2,497,000	325	811,525,000	
東邦瓦斯	657,000	491	322,587,000	
北海道瓦斯	54,000	252	13,608,000	
西部瓦斯	305,000	210	64,050,000	
静岡瓦斯	71,500	552	39,468,000	
東武鉄道	1,455,000	402	584,910,000	
相鉄ホールディングス	405,000	246	99,630,000	
東京急行電鉄	1,509,000	373	562,857,000	
京浜急行電鉄	659,000	678	446,802,000	
小田急電鉄	821,000	742	609,182,000	
京王電鉄	717,000	557	399,369,000	
京成電鉄	409,000	605	247,445,000	
富士急行	74,000	495	36,630,000	
新京成電鉄	32,000	348	11,136,000	
東日本旅客鉄道	445,800	4,985	2,222,313,000	
西日本旅客鉄道	223,300	3,330	743,589,000	
東海旅客鉄道	2,226	654,000	1,455,804,000	
西日本鉄道	323,000	378	122,094,000	
ハマキョウレックス	7,700	2,969	22,861,300	

サカイ引越センター	4,400	1,767	7,774,800
近畿日本鉄道	2,318,000	296	686,128,000
阪急阪神ホールディングス	1,718,000	352	604,736,000
南海電気鉄道	530,000	336	178,080,000
京阪電気鉄道	570,000	369	210,330,000
名糖運輸	9,400	603	5,668,200
名古屋鉄道	885,000	216	191,160,000
日本通運	1,013,000	305	308,965,000
ヤマトホールディングス	520,700	1,211	630,567,700
山九	313,000	305	95,465,000
丸運	19,400	203	3,938,200
丸全昭和運輸	83,000	249	20,667,000
センコー	105,000	319	33,495,000
トナミホールディングス	62,000	177	10,974,000
日本梱包運輸倉庫	77,300	956	73,898,800
日本石油輸送	31,000	201	6,231,000
福山通運	155,000	427	66,185,000
セイノーホールディングス	196,000	566	110,936,000
神奈川中央交通	29,000	445	12,905,000
日立物流	53,300	1,510	80,483,000
日本郵船	2,042,000	236	481,912,000
商船三井	1,354,000	317	429,218,000
川崎汽船	811,000	167	135,437,000
N S ユナイテッド海運	138,000	126	17,388,000
乾汽船	40,700	308	12,535,600
飯野海運	134,000	356	47,704,000
共栄タンカー	34,000	212	7,208,000
第一中央汽船	47,000	106	4,982,000
全日本空輸	3,416,000	231	789,096,000
パスコ	28,000	320	8,960,000
日新	99,000	195	19,305,000
三菱倉庫	182,000	887	161,434,000
三井倉庫	121,000	335	40,535,000
住友倉庫	185,000	383	70,855,000
澁澤倉庫	65,000	236	15,340,000
東陽倉庫	42,000	180	7,560,000
日本トランスシティ	57,000	274	15,618,000
ケイヒン	67,000	107	7,169,000
安田倉庫	20,200	492	9,938,400
東洋埠頭	92,000	139	12,788,000
宇徳	24,400	267	6,514,800
上組	279,000	649	181,071,000
サンリツ	9,900	531	5,256,900
キューソー流通システム	5,500	875	4,812,500
郵船ロジスティクス	20,700	1,221	25,274,700
近鉄エクスプレス	23,200	2,827	65,586,400

東海運	21,300	240	5,112,000	
NEC ネットエスアイ	24,500	1,194	29,253,000	
システナ	305	58,200	17,751,000	
新日鉄ソリューションズ	17,500	1,499	26,232,500	
コア	10,000	681	6,810,000	
ITホールディングス	78,600	1,042	81,901,200	
グリー	130,600	2,044	266,946,400	
コーエーテクモホールディングス	52,900	663	35,072,700	
三菱総合研究所	10,600	1,637	17,352,200	
ボルテージ	4,400	1,154	5,077,600	
ネクソン	129,500	1,482	191,919,000	
ドワンゴ	147	125,800	18,492,600	
マクロミル	23,100	789	18,225,900	
ティーガイア	169	135,800	22,950,200	
GMO ペイメントゲートウェイ	53	308,500	16,350,500	
ザッパラス	162	100,400	16,264,800	
インターネットイニシアティブ	156	312,500	48,750,000	
ソネットエンタテインメント	148	323,000	47,804,000	
SRAホールディングス	11,800	894	10,549,200	
朝日ネット	17,000	361	6,137,000	
パナソニック電工インフォメーションシステムズ	6,000	2,036	12,216,000	
フェイス	856	9,800	8,388,800	
野村総合研究所	143,800	1,904	273,795,200	
インテージ	7,900	1,666	13,161,400	
シンプレクス・ホールディングス	509	29,450	14,990,050	
クレスコ	8,100	618	5,005,800	
フジ・メディア・ホールディングス	2,637	141,600	373,399,200	
オービック	7,990	15,980	127,680,200	
ティーディーシーソフトウェアエンジニアリング	6,400	727	4,652,800	
ヤフー	18,601	25,180	468,373,180	
トレンドマイクロ	112,400	2,365	265,826,000	
日本オラクル	51,400	3,100	159,340,000	
アルファシステムズ	9,960	1,169	11,643,240	
フューチャーアーキテクト	302	34,550	10,434,100	
シーエーシー	15,800	710	11,218,000	
ソフトバンク・テクノロジー	7,300	1,041	7,599,300	
トーセ	4,700	538	2,528,600	
オービックビジネスコンサルタント	6,800	3,730	25,364,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	30,300	3,540	107,262,000	
アイティフォー	32,000	290	9,280,000	
大塚商会	20,300	6,300	127,890,000	
サイボウズ	541	25,830	13,974,030	
電通国際情報サービス	19,100	625	11,937,500	
ウェザーニューズ	7,000	2,519	17,633,000	
CIJ	25,600	342	8,755,200	
WOWOW	80	172,400	13,792,000	

ネットワークシステムズ	117,600	1,001	117,717,600	
アルゴグラフィックス	8,000	1,071	8,568,000	
エイベックス・グループ・ホールディングス	49,400	946	46,732,400	
日本ユニシス	63,300	559	35,384,700	
兼松エレクトロニクス	7,400	880	6,512,000	
東京放送ホールディングス	151,700	1,175	178,247,500	
日本テレビ放送網	22,210	13,140	291,839,400	
テレビ朝日	634	124,000	78,616,000	
スカパーJ S A Tホールディングス	1,974	34,850	68,793,900	
テレビ東京ホールディングス	17,300	1,059	18,320,700	
アイ・ティー・シーネットワーク	16,000	521	8,336,000	
イー・アクセス	2,009	16,820	33,791,380	
N E Cモバイリング	8,400	2,641	22,184,400	
日本電信電話	1,164,500	3,655	4,256,247,500	
K D D I	3,927	519,000	2,038,113,000	
光通信	23,800	2,497	59,428,600	
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	20,836	135,700	2,827,445,200	
G M Oインターネット	36,000	421	15,156,000	
学研ホールディングス	89,000	171	15,219,000	
ゼンリン	37,200	798	29,685,600	
昭文社	11,400	594	6,771,600	
角川グループホールディングス	24,500	2,458	60,221,000	
インプレスホールディングス	31,200	127	3,962,400	
アイネット	14,200	500	7,100,000	
松竹	167,000	745	124,415,000	
東宝	179,200	1,475	264,320,000	
東映	106,000	414	43,884,000	
葵プロモーション	11,500	531	6,106,500	
エヌ・ティ・ティ・データ	1,563	270,400	422,635,200	
D T S	27,000	1,020	27,540,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	83,400	1,646	137,276,400	
シーイーシー	17,100	417	7,130,700	
カプコン	49,700	1,849	91,895,300	
ジャステック	15,100	496	7,489,600	
S C S K	53,000	1,209	64,077,000	
アイネス	32,900	618	20,332,200	
T K C	19,900	1,678	33,392,200	
富士ソフト	33,500	1,475	49,412,500	
N S D	49,900	709	35,379,100	
コナミ	115,100	2,260	260,126,000	
福井コンピュータ	7,300	419	3,058,700	
J B C Cホールディングス	20,600	533	10,979,800	
ソフトバンク	1,146,300	2,294	2,629,612,200	
インターニックス	14,500	357	5,176,500	
高千穂交易	9,600	856	8,217,600	
伊藤忠食品	4,900	3,075	15,067,500	

エレマテック	17,700	1,190	21,063,000
JALUX	8,800	837	7,365,600
トーメンデバイス	3,300	2,002	6,606,600
双日	1,692,500	143	242,027,500
アルフレッサホールディングス	66,100	3,775	249,527,500
横浜冷凍	51,600	632	32,611,200
山下医科器械	2,200	1,061	2,334,200
アルコニックス	7,200	1,879	13,528,800
あいホールディングス	41,000	472	19,352,000
ダイワボウホールディングス	245,000	175	42,875,000
バイタルケーエスケー・ホールディングス	48,700	654	31,849,800
UKCホールディングス	15,700	1,151	18,070,700
TOKAIホールディングス	126,000	381	48,006,000
ミタチ産業	8,800	412	3,625,600
シップヘルスケアホールディングス	33,500	1,844	61,774,000
富士興産	116,000	70	8,120,000
協栄産業	42,000	143	6,006,000
小野建	20,800	672	13,977,600
佐島電機	20,200	489	9,877,800
伯東	12,800	788	10,086,400
コンドーテック	20,100	586	11,778,600
ナガイレーベン	33,700	1,210	40,777,000
三菱食品	23,300	2,023	47,135,900
松田産業	18,800	1,264	23,763,200
メディバルホールディングス	273,300	1,011	276,306,300
アドヴァン	17,900	732	13,102,800
SPK	5,600	1,402	7,851,200
アズワン	16,200	1,694	27,442,800
スズデン	7,200	493	3,549,600
尾家産業	9,300	829	7,709,700
シモジマ	15,900	1,006	15,995,400
ドウシシャ	12,100	2,270	27,467,000
高速	15,900	679	10,796,100
黒田電気	31,400	849	26,658,600
丸文	22,400	380	8,512,000
ハピネット	15,100	884	13,348,400
トーメンエレクトロニクス	11,100	1,014	11,255,400
エクセル	12,000	772	9,264,000
マルカキカイ	9,100	980	8,918,000
ガリバーインターナショナル	8,010	2,966	23,757,660
日本エム・ディ・エム	26,600	257	6,836,200
進和	17,100	940	16,074,000
ダイトエレクトロン	17,300	404	6,989,200
シークス	16,900	1,236	20,888,400
田中商事	11,000	433	4,763,000
オーハシテクニカ	16,700	600	10,020,000

マクニカ	13,600	1,908	25,948,800
白銅	10,000	742	7,420,000
伊藤忠商事	2,016,600	915	1,845,189,000
丸紅	2,212,000	566	1,251,992,000
高島	56,000	229	12,824,000
F & A アクアホールディングス	19,900	867	17,253,300
長瀬産業	142,300	984	140,023,200
蝶理	168,000	97	16,296,000
豊田通商	280,300	1,601	448,760,300
三共生興	44,800	271	12,140,800
兼松	555,000	100	55,500,000
ツカモトコーポレーション	57,000	151	8,607,000
三井物産	2,182,400	1,312	2,863,308,800
日本紙パルプ商事	126,000	277	34,902,000
日立ハイテクノロジーズ	77,200	1,884	145,444,800
カメイ	34,000	1,150	39,100,000
東都水産	55,000	152	8,360,000
スターゼン	76,000	238	18,088,000
山善	97,700	677	66,142,900
椿本興業	29,000	251	7,279,000
住友商事	1,491,900	1,181	1,761,933,900
内田洋行	66,000	246	16,236,000
三菱商事	1,841,100	1,836	3,380,259,600
第一実業	56,000	383	21,448,000
キヤノンマーケティングジャパン	84,900	996	84,560,400
西華産業	93,000	242	22,506,000
佐藤商事	22,900	580	13,282,000
菱洋エレクトロ	27,700	898	24,874,600
東京産業	22,500	293	6,592,500
ユアサ商事	267,000	135	36,045,000
神鋼商事	60,000	184	11,040,000
阪和興業	252,000	346	87,192,000
カナデン	27,000	517	13,959,000
菱電商事	32,000	465	14,880,000
フルサト工業	16,200	837	13,559,400
岩谷産業	274,000	272	74,528,000
すてきナイスグループ	117,000	241	28,197,000
昭光通商	103,000	131	13,493,000
ニチモウ	45,000	193	8,685,000
極東貿易	43,000	187	8,041,000
イワキ	41,000	194	7,954,000
三愛石油	58,000	388	22,504,000
稲畑産業	66,100	552	36,487,200
G S I クレオス	73,000	118	8,614,000
明和産業	24,000	410	9,840,000
J F E 商事	171,000	405	69,255,000

東邦ホールディングス	82,000	1,466	120,212,000	
サンゲツ	44,100	2,120	93,492,000	
ミツウロコグループホールディングス	41,300	483	19,947,900	
シナネン	48,000	339	16,272,000	
伊藤忠エネクス	53,500	454	24,289,000	
サンリオ	64,500	3,390	218,655,000	
サンワテクノス	14,000	794	11,116,000	
リョーサン	40,900	1,513	61,881,700	
新光商事	27,000	670	18,090,000	
トーホー	42,000	310	13,020,000	
三信電気	37,400	602	22,514,800	
東陽テクニカ	36,200	883	31,964,600	
モスフードサービス	29,200	1,542	45,026,400	
加賀電子	26,700	836	22,321,200	
ソーダニッカ	25,000	349	8,725,000	
立花エレテック	16,300	716	11,670,800	
P a l t a c	27,700	1,130	31,301,000	
太平洋興発	106,000	82	8,692,000	
ヤマタネ	147,000	119	17,493,000	
丸紅建材リース	39,000	174	6,786,000	
日鐵商事	58,000	236	13,688,000	
トラスコ中山	31,500	1,705	53,707,500	
オートバックスセブン	30,000	3,815	114,450,000	
加藤産業	35,800	1,633	58,461,400	
イノテック	18,300	538	9,845,400	
イエローハット	24,700	1,502	37,099,400	
富士エレクトロニクス	14,100	1,168	16,468,800	
J Kホールディングス	23,600	404	9,534,400	
日伝	10,100	2,078	20,987,800	
北沢産業	32,000	176	5,632,000	
杉本商事	13,300	757	10,068,100	
因幡電機産業	28,900	2,379	68,753,100	
住金物産	121,000	206	24,926,000	
ミスミグループ本社	93,900	1,861	174,747,900	
タキヒヨー	41,000	440	18,040,000	
スズケン	97,500	2,472	241,020,000	
ジェコス	19,400	385	7,469,000	
ローソン	79,700	5,120	408,064,000	
サンエー	7,800	3,105	24,219,000	
キリン堂	11,900	602	7,163,800	
カワチ薬品	17,500	1,959	34,282,500	
エービーシー・マート	36,400	2,949	107,343,600	
ハードオフコーポレーション	12,300	634	7,798,200	
アスクル	18,700	1,473	27,545,100	
ゲオホールディングス	407	96,900	39,438,300	
ポイント	22,150	2,852	63,171,800	

シー・ヴィ・エス・ベイエリア	14,000	234	3,276,000	
くらコーポレーション	13,600	1,335	18,156,000	
キャンドウ	121	101,300	12,257,300	
パル	7,900	3,535	27,926,500	
エディオン	102,700	533	54,739,100	
サーラコーポレーション	24,500	515	12,617,500	
あみやき亭	39	212,000	8,268,000	
ひらまつ	127	74,100	9,410,700	
ゲンキー	2,800	2,590	7,252,000	
ハニーズ	24,130	1,534	37,015,420	
アルペン	19,200	1,614	30,988,800	
ビックカメラ	947	40,200	38,069,400	
D C Mホールディングス	133,100	643	85,583,300	
MonotaRO	15,700	1,344	21,100,800	
J . フロント リテイリング	598,000	416	248,768,000	
ドトール・日レスホールディングス	38,900	1,069	41,584,100	
マツモトキヨシホールディングス	46,900	1,747	81,934,300	
スタートトゥデイ	46,400	1,293	59,995,200	
ココカラファイン	26,200	2,537	66,469,400	
三越伊勢丹ホールディングス	502,300	885	444,535,500	
クリエイトSDホールディングス	8,700	2,226	19,366,200	
ブックオフコーポレーション	15,700	735	11,539,500	
あさひ	15,200	1,551	23,575,200	
サークルKサンクス	55,400	1,766	97,836,400	
日本調剤	3,410	2,608	8,893,280	
コスモス薬品	11,300	4,375	49,437,500	
セブン&アイ・ホールディングス	1,058,200	2,379	2,517,457,800	
ツルハホールディングス	20,900	4,800	100,320,000	
サンマルクホールディングス	7,300	3,165	23,104,500	
フェリシモ	7,300	1,131	8,256,300	
トリドール	23,100	1,059	24,462,900	
クスリのアオキ	3,700	2,154	7,969,800	
メディカルシステムネットワーク	9,600	1,356	13,017,600	
総合メディカル	6,000	3,025	18,150,000	
はるやま商事	12,100	460	5,566,000	
カップ・クリエイト	17,900	1,710	30,609,000	
ライトオン	18,300	782	14,310,600	
良品計画	27,400	4,300	117,820,000	
三城ホールディングス	30,100	524	15,772,400	
コナカ	33,000	872	28,776,000	
イオン北海道	16,200	362	5,864,400	
コジマ	36,400	424	15,433,600	
コーナン商事	27,200	1,266	34,435,200	
エコス	7,000	512	3,584,000	
ワタミ	30,100	1,728	52,012,800	
ドン・キホーテ	67,900	2,886	195,959,400	

メガネトップ	37,800	1,014	38,329,200	
西松屋チェーン	56,700	678	38,442,600	
ゼンショーホールディングス	97,200	1,012	98,366,400	
幸楽苑	14,000	1,243	17,402,000	
サイゼリヤ	37,900	1,285	48,701,500	
ユナイテッドアローズ	28,900	1,784	51,557,600	
ハイデイ日高	12,700	1,279	16,243,300	
京都きもの友禅	16,000	967	15,472,000	
コロワイド	82,000	586	48,052,000	
壱番屋	7,900	2,543	20,089,700	
スギホールディングス	45,600	2,586	117,921,600	
スクロール	34,700	317	10,999,900	
ファミリーマート	77,900	3,400	264,860,000	
木曽路	28,100	1,556	43,723,600	
千趣会	46,600	570	26,562,000	
タカキュー	30,000	170	5,100,000	
ケーヨー	46,200	512	23,654,400	
上新電機	53,000	790	41,870,000	
日本瓦斯	25,800	1,207	31,140,600	
ベスト電器	89,500	190	17,005,000	
マルエツ	51,000	301	15,351,000	
ロイヤルホールディングス	38,800	937	36,355,600	
東天紅	29,000	151	4,379,000	
いなげや	26,500	916	24,274,000	
島忠	57,000	1,805	102,885,000	
チヨダ	34,000	1,805	61,370,000	
ライフコーポレーション	16,700	1,406	23,480,200	
カスミ	45,900	567	26,025,300	
リンガーハット	24,000	1,072	25,728,000	
テンアライド	26,300	261	6,864,300	
A O K Iホールディングス	23,100	1,546	35,712,600	
オークワ	37,000	1,106	40,922,000	
コメリ	35,300	2,340	82,602,000	
青山商事	70,800	1,699	120,289,200	
しまむら	29,400	9,290	273,126,000	
C F Sコーポレーション	20,500	375	7,687,500	
高島屋	343,000	633	217,119,000	
松屋	54,700	724	39,602,800	
エイチ・ツー・オー リテイリング	134,000	706	94,604,000	
ニッセンホールディングス	57,300	428	24,524,400	
パルコ	47,800	808	38,622,400	
丸井グループ	331,400	647	214,415,800	
原信ナルスホールディングス	14,100	1,357	19,133,700	
井筒屋	110,000	60	6,600,000	
ダイエー	160,250	272	43,588,000	
イズミヤ	91,000	421	38,311,000	

イオン	891,900	1,080	963,252,000	
ユニー	190,200	948	180,309,600	
イズミ	76,800	1,775	136,320,000	
東武ストア	29,000	274	7,946,000	
平和堂	45,200	1,137	51,392,400	
フジ	28,300	1,827	51,704,100	
ヤオコー	11,000	2,874	31,614,000	
ゼビオ	30,800	2,185	67,298,000	
ケースホールディングス	63,500	2,515	159,702,500	
O l y m p i c	17,900	782	13,997,800	
日産東京販売ホールディングス	46,000	241	11,086,000	
アインファーマシーズ	14,100	4,490	63,309,000	
元気寿司	9,100	999	9,090,900	
ヤマダ電機	123,380	5,140	634,173,200	
アークランドサカモト	17,600	1,320	23,232,000	
ニトリホールディングス	50,150	7,240	363,086,000	
グルメ杵屋	22,000	453	9,966,000	
愛眼	26,300	351	9,231,300	
吉野家ホールディングス	692	105,000	72,660,000	
松屋フーズ	9,000	1,559	14,031,000	
サガミチェーン	26,000	606	15,756,000	
ブレナス	27,100	1,517	41,110,700	
ミニストップ	17,100	1,482	25,342,200	
アークス	33,300	1,560	51,948,000	
パロー	50,800	1,438	73,050,400	
ベルク	11,300	1,210	13,673,000	
大庄	13,000	1,020	13,260,000	
ファーストリテイリング	59,100	18,970	1,121,127,000	
サンドラッグ	48,000	2,498	119,904,000	
ヤマザワ	6,400	1,351	8,646,400	
やまや	5,000	1,726	8,630,000	
ベルーナ	33,850	631	21,359,350	
新生銀行	1,983,000	106	210,198,000	
あおぞら銀行	796,000	214	170,344,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	19,139,400	402	7,694,038,800	
りそなホールディングス	2,205,800	364	802,911,200	
三井住友トラスト・ホールディングス	4,960,000	251	1,244,960,000	
三井住友フィナンシャルグループ	1,919,900	2,726	5,233,647,400	
第四銀行	322,000	271	87,262,000	
北越銀行	257,000	160	41,120,000	
西日本シティ銀行	887,000	220	195,140,000	
札幌北洋ホールディングス	385,200	300	115,560,000	
千葉銀行	998,000	501	499,998,000	
横浜銀行	1,625,000	397	645,125,000	
常陽銀行	963,000	363	349,569,000	
群馬銀行	569,000	417	237,273,000	

武蔵野銀行	40,400	2,658	107,383,200
千葉興業銀行	50,200	449	22,539,800
筑波銀行	110,800	266	29,472,800
東京都民銀行	48,700	938	45,680,600
七十七銀行	400,000	335	134,000,000
青森銀行	189,000	237	44,793,000
秋田銀行	171,000	255	43,605,000
山形銀行	152,000	368	55,936,000
岩手銀行	17,300	3,530	61,069,000
東邦銀行	216,000	262	56,592,000
東北銀行	149,000	133	19,817,000
みちのく銀行	136,000	156	21,216,000
ふくおかフィナンシャルグループ	1,026,000	350	359,100,000
静岡銀行	762,000	833	634,746,000
十六銀行	316,000	264	83,424,000
スルガ銀行	248,000	811	201,128,000
八十二銀行	462,000	463	213,906,000
山梨中央銀行	153,000	342	52,326,000
大垣共立銀行	328,000	279	91,512,000
福井銀行	217,000	244	52,948,000
北國銀行	301,000	291	87,591,000
清水銀行	8,800	2,930	25,784,000
滋賀銀行	233,000	463	107,879,000
南都銀行	237,000	364	86,268,000
百五銀行	223,000	355	79,165,000
京都銀行	450,000	700	315,000,000
三重銀行	98,000	187	18,326,000
ほくほくフィナンシャルグループ	1,768,000	146	258,128,000
広島銀行	739,000	352	260,128,000
山陰合同銀行	148,000	612	90,576,000
中国銀行	204,000	1,056	215,424,000
鳥取銀行	84,000	163	13,692,000
伊予銀行	268,000	673	180,364,000
百十四銀行	277,000	356	98,612,000
四国銀行	185,000	286	52,910,000
阿波銀行	218,000	485	105,730,000
鹿児島銀行	157,000	501	78,657,000
大分銀行	164,000	239	39,196,000
宮崎銀行	170,000	215	36,550,000
肥後銀行	194,000	464	90,016,000
佐賀銀行	155,000	216	33,480,000
十八銀行	163,000	229	37,327,000
沖縄銀行	19,200	3,395	65,184,000
琉球銀行	53,700	1,060	56,922,000
八千代銀行	13,500	1,909	25,771,500
セブン銀行	719,500	183	131,668,500

みずほフィナンシャルグループ	32,498,100	131	4,257,251,100	
紀陽ホールディングス	999,000	117	116,883,000	
山口フィナンシャルグループ	250,000	713	178,250,000	
長野銀行	88,000	151	13,288,000	
名古屋銀行	231,000	267	61,677,000	
愛知銀行	9,100	4,500	40,950,000	
第三銀行	145,000	163	23,635,000	
中京銀行	108,000	195	21,060,000	
東日本銀行	125,000	177	22,125,000	
大光銀行	94,000	230	21,620,000	
愛媛銀行	157,000	225	35,325,000	
トマト銀行	106,000	146	15,476,000	
みなと銀行	232,000	152	35,264,000	
京葉銀行	203,000	377	76,531,000	
関西アーバン銀行	363,000	119	43,197,000	
栃木銀行	124,000	291	36,084,000	
北日本銀行	8,800	2,050	18,040,000	
東和銀行	272,000	91	24,752,000	
福島銀行	324,000	67	21,708,000	
大東銀行	191,000	69	13,179,000	
トモニホールディングス	197,100	367	72,335,700	
フィデアホールディングス	151,600	201	30,471,600	
池田泉州ホールディングス	1,063,200	111	118,015,200	
S B Iホールディングス	26,893	7,240	194,705,320	
ジャフコ	31,700	1,916	60,737,200	
大和証券グループ本社	2,503,000	316	790,948,000	
野村ホールディングス	5,475,100	354	1,938,185,400	
岡三証券グループ	214,000	337	72,118,000	
丸三証券	88,700	342	30,335,400	
東洋証券	98,000	209	20,482,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	290,000	306	88,740,000	
光世証券	65,000	95	6,175,000	
水戸証券	83,000	211	17,513,000	
いちよし証券	59,400	537	31,897,800	
松井証券	150,800	527	79,471,600	
だいこう証券ビジネス	17,900	306	5,477,400	
マネックスグループ	2,158	17,690	38,175,020	
カブドットコム証券	107,900	282	30,427,800	
極東証券	35,600	683	24,314,800	
岩井コスモホールディングス	27,000	393	10,611,000	
N K S Jホールディングス	529,000	1,675	886,075,000	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	755,000	1,556	1,174,780,000	
ソニーフィナンシャルホールディングス	243,400	1,361	331,267,400	
第一生命保険	13,530	105,400	1,426,062,000	
東京海上ホールディングス	959,400	2,084	1,999,389,600	
T & Dホールディングス	921,800	892	822,245,600	

クレディセゾン	208,900	1,663	347,400,700
芙蓉総合リース	25,800	2,704	69,763,200
興銀リース	36,800	2,244	82,579,200
東京センチュリーリース	70,000	1,619	113,330,000
日本証券金融	112,000	445	49,840,000
大阪証券金融	53,000	175	9,275,000
ポケットカード	34,900	327	11,412,300
リコーリース	19,600	1,838	36,024,800
イオンクレジットサービス	116,100	1,365	158,476,500
アコム	42,380	1,685	71,410,300
ジャックス	164,000	283	46,412,000
オリエントコーポレーション	396,000	104	41,184,000
日立キャピタル	53,000	1,203	63,759,000
オリックス	132,040	7,520	992,940,800
三菱UFJリース	64,940	3,385	219,821,900
NECキャピタルソリューション	11,300	1,213	13,706,900
日本駐車場開発	3,542	4,420	15,655,640
昭栄	51,100	308	15,738,800
野村不動産ホールディングス	121,800	1,397	170,154,600
常和ホールディングス	4,600	1,370	6,302,000
ヒューリック	77,200	919	70,946,800
パーク24	133,600	1,112	148,563,200
三井不動産	1,125,000	1,486	1,671,750,000
三菱地所	1,773,000	1,405	2,491,065,000
平和不動産	244,500	204	49,878,000
東京建物	489,000	305	149,145,000
ダイビル	76,700	610	46,787,000
東急不動産	511,000	378	193,158,000
京阪神ビルディング	34,600	372	12,871,200
住友不動産	608,000	1,860	1,130,880,000
東宝不動産	29,500	492	14,514,000
大京	396,000	220	87,120,000
テーオーシー	101,500	451	45,776,500
東京楽天地	45,000	301	13,545,000
レオパレス21	141,400	265	37,471,000
フジ住宅	33,500	446	14,941,000
空港施設	29,500	373	11,003,500
住友不動産販売	9,430	3,855	36,352,650
ゴールドクレスト	24,080	1,418	34,145,440
東栄住宅	18,300	832	15,225,600
リロ・ホールディング	8,900	2,366	21,057,400
日本エスリード	11,800	782	9,227,600
東急リパブル	25,400	868	22,047,200
飯田産業	25,100	709	17,795,900
日神不動産	18,300	571	10,449,300
アーネストワン	42,400	891	37,778,400

タカラレーベン	32,000	737	23,584,000	
サンヨーハウジング名古屋	124	75,800	9,399,200	
イオンモール	115,800	1,817	210,408,600	
フージャースコーポレーション	163	65,000	10,595,000	
タクトホーム	141	76,200	10,744,200	
トーセイ	314	31,050	9,749,700	
エヌ・ティ・ティ都市開発	1,603	63,700	102,111,100	
日本空港ビルデング	82,600	1,060	87,556,000	
日本工営	90,000	275	24,750,000	
ネクスト	15,900	367	5,835,300	
日本M & Aセンター	12,200	2,242	27,352,400	
アコーディア・ゴルフ	1,126	63,900	71,951,400	
パソナグループ	265	71,000	18,815,000	
テンプホールディングス	37,300	820	30,586,000	
クックパッド	5,600	2,216	12,409,600	
学情	14,000	433	6,062,000	
スタジオアリス	13,700	1,404	19,234,800	
シミックホールディングス	9,900	1,371	13,572,900	
NECフィールディング	21,000	1,037	21,777,000	
総合警備保障	95,900	947	90,817,300	
カカクコム	42,600	2,406	102,495,600	
ルネサンス	17,600	445	7,832,000	
新日本科学	16,000	234	3,744,000	
エムスリー	220	317,000	69,740,000	
ベストブライダル	69	88,100	6,078,900	
ディー・エヌ・エー	121,000	2,422	293,062,000	
博報堂D Yホールディングス	33,720	5,040	169,948,800	
ぐるなび	21,000	907	19,047,000	
ジェイコムホールディングス	8,000	771	6,168,000	
P G Mホールディングス	433	58,200	25,200,600	
イーピーエス	150	189,800	28,470,000	
アミューズ	7,500	1,075	8,062,500	
ケネディクス	3,043	15,080	45,888,440	
電通	243,100	2,497	607,020,700	
テイクアンドギヴ・ニーズ	1,407	8,630	12,142,410	
ぴあ	9,500	885	8,407,500	
イオンファンタジー	9,700	1,260	12,222,000	
みらかホールディングス	69,900	3,145	219,835,500	
アルプス技研	13,400	616	8,254,400	
サニックス	48,600	215	10,449,000	
オリエンタルランド	72,200	8,900	642,580,000	
ダスキン	77,400	1,573	121,750,200	
明光ネットワークジャパン	26,300	774	20,356,200	
ファルコSDホールディングス	15,600	896	13,977,600	
ラウンドワン	88,100	521	45,900,100	
リゾートトラスト	42,300	1,332	56,343,600	

ビー・エム・エル	17,500	2,069	36,207,500	
ワタベウェディング	9,200	750	6,900,000	
もしもしホットライン	45,700	778	35,554,600	
東急コミュニティー	5,600	2,545	14,252,000	
リソー教育	3,276	5,160	16,904,160	
ウェアハウス	12,500	275	3,437,500	
ユー・エス・エス	34,960	8,320	290,867,200	
セントラルスポーツ	8,400	1,061	8,912,400	
フルキャストホールディングス	328	17,650	5,789,200	
リゾートソリューション	41,000	157	6,437,000	
エイチ・アイ・エス	27,600	2,620	72,312,000	
共立メンテナンス	12,800	1,802	23,065,600	
イチネンホールディングス	22,500	435	9,787,500	
建設技術研究所	16,600	516	8,565,600	
燦ホールディングス	4,600	1,563	7,189,800	
東京テアトル	123,000	116	14,268,000	
よみうりランド	61,000	264	16,104,000	
東京都競馬	213,000	124	26,412,000	
常磐興産	112,000	97	10,864,000	
カナモト	35,000	973	34,055,000	
東京ドーム	221,000	274	60,554,000	
トランス・コスモス	35,900	1,219	43,762,100	
乃村工藝社	58,000	293	16,994,000	
藤田観光	76,000	304	23,104,000	
日本管財	9,600	1,459	14,006,400	
トーカイ	11,500	1,759	20,228,500	
白洋舎	36,000	214	7,704,000	
セコム	259,700	3,965	1,029,710,500	
セントラル警備保障	9,000	784	7,056,000	
丹青社	33,000	259	8,547,000	
メイテック	43,100	1,665	71,761,500	
アサツー ディ・ケイ	43,800	2,300	100,740,000	
応用地質	29,400	941	27,665,400	
船井総合研究所	24,500	562	13,769,000	
進学会	12,300	326	4,009,800	
ベネッセホールディングス	83,200	4,075	339,040,000	
イオンディライト	30,400	1,836	55,814,400	
ナック	6,900	1,669	11,516,100	
ニチイ学館	52,900	1,124	59,459,600	
ダイセキ	43,900	1,382	60,669,800	
合計	392,620,151		285,252,885,760	

1 差入委託証拠金代用有価証券 1,800,000株

(b) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

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3期 (平成23年4月13日現在)	第4期 (平成24年4月13日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	395,899	818,208
親投資信託受益証券	128,447,120	219,788,796
未収入金	70,000	19,000
未収利息	-	1
流動資産合計	128,913,019	220,626,005
資産合計	128,913,019	220,626,005
負債の部		
流動負債		
未払解約金	69,780	18,694
未払受託者報酬	17,153	30,455
未払委託者報酬	320,247	568,438
その他未払費用	2,803	5,010
流動負債合計	409,983	622,597
負債合計	409,983	622,597
純資産の部		
元本等		
元本	135,988,910	231,415,652
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	7,485,874	11,412,244
元本等合計	128,503,036	220,003,408
純資産合計	128,503,036	220,003,408
負債純資産合計	128,913,019	220,626,005

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第3期	第4期
	自平成22年4月14日 至平成23年4月13日	自平成23年4月14日 至平成24年4月13日
営業収益		
受取利息	8	10
有価証券売買等損益	674,630	4,452,677
営業収益合計	674,622	4,452,687
営業費用		
受託者報酬	29,783	53,935
委託者報酬	555,872	1,006,635
その他費用	4,852	8,867
営業費用合計	590,507	1,069,437
営業利益又は営業損失()	1,265,129	3,383,250
経常利益又は経常損失()	1,265,129	3,383,250
当期純利益又は当期純損失()	1,265,129	3,383,250
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()	183,961	474
期首剰余金又は期首欠損金()	2,262,051	7,485,874
剰余金増加額又は欠損金減少額	439,501	834,133
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	439,501	834,133
剰余金減少額又は欠損金増加額	4,582,156	8,143,279
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	4,582,156	8,143,279
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金()	7,485,874	11,412,244

（ 3 ）【注記表】

（重要な会計方針の注記）

項目	第 4 期
	自 平成23年 4 月14日 至 平成24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。

（追加情報）

第 4 期
自 平成23年 4 月14日 至 平成24年 4 月13日
当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月 4 日）および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月 4 日）を適用しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	第 3 期	第 4 期
	（平成23年 4 月13日現在）	（平成24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 135,988,910口	当計算期間の末日における受益権の総数 231,415,652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 7,485,874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 11,412,244円
3. 1 単位当たり純資産額	0.9450円 （ 1 万口 = 9,450円 ）	0.9507円 （ 1 万口 = 9,507円 ）

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第 3 期	第 4 期
	自 平成22年 4 月14日 至 平成23年 4 月13日	自 平成23年 4 月14日 至 平成24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（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。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（2,867,383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（17,022,215円）、および分配準備積立金（5,058,922円）より、分配対象収益は24,948,520円（1 万口当たり1,078.08円）であります。分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

. 金融商品の状況に関する事項

項目	第3期 自平成22年4月14日 至平成23年4月13日	第4期 自平成23年4月14日 至平成24年4月13日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいておりません。当ファンドにおけるデリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>	<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>

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

金融商品の時価等に関する事項

項目	第3期 (平成23年4月13日現在)	第4期 (平成24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（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p>	<p>(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 同左</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） 同左</p>

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第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

第4期（自平成23年4月14日至平成24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	5,123,378円
合 計	5,123,378円

（デリバティブ取引に関する注記）

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。

第4期（平成24年4月13日現在）

第4期末現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（関連当事者との取引に関する注記）

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。

第4期（自平成23年4月14日至平成24年4月13日）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項 目	第3期 （平成23年4月13日現在）	第4期 （平成24年4月13日現在）
期首元本額	70,731,031円	135,988,910円
期中追加設定元本額	74,934,583円	108,988,282円
期中一部解約元本額	9,676,704円	13,561,540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)	44,485,704円	1.1082円	49,299,057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	90,605,692円	1.1186円	101,351,527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	16,276,985円	1.3219円	21,516,546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	31,332,999円	1.1630円	36,440,277円
親投資信託 受益証券	マネーインカム・マザーファンド	11,075,069円	1.0096円	11,181,389円
合計		193,776,449円		219,788,796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24年5月31日現在

資産総額	220,326,819円
負債総額	1,219,668円
純資産総額(-)	219,107,151円
発行済口数	240,320,539口
1口当たり純資産額(/)	0.9117円
(1万口当たり純資産額	9,117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23年4月13日現在)	(平成24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	2,294,911,264	917,269,688
国債証券	373,701,066,270	383,018,714,760
地方債証券	33,434,852,030	31,018,015,635
特殊債券	54,214,059,889	49,633,555,160
社債券	41,186,861,400	32,608,215,000
未収入金	-	691,048,200
未収利息	1,385,969,753	1,377,491,146
前払費用	58,667,060	65,953,245
流動資産合計	506,276,387,666	499,330,262,834
資産合計	506,276,387,666	499,330,262,834
負債の部		
流動負債		
未払金	1,449,131,000	-
未払解約金	-	527,918,081
流動負債合計	1,449,131,000	527,918,081
負債合計	1,449,131,000	527,918,081
純資産の部		
元本等		
元本		
元本	467,076,484,703	445,931,665,232
剰余金		
剰余金又は欠損金()	37,750,771,963	52,870,679,521
元本等合計	504,827,256,666	498,802,344,753
純資産合計	504,827,256,666	498,802,344,753
負債純資産合計	506,276,387,666	499,330,262,834

(注) 「国内債券パッシブ・マザーファンド」は、毎年5月25日(ただし、休業日の場合は翌営業日)に決算を行います。上記の貸借対照表は平成23年4月13日ならびに平成24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

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成23年4月14日 至平成24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。

（追加情報）

自 平成23年 4月14日 至 平成24年 4月13日
当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

（貸借対照表に関する注記）

項目	（平成23年 4月13日現在）	（平成24年 4月13日現在）
1. 受益権総数	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	平成24年 4月13日現在における受益権の 総数 445,931,665,232口
2. 1単位当たり純資産額	1.0808円 (1万口 = 10,808円)	1.1186円 (1万口 = 11,186円)

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

項目	自 平成22年 4月14日 至 平成23年 4月13日	自 平成23年 4月14日 至 平成24年 4月13日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。	同 左
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、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。</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。</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>	<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23年4月13日現在）	（平成24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） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<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。

（平成24年4月13日現在）

平成24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。

（自平成23年4月14日 至 平成24年4月13日）

該当事項はありません。

(その他の注記)

(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
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定>	16,332,559円
SMAM・FGグローバルバランス25VA<適格機関投資家限定>	11,624,620円
合計	467,076,484,703円

(平成24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	467,076,484,703円
同期中における追加設定元本額	29,782,880,351円
同期中における一部解約元本額	50,927,699,822円
平成24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)	1,269,875,774円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	2,302,653,287円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	463,599,413円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	90,605,692円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	14,385,016円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	10,951,742円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	5,785,887円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	5,468,232円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	4,012,929円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	2,580,523円
SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定>	10,039,808,379円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	44,787,084,300円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	11,081,720,649円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	25,869,354,408円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	541,431,048円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	748,676,684円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	159,090,611円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	356,328,962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>	128,561,394円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	2,697,805,329円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	3,157,375,514円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	7,367,618,679円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	18,571,008,946円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,306,171,892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)	10,043,419,829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)	63,306,736,030円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	878,249,576円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	11,402,427,175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)	199,932,414,931円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	1,349,162,627円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	322,143,913円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	57,380,381円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	3,974,578,020円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	4,655,230,926円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	3,979,749,212円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	1,569,561,934円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	319,815,955円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	33,116,439円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	798,587,192円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	11,374,771,260円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	914,399,533円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定>	22,759,855円
SMAM・FGグローバルバランス25VA<適格機関投資家限定>	15,205,154円
合計	445,931,665,232円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第1回利付国債(40年)	590,000,000	645,401,000	
	第2回利付国債(40年)	782,000,000	811,762,920	
	第3回利付国債(40年)	840,000,000	868,728,000	
	第4回利付国債(40年)	1,170,000,000	1,204,082,100	
	第250回利付国債(10年)	2,170,000,000	2,180,155,600	
	第253回利付国債(10年)	10,240,000,000	10,457,702,400	
	第256回利付国債(10年)	7,330,000,000	7,489,207,600	
	第258回利付国債(10年)	11,923,000,000	12,194,844,400	
	第260回利付国債(10年)	10,985,000,000	11,338,497,300	
	第263回利付国債(10年)	11,072,000,000	11,466,716,800	
	第265回利付国債(10年)	11,240,000,000	11,647,225,200	
	第268回利付国債(10年)	13,145,000,000	13,660,941,250	
	第270回利付国債(10年)	9,507,000,000	9,847,540,740	
	第272回利付国債(10年)	10,515,000,000	10,951,582,800	
	第274回利付国債(10年)	10,805,000,000	11,319,318,000	
	第277回利付国債(10年)	11,175,000,000	11,779,008,750	
	第280回利付国債(10年)	8,767,000,000	9,375,955,820	
	第282回利付国債(10年)	10,060,000,000	10,700,620,800	
	第284回利付国債(10年)	9,987,000,000	10,648,638,750	
	第285回利付国債(10年)	5,938,000,000	6,347,246,960	
	第286回利付国債(10年)	3,350,000,000	3,605,940,000	
	第288回利付国債(10年)	3,555,000,000	3,814,550,550	
	第289回利付国債(10年)	3,994,000,000	4,247,139,720	
	第290回利付国債(10年)	5,367,000,000	5,680,647,480	
	第293回利付国債(10年)	2,470,000,000	2,675,059,400	
	第296回利付国債(10年)	3,933,000,000	4,189,549,590	
	第297回利付国債(10年)	4,303,000,000	4,557,522,450	
	第299回利付国債(10年)	2,600,000,000	2,735,460,000	
	第300回利付国債(10年)	2,000,000,000	2,131,640,000	
	第301回利付国債(10年)	2,595,000,000	2,766,062,400	
	第303回利付国債(10年)	4,455,000,000	4,713,345,450	
	第305回利付国債(10年)	5,920,000,000	6,212,566,400	
	第306回利付国債(10年)	5,850,000,000	6,175,845,000	
	第307回利付国債(10年)	400,000,000	419,268,000	
	第308回利付国債(10年)	4,690,000,000	4,909,398,200	
	第309回利付国債(10年)	2,200,000,000	2,268,024,000	
	第310回利付国債(10年)	6,600,000,000	6,736,026,000	
	第312回利付国債(10年)	6,220,000,000	6,434,838,800	

第313回利付国債(10年)	6,270,000,000	6,528,261,300
第315回利付国債(10年)	6,330,000,000	6,524,014,500
第317回利付国債(10年)	2,630,000,000	2,680,338,200
第318回利付国債(10年)	3,200,000,000	3,232,000,000
第319回利付国債(10年)	1,750,000,000	1,779,557,500
第320回利付国債(10年)	4,780,000,000	4,816,089,000
第321回利付国債(10年)	1,550,000,000	1,558,432,000
第2回利付国債(30年)	570,000,000	635,498,700
第4回利付国債(30年)	300,000,000	358,452,000
第5回利付国債(30年)	290,000,000	313,606,000
第7回利付国債(30年)	549,000,000	601,473,420
第9回利付国債(30年)	100,000,000	93,902,000
第10回利付国債(30年)	585,000,000	517,648,950
第11回利付国債(30年)	570,000,000	563,849,700
第12回利付国債(30年)	540,000,000	572,124,600
第14回利付国債(30年)	1,000,000,000	1,112,670,000
第16回利付国債(30年)	895,000,000	1,012,066,000
第18回利付国債(30年)	1,170,000,000	1,278,400,500
第19回利付国債(30年)	715,000,000	781,766,700
第21回利付国債(30年)	755,000,000	824,505,300
第22回利付国債(30年)	715,000,000	808,829,450
第23回利付国債(30年)	529,000,000	597,918,120
第24回利付国債(30年)	660,000,000	746,611,800
第25回利付国債(30年)	790,000,000	861,163,200
第26回利付国債(30年)	803,000,000	891,249,700
第27回利付国債(30年)	1,110,000,000	1,256,475,600
第28回利付国債(30年)	1,196,000,000	1,353,537,120
第29回利付国債(30年)	1,212,000,000	1,347,041,040
第30回利付国債(30年)	1,600,000,000	1,745,056,000
第31回利付国債(30年)	1,730,000,000	1,848,556,900
第32回利付国債(30年)	1,600,000,000	1,743,792,000
第33回利付国債(30年)	1,880,000,000	1,923,559,600
第34回利付国債(30年)	2,140,000,000	2,283,251,600
第35回利付国債(30年)	2,030,000,000	2,074,172,800
第36回利付国債(30年)	520,000,000	530,420,800
第32回利付国債(20年)	70,000,000	79,536,800
第35回利付国債(20年)	170,000,000	195,107,300
第37回利付国債(20年)	302,000,000	346,765,460
第39回利付国債(20年)	458,000,000	517,022,460
第40回利付国債(20年)	390,000,000	435,185,400
第42回利付国債(20年)	480,000,000	547,425,600
第43回利付国債(20年)	1,370,000,000	1,598,516,000
第46回利付国債(20年)	775,000,000	866,256,250
第48回利付国債(20年)	955,000,000	1,092,481,800
第50回利付国債(20年)	918,000,000	1,002,960,900
第52回利付国債(20年)	720,000,000	798,897,600

第54回利付国債(20年)	965,000,000	1,079,999,050	
第56回利付国債(20年)	1,308,000,000	1,438,734,600	
第59回利付国債(20年)	1,435,000,000	1,534,086,750	
第61回利付国債(20年)	1,255,000,000	1,249,452,900	
第64回利付国債(20年)	1,725,000,000	1,873,608,750	
第65回利付国債(20年)	2,280,000,000	2,473,800,000	
第70回利付国債(20年)	1,540,000,000	1,753,028,200	
第72回利付国債(20年)	1,453,000,000	1,602,179,510	
第74回利付国債(20年)	1,774,000,000	1,953,936,820	
第75回利付国債(20年)	1,370,000,000	1,507,082,200	
第78回利付国債(20年)	1,360,000,000	1,459,973,600	
第82回利付国債(20年)	1,390,000,000	1,523,189,800	
第84回利付国債(20年)	1,820,000,000	1,970,186,400	
第85回利付国債(20年)	2,170,000,000	2,370,421,200	
第88回利付国債(20年)	1,797,000,000	2,006,045,010	
第90回利付国債(20年)	2,190,000,000	2,414,737,800	
第92回利付国債(20年)	1,959,000,000	2,131,117,740	
第93回利付国債(20年)	1,807,000,000	1,938,423,110	
第95回利付国債(20年)	1,760,000,000	1,955,764,800	
第97回利付国債(20年)	1,767,000,000	1,936,490,640	
第99回利付国債(20年)	1,468,000,000	1,586,819,920	
第100回利付国債(20年)	1,387,000,000	1,517,613,790	
第101回利付国債(20年)	635,000,000	712,565,250	
第102回利付国債(20年)	1,982,000,000	2,222,832,820	
第105回利付国債(20年)	1,510,000,000	1,626,164,300	
第106回利付国債(20年)	200,000,000	218,304,000	
第107回利付国債(20年)	2,168,000,000	2,332,160,960	
第109回利付国債(20年)	2,270,000,000	2,371,718,700	
第111回利付国債(20年)	2,346,000,000	2,552,799,900	
第113回利付国債(20年)	2,802,000,000	3,003,127,560	
第114回利付国債(20年)	2,383,000,000	2,550,667,880	
第116回利付国債(20年)	2,810,000,000	3,046,911,100	
第118回利付国債(20年)	350,000,000	368,154,500	
第119回利付国債(20年)	860,000,000	877,415,000	
第120回利付国債(20年)	1,080,000,000	1,067,968,800	
第121回利付国債(20年)	2,100,000,000	2,172,639,000	
第122回利付国債(20年)	1,250,000,000	1,272,887,500	
第123回利付国債(20年)	1,240,000,000	1,321,542,400	
第124回利付国債(20年)	1,150,000,000	1,206,591,500	
第125回利付国債(20年)	1,790,000,000	1,934,739,400	
第126回利付国債(20年)	80,000,000	83,855,200	
第127回利付国債(20年)	1,340,000,000	1,383,308,800	
第128回利付国債(20年)	580,000,000	598,067,000	
第129回利付国債(20年)	1,900,000,000	1,927,455,000	
第130回利付国債(20年)	820,000,000	831,365,200	
第131回利付国債(20年)	1,660,000,000	1,653,957,600	

	第132回利付国債(20年)	450,000,000	448,015,500	
	第133回利付国債(20年)	2,530,000,000	2,561,625,000	
	第134回利付国債(20年)	900,000,000	910,674,000	
	国債証券 小計	363,581,000,000	383,018,714,760	
地方債証券	第1回東京都公募公債(20年)	100,000,000	104,022,000	
	第1回東京都公募公債(30年)	100,000,000	104,762,000	
	第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	107,751,000	
	第7回東京都公募公債(20年)	100,000,000	109,274,000	
	第8回東京都公募公債(20年)	100,000,000	111,407,000	
	第8回東京都公募公債(30年)	400,000,000	415,880,000	
	第588回東京都公募公債	100,000,000	100,418,000	
	第596回東京都公募公債	100,000,000	100,562,000	
	第598回東京都公募公債	200,000,000	200,824,000	
	第602回東京都公募公債	200,000,000	203,794,000	
	第603回東京都公募公債	200,000,000	204,326,000	
	第604回東京都公募公債	100,000,000	102,272,000	
	第608回東京都公募公債	600,000,000	616,428,000	
	第610回東京都公募公債	100,000,000	103,605,000	
	第613回東京都公募公債	100,000,000	103,359,000	
	第623回東京都公募公債	200,000,000	206,924,000	
	第628回東京都公募公債	100,000,000	104,926,000	
	第629回東京都公募公債	100,000,000	104,415,000	
	第634回東京都公募公債	106,000,000	112,940,880	
	第642回東京都公募公債	200,000,000	214,088,000	
	第643回東京都公募公債	100,000,000	106,640,000	
	第646回東京都公募公債	100,000,000	108,328,000	
	第652回東京都公募公債	200,000,000	214,168,000	
	第653回東京都公募公債	200,000,000	212,500,000	
	第660回東京都公募公債	700,000,000	746,480,000	
	第662回東京都公募公債	100,000,000	107,264,000	
	第668回東京都公募公債	200,000,000	212,940,000	
	平成16年度第3回北海道公募公債	100,000,000	102,949,000	
	平成17年度第4回北海道公募公債	100,000,000	103,150,000	
	平成17年度第9回北海道公募公債	100,000,000	104,268,000	
	平成19年度第2回北海道公募公債	100,000,000	107,027,000	
	平成19年度第7回北海道公募公債	100,000,000	107,041,000	
	平成20年度第4回北海道公募公債	100,000,000	108,395,000	
	平成20年度第9回北海道公募公債(5年)	300,000,000	306,741,000	
	平成20年度第12回北海道公募公債	100,000,000	107,045,000	
	平成20年度第15回北海道公募公債(5年)	200,000,000	203,622,000	
	第1回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	114,353,000	
	第3回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	108,690,000	
	第7回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	108,920,000	
	第26回神奈川県公募公債(5年)	100,000,000	100,492,000	
	第27回神奈川県公募公債(5年)	100,000,000	100,440,000	

第122回神奈川県公募公債	200,000,000	204,196,000	
第129回神奈川県公募公債	100,000,000	103,554,000	
第143回神奈川県公募公債	100,000,000	106,671,000	
第144回神奈川県公募公債	300,000,000	320,844,000	
第147回神奈川県公募公債	100,000,000	108,222,000	
第149回神奈川県公募公債	100,000,000	107,745,000	
第157回神奈川県公募公債	115,600,000	123,354,448	
第3回大阪府公募公債(7年)	200,000,000	206,580,000	
第31回大阪府公募公債(5年)	100,000,000	100,394,000	
第52回大阪府公募公債(5年)	400,000,000	406,088,000	
第261回大阪府公募公債(10年)	105,000,000	107,249,100	
第262回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,074,000	
第267回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,972,000	
第277回大阪府公募公債(10年)	600,000,000	620,148,000	
第299回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	214,298,000	
第303回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	107,615,000	
第306回大阪府公募公債(10年)	200,000,000	214,528,000	
第313回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	106,580,000	
平成14年度第2回京都府公募公債	300,000,000	301,698,000	
平成19年度第1回京都府公募公債	130,260,000	140,101,143	
平成14年度第5回兵庫県公募公債	100,000,000	100,512,000	
平成15年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	101,130,000	
平成16年度第12回兵庫県公募公債	100,000,000	103,141,000	
平成17年度第2回兵庫県公募公債	200,000,000	206,778,000	
平成17年度第6回兵庫県公募公債	101,000,000	104,321,890	
平成19年度第8回兵庫県公募公債(5年)	100,000,000	100,471,000	
平成20年度第5回兵庫県公募公債	100,000,000	108,320,000	
平成21年度第3回兵庫県公募公債	200,000,000	213,104,000	
平成21年度第11回兵庫県公募公債	200,000,000	213,716,000	
平成21年度第23回兵庫県公募公債	200,000,000	209,264,000	
平成18年度第2回静岡県公募公債	100,000,000	107,116,000	
平成18年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	106,865,000	
平成19年度第7回静岡県公募公債	100,000,000	107,670,000	
平成20年度第1回静岡県公募公債	200,000,000	218,754,000	
平成20年度第7回静岡県公募公債	100,000,000	107,482,000	
平成21年度第5回静岡県公募公債	300,000,000	314,814,000	
平成14年度第2回愛知県公募公債(10年)	110,000,000	110,642,400	
平成17年度第2回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	103,331,000	
平成18年度第4回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	106,630,000	
平成19年度第3回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	107,882,000	
平成20年度第5回愛知県公募公債(5年)	500,000,000	507,255,000	
平成21年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	106,900,000	
平成21年度第7回愛知県公募公債(10年)	200,000,000	212,742,000	
平成19年度第3回広島県公募公債	200,000,000	213,368,000	
平成20年度第1回広島県公募公債	100,000,000	107,834,000	
平成15年度第3回埼玉県公募公債	205,670,000	209,954,106	

平成16年度第3回埼玉県公募公債	100,000,000	104,051,000	
平成16年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	103,319,000	
平成17年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	104,855,000	
平成18年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	107,268,000	
平成19年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	107,973,000	
平成21年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	106,342,000	
平成21年度第4回埼玉県公募公債	200,000,000	211,648,000	
平成18年度第1回福岡県公募公債	100,000,000	107,780,000	
平成19年度第2回福岡県公募公債	100,000,000	108,375,000	
平成20年度第9回福岡県公募公債	200,000,000	202,474,000	
平成16年度第9回千葉県公募公債	100,000,000	103,779,000	
平成18年度第1回千葉県公募公債	200,000,000	213,978,000	
平成18年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	106,638,000	
平成19年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	107,083,000	
平成21年度第2回千葉県公募公債	345,000,000	367,949,400	
平成14年度第1回新潟県公募公債	240,000,000	241,341,600	
平成17年度第1回新潟県公募公債	200,000,000	206,892,000	
平成19年度第1回岐阜県公募公債（10年）	200,000,000	215,748,000	
第1回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,551,000	
第2回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,482,000	
第4回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,196,000	
第6回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,142,000	
第7回共同発行市場公募地方債	319,400,000	325,411,108	
第12回共同発行市場公募地方債	437,000,000	447,435,560	
第15回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,122,000	
第20回共同発行市場公募地方債	300,000,000	310,158,000	
第21回共同発行市場公募地方債	300,000,000	309,627,000	
第22回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,606,000	
第23回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,110,000	
第27回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,415,000	
第29回共同発行市場公募地方債	300,000,000	311,673,000	
第30回共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,224,000	
第31回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,397,000	
第32回共同発行市場公募地方債	300,000,000	314,565,000	
第33回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,950,000	
第35回共同発行市場公募地方債	400,000,000	420,540,000	
第36回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,194,000	
第38回共同発行市場公募地方債	200,000,000	213,978,000	
第40回共同発行市場公募地方債	300,000,000	322,944,000	
第46回共同発行市場公募地方債	200,000,000	213,800,000	
第55回共同発行市場公募地方債	200,000,000	215,642,000	
第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,162,000	
第57回共同発行市場公募地方債	300,000,000	320,454,000	
第62回共同発行市場公募地方債	200,000,000	215,032,000	
第64回共同発行市場公募地方債	300,000,000	323,484,000	
第65回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,874,000	

	第73回共同発行市場公募地方債	300,000,000	320,256,000	
	第75回共同発行市場公募地方債	900,000,000	964,260,000	
	第77回共同発行市場公募地方債	200,000,000	212,804,000	
	平成14年度第11回大阪市公募公債	100,000,000	100,525,000	
	平成18年度第2回大阪市公募公債	200,000,000	213,478,000	
	平成18年度第3回大阪市公募公債	100,000,000	107,294,000	
	平成18年度第6回大阪市公募公債	300,000,000	321,531,000	
	平成19年度第5回大阪市公募公債	100,000,000	107,922,000	
	平成19年度第10回大阪市公募公債	100,000,000	106,854,000	
	平成21年度第4回大阪市公募公債	300,000,000	319,077,000	
	第1回名古屋市公募公債(20年)	200,000,000	216,642,000	
	第3回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	107,732,000	
	第11回名古屋市公募公債(5年)	300,000,000	305,046,000	
	第12回ひ号名古屋市公募公債	100,000,000	103,474,000	
	第455回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	106,669,000	
	第1回京都市公募公債(30年)	100,000,000	110,250,000	
	第7回京都市公募公債(20年)	100,000,000	110,021,000	
	平成18年度第3回京都市公募公債	200,000,000	214,708,000	
	平成15年度第1回神戸市公募公債	100,000,000	100,453,000	
	平成19年度第10回神戸市公募公債	100,000,000	106,717,000	
	第4回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	108,023,000	
	第9回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	111,050,000	
	第14回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	109,762,000	
	平成17年度第4回横浜市公募公債	200,000,000	209,286,000	
	平成17年度第3回横浜市公募公債	100,000,000	104,645,000	
	平成18年度第4回横浜市公募公債	300,000,000	322,152,000	
	平成18年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	106,434,000	
	平成18年度第3回横浜市公募公債	200,000,000	214,266,000	
	平成20年度第6回横浜市公募公債	200,000,000	212,382,000	
	平成18年度第4回札幌市公募公債	200,000,000	212,998,000	
	第2回川崎市15年公募公債	100,000,000	106,668,000	
	第4回川崎市15年公募公債	100,000,000	110,241,000	
	第19回川崎市公募公債(5年)	100,000,000	101,461,000	
	平成15年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	102,225,000	
	平成19年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	106,520,000	
	平成18年度第4回福岡市公募公債	100,000,000	106,550,000	
	平成20年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	106,430,000	
	平成21年度第7回福岡市公募公債	200,000,000	201,956,000	
	平成19年度第1回広島市公募公債	100,000,000	107,029,000	
	平成21年度第1回千葉市公募公債	200,000,000	213,222,000	
	地方債証券 小計	29,514,930,000	31,018,015,635	
特殊債券	第27回韓国産業銀行円貨債券(2007)	100,000,000	100,446,000	
	第1回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	106,893,000	
	第2回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	211,156,000	
	第3回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	219,568,000	

第5回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	105,555,000	
第9回日本政策投資銀行債券	100,000,000	101,913,000	
第10回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,929,000	
第15回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	109,465,000	
第16回日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,024,000	
第20回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	109,179,000	
第20回日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,517,000	
第23回政府保証日本政策投資銀行債券	400,000,000	427,352,000	
第24回日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,516,000	
第27回日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,959,000	
第30回日本政策投資銀行債券	100,000,000	108,456,000	
第36回日本政策投資銀行債券	100,000,000	107,543,000	
第51回日本政策投資銀行債券	100,000,000	107,652,000	
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	150,710,400	
第2回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	216,278,000	
第4回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	302,283,000	
第5回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	158,000,000	166,214,420	
第7回道路債券	100,000,000	114,866,000	
第8回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,273,000	
第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,712,000	
第9回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,865,000	
第9回道路債券	100,000,000	114,131,000	
第12回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,103,000	
第13回道路債券	300,000,000	332,679,000	
第16回道路債券	200,000,000	201,370,000	
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	109,593,900	
第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,005,000	
第21回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,563,000	
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	303,909,000	
第23回道路債券	200,000,000	203,998,000	
第23回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	218,318,000	
第25回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	321,075,000	
第26回道路債券	300,000,000	307,230,000	
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	535,550,000	
第27回道路債券	100,000,000	111,630,000	
第29回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,529,000	
第30回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	213,412,000	
第30回道路債券	100,000,000	102,906,000	
第34回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,842,000	
第36回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	153,000,000	165,125,250	
第37回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	324,024,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,140,000	
第39回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,270,000	
第40回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	324,228,000	
第40回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,756,000	
第41回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	428,240,000	

第42回道路債券	200,000,000	217,728,000	
第44回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	212,704,000	
第45回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	213,392,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	217,172,000	
第48回日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	427,848,000	
第49回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,117,000	
第52回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	213,478,000	
第56回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	211,196,000	
第58回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	500,000,000	537,110,000	
第60回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,058,000	
第62回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,491,000	
第67回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	213,818,000	
第69回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,918,000	
第81回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	212,878,000	
第88回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,295,000	
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	318,717,000	
第313回政府保証道路債券	200,000,000	201,016,000	
第325回政府保証道路債券	100,000,000	102,132,000	
第327回政府保証道路債券	552,000,000	567,102,720	
第329回政府保証道路債券	300,000,000	309,492,000	
第330回政府保証道路債券	100,000,000	103,747,000	
第335回政府保証道路債券	100,000,000	103,275,000	
第336回政府保証道路債券	200,000,000	206,754,000	
第337回政府保証道路債券	100,000,000	103,175,000	
第338回政府保証道路債券	200,000,000	207,694,000	
第339回政府保証道路債券	100,000,000	103,627,000	
第340回政府保証道路債券	100,000,000	107,530,000	
第341回政府保証道路債券	100,000,000	103,417,000	
第346回政府保証道路債券	301,000,000	312,931,640	
第1回政府保証地方公営企業等金融機構債券	300,000,000	320,700,000	
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券	300,000,000	318,888,000	
第1回公営企業債券(5年)	500,000,000	503,210,000	
第2回地方公営企業等金融機構債券(20年)	100,000,000	108,154,000	
第3回公営企業債券(20年)	100,000,000	98,501,000	
第3回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,308,000	
第5回公営企業債券(20年)	100,000,000	109,263,000	
第6回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	104,895,000	
第6回公営企業債券	100,000,000	100,408,000	
第6回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,802,000	
第7回政府保証地方公営企業等金融機構債券	500,000,000	527,955,000	
第7回公営企業債券	400,000,000	406,316,000	
第10回公営企業債券	100,000,000	103,383,000	
第11回公営企業債券(20年)	100,000,000	108,434,000	
第11回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,223,000	
第12回公営企業債券	100,000,000	103,178,000	
第15回公営企業債券	100,000,000	103,362,000	

第16回公営企業債券(20年)	100,000,000	107,853,000	
第17回公営企業債券	100,000,000	104,407,000	
第17回公営企業債券(20年)	100,000,000	111,117,000	
第18回公営企業債券(20年)	100,000,000	113,433,000	
第20回公営企業債券	100,000,000	107,113,000	
第22回公営企業債券(20年)	100,000,000	109,534,000	
第24回公営企業債券	100,000,000	107,258,000	
第24回公営企業債券(20年)	200,000,000	217,326,000	
第30回公営企業債券	100,000,000	108,690,000	
第818回政府保証公営企業債券	102,000,000	102,423,300	
第821回政府保証公営企業債券	100,000,000	100,586,000	
第823回政府保証公営企業債券	200,000,000	201,050,000	
第824回政府保証公営企業債券	600,000,000	603,468,000	
第825回政府保証公営企業債券	500,000,000	503,130,000	
第826回政府保証公営企業債券	300,000,000	301,692,000	
第827回政府保証公営企業債券	200,000,000	201,006,000	
第829回政府保証公営企業債券	500,000,000	506,065,000	
第833回政府保証公営企業債券	200,000,000	204,346,000	
第834回政府保証公営企業債券	200,000,000	204,588,000	
第836回政府保証公営企業債券	300,000,000	306,444,000	
第838回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,725,000	
第840回政府保証公営企業債券	200,000,000	206,274,000	
第841回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,717,000	
第843回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,262,000	
第844回政府保証公営企業債券	400,000,000	414,424,000	
第846回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,268,000	
第847回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,374,000	
第849回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,822,000	
第851回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,389,000	
第852回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,476,000	
第858回政府保証公営企業債券	200,000,000	209,320,000	
第861回政府保証公営企業債券	300,000,000	315,804,000	
第863回政府保証公営企業債券	100,000,000	107,085,000	
第865回政府保証公営企業債券	300,000,000	321,807,000	
第866回政府保証公営企業債券	200,000,000	214,766,000	
第875回政府保証公営企業債券	200,000,000	213,656,000	
第883回政府保証公営企業債券	100,000,000	105,579,000	
第884回政府保証公営企業債券	300,000,000	316,770,000	
第885回政府保証公営企業債券	200,000,000	214,794,000	
第886回政府保証公営企業債券	200,000,000	216,112,000	
第3回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	101,383,000	
第187回政府保証首都高速道路債券	193,000,000	197,357,940	
第195回政府保証首都高速道路債券	400,000,000	413,368,000	
第197回政府保証首都高速道路債券	300,000,000	311,454,000	
第199回政府保証首都高速道路債券	200,000,000	207,872,000	
第4回阪神高速道路債券	200,000,000	201,272,000	

第23回中小企業債券	100,000,000	101,045,000	
第6回国際協力銀行債券	100,000,000	100,413,000	
第10回国際協力銀行債券	300,000,000	306,222,000	
第15回国際協力銀行債券	200,000,000	206,502,000	
第21回国際協力銀行債券	100,000,000	104,313,000	
第27回国際協力銀行債券	100,000,000	106,592,000	
第8回都市再生債券	200,000,000	207,586,000	
第19回都市再生債券	100,000,000	108,406,000	
第27回都市再生債券	300,000,000	303,948,000	
第3回本州四国連絡橋債券	100,000,000	103,750,000	
第7回本州四国連絡橋債券	100,000,000	109,148,000	
第332回東京交通債券	100,000,000	113,869,000	
第342回東京交通債券	100,000,000	112,167,000	
第13回関西国際空港株式会社社債	100,000,000	106,153,000	
第16回関西国際空港株式会社社債	100,000,000	107,005,000	
第38回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	100,306,000	
第51回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	110,295,000	
第14回独立行政法人福祉医療機構債券	200,000,000	215,558,000	
第17回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	108,517,000	
第143回政府保証預金保険機構債券	100,000,000	100,256,000	
第153回政府保証預金保険機構債券	100,000,000	100,643,000	
第1回貸付債権担保住宅金融公庫債券	44,708,000	46,596,018	
第1回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	68,072,000	69,931,727	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	90,412,000	95,372,906	
第2回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	70,416,000	72,642,553	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	140,535,000	149,012,071	
第3回貸付債権担保住宅金融公庫債券	24,397,000	25,529,020	
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	35,205,000	36,703,324	
第4回貸付債権担保住宅金融公庫債券	25,389,000	26,437,565	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	62,169,000	66,152,789	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	156,894,000	164,213,105	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	36,966,000	38,386,973	
第6回貸付債権担保住宅金融公庫債券	58,906,000	61,509,645	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	38,975,000	41,452,251	
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	118,875,000	126,384,333	
第7回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	54,675,000	57,118,425	
第8回貸付債権担保住宅金融公庫債券	32,193,000	33,294,322	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	121,086,000	128,061,764	
第8回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,652,000	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	80,486,000	85,273,307	
第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	59,115,000	62,448,494	
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券	33,870,000	34,609,382	
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	124,761,000	131,918,538	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	64,180,000	67,315,193	
第11回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	64,620,000	67,931,128	
第12回貸付債権担保住宅金融公庫債券	39,872,000	41,143,518	

第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	64,725,000	67,579,372
第14回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	215,302,000
第16回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	133,986,000	139,378,936
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	138,406,000	144,635,654
第19回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	74,207,000	78,309,905
第21回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,249,000
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	151,096,000	161,264,760
第25回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	213,414,000
第26回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	222,783,000	234,777,636
第27回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	75,501,000	79,175,633
第28回貸付債権担保住宅金融公庫債券	52,460,000	54,269,345
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,068,000	83,638,232
第29回貸付債権担保住宅金融公庫債券	56,513,000	58,556,510
第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	80,499,000	83,933,087
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	81,939,000	85,565,620
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券	59,910,000	61,646,191
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	61,578,000	63,378,540
第32回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	167,924,000	173,927,283
第33回貸付債権担保住宅金融公庫債券	60,985,000	62,715,144
第34回貸付債権担保住宅金融公庫債券	126,630,000	131,192,478
第35回貸付債権担保住宅金融公庫債券	62,265,000	64,368,311
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,277,000	91,797,486
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	59,836,000	62,195,333
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,274,000	92,506,611
第38回貸付債権担保住宅金融公庫債券	119,436,000	124,347,208
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	59,733,000	61,926,993
第40回貸付債権担保住宅金融公庫債券	119,958,000	124,936,257
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	61,282,000	64,452,730
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	118,194,000	126,121,271
第43回貸付債権担保住宅金融公庫債券	116,656,000	124,000,661
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,997,000	95,963,417
第44回貸付債権担保住宅金融公庫債券	56,529,000	60,121,417
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	188,892,000	195,590,110
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	94,788,000	98,554,875
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	190,986,000	199,309,169
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,266,000	99,420,636
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	59,717,000	63,168,045
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	291,396,000	298,342,880
第52回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,393,000
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	60,794,000	63,847,682
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	197,196,000	197,992,671
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,259,000	99,871,428
第58回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,763,000	100,130,127
第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	201,560,000
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	123,500,000	130,277,680
第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	124,810,000	132,053,972

第3回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	47,417,000	49,855,656
第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	61,649,000	64,999,623
第5回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	106,892,000	111,471,253
第15回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	130,516,000	136,159,511
第36回国民生活債券	100,000,000	100,836,000
第6回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	102,772,000
第10回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	107,805,000
第3回新東京国際空港債券	100,000,000	100,562,000
第4回政府保証新東京国際空港債券	100,000,000	101,219,000
第5回新東京国際空港債券	100,000,000	102,408,000
第3回沖縄振興開発金融公庫債券	200,000,000	205,236,000
第5回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	103,143,000
い第703号商工債	200,000,000	204,162,000
い第711号商工債	100,000,000	101,780,000
い第712号商工債	100,000,000	101,463,000
い第722号商工債	100,000,000	100,667,000
い第723号商工債	100,000,000	100,667,000
い第725号商工債	200,000,000	200,294,000
い第727号商工債	200,000,000	202,450,000
い第687号農林債	100,000,000	100,526,000
い第690号農林債	400,000,000	402,732,000
い第695号農林債	200,000,000	201,952,000
い第696号農林債	500,000,000	506,395,000
い第697号農林債	200,000,000	202,990,000
い第698号農林債	100,000,000	101,600,000
い第704号農林債	200,000,000	203,706,000
い第707号農林債	100,000,000	102,193,000
い第708号農林債	300,000,000	305,598,000
い第712号農林債	300,000,000	304,533,000
い第713号農林債	100,000,000	101,298,000
い第714号農林債	400,000,000	406,352,000
い第723号農林債	200,000,000	201,466,000
第597回あおぞら債	100,000,000	100,448,000
第240回信金中金債(5年)	200,000,000	203,282,000
第243回信金中金債(5年)	100,000,000	101,198,000
第215回信金中金債(5年)	200,000,000	201,404,000
第216回信金中金債(5年)	200,000,000	201,390,000
第218回信金中金債(5年)	300,000,000	302,367,000
第221回信金中金債(5年)	100,000,000	100,997,000
第225回信金中金債(5年)	500,000,000	507,285,000
第227回信金中金債(5年)	100,000,000	101,772,000
第228回信金中金債(5年)	400,000,000	407,860,000
第229回信金中金債(5年)	300,000,000	305,934,000
第230回信金中金債(5年)	100,000,000	101,800,000
第231回信金中金債(5年)	100,000,000	102,073,000
第233回信金中金債(5年)	500,000,000	511,175,000

	第236回信金中金債(5年)	200,000,000	202,948,000	
	第1回政府保証東日本高速道路債券	137,000,000	143,729,440	
	第3回政府保証東日本高速道路債券	100,000,000	107,045,000	
	第1回政府保証中日本高速道路債券	250,000,000	262,280,000	
	第1回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	102,482,000	
	第3回政府保証中日本高速道路債券	163,000,000	171,430,360	
	第5回中日本高速道路株式会社社債	200,000,000	215,486,000	
	第6回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	106,955,000	
	第10回政府保証中日本高速道路債券	100,000,000	106,781,000	
	第12回政府保証中日本高速道路債券	103,000,000	110,177,040	
	第14回政府保証中日本高速道路債券	100,000,000	107,881,000	
	第19回政府保証中日本高速道路債券	124,000,000	131,519,360	
	第21回政府保証中日本高速道路債券	200,000,000	214,786,000	
	第25回政府保証中日本高速道路債券	200,000,000	212,518,000	
	第8回政府保証西日本高速道路債券	233,000,000	248,820,700	
	第15回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	108,009,000	
	第19回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	105,557,000	
	第5回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	206,906,000	
	第1回緑資源債券	100,000,000	100,399,000	
	第3回東京地下鉄株式会社社債	200,000,000	213,220,000	
	特殊債券 小計	47,570,265,000	49,633,555,160	
社債券	第9回株式会社ポスコ円貨社債(2006)	200,000,000	202,284,000	
	第7回ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポレーション	200,000,000	200,394,000	
	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	100,078,000	
	第18回ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポレーション	100,000,000	101,722,000	
	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	101,366,000	
	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	101,733,000	
	第3回ジェイ・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニー	300,000,000	306,639,000	
	第9回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク	100,000,000	100,741,000	
	第11回シティグループ・インク円貨社債(2003)	200,000,000	199,670,000	
	第17回シティグループ・インク円貨債券	100,000,000	97,402,000	
	第22回シティグループ・インク円貨債券	300,000,000	306,648,000	
	第3回バンク・オブ・アメリカ・コーポレーション	100,000,000	99,429,000	
	第5回バンク・オブ・アメリカ・コーポレーション	100,000,000	99,922,000	
	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	298,863,000	
	第5回オーストラリア・コモンウェルス銀行円貨社債(2011)	300,000,000	299,796,000	
	第8回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	300,000,000	301,482,000	
	第10回コーペラティブ・セントラル・ライフアイゼン・ボエレンリーバンク・ピー・エー	300,000,000	296,763,000	
	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	100,878,000	
	H S B C 銀行 P L C 第1回円貨社債	200,000,000	202,334,000	
	H S B C 銀行 P L C 第2回円貨社債	200,000,000	199,160,000	
	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	212,114,000	
	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	101,893,000	
	第19回味の素株式会社無担保社債	100,000,000	102,643,000	

第4回日本たばこ産業株式会社社債	200,000,000	200,806,000	
第38回住友化学株式会社無担保社債	100,000,000	106,298,000	
第33回三菱化学株式会社無担保社債	200,000,000	212,046,000	
第35回三菱化学株式会社無担保社債	100,000,000	107,005,000	
第35回三井化学株式会社無担保社債	100,000,000	107,046,000	
第26回新日本石油株式会社無担保社債	200,000,000	214,692,000	
第16回住友ゴム工業株式会社無担保社債	100,000,000	108,239,000	
第12回旭硝子株式会社無担保社債	200,000,000	216,480,000	
第30回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	114,120,000	
第55回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	106,142,000	
第62回住友金属工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,888,000	
第46回株式会社神戸製鋼所無担保社債	100,000,000	107,221,000	
第15回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	104,514,000	
第18回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	109,390,000	
第7回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	101,993,000	
第45回株式会社東芝無担保社債	200,000,000	212,550,000	
第50回株式会社東芝無担保社債	100,000,000	100,925,000	
第45回日本電気株式会社無担保社債	100,000,000	100,082,000	
第7回パナソニック株式会社無担保社債	200,000,000	204,252,000	
第8回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	107,500,000	
第10回パナソニック株式会社無担保社債	300,000,000	302,538,000	
第11回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	101,700,000	
第24回シャープ株式会社無担保社債	200,000,000	200,970,000	
第26回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	107,232,000	
第20回三洋電機株式会社無担保社債	200,000,000	207,566,000	
第22回三菱重工工業株式会社無担保社債	200,000,000	215,852,000	
第1回日本生命2011基金特定目的会社特定社債 第1回 - B	200,000,000	201,194,000	
第1回住友生命第4回基金流動化特定目的会社特定社債	100,000,000	100,198,000	
第9回トヨタ自動車株式会社無担保社債	300,000,000	305,334,000	
第5回アイシン精機株式会社無担保社債	100,000,000	102,941,000	
第43回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	107,539,000	
第56回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,662,000	
第70回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	102,692,000	
第61回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	106,294,000	
第63回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	108,739,000	
第30回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	105,041,000	
第33回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	106,451,000	
第67回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	106,411,000	
第69回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	108,148,000	
第32回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	100,043,000	
第38回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	100,423,000	
第2回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	103,502,000	
第3回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	106,935,000	
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	200,804,000	
第7回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	200,000,000	217,304,000	
第8回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	109,694,000	

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	203,794,000	
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	407,836,000	
株式会社東京三菱銀行第8回無担保社債	100,000,000	103,455,000	
第9回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	114,170,000	
第11回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	200,000,000	214,076,000	
株式会社三菱東京UFJ銀行第12回無担保社債	200,000,000	214,298,000	
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	300,000,000	301,395,000	
第56回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	100,614,000	
第72回株式会社東京三菱銀行無担保社債	100,000,000	101,941,000	
第90回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	100,412,000	
第92回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	400,000,000	402,672,000	
第95回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	100,750,000	
第100回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	200,000,000	202,844,000	
第104回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	102,188,000	
第105回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	100,113,000	
第110回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	105,185,000	
第4回株式会社りそな銀行無担保社債	200,000,000	219,118,000	
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	101,835,000	
第11回株式会社静岡銀行無担保社債	100,000,000	103,151,000	
第9回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債	200,000,000	205,580,000	
第7回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	105,162,000	
第8回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	104,082,000	
第11回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	101,634,000	
中央三井信託銀行第3回無担保社債	100,000,000	103,764,000	
第5回株式会社三井住友銀行無担保社債	300,000,000	301,263,000	
第7回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	102,823,000	
第8回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	103,635,000	
第9回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	103,813,000	
第20回株式会社三井住友銀行無担保社債	300,000,000	324,180,000	
第24回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	102,041,000	
第42回株式会社三井住友銀行無担保社債	200,000,000	201,386,000	
第43回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	101,000,000	
第45回株式会社三井住友銀行無担保社債	200,000,000	203,464,000	
第8回株式会社みずほ銀行無担保社債	200,000,000	210,388,000	
第9回株式会社みずほ銀行無担保社債	100,000,000	104,002,000	
第10回株式会社みずほ銀行無担保社債	100,000,000	105,764,000	
第15回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	100,000,000	100,212,000	
第16回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	200,000,000	201,576,000	
第17回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	107,997,000	
第21回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	106,930,000	
第41回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,841,000	
第113回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	104,549,000	
第115回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	100,166,000	
第118回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	103,243,000	
第6回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	100,157,000	
第6回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	100,345,000	

第7回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,355,000	
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	500,980,000	
第15回野村ホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	308,139,000	
第21回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	204,090,000	
第58回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	114,588,000	
第65回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	100,117,000	
第87回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	106,841,000	
第63回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	109,112,000	
第28回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	103,469,000	
第41回小田急電鉄株式会社無担保社債	200,000,000	215,428,000	
第42回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	106,892,000	
第2回東日本旅客鉄道株式会社社債	200,000,000	226,252,000	
第7回東日本旅客鉄道株式会社社債	200,000,000	229,750,000	
第9回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	114,588,000	
第15回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	114,146,000	
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	200,000,000	223,532,000	
第34回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	113,297,000	
第52回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	106,202,000	
第3回西日本旅客鉄道株式会社社債	200,000,000	228,066,000	
第5回西日本旅客鉄道株式会社社債	200,000,000	228,090,000	
第3回東海旅客鉄道株式会社普通社債	100,000,000	112,641,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	110,276,000	
第11回東海旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	99,670,000	
第21回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	105,191,000	
第28回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	106,736,000	
第41回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	106,017,000	
第42回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	216,026,000	
第40回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,510,000	
第48回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	103,242,000	
第51回日本電信電話株式会社電信電話債券	300,000,000	320,931,000	
第53回日本電信電話株式会社電信電話債券	300,000,000	317,166,000	
第15回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	108,241,000	
第15回株式会社エヌ・ティ・ティ・ドコモ無担保社債	200,000,000	216,660,000	
第425回東京電力株式会社社債	100,000,000	96,792,000	
第514回東京電力株式会社社債	100,000,000	88,513,000	
第515回東京電力株式会社社債	200,000,000	173,946,000	
第516回東京電力株式会社社債	100,000,000	86,047,000	
第522回東京電力株式会社社債	300,000,000	251,418,000	
第524回東京電力株式会社社債	100,000,000	80,868,000	
第526回東京電力株式会社社債	300,000,000	240,063,000	
第527回東京電力株式会社社債	100,000,000	90,174,000	
第528回東京電力株式会社社債	100,000,000	74,196,000	
第532回東京電力株式会社社債	200,000,000	158,896,000	
第533回東京電力株式会社社債	200,000,000	176,960,000	
第535回東京電力株式会社社債	200,000,000	157,852,000	
第537回東京電力株式会社社債	100,000,000	72,631,000	

第544回東京電力株式会社社債	200,000,000	155,816,000	
第545回東京電力株式会社社債	100,000,000	76,970,000	
第547回東京電力株式会社社債	200,000,000	144,170,000	
第552回東京電力株式会社社債	100,000,000	91,957,000	
第406回中部電力株式会社社債	200,000,000	219,676,000	
第408回中部電力株式会社社債	100,000,000	111,043,000	
第409回中部電力株式会社社債	200,000,000	226,164,000	
第469回中部電力株式会社社債	100,000,000	102,425,000	
第471回中部電力株式会社社債	300,000,000	306,543,000	
第474回中部電力株式会社社債	100,000,000	103,862,000	
第475回中部電力株式会社社債	200,000,000	210,582,000	
第486回中部電力株式会社社債	200,000,000	209,020,000	
第433回関西電力株式会社社債	100,000,000	101,843,000	
第440回関西電力株式会社社債	100,000,000	103,398,000	
第449回関西電力株式会社社債	100,000,000	105,906,000	
第451回関西電力株式会社社債	100,000,000	104,679,000	
第453回関西電力株式会社社債	100,000,000	104,794,000	
第465回関西電力株式会社社債	200,000,000	205,254,000	
第467回関西電力株式会社社債	100,000,000	104,084,000	
第472回関西電力株式会社社債	100,000,000	104,801,000	
第306回中国電力株式会社社債	200,000,000	225,438,000	
第310回中国電力株式会社社債	100,000,000	112,462,000	
第349回中国電力株式会社社債	200,000,000	210,964,000	
第279回北陸電力株式会社社債	30,000,000	30,981,000	
第286回北陸電力株式会社社債	100,000,000	106,399,000	
第368回東北電力株式会社社債	450,000,000	487,809,000	
第372回東北電力株式会社社債	200,000,000	223,520,000	
第376回東北電力株式会社社債	100,000,000	110,544,000	
第408回東北電力株式会社社債	100,000,000	100,107,000	
第431回東北電力株式会社社債	100,000,000	106,008,000	
第445回東北電力株式会社社債	100,000,000	104,426,000	
第229回四国電力株式会社社債	100,000,000	112,939,000	
第245回四国電力株式会社社債	100,000,000	105,320,000	
第253回四国電力株式会社社債	100,000,000	93,906,000	
第268回四国電力株式会社社債	100,000,000	104,120,000	
第346回九州電力株式会社社債	100,000,000	106,427,000	
第380回九州電力株式会社社債	100,000,000	102,867,000	
第384回九州電力株式会社社債	100,000,000	103,421,000	
第394回九州電力株式会社社債	100,000,000	105,482,000	
第400回九州電力株式会社社債	100,000,000	104,610,000	
第405回九州電力株式会社社債	100,000,000	105,074,000	
第408回九州電力株式会社社債	100,000,000	104,199,000	
第258回北海道電力株式会社社債	200,000,000	226,572,000	
第300回北海道電力株式会社社債	100,000,000	104,466,000	
第11回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,794,000	
第14回電源開発株式会社無担保社債	200,000,000	205,990,000	

	第19回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	105,248,000	
	第21回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	104,033,000	
	第23回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	104,791,000	
	第17回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	224,662,000	
	第25回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	102,815,000	
	第18回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	205,704,000	
	第22回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	106,371,000	
	第27回東邦瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	99,038,000	
	第30回東邦瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	106,930,000	
	社債券 小計	31,780,000,000	32,608,215,000	
	合計		496,278,500,555	

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

イ 資本金の額および株式数

	平成24年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、

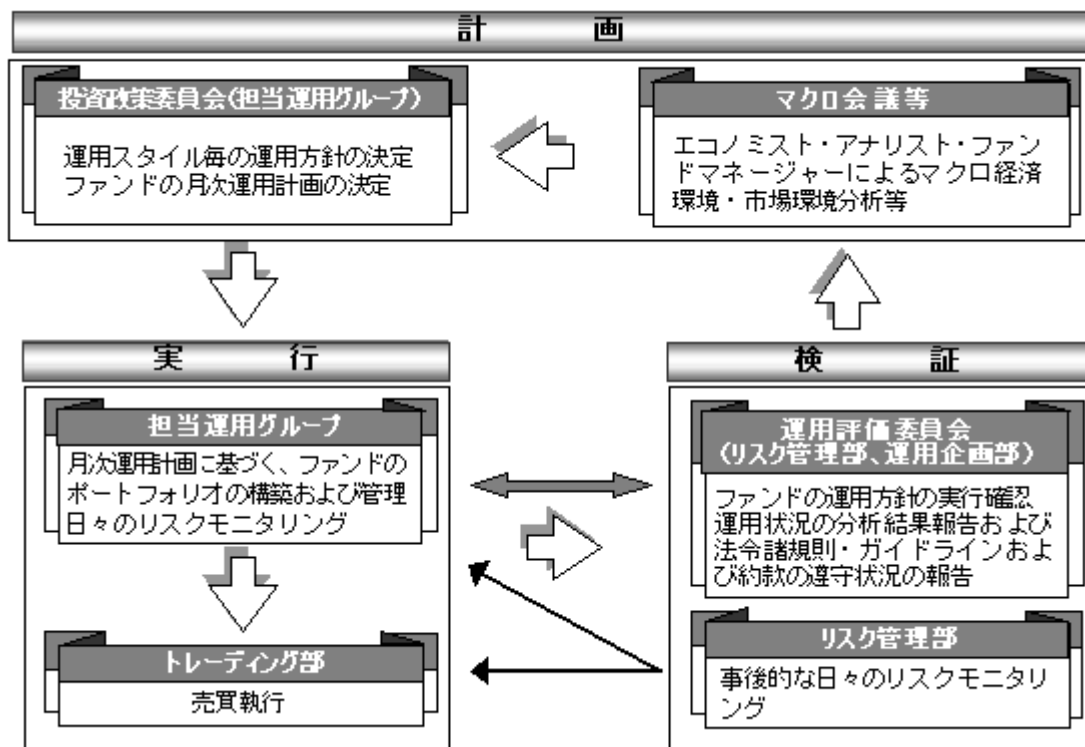
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役を若干名を選定します。

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

ニ 投資信託の運用の流れ



2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成24年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24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	36 (2)	41,133 (5,287)
	追加型	311 (135)	4,452,836 (2,943,374)
	計	347 (137)	4,493,969 (2,948,661)
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		347 (137)	4,493,969 (2,948,661)

()内は、私募投資信託分であり、内書き表記しております。

3【委託会社等の経理状況】

- 1 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
- 2 当社は、第27期（平成23年4月1日から平成24年3月31日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

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

	第 26 期 (平成23年 3月31日)	第 27 期 (平成24年 3月31日)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	47,190	47,840
未払金		
未払収益分配金	681	403
未払償還金	21,638	106,771
未払手数料	2 1,971,626	1,893,658
その他未払金	64,551	86,141
未払費用	824,240	930,998
未払消費税等	126,666	35,683
未払法人税等	1,004,164	264,114
賞与引当金	327,914	279,981
その他の流動負債	-	10
流動負債計	4,388,674	3,645,603
固定負債		
退職給付引当金	1,310,821	1,489,315
固定負債計	1,310,821	1,489,315
負債合計	5,699,496	5,134,919
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	8,628,984	8,628,984
資本剰余金合計	8,628,984	8,628,984
利益剰余金		
利益準備金	284,245	284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金	60,000	60,000
別途積立金	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金	15,381,398	15,791,435
利益剰余金合計	17,202,602	17,612,639
株主資本計	27,831,586	28,241,623
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	110,498	76,327
評価・換算差額等計	110,498	76,327
純資産合計	27,942,085	28,317,951
負債・純資産合計	33,641,581	33,452,870

（２）【損益計算書】

（単位：千円）

	第 26 期 （自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日）	第 27 期 （自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日）
営業収益		
委託者報酬	27,350,519	25,467,198
運用受託報酬	2,113,027	2,001,039
投資助言報酬	1,828,087	1,743,437
その他営業収益		
情報提供コンサルタント業務報酬	5,000	5,000
投資法人運用受託報酬	35,635	31,647
サービス支援手数料	234,885	99,134
その他	26,930	48,776
営業収益計	31,594,086	29,396,234
営業費用		
支払手数料	14,161,927	13,259,090
広告宣伝費	482,728	475,028
公告費	4,634	4,092
調査費		
調査費	537,254	503,839
委託調査費	2,115,042	2,285,064
営業雑経費		
通信費	34,433	35,155
印刷費	266,803	199,733
協会費	23,235	28,233
諸会費	11,346	12,025
情報機器関連費	2,066,205	1,855,475
販売促進費	27,670	28,021
その他	79,571	123,714
営業費用計	19,810,852	18,809,475
一般管理費		
給料		
役員報酬	155,867	154,738
給料・手当	4,342,937	4,427,312
賞与	983,434	937,970
賞与引当金繰入額	327,914	279,981
交際費	21,460	20,938
寄付金	31	10,026
事務委託費	220,738	245,311
旅費交通費	219,278	230,691
租税公課	87,674	80,136
不動産賃借料	677,468	683,098
退職給付費用	199,545	205,957
固定資産減価償却費	100,356	170,410
諸経費	250,817	268,760
一般管理費計	7,587,526	7,715,334

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

（ 3 ） 【 株主資本等変動計算書 】

（ 単位：千円 ）

	第 26 期 （ 自 平成22年 4 月 1 日 至 平成23年 3 月31日 ）	第 27 期 （ 自 平成23年 4 月 1 日 至 平成24年 3 月31日 ）
株主資本		
資本金		
当期首残高	2,000,000	2,000,000
当期末残高	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金		
当期首残高	8,628,984	8,628,984
当期末残高	8,628,984	8,628,984
資本剰余金合計		
当期首残高	8,628,984	8,628,984
当期末残高	8,628,984	8,628,984
利益剰余金		
利益準備金		
当期首残高	284,245	284,245
当期末残高	284,245	284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金		
当期首残高	60,000	60,000
当期末残高	60,000	60,000
別途積立金		
当期首残高	1,476,959	1,476,959
当期末残高	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金		
当期首残高	14,172,932	15,381,398
当期変動額		
剰余金の配当	1,323,000	1,252,440
当期純利益	2,531,465	1,662,477
当期変動額合計	1,208,465	410,037
当期末残高	15,381,398	15,791,435
利益剰余金合計		
当期首残高	15,994,137	17,202,602
当期変動額		
剰余金の配当	1,323,000	1,252,440
当期純利益	2,531,465	1,662,477
当期変動額合計	1,208,465	410,037
当期末残高	17,202,602	17,612,639
株主資本合計		
当期首残高	26,623,121	27,831,586
当期変動額		
剰余金の配当	1,323,000	1,252,440
当期純利益	2,531,465	1,662,477

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

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 満期保有目的の債券

償却原価法

(2) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

(3) その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

時価のないもの

移動平均法による原価法

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 3～50年

器具備品 3～20年

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

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

過去勤務債務については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

追加情報

当事業年度の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

注 記 事 項

(貸借対照表関係)

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

(損益計算書関係)

第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
<p>1 関係会社との取引に係るもの</p> <p>受取利息 3,867千円</p>	<p>1 関係会社との取引に係るもの</p> <p>受取利息 2,455千円</p>
<p>2 固定資産除却損は、建物9,847千円、器具備品7,471千円であります。</p>	<p>2 固定資産除却損は、器具備品12,873千円であります。</p>

(株主資本等変動計算書関係)

第26期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

1. 発行済株式数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額等

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

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

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

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

第27期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

1. 発行済株式数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額等

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

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

平成24年6月25日開催の第27回定時株主総会において次の通り付議いたします。

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

(リース取引関係)

第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
1.オペレーティング・リース取引 (借主側) 未経過リース料(解約不能のもの)(単位:千円) 1年以内 672,700 1年超 958,593 合計 1,631,293	1.オペレーティング・リース取引 (借主側) 未経過リース料(解約不能のもの)(単位:千円) 1年以内 672,641 1年超 286,301 合計 958,942

(金融商品関係)

1.金融商品の状況に関する事項

(1)金融商品に対する取組方針

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

(2)金融商品の内容及びそのリスク

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

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

営業債務である未払手数料は、すべて1年以内の支払期日であります。

(3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスクの管理

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

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

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

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

市場リスクの管理

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

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

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

第26期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

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

(単位：千円)

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

(注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資 産

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

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

(5)有価証券及び投資有価証券

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

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

(6)長期差入保証金

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

負債

(1)未払金

未払手数料

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

(注2)時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

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

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

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

(注3)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：千円)

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

第27期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

平成24年3月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれていません（（注2）参照）。

(単位：千円)

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

(注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資産

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

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

(5)有価証券及び投資有価証券

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

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

(6)長期差入保証金

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

負債

(1)未払金

未払手数料

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

(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。

(注3)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：千円)

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	15,970,870	-	-	-
未収委託者報酬	3,392,765	-	-	-
未収運用受託報酬	305,910	-	-	-
未収投資助言報酬	452,618	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
満期保有目的の債券	4,000,000	-	-	-
その他有価証券のうち				
満期があるもの	-	-	-	-
長期差入保証金	13,877	667,318	-	-
合計	24,136,043	667,318	-	-

(有価証券関係)

第26期(平成23年3月31日)

1. 満期保有目的の債券

(単位：千円)

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

2. 子会社株式及び関連会社株式

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

3. その他有価証券

(単位：千円)

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

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

4. 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：千円)

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

第27期(平成24年3月31日)

1. 満期保有目的の債券

(単位：千円)

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)貸借対照表日の時価が貸借対照表計上額を超えるもの	-	-	-
小計	-	-	-
(2)貸借対照表日の時価が貸借対照表計上額を超えないもの	3,999,305	3,999,200	105
小計	3,999,305	3,999,200	105
合計	3,999,305	3,999,200	105

2. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（貸借対照表計上額 関係会社株式234,921千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

3. その他有価証券

(単位：千円)

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

(注) 非上場株式等（貸借対照表計上額 48,741千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。また、上記「貸借対照表計上額」は、減損処理後の帳簿価額です。当事業年度における減損処理額は、301千円です。

4. 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
1,012,727	13,806	6,578

(デリバティブ取引関係)

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

(退職給付関係)

第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)																				
<p>1. 採用している退職給付制度の概要 当社は、確定給付型の制度として、退職一時金制度を設けております。</p>	<p>1. 採用している退職給付制度の概要 当社は、確定給付型の制度として、退職一時金制度を設けております。</p>																				
<p>2. 退職給付債務の額 (単位：千円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">退職給付債務</td> <td style="text-align: right;">1,310,821</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">1,310,821</td> </tr> </table>	退職給付債務	1,310,821	退職給付引当金	1,310,821	<p>2. 退職給付債務の額 (単位：千円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">退職給付債務</td> <td style="text-align: right;">1,489,315</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">1,489,315</td> </tr> </table>	退職給付債務	1,489,315	退職給付引当金	1,489,315												
退職給付債務	1,310,821																				
退職給付引当金	1,310,821																				
退職給付債務	1,489,315																				
退職給付引当金	1,489,315																				
<p>3. 退職給付費用の額 (単位：千円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">勤務費用</td> <td style="text-align: right;">160,751</td> </tr> <tr> <td>利息費用</td> <td style="text-align: right;">17,066</td> </tr> <tr> <td>数理計算上の差異の費用処理額</td> <td style="text-align: right;">6,439</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">15,287</td> </tr> <tr> <td>退職給付費用</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">199,545</td> </tr> </table> <p>(注)その他は、その他の関係会社からの出向者の年金掛金負担分と退職給付引当額相当額負担分になります。</p>	勤務費用	160,751	利息費用	17,066	数理計算上の差異の費用処理額	6,439	その他	15,287	退職給付費用	199,545	<p>3. 退職給付費用の額 (単位：千円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">勤務費用</td> <td style="text-align: right;">167,222</td> </tr> <tr> <td>利息費用</td> <td style="text-align: right;">19,662</td> </tr> <tr> <td>数理計算上の差異の費用処理額</td> <td style="text-align: right;">5,053</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">14,018</td> </tr> <tr> <td>退職給付費用</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">205,957</td> </tr> </table> <p>(注)その他は、その他の関係会社からの出向者の年金掛金負担分と退職給付引当額相当額負担分になります。</p>	勤務費用	167,222	利息費用	19,662	数理計算上の差異の費用処理額	5,053	その他	14,018	退職給付費用	205,957
勤務費用	160,751																				
利息費用	17,066																				
数理計算上の差異の費用処理額	6,439																				
その他	15,287																				
退職給付費用	199,545																				
勤務費用	167,222																				
利息費用	19,662																				
数理計算上の差異の費用処理額	5,053																				
その他	14,018																				
退職給付費用	205,957																				
<p>4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項</p> <p>退職給付見込額の期間配分方法 勤務期間を基準とする方法</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">割引率</td> <td style="text-align: right;">1.5%</td> </tr> </table> <p>過去勤務債務の額の処理年数 1年（発生時において費用処理する方法）</p> <p>数理計算上の差異の処理年数 1年（発生時において費用処理する方法）</p>	割引率	1.5%	<p>4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項</p> <p>退職給付見込額の期間配分方法 勤務期間を基準とする方法</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">割引率</td> <td style="text-align: right;">1.5%</td> </tr> </table> <p>過去勤務債務の額の処理年数 1年（発生時において費用処理する方法）</p> <p>数理計算上の差異の処理年数 1年（発生時において費用処理する方法）</p>	割引率	1.5%																
割引率	1.5%																				
割引率	1.5%																				

(税効果会計関係)

第26期 (平成23年3月31日)	第27期 (平成24年3月31日)
1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳
(単位：千円)	(単位：千円)
(1) 流動の部	(1) 流動の部
繰延税金資産	繰延税金資産
賞与引当金	賞与引当金
133,428	106,421
未払社会保険料	未払社会保険料
14,807	12,691
未払事業税	未払事業税
83,126	27,381
未払事業所税	未払事業所税
6,378	5,808
その他	その他
4,235	3,644
繰延税金資産計	繰延税金資産計
241,975	155,946
評価性引当額	評価性引当額
-	-
繰延税金資産合計	繰延税金資産合計
241,975	155,946
繰延税金資産の純額	繰延税金資産の純額
241,975	155,946
(2) 固定の部	(2) 固定の部
繰延税金資産	繰延税金資産
退職給付引当金	退職給付引当金
533,373	530,792
ソフトウェア償却	ソフトウェア償却
141,119	95,129
投資有価証券評価損	投資有価証券評価損
71,023	61,204
特定外国子会社留保金額	特定外国子会社留保金額
247,489	222,604
その他	その他
4,925	7,328
繰延税金資産計	繰延税金資産計
997,931	917,059
評価性引当額	評価性引当額
321,097	290,326
繰延税金資産合計	繰延税金資産合計
676,833	626,732
繰延税金負債	繰延税金負債
その他有価証券評価差額金	その他有価証券評価差額金
70,383	37,399
繰延税金負債合計	繰延税金負債合計
70,383	37,399
繰延税金資産の純額	繰延税金資産の純額
606,449	589,332
2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳	2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳
	(%)
法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、記載を省略しております。	法定実効税率
	40.6
	(調整)
	評価性引当額の増減
	1.0
	交際費等永久に損金に算入されない項目
	0.3
	住民税均等割等
	0.2
	外国税額控除
	0.5
	税率変更による期末繰延税金資産の減額修正
	4.5
	その他
	0.2
	税効果会計適用後の法人税等の負担率
	44.4

3. 法定実効税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の修正

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

平成24年4月1日から平成27年3月31日 38.0%

平成27年4月1日以降 35.6%

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

(資産除去債務関係)

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

第26期（自 平成22年 4月 1日 至 平成23年 3月31日）

1.セグメント情報

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

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

2.関連情報

(1)製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

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

(2)地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

第27期(自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)

1.セグメント情報

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

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

2.関連情報

(1)製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

	委託者報酬	運用受託報酬	投資助言報酬	その他	合計
外部顧客への売上高	25,467,198	2,001,039	1,743,437	184,558	29,396,234

(2)地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

(関連当事者情報)

第26期(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

1.親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等

（単位：千円）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2. その他の関係会社の子会社等

（単位：千円）

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

第27期(自平成23年4月1日至平成24年3月31日)

1.親会社及び主要株主(会社等の場合に限る。)等

(単位:千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の関係会社	住友生命保険(相)	大阪府 大阪市 中央区	220,000,000	生命保険業	(被所有) % 直接 40	当社の 主要顧客	投資助言 報酬	1,082,284	未収投資 助言報酬	283,244
その他の関係会社	(株)三井住友銀行	東京都 千代田区	1,770,996,505	銀行業	(被所有) % 直接 27.5	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売 手数料	4,294,733	未払手数料	345,061

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

- (1) 投資助言契約の受託については、一般取引条件を勘案した個別契約に基づき決定しております。
- (2) 投信の販売委託については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

2. その他の関係会社の子会社等

(単位:千円)

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の関係会社の子会社	S M B C 日興証券(株)	東京都 千代田区	10,000,000	証券業	- %	投信の 販売委託	委託販売 手数料	1,765,986	未払手数料	264,970

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(1株当たり情報)

第26期 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)	第27期 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日)
1株当たり純資産額 1,584,018円42銭 1株当たり当期純利益 143,507円12銭	1株当たり純資産額 1,605,326円06銭 1株当たり当期純利益 94,244円73銭
なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。
(1株当たり純資産額の算定上の基礎) 貸借対照表の純資産の部の合計額 27,942,085千円 普通株式に係る純資産額 27,942,085千円 普通株式の発行済株式数 17,640株 1株当たり純資産額の算定に用いられた普通株式の数 17,640株	(1株当たり純資産額の算定上の基礎) 貸借対照表の純資産の部の合計額 28,317,951千円 普通株式に係る純資産額 28,317,951千円 普通株式の発行済株式数 17,640株 1株当たり純資産額の算定に用いられた普通株式の数 17,640株
(1株当たり当期純利益の算定上の基礎) 損益計算書上の当期純利益 2,531,465千円 普通株式に係る当期純利益 2,531,465千円 普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。 普通株式の期中平均株式数 17,640株	(1株当たり当期純利益の算定上の基礎) 損益計算書上の当期純利益 1,662,477千円 普通株式に係る当期純利益 1,662,477千円 普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。 普通株式の期中平均株式数 17,640株

(重要な後発事象)

該当事項はありません。

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

イ 受託会社

（イ）名称 三井住友信託銀行株式会社

（ロ）資本金の額 342,037百万円（平成24年4月1日現在）

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

【参考情報：再信託受託会社の概要】

・ 名称 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

・ 資本金の額 51,000百万円（平成24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 539,000百万円（平成24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23年4月13日現在)	(平成24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	1,006,822,930	1,219,131,111
コール・ローン	620,514,645	187,824,056
株式	236,971,201,683	212,115,436,192
投資証券	3,963,481,308	4,356,239,606
派生商品評価勘定	1,582,293	-
未収入金	2,616,494	4,393,074
未収配当金	364,134,855	426,794,584
未収利息	850	257
差入委託証拠金	614,038,852	745,301,709
流動資産合計	243,544,393,910	219,055,120,589
資産合計	243,544,393,910	219,055,120,589
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	18,886,957	80,779,385
未払解約金	450,803,843	1,721,904
流動負債合計	469,690,800	82,501,289
負債合計	469,690,800	82,501,289
純資産の部		
元本等		
元本		
元本	175,017,042,490	165,644,585,873
剰余金		
剰余金又は欠損金()	68,057,660,620	53,328,033,427
元本等合計	243,074,703,110	218,972,619,300
純資産合計	243,074,703,110	218,972,619,300
負債純資産合計	243,544,393,910	219,055,120,589

(注) 「外国株式インデックス・マザーファンド」は、毎年11月30日（ただし、休業日の場合は翌営業日）に決算を行います。上記の貸借対照表は平成23年4月13日ならびに平成24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

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成23年4月14日 至平成24年4月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式および投資証券（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。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、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。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。

(追加情報)

自平成23年4月14日 至平成24年4月13日
当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成23年4月13日現在)	(平成24年4月13日現在)
1. 受益権総数	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	平成24年4月13日現在における受益権の総数 165,644,585,873口
2. 1単位当たり純資産額	1.3889円 (1万口 = 13,889円)	1.3219円 (1万口 = 13,219円)

（金融商品に関する注記）

. 金融商品の状況に関する事項

項目	自平成22年4月14日 至平成23年4月13日	自平成23年4月14日 至平成24年4月13日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式、新株予約権証券および投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。当ファンドにおけるデリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、先物取引および為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式および投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 同左</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 同左</p>

<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理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23年4月13日現在）	（平成24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（株式および投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1) 有価証券（株式および投資証券） 同左</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） 同左</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 同左</p>

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成23年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。

(平成24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	1,656,168,561 (20,449,050米ドル)	()	1,627,538,594 (20,095,550米ドル)	28,629,967 (353,500米ドル)
	DJ EUR	560,155,626 (5,243,430ユーロ)	()	517,732,365 (4,846,320ユーロ)	42,423,261 (397,110ユーロ)
	FTSE	295,439,299 (2,284,560英ポンド)	()	285,713,142 (2,209,350英ポンド)	9,726,157 (75,210英ポンド)
	買建 合計	2,511,763,486		2,430,984,101	80,779,385

(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。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

(自平成22年4月14日 至 平成23年4月13日)

該当事項はありません。

(自平成23年4月14日 至 平成24年4月13日)

該当事項はありません。

(その他の注記)

(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
SMAM・外国株式パッシブ・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
SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	21,241,761,961円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	9,637,571,508円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	5,845,182,923円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	23,072,107,718円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	76,391,191円
SMAM・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
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	2,456,997,870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>	160,510,809円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	599,735,836円
SMAM・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
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	4,145,190,129円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	7,287,256,183円
SMAM・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
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	577,260,050円
SMAM・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・VAS(適格機関投資家専用)	38,049,916,486円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	87,582,196円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	54,322,075円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	20,535,269円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	248,717,493円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	560,467,062円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	473,052,967円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定>	13,073,644円
SMAM・FGグローバルバランス25VA<適格機関投資家限定>	9,408,977円
合計	175,017,042,490円

(平成24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	175,017,042,490円
同期中における追加設定元本額	27,306,486,339円
同期中における一部解約元本額	36,678,942,956円
平成24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	4,429,304,438円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	188,307,173円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	800,885,604円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	501,126,771円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	16,276,985円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	1,973,893円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	2,775,208円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	3,161,753円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	3,990,254円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	3,723,999円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	2,892,544円
外国株式指数ファンド	237,380,978円
三井住友・DC全海外株式インデックスファンド	613,025円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	33,783,904,764円
バランスファンドVA(安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	286,187,769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 >	20,175,227,743円
SMAM・バランスファンドVA25 < 適格機関投資家専用 >	9,110,284,758円
SMAM・バランスファンドVA37.5 < 適格機関投資家専用 >	5,329,172,366円
SMAM・バランスファンドVA50 < 適格機関投資家専用 >	21,129,317,278円
SMAM・バランスファンドVL30 < 適格機関投資家限定 >	73,420,328円
SMAM・バランスファンドVL50 < 適格機関投資家限定 >	303,987,649円
世界6資産バランスファンドVA < 適格機関投資家限定 >	55,461,630円
SMAM・バランスファンドVA75 < 適格機関投資家専用 >	2,340,121,195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 >	157,170,465円
SMAM・インデックス・バランスVA25 < 適格機関投資家専用 >	549,342,233円
SMAM・インデックス・バランスVA50 < 適格機関投資家専用 >	2,545,245,260円
SMAM・バランスファンドVA40 < 適格機関投資家専用 >	4,000,140,493円
SMAM・バランスファンドVA35 < 適格機関投資家専用 >	6,499,911,846円
SMAM・バランスVA株40T < 適格機関投資家限定 >	1,064,812,154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)	2,889,635,876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)	8,594,952,211円
SMAM・グローバルバランス40VA < 適格機関投資家限定 >	535,448,848円
SMAM・バランスファンドVA20 < 適格機関投資家専用 >	2,331,703,375円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	36,344,490,401円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A < 適格機関投資家専用 >	84,773,356円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A < 適格機関投資家専用 >	52,310,735円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A < 適格機関投資家専用 >	19,865,917円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L < 適格機関投資家専用 >	221,321,296円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L < 適格機関投資家専用 >	501,521,996円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T < 適格機関投資家専用 >	441,769,401円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA < 適格機関投資家限定 >	18,318,140円
SMAM・FGグローバルバランス25VA < 適格機関投資家限定 >	12,353,765円
合計	165,644,585,873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	25,580	16.08	411,326.40	
ANADARKO PETROLEUM CORP	59,843	76.59	4,583,375.37	
APACHE CORPORATION	46,261	94.90	4,390,168.90	
ARCH COAL INC	24,777	10.63	263,379.51	
BAKER HUGHES INC	52,452	41.77	2,190,920.04	
CABOT OIL & GAS CORPORATION	25,000	30.68	767,000.00	
CAMERON INTERNATIONAL CORP	29,253	52.20	1,527,006.60	
CHESAPEAKE ENERGY CORPORATION	79,523	20.66	1,642,945.18	
CHEVRON CORPORATION	239,935	102.59	24,614,931.65	
CIMAREX ENERGY CO	10,130	70.94	718,622.20	
COBALT INTERNATIONAL ENERGY	21,000	29.57	620,970.00	
CONCHO RESOURCES INC	12,132	98.70	1,197,428.40	
CONOCOPHILLIPS	151,790	74.53	11,312,908.70	
CONSOL ENERGY INC	27,862	34.75	968,204.50	
CONTINENTAL RESOURCES, INC.	5,100	83.33	424,983.00	
DENBURY RESOURCES INC	47,546	18.46	877,699.16	
DEVON ENERGY CORPORATION	46,045	69.13	3,183,090.85	
DIAMOND OFFSHORE DRILLING, INC.	8,356	66.02	551,663.12	
EL PASO CORPORATION	93,418	29.95	2,797,869.10	
EOG RESOURCES INC	32,305	105.22	3,399,132.10	
EXXON MOBIL CORPORATION	577,246	83.60	48,257,765.60	
FMC TECHNOLOGIES INC	28,290	48.25	1,364,992.50	
HALLIBURTON CO	111,438	33.18	3,697,512.84	
HELMERICH & PAYNE INC	12,500	54.38	679,750.00	
HESS CORPORATION	36,615	56.66	2,074,605.90	
HOLLYFRONTIER CORP	25,700	30.52	784,364.00	
KINDER MORGAN INC	13,200	38.52	508,464.00	
KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	10,293	73.48	756,329.64	
MARATHON OIL CORP	85,781	30.34	2,602,595.54	
MARATHON PETROLEUM CORPORATION	42,736	41.76	1,784,655.36	
MURPHY OIL CORPORATION	21,797	53.45	1,165,049.65	
NABORS INDUSTRIES LTD	36,184	16.97	614,042.48	
NATIONAL-OILWELL VARCO INC.	50,692	80.46	4,078,678.32	
NEWFIELD EXPLORATION CO	15,187	33.72	512,105.64	
NOBLE CORPORATION	31,218	36.53	1,140,393.54	
NOBLE ENERGY INC	21,159	94.82	2,006,296.38	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	97,743	91.12	8,906,342.16	
PEABODY ENERGY CORP	32,753	29.34	960,973.02	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	13,575	107.83	1,463,792.25	

PLAINS EXPLORATION & PRODUCTION COMPANY	17,700	42.19	746,763.00	
RANGE RESOURCES CORPORATION	19,982	56.30	1,124,986.60	
ROWAN COMPANIES INC	15,345	33.99	521,576.55	
SCHLUMBERGER LTD	161,691	70.34	11,373,344.94	
SOUTHWESTERN ENERGY COMPANY	42,961	28.95	1,243,720.95	
SPECTRA ENERGY CORPORATION	78,063	30.45	2,377,018.35	
SUNOCO INC	12,794	38.41	491,417.54	
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	20,000	25.76	515,200.00	
ULTRA PETROLEUM CORP	19,748	19.47	384,493.56	
VALERO ENERGY CORP	66,842	24.93	1,666,371.06	
WEATHERFORD INTL LTD	90,018	14.30	1,287,257.40	
WHITING PETROLEUM CORP	14,600	52.29	763,434.00	
WILLIAMS COS INC	70,747	31.82	2,251,169.54	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	25,349	89.49	2,268,482.01	
AIRGAS INC	8,900	89.19	793,791.00	
ALCOA INC	131,099	10.17	1,333,276.83	
ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	12,080	41.37	499,749.60	
BALL CORPORATION	18,906	42.81	809,365.86	
CELANESE CORPORATION	19,423	47.07	914,240.61	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	7,758	188.89	1,465,408.62	
CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	17,655	71.16	1,256,329.80	
CROWN HOLDINGS INC	19,100	36.98	706,318.00	
DOW CHEMICAL	142,356	32.67	4,650,770.52	
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	111,260	52.41	5,831,136.60	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	16,254	52.77	857,723.58	
ECOLAB INC	35,554	61.82	2,197,948.28	
FMC CORPORATION	8,500	105.07	893,095.00	
FREEMONT-MCMORAN COPPER-B	113,346	37.89	4,294,679.94	
INTERNATIONAL PAPER CO	49,147	33.27	1,635,120.69	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	9,292	58.53	543,860.76	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	34,572	42.83	1,480,718.76	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,093	83.82	426,895.26	
MEADWESTVACO CORP	21,015	31.22	656,088.30	
MONSANTO CO	64,556	78.34	5,057,317.04	
MOSAIC CO/THE	36,888	51.17	1,887,558.96	
NEWMONT MINING CORP	60,023	49.55	2,974,139.65	
NUCOR CORP	39,163	42.25	1,654,636.75	
OWENS-ILLINOIS INC	19,739	23.80	469,788.20	
PPG INDUSTRIES INC	18,526	96.83	1,793,872.58	
PRAXAIR INC	35,848	113.62	4,073,049.76	
ROCK-TENN COMPANY CL A	8,500	64.29	546,465.00	
SEALED AIR CORP	21,938	18.77	411,776.26	
SIGMA-ALDRICH	14,656	72.33	1,060,068.48	
UNITED STATES STEEL CORPORATION	17,409	29.36	511,128.24	
VULCAN MATERIALS CO	15,553	42.11	654,936.83	
WALTER ENERGY INC	7,100	64.04	454,684.00	

WEYERHAEUSER CO	64,443	21.07	1,357,814.01	
3M COMPANY	80,108	86.86	6,958,180.88	
AGCO CORP	11,954	45.61	545,221.94	
AMETEK INC	19,240	48.25	928,330.00	
BOEING CO	85,063	73.50	6,252,130.50	
CATERPILLAR INC	77,910	106.44	8,292,740.40	
COOPER INDUSTRIES PLC-CL-A	18,457	62.26	1,149,132.82	
CUMMINS INC	21,778	116.05	2,527,336.90	
DANAHER CORP	70,075	54.49	3,818,386.75	
DEERE & CO	49,733	79.34	3,945,816.22	
DOVER CORP	22,091	60.86	1,344,458.26	
EATON CORP	37,578	47.72	1,793,222.16	
EMERSON ELECTRIC CO	88,407	51.02	4,510,525.14	
FASTENAL COMPANY	33,836	48.87	1,653,565.32	
FIRST SOLAR,INC.	7,420	22.01	163,314.20	
FLOWERVE CORPORATION	6,969	112.56	784,430.64	
FLUOR CORP	20,981	59.43	1,246,900.83	
GENERAL DYNAMICS CORP	36,617	69.66	2,550,740.22	
GENERAL ELECTRIC CO	1,271,645	19.30	24,542,748.50	
GOODRICH CORPORATION	15,043	125.31	1,885,038.33	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	88,344	58.79	5,193,743.76	
ILLINOIS TOOL WORKS	53,048	56.69	3,007,291.12	
INGERSOLL-RAND PLC	37,464	40.23	1,507,176.72	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	16,090	43.66	702,489.40	
JOY GLOBAL INC	12,960	76.81	995,457.60	
KBR,INC.	18,685	34.95	653,040.75	
L-3 COMMUNICATIONS HLDGS INC	12,510	69.56	870,195.60	
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	33,413	90.17	3,012,850.21	
MASCO CORP	44,766	12.57	562,708.62	
NORTHROP GRUMMAN CORP	29,833	61.29	1,828,464.57	
PACCAR INC	38,024	43.28	1,645,678.72	
PALL CORPORATION	13,476	58.92	794,005.92	
PARKER HANNIFIN CORPORATIOM	18,386	83.69	1,538,724.34	
PENTAIR INC	11,850	44.16	523,296.00	
PRECISION CASTPARTS CORP	17,534	171.24	3,002,522.16	
QUANTA SERVICES INC	26,059	20.98	546,717.82	
RAYTHEON COMPANY	41,977	52.70	2,212,187.90	
ROCKWELL AUTOMATION INC	16,898	80.18	1,354,881.64	
ROCKWELL COLLINS INC.	18,544	57.21	1,060,902.24	
ROPER INDUSTRIES INC	11,600	98.60	1,143,760.00	
SPX CORP	6,068	76.92	466,750.56	
TEXTRON INC	32,168	27.35	879,794.80	
TYCO INTERNATIONAL LTD	55,610	54.76	3,045,203.60	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	103,597	81.17	8,408,968.49	
URS CORPORATION	9,300	40.88	380,184.00	
WW GRAINGER INC	7,230	214.00	1,547,220.00	

XYLEM INC	21,566	27.32	589,183.12	
AVERY DENNISON CORP	10,862	30.64	332,811.68	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3,734	433.22	1,617,643.48	
CINTAS CORP	14,713	38.68	569,098.84	
DUN & BRADSTREET CORP	6,001	83.09	498,623.09	
EQUIFAX INC	14,242	44.05	627,360.10	
IHS INC-CLASS A	5,400	97.26	525,204.00	
IRON MOUNTAIN INC	17,022	29.55	503,000.10	
MANPOWERGROUP	9,392	44.28	415,877.76	
NETFLIX INC	6,598	104.26	687,907.48	
NIELSEN HOLDINGS NV	14,600	29.43	429,678.00	
PITNEY BOWES INC	25,773	17.07	439,945.11	
REPUBLIC SERVICES INC	35,694	30.89	1,102,587.66	
ROBERT HALF INTL INC	15,191	29.53	448,590.23	
STERICYCLE,INC.	10,121	86.67	877,187.07	
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	16,100	47.47	764,267.00	
WASTE MANAGEMENT INC	52,128	35.39	1,844,809.92	
C.H.ROBINSON WORLDWIDE,INC.	19,202	64.48	1,238,144.96	
CSX CORPORATION	127,639	22.06	2,815,716.34	
DELTA AIR LINES INC	21,520	10.26	220,795.20	
EXPEDITORS INTL WASH INC	25,378	46.99	1,192,512.22	
FEDEX CORP	36,661	89.84	3,293,624.24	
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	30,375	14.66	445,297.50	
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	11,400	55.80	636,120.00	
KANSAS CITY SOUTHERN	13,300	72.74	967,442.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	42,457	67.91	2,883,254.87	
SOUTHWEST AIRLINES	24,000	8.14	195,360.00	
UNION PACIFIC CORP	58,121	108.80	6,323,564.80	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	11,000	21.52	236,720.00	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	87,238	79.42	6,928,441.96	
AUTOLIV INC	11,200	64.82	725,984.00	
BORGWARNER INC	13,000	83.68	1,087,840.00	
FORD MOTOR COMPANY	426,019	12.07	5,142,049.33	
GENERAL MOTORS CO	94,173	24.30	2,288,403.90	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	31,234	10.96	342,324.64	
HARLEY-DAVIDSON INC	28,086	48.52	1,362,732.72	
JOHNSON CONTROLS INC	81,986	31.83	2,609,614.38	
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	12,350	44.60	550,810.00	
BEAM INC	17,302	57.01	986,387.02	
COACH INC	35,155	74.85	2,631,351.75	
D.R.HORTON INC	35,448	15.19	538,455.12	
FOSSIL INC	6,350	133.00	844,550.00	
GARMIN LTD	13,416	45.30	607,744.80	
HASBRO INC	14,714	36.26	533,529.64	
LEGGETT & PLATT INC	17,715	22.44	397,524.60	
LULULEMON ATHLETICA INC	12,480	73.13	912,662.40	

MATTEL INC	40,293	34.30	1,382,049.90	
MOHAWK INDUSTRIES INC	7,383	63.12	466,014.96	
NEWELL RUBBERMAID INC	35,644	17.24	614,502.56	
NIKE INC -CL B	42,667	108.65	4,635,769.55	
RALPH LAUREN CORPORATION	7,508	171.80	1,289,874.40	
STANLEY BLACK & DECKER INC	18,911	77.65	1,468,439.15	
TOLL BROTHERS INC	17,339	23.13	401,051.07	
VF CORP	10,525	146.72	1,544,228.00	
WHIRLPOOL CORP	9,084	71.97	653,775.48	
APOLLO GROUP INC-CL A	14,523	37.17	539,819.91	
CARNIVAL CORP	53,688	31.41	1,686,340.08	
DARDEN RESTAURANTS INC	16,540	49.79	823,526.60	
H&R BLOCK INC	37,392	16.99	635,290.08	
INTL GAME TECHNOLOGY	33,660	16.67	561,112.20	
LAS VEGAS SANDS CORP	44,139	61.05	2,694,685.95	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	31,847	37.57	1,196,491.79	
MCDONALD'S CORPORATION	123,240	97.66	12,035,618.40	
MGM MIRAGE	43,400	13.86	601,524.00	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	18,071	27.73	501,108.83	
STARBUCKS CORP	89,546	60.61	5,427,383.06	
STARWOOD HOTELS & RESORTS	22,980	56.27	1,293,084.60	
WYNN RESORTS LTD	10,014	126.28	1,264,567.92	
YUM! BRANDS INC	55,642	70.87	3,943,348.54	
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	23,920	13.42	321,006.40	
CBS CORP-CL B	73,829	32.18	2,375,817.22	
COMCAST CORP-CL A	252,255	29.69	7,489,450.95	
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	79,391	29.18	2,316,629.38	
DIRECTV-CLASS A	84,955	49.24	4,183,184.20	
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-A	16,730	51.32	858,583.60	
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-C	14,530	48.19	700,200.70	
DISH NETWORK CORP.	25,664	32.00	821,248.00	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	57,525	11.00	632,775.00	
LIBERTY GLOBAL INC-A	16,040	48.63	780,025.20	
LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	13,363	46.69	623,918.47	
LIBERTY MEDIA CORP-CAPITAL	12,700	84.99	1,079,373.00	
MCGRAW-HILL COMPANIES INC	35,227	49.03	1,727,179.81	
NEWS CORP-CL A	205,905	19.33	3,980,143.65	
NEWS CORPORATION-CLASS B	51,931	19.66	1,020,963.46	
OMNICOM GROUP	32,949	49.49	1,630,646.01	
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	11,100	47.50	527,250.00	
SIRIUS XM RADIO INC	459,000	2.26	1,037,340.00	
THE WALT DISNEY CO.	205,538	42.15	8,663,426.70	
TIME WARNER CABLE,INC.	38,777	80.22	3,110,690.94	
TIME WARNER INC	119,841	36.03	4,317,871.23	
VIACOM INC-CLASS B	59,559	47.08	2,804,037.72	
VIRGIN MEDIA INC	33,677	24.42	822,392.34	

WASHINGTON POST CO B	667	383.73	255,947.91	
ABERCROMBIE & FITCH CO -CL A	9,871	48.17	475,486.07	
ADVANCE AUTO PARTS	9,088	89.95	817,465.60	
AMAZON.COM INC	43,773	190.69	8,347,073.37	
AUTOZONE INC	2,798	378.73	1,059,686.54	
BED BATH & BEYOND INC	29,807	70.14	2,090,662.98	
BEST BUY COMPANY INC	36,016	22.24	800,995.84	
CARMAX INC	26,222	31.81	834,121.82	
DOLLAR GENERAL CORP	22,100	46.63	1,030,523.00	
DOLLAR TREE INC	14,150	95.91	1,357,126.50	
EXPEDIA INC	10,591	32.02	339,123.82	
FAMILY DOLLAR STORES	12,636	64.44	814,263.84	
GAMESTOP CORP-CL A	15,147	21.56	326,569.32	
GAP INC/THE	39,405	25.96	1,022,953.80	
GENUINE PARTS CO	18,884	62.98	1,189,314.32	
HOME DEPOT INC	185,573	50.63	9,395,560.99	
J.C.PENNEY CO INC (HLDG CO)	19,297	34.46	664,974.62	
KOHL'S CORP	28,951	49.92	1,445,233.92	
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION	67,372	18.81	1,267,267.32	
LIMITED BRANDS	30,973	47.81	1,480,819.13	
LOWE'S COMPANIES INC	151,473	31.50	4,771,399.50	
MACY'S INC	49,676	40.33	2,003,433.08	
NORDSTROM INC	20,435	55.09	1,125,764.15	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC NEW	15,340	94.28	1,446,255.20	
PETSMART INC	13,891	56.90	790,397.90	
PRICELINE.COM INC	5,997	742.15	4,450,673.55	
ROSS STORES INC	27,666	59.03	1,633,123.98	
SEARS HOLDINGS CORP	5,310	58.85	312,493.50	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	10,610	115.58	1,226,303.80	
STAPLES INC	83,576	15.66	1,308,800.16	
TARGET CORP	76,783	57.93	4,448,039.19	
TIFFANY & CO	15,007	67.37	1,011,021.59	
TJX COMPANIES INC	90,350	39.76	3,592,316.00	
URBAN OUTFITTERS,INC.	14,100	28.99	408,759.00	
COSTCO WHOLESALE CORP	52,107	87.16	4,541,646.12	
CVS CAREMARK CORPORATION	156,931	43.48	6,823,359.88	
KROGER CO	68,987	23.62	1,629,472.94	
SAFEWAY INC	42,049	20.67	869,152.83	
SYSCO CORP	71,199	29.44	2,096,098.56	
WAL-MART STORES INC	228,358	60.14	13,733,450.12	
WALGREEN CO	105,382	33.29	3,508,166.78	
WHOLE FOODS MARKET INC	18,480	85.64	1,582,627.20	
ALTRIA GROUP INC	247,473	31.31	7,748,379.63	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	79,603	31.10	2,475,653.30	
BROWN-FORMAN CORPORATION	10,195	83.05	846,694.75	
BUNGE LIMITED	18,060	68.41	1,235,484.60	

CAMPBELL SOUP CO	23,179	33.14	768,152.06
COCA-COLA CO/THE	246,087	72.22	17,772,403.14
COCA-COLA ENTERPRISES INC	38,704	27.55	1,066,295.20
CONAGRA FOODS INC	49,533	25.94	1,284,886.02
CONSTELLATION BRANDS INC-A	20,823	21.49	447,486.27
DR.PEPPER SNAPPLE GROUP,INC	25,970	39.14	1,016,465.80
GENERAL MILLS INC	78,076	38.76	3,026,225.76
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTERS, INC.	15,150	43.62	660,843.00
HJ HEINZ CO	38,453	52.86	2,032,625.58
HORMEL FOODS CORPORATION	17,200	28.25	485,900.00
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	13,700	79.37	1,087,369.00
KELLOGG CO	30,028	53.20	1,597,489.60
KRAFT FOODS INC-A	202,416	37.14	7,517,730.24
LORILLARD INC	16,385	136.06	2,229,343.10
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	14,830	54.01	800,968.30
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	24,852	82.66	2,054,266.32
MOLSON COORS BREWING COMPANY	18,225	40.82	743,944.50
MONSTER BEVERAGE CORPORATION	18,000	62.61	1,126,980.00
PEPSICO INC	188,197	65.38	12,304,319.86
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	209,250	87.26	18,259,155.00
RALCORP HOLDINGS INC	6,350	73.66	467,741.00
REYNOLDS AMERICAN INC	42,213	41.79	1,764,081.27
SARA LEE CORP	67,032	21.31	1,428,451.92
THE HERSHEY COMPANY	19,310	61.65	1,190,461.50
TYSON FOODS INC-CL A	36,800	18.10	666,080.00
AVON PRODUCTS INC	50,190	23.07	1,157,883.30
CHURCH & DWIGHT CO INC	16,970	50.17	851,384.90
CLOROX COMPANY	15,961	69.85	1,114,875.85
COLGATE-PALMOLIVE CO	58,234	97.44	5,674,320.96
ENERGIZER HOLDINGS INC	8,227	72.24	594,318.48
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	28,019	62.41	1,748,665.79
HERBALIFE LTD	14,250	68.67	978,547.50
KIMBERLY-CLARK CORP	47,055	74.17	3,490,069.35
PROCTER & GAMBLE CO	331,275	66.09	21,893,964.75
AETNA INC	43,853	48.19	2,113,276.07
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	22,244	90.10	2,004,184.40
AMERISOURCEBERGEN CORP	31,218	38.81	1,211,570.58
BARD(C.R.) INC	10,040	96.57	969,562.80
BAXTER INTERNATIONAL INC	67,766	58.71	3,978,541.86
BECTON DICKINSON & CO	26,058	76.28	1,987,704.24
BOSTON SCIENTIFIC CORP	180,125	5.82	1,048,327.50
CARDINAL HEALTH INC	42,197	41.30	1,742,736.10
CAREFUSION CORPORATION	26,745	26.01	695,637.45
CERNER CORP	17,610	73.55	1,295,215.50
CIGNA CORP	34,452	48.42	1,668,165.84
COVENTRY HEALTH CARE INC	17,913	33.31	596,682.03

COVIDIEN PLC	58,817	53.90	3,170,236.30	
DAVITA INC	11,178	86.74	969,579.72	
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	16,809	39.74	667,989.66	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	13,250	72.60	961,950.00	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	96,078	57.50	5,524,485.00	
HCA HOLDINGS, INC.	21,300	27.57	587,241.00	
HENRY SCHEIN INC	11,150	75.07	837,030.50	
HOLOGIC INC	31,780	21.18	673,100.40	
HOSPIRA INC	19,733	35.20	694,601.60	
HUMANA INC.	20,093	89.85	1,805,356.05	
INTUITIVE SURGICAL INC	4,691	551.59	2,587,508.69	
LABORATORY CRP OF AMR HLDGS	12,063	89.52	1,079,879.76	
MCKESSON CORP	29,454	91.34	2,690,328.36	
MEDTRONIC INC	127,340	38.24	4,869,481.60	
OMNICARE INC	12,995	35.11	456,254.45	
PATTERSON COS INC	10,432	33.08	345,090.56	
QUEST DIAGNOSTICS	19,666	58.83	1,156,950.78	
ST JUDE MEDICAL INC	38,327	40.30	1,544,578.10	
STRYKER CORP	34,371	54.86	1,885,593.06	
UNITEDHEALTH GROUP INC	128,301	58.46	7,500,476.46	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	13,867	67.82	940,459.94	
WELLPOINT INC	42,289	70.00	2,960,230.00	
ZIMMER HOLDINGS INC	21,423	64.22	1,375,785.06	
ABBOTT LABORATORIES	187,682	59.72	11,208,369.04	
ALLERGAN INC	36,480	93.19	3,399,571.20	
AMGEN INC	95,479	66.90	6,387,545.10	
BIOGEN IDEC INC	27,571	125.49	3,459,884.79	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	204,253	32.55	6,648,435.15	
CELGENE CORP	53,232	78.58	4,182,970.56	
COVANCE INC	6,860	46.44	318,578.40	
ELI LILLY & CO	125,161	39.58	4,953,872.38	
FOREST LABORATORIES,INC.	32,930	33.73	1,110,728.90	
GILEAD SCIENCES INC	90,338	45.74	4,132,060.12	
ILLUMINA INC	13,989	49.56	693,294.84	
JOHNSON & JOHNSON	328,798	64.15	21,092,391.70	
LIFE TECHNOLOGIES CORPORATION	21,677	47.11	1,021,203.47	
MERCK & CO. INC.	367,022	38.28	14,049,602.16	
MYLAN INC	52,500	22.40	1,176,000.00	
PERRIGO CO	10,400	103.94	1,080,976.00	
PFIZER INC	926,101	21.91	20,290,872.91	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	45,295	55.12	2,496,660.40	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	25,608	37.71	965,677.68	
WARNER CHILCOTT PLC	15,500	15.89	246,295.00	
WATERS CORP	10,621	89.28	948,242.88	
WATSON PHARMACEUTICALS INC	14,800	67.03	992,044.00	
BB & T CORPORATION	85,007	31.20	2,652,218.40	

COMERICA INC	23,550	31.35	738,292.50	
FIFTH THIRD BANCORP	110,338	14.48	1,597,694.24	
HUDSON CITY BANCORP INC	59,969	6.89	413,186.41	
KEYCORP	114,915	8.35	959,540.25	
M & T BANK CORP	13,578	86.33	1,172,188.74	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	52,068	13.50	702,918.00	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	45,000	12.74	573,300.00	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	62,805	63.41	3,982,465.05	
REGIONS FINANCIAL CORPORATION	164,522	6.30	1,036,488.60	
SUNTRUST BANKS INC	64,186	23.55	1,511,580.30	
US BANCORP	230,043	31.34	7,209,547.62	
WELLS FARGO & COMPANY	603,219	34.02	20,521,510.38	
AMERICAN EXPRESS COMPANY	125,818	58.04	7,302,476.72	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	26,667	54.73	1,459,484.91	
BANK OF AMERICA CORP	1,220,118	9.17	11,188,482.06	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP(THE)	144,697	23.94	3,464,046.18	
BLACKROCK INC	12,540	201.71	2,529,443.40	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	59,522	54.65	3,252,877.30	
CIT GROUP INC	23,700	40.83	967,671.00	
CITIGROUP INC	352,241	34.64	12,201,628.24	
CME GROUP INC.	7,560	287.49	2,173,424.40	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	67,581	33.27	2,248,419.87	
EATON VANCE CORP	15,000	27.17	407,550.00	
FRANKLIN RESOURCES INC	18,624	124.54	2,319,432.96	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	56,288	120.39	6,776,512.32	
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	8,628	134.13	1,157,273.64	
INVESCO LIMITED	55,339	25.37	1,403,950.43	
JPMORGAN CHASE & CO	457,685	44.84	20,522,595.40	
LEGG MASON INC	15,803	26.13	412,932.39	
LEUCADIA NATIONAL CORPORATION	24,984	24.85	620,852.40	
MOODY'S CORP	23,868	42.91	1,024,175.88	
MORGAN STANLEY	173,494	18.22	3,161,060.68	
NASDAQ STOCK MARKET INC	16,080	24.95	401,196.00	
NORTHERN TRUST CORP	26,005	46.79	1,216,773.95	
NYSE EURONEXT	31,929	27.84	888,903.36	
SCHWAB (CHARLES) CORP	129,936	14.25	1,851,588.00	
SEI INVESTMENTS COMPANY	17,324	20.25	350,811.00	
SLM CORPORATION	62,561	15.23	952,804.03	
STATE STREET CORP	60,121	44.18	2,656,145.78	
T ROWE PRICE GROUP INC	30,445	63.05	1,919,557.25	
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	25,294	19.51	493,485.94	
ACE LIMITED	40,226	73.02	2,937,302.52	
AFLAC INC	56,675	44.21	2,505,601.75	
ALLEGHANY CORPORATION	1,580	337.04	532,523.20	
ALLSTATE CORP	60,494	32.87	1,988,437.78	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	63,657	33.23	2,115,322.11	

AON PLC	34,751	48.50	1,685,423.50	
ARCH CAPITAL GROUP LTD.	15,100	37.86	571,686.00	
ASSURANT INC	11,089	39.45	437,461.05	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	14,503	33.49	485,705.47	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	109,303	80.06	8,750,798.18	
CHUBB CORP	33,477	70.51	2,360,463.27	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	17,926	34.03	610,021.78	
EVEREST RE GROUP LTD	6,323	94.29	596,195.67	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL INC-CL A	24,361	18.15	442,152.15	
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	60,800	7.85	477,280.00	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	51,686	20.57	1,063,181.02	
LINCOLN NATIONAL CORP	36,427	24.70	899,746.90	
LOEWS CORPORATION	37,338	39.43	1,472,237.34	
MARSH & MCLENNAN COS	64,492	32.02	2,065,033.84	
METLIFE INC	127,463	36.34	4,632,005.42	
PARTNERRE LTD	8,143	67.61	550,548.23	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	37,628	28.49	1,072,021.72	
PROGRESSIVE CORP	69,583	22.59	1,571,879.97	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	56,429	61.40	3,464,740.60	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	5,863	75.19	440,838.97	
TORCHMARK CORPORATION	12,108	49.28	596,682.24	
TRAVELERS COS INC(THE)	50,188	59.10	2,966,110.80	
UNUM GROUP	35,170	23.69	833,177.30	
W.R.BERKLEY CORPORATION	14,384	36.97	531,776.48	
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	20,098	35.36	710,665.28	
XL GROUP PLC	38,800	21.47	833,036.00	
CBRE GROUP INC-A	36,200	18.86	682,732.00	
ACCENTURE PLC-CL A	77,094	64.13	4,944,038.22	
ACTIVISION BLIZZARD INC	63,020	12.48	786,489.60	
ADOBE SYSTEMS INC	58,496	33.55	1,962,540.80	
AKAMAI TECHNOLOGIES	22,306	36.54	815,061.24	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	6,010	125.04	751,490.40	
AUTODESK INC	27,034	40.46	1,093,795.64	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	58,460	54.96	3,212,961.60	
BMC SOFTWARE INC	20,078	39.19	786,856.82	
CA INC	48,713	26.69	1,300,149.97	
CITRIX SYSTEMS INC	22,318	74.86	1,670,725.48	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATION	36,701	76.75	2,816,801.75	
COMPUTER SCIENCES CORP	17,862	27.69	494,598.78	
EBAY INC	139,964	36.46	5,103,087.44	
ELECTRONIC ARTS INC	38,781	16.52	640,662.12	
F5 NETWORKS INC	9,831	124.15	1,220,518.65	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	29,012	32.89	954,204.68	
FISERV INC	17,185	69.11	1,187,655.35	
GOOGLE INC-CL A	30,841	651.01	20,077,799.41	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	141,916	205.32	29,138,193.12	

INTUIT INC	33,809	60.58	2,048,149.22	
MASTERCARD INC-CL A	13,154	433.98	5,708,572.92	
MICROSOFT CORP	912,065	31.00	28,274,015.00	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	28,400	24.47	694,948.00	
ORACLE CORPORATION	486,307	28.70	13,957,010.90	
PAYCHEX INC	39,144	31.22	1,222,075.68	
RED HAT INC	22,900	60.81	1,392,549.00	
SAIC INC	31,400	12.49	392,186.00	
SALESFORCE.COM,INC.	15,561	158.30	2,463,306.30	
SYMANTEC CORPORATION	87,837	18.28	1,605,660.36	
SYNOPSYS INC	16,584	30.19	500,670.96	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	21,919	22.92	502,383.48	
VERISIGN INC	18,118	39.69	719,103.42	
VISA INC	62,770	121.02	7,596,425.40	
VMWARE INC	10,200	109.07	1,112,514.00	
WESTERN UNION COMPANY	73,604	17.81	1,310,887.24	
YAHOO! INC	143,708	15.05	2,162,805.40	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	42,737	43.53	1,860,341.61	
AMPHENOL CORPORATION -CL A	19,978	59.11	1,180,899.58	
APPLE INC	111,954	622.56	69,698,082.24	
ARROW ELECTRONICS INC	14,290	41.04	586,461.60	
AVAGO TECHNOLOGIES LTD.	26,900	38.17	1,026,773.00	
AVNET INC	18,900	35.29	666,981.00	
CISCO SYSTEMS INC	647,615	20.07	12,997,633.05	
CORNING INC	187,350	13.73	2,572,315.50	
DELL INC	196,651	16.26	3,197,545.26	
DOLBY LABORATORIES INC-CL A	5,800	37.47	217,326.00	
EMC CORP/MASS	245,867	29.20	7,179,316.40	
FLEXTRONICS INTL LTD	89,331	7.03	627,996.93	
FLIR SYSTEMS INC	18,640	24.14	449,969.60	
HARRIS CORP	13,550	44.34	600,807.00	
HEWLETT-PACKARD CO	239,134	25.09	5,999,872.06	
JUNIPER NETWORKS INC	62,656	22.02	1,379,685.12	
MOTOROLA MOBILITY HOLDINGS INC	33,697	39.19	1,320,585.43	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	33,189	49.03	1,627,256.67	
NETAPP INC	44,883	40.95	1,837,958.85	
QUALCOMM INC	202,365	68.27	13,815,458.55	
SANDISK CORP	28,477	42.14	1,200,020.78	
SEAGATE TECHNOLOGY	49,968	26.99	1,348,636.32	
TE CONNECTIVITY LTD	50,541	35.23	1,780,559.43	
TERADATA CORP	19,964	68.90	1,375,519.60	
WESTERN DIGITAL CORP	27,923	39.19	1,094,302.37	
XEROX CORP	169,663	7.96	1,350,517.48	
AT&T INC	713,624	30.84	22,008,164.16	
CENTURYLINK INC	75,055	38.47	2,887,365.85	
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	33,917	54.38	1,844,406.46	

FRONTIER COMMUNICATIONS CORPORATION	113,153	4.20	475,242.60	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	18,366	25.86	474,944.76	
METROPCS COMMUNICATIONS INC.	31,031	8.62	267,487.22	
NII HOLDINGS INC	20,689	19.30	399,297.70	
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	13,600	51.95	706,520.00	
SPRINT NEXTEL CORP	366,323	2.75	1,007,388.25	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	341,017	37.55	12,805,188.35	
WINDSTREAM CORPORATION	72,600	11.38	826,188.00	
AES CORPORATION	77,266	12.66	978,187.56	
ALLIANT ENERGY CORP	12,748	42.84	546,124.32	
AMEREN CORPORATION	29,924	31.56	944,401.44	
AMERICAN ELECTRIC POWER	57,851	37.37	2,161,891.87	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	22,000	33.37	734,140.00	
CALPINE CORP	39,000	16.99	662,610.00	
CENTERPOINT ENERGY INC	49,009	19.26	943,913.34	
CONSOLIDATED EDISON INC	34,832	57.87	2,015,727.84	
DOMINION RESOURCES INC/VA	68,936	50.30	3,467,480.80	
DTE ENERGY COMPANY	19,873	54.52	1,083,475.96	
DUKE ENERGY CORP	159,959	20.38	3,259,964.42	
EDISON INTERNATIONAL	37,285	41.71	1,555,157.35	
ENERGEN CORPORATION	8,800	47.60	418,880.00	
ENTERGY CORP	21,391	66.16	1,415,228.56	
EQT CORPORATION	16,480	46.60	767,968.00	
EXELON CORP	102,717	37.89	3,891,947.13	
FIRSTENERGY CORP	49,576	45.20	2,240,835.20	
INTEGRYS ENERGY GROUP,INC.	9,400	51.76	486,544.00	
MDU RESOURCES GROUP INC	23,500	22.04	517,940.00	
NEXTERA ENERGY INC	48,715	62.52	3,045,661.80	
NISOURCE INC	33,692	23.90	805,238.80	
NORTHEAST UTILITIES	37,512	35.72	1,339,928.64	
NRG ENERGY INC	28,425	14.74	418,984.50	
ONEOK INC	11,700	80.47	941,499.00	
P G & E CORPORATION	49,434	42.65	2,108,360.10	
PEPCO HOLDINGS INC	28,234	18.46	521,199.64	
PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	13,344	46.34	618,360.96	
PPL CORPORATION	68,562	27.10	1,858,030.20	
PROGRESS ENERGY INC	35,342	51.49	1,819,759.58	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	61,197	29.41	1,799,803.77	
QEP RESOURCES INC	22,366	28.99	648,390.34	
SCANA CORP	14,963	44.40	664,357.20	
SEMPRA ENERGY	27,454	62.89	1,726,582.06	
SOUTHERN CO	103,303	44.76	4,623,842.28	
WISCONSIN ENERGY CORP	28,232	34.99	987,837.68	
XCEL ENERGY INC	58,135	26.15	1,520,230.25	
ADVANCED MICRO DEVICES	73,485	7.92	582,001.20	
ALTERA CORPORATION	39,308	38.44	1,510,999.52	

ANALOG DEVICES INC	35,501	38.83	1,378,503.83	
APPLIED MATERIALS INC	158,136	12.05	1,905,538.80	
BROADCOM CORP-CL A	58,536	37.42	2,190,417.12	
CREE INC	12,400	32.55	403,620.00	
INTEL CORP	613,039	28.48	17,459,350.72	
KLA-TENCOR CORPORATION	19,924	53.73	1,070,516.52	
LAM RESEARCH CORP	14,764	43.40	640,757.60	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	26,854	32.48	872,217.92	
LSI CORPORATION	68,857	8.33	573,578.81	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	62,474	15.30	955,852.20	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	36,400	27.77	1,010,828.00	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	22,308	36.18	807,103.44	
MICRON TECHNOLOGY INC	106,482	7.13	759,216.66	
NVIDIA CORP	75,494	14.68	1,108,251.92	
TEXAS INSTRUMENTS INC	137,621	32.50	4,472,682.50	
XILINX INC	32,053	35.97	1,152,946.41	
米ドル 小計	36,162,582		1,529,823,206.31	
(邦貨換算額)			(123,900,381,479)	(単位：円)
カナダドル				
ARC RESOURCES LTD	34,900	20.33	709,517.00	
ATHABASCA OIL SANDS CORP	35,800	10.96	392,368.00	
BAYTEX ENERGY CORPORATION	14,507	49.73	721,433.11	
BONAVISTA ENERGY CORPORATION	17,500	17.94	313,950.00	
CAMECO CORP	49,343	20.94	1,033,242.42	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	131,519	33.01	4,341,442.19	
CANADIAN OIL SANDS LTD	56,942	20.70	1,178,699.40	
CENOVUS ENERGY INC	91,333	34.41	3,142,768.53	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	35,145	42.17	1,482,064.65	
ENBRIDGE INC	88,162	38.69	3,410,987.78	
ENCANA CORP	86,744	18.14	1,573,536.16	
ENERPLUS CORP	24,590	19.22	472,619.80	
HUSKY ENERGY INC	41,542	24.62	1,022,764.04	
IMPERIAL OIL LTD	35,451	43.69	1,548,854.19	
MEG ENERGY CORPORATION	14,600	38.01	554,946.00	
NEXEN INC	63,108	18.29	1,154,245.32	
NIKO RESOURCES LTD	5,880	36.18	212,738.40	
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORPORATION	31,100	28.95	900,345.00	
PEMBINA PIPELINE CORP	34,600	29.35	1,015,510.00	
PENGROWTH ENERGY CORPORATION	43,700	9.03	394,611.00	
PENN WEST PETROLEUM LTD	55,553	17.52	973,288.56	
PRECISION DRILLING CORP	26,300	9.47	249,061.00	
PROGRESS ENERGY RESOURCES CORP	20,400	10.25	209,100.00	
SUNCOR ENERGY INC	189,601	30.95	5,868,150.95	
TALISMAN ENERGY INC	125,707	12.74	1,601,507.18	
TOURMALINE OIL CORP	14,700	21.66	318,402.00	

TRANSCANADA CORP	84,592	42.79	3,619,691.68	
VERMILION ENERGY INC	11,400	47.32	539,448.00	
AGNICO-EAGLE MINES	20,950	34.18	716,071.00	
AGRIUM INC	19,223	85.93	1,651,832.39	
BARRICK GOLD CORP	120,208	41.98	5,046,331.84	
CENTERRA GOLD INC	21,000	13.75	288,750.00	
ELDORADO GOLD CORPORATION	79,931	14.37	1,148,608.47	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	57,710	22.54	1,300,783.40	
FRANCO-NEVADA CORPORATION	15,900	42.59	677,181.00	
GOLDCORP INC	97,511	41.79	4,074,984.69	
IAMGOLD CORP	45,500	12.79	581,945.00	
INMET MINING CORPORATION	6,322	58.07	367,118.54	
IVANHOE MINES LTD	33,466	13.55	453,464.30	
KINROSS GOLD CORP	135,027	9.48	1,280,055.96	
NEW GOLD INC	47,500	9.96	473,100.00	
OSISKO MINING CORPORATION	41,100	10.88	447,168.00	
PAN AMERICAN SILVER CORP	18,772	20.28	380,696.16	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	103,343	43.31	4,475,785.33	
SILVER WHEATON CORPORATION	43,486	31.90	1,387,203.40	
SINO-FOREST CORPORATION-CL A	30,871	0.01	308.71	3
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	70,105	36.93	2,588,977.65	
YAMANA GOLD INC	91,490	15.40	1,408,946.00	
BOMBARDIER INC 'B'	168,759	4.03	680,098.77	
CAE INC	32,614	10.34	337,228.76	
FINNING INTERNATIONAL INC	20,095	27.20	546,584.00	
SNC-LAVALIN GROUP INC	18,681	40.07	748,547.67	
RITCHIE BROS. AUCTIONEERS	12,400	21.34	264,616.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	53,064	78.78	4,180,381.92	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	20,651	75.98	1,569,062.98	
MAGNA INTERNATIONAL INC	25,286	45.89	1,160,374.54	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	13,200	27.20	359,040.00	
TIM HORTONS INC	18,950	53.76	1,018,752.00	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	47,271	20.76	981,345.96	
THOMSON REUTERS CORP	45,678	28.38	1,296,341.64	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	9,078	69.31	629,196.18	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B	14,100	33.57	473,337.00	
EMPIRE CO LTD A	3,300	58.35	192,555.00	
LOBLAW COMPANIES LTD	12,453	33.20	413,439.60	
METRO INC	12,650	53.72	679,558.00	
SHOPPERS DRUG MART CORP	25,260	43.71	1,104,114.60	
WESTON (GEORGE) LTD	6,480	61.42	398,001.60	
SAPUTO INC	17,290	44.26	765,255.40	
VITERRA INC	45,700	15.97	729,829.00	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN	33,864	53.47	1,810,708.08	
BANK OF MONTREAL	76,733	58.64	4,499,623.12	
BANK OF NOVA SCOTIA	131,210	55.34	7,261,161.40	

CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	48,073	75.50	3,629,511.50	
NATIONAL BANK OF CANADA	19,277	78.55	1,514,208.35	
ROYAL BANK OF CANADA	173,144	56.82	9,838,042.08	
TORONTO-DOMINION BANK	108,708	83.50	9,077,118.00	
CI FINANCIAL CORP	20,100	23.34	469,134.00	
IGM FINANCIAL INC	14,301	46.42	663,852.42	
ONEX CORPORATION	10,523	37.05	389,877.15	
TMX GROUP INC	9,421	44.07	415,183.47	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,322	394.91	916,981.02	
GREAT-WEST LIFECO INC	34,704	24.88	863,435.52	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANC	11,000	31.61	347,710.00	
INTACT FINANCIAL CORPORATION	15,200	61.74	938,448.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	215,997	13.40	2,894,359.80	
POWER CORP OF CANADA	43,160	26.90	1,161,004.00	
POWER FINANCIAL CORP	30,830	29.57	911,643.10	
SUN LIFE FINANCIAL INC	69,733	24.66	1,719,615.78	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	67,090	30.86	2,070,397.40	
BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES	31,763	17.07	542,194.41	
CGI GROUP INC - CL A	27,687	21.69	600,531.03	
OPEN TEXT CORPORATION	6,300	60.52	381,276.00	
RESEARCH IN MOTION	59,855	13.30	796,071.50	
BCE INC	30,520	39.81	1,215,001.20	
BELL ALIANT INC.	9,950	27.57	274,321.50	
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	48,850	39.91	1,949,603.50	
TELUS CORPORATION	4,400	57.72	253,968.00	
TELUS CORPORATION -NON VOTE	19,897	56.47	1,123,583.59	
CANADIAN UTILITIES LIMITED	10,980	67.16	737,416.80	
FORTIS INC	23,140	32.58	753,901.20	
TRANSALTA CORP	23,868	17.65	421,270.20	
カナダドル 小計	4,619,694		146,673,417.94	
(邦貨換算額)			(11,945,083,157)	(単位 : 円)
ユーロ				
COMPAGNIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE-VERITA	17,750	20.95	371,951.25	
ENI SPA	289,248	16.47	4,763,914.56	
FUGRO NV-CVA	8,595	52.90	454,675.50	
GALP ENERGIA SGPS S.A	30,100	11.67	351,417.50	
NESTE OIL OYJ	16,085	8.76	140,985.02	
OMV AG	18,599	25.21	468,973.78	
REPSOL YPF SA	94,168	17.96	1,691,257.28	
SAIPEM	32,115	37.57	1,206,560.55	
SBM OFFSHORE NV	20,087	13.84	278,004.08	
TECHNIP S.A.	11,999	86.09	1,032,993.91	
TENARIS S.A.	57,974	14.03	813,375.22	
TOTAL SA	255,427	37.04	9,461,016.08	
ACERINOX SA	13,536	9.03	122,338.36	

AIR LIQUIDE	33,995	98.88	3,361,425.60	
AKZO NOBEL	28,545	44.22	1,262,259.90	
ARCELOR MITTAL	104,111	13.74	1,431,005.69	
ARKEMA	6,980	69.01	481,689.80	
BASF SE	110,574	63.55	7,026,977.70	
CIMPOR-CIMENTOS DE PORTUGAL	20,160	5.50	111,021.12	
CRH PLC	87,580	15.29	1,339,098.20	
HEIDELBERGCEMENT AG	16,485	43.84	722,702.40	
IMERYS SA	3,513	43.59	153,131.67	
K+S AG	21,420	38.39	822,420.90	
KONINKLIJKE DSM NV	18,631	42.51	792,096.96	
LAFARGE SA	24,861	32.48	807,609.58	
LANXESS	10,360	60.40	625,744.00	
LINDE AG	20,346	130.75	2,660,239.50	
SALZGITTER AG	4,539	40.47	183,716.02	
SOLVAY SA	7,425	89.27	662,829.75	
STORA ENSO OYJ-R SHS	70,712	5.27	373,005.80	
THYSSENKRUPP AG	46,526	17.94	834,676.44	
UMICORE	13,550	42.65	577,975.25	
UPM-KYMMENE OYJ	60,416	9.05	547,066.88	
VOESTALPINE AG	12,253	24.49	300,137.23	
WACKER CHEMIE AG	2,140	61.38	131,353.20	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	18,435	17.55	323,534.25	
ALSTOM RGPT	25,613	27.82	712,681.72	
BEKAERT NV	5,000	23.39	116,950.00	
BOSKALIS WESTMINSTER NV	8,900	27.57	245,373.00	
BOUYGUES SA	23,431	21.39	501,189.09	
BRENNTAG AG	5,620	91.24	512,768.80	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	49,124	30.65	1,505,896.22	
EIFFAGE SA	5,600	26.99	151,144.00	
EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	49,418	30.90	1,527,016.20	
FINMECCANICA SPA	46,589	3.50	163,247.85	
FOMENTO DE CONSTRUC Y CONTRA	5,733	14.79	84,791.07	
GEA GROUP AG	20,800	25.77	536,016.00	
HOCHTIEF AG	5,337	45.17	241,072.29	
KONE OYJ-B	18,600	41.67	775,062.00	
LEGRAND SA	26,051	26.45	689,179.20	
MAN SE	7,888	100.50	792,744.00	
METSO OYJ	15,335	31.95	489,953.25	
PHILIPS ELECTRONICS NV	121,241	14.08	1,707,073.28	
PRYSMIAN SPA	25,400	12.63	320,802.00	
SAFRAN SA	20,019	26.76	535,808.53	
SCHNEIDER ELECTRIC SA	58,592	47.54	2,785,463.68	
SIEMENS AG-REG	99,151	73.01	7,239,014.51	
THALES SA	12,675	26.99	342,161.62	
VALLOUREC	13,347	46.94	626,508.18	

VINCI S.A.	53,761	36.36	1,955,018.76	
WARTSILA OYJ-B SHARES	20,402	28.00	571,256.00	
WENDEL	3,900	58.87	229,593.00	
ZARDOYA OTIS SA	15,500	9.44	146,320.00	
BIC	3,350	75.27	252,154.50	
BUREAU VERITAS SA	6,650	67.74	450,471.00	
EDENRED	19,767	23.26	459,780.42	
RANDSTAD HOLDING NV	14,498	25.91	375,715.67	
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	44,910	12.12	544,309.20	
AEROPORTS DE PARIS (ADP)	3,800	64.65	245,670.00	
ATLANTIA SPA	38,867	11.79	458,241.93	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	26,979	10.23	275,995.17	
DEUTSCHE POST AG-REG	100,084	14.37	1,438,207.08	
FERROVIAL SA	47,368	8.56	405,470.08	
FRAPORT AG	4,020	49.00	196,980.00	
GROUPE EUROTUNNEL SA	66,800	6.08	406,611.60	
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP	116,344	2.15	251,070.35	
RYANAIR HOLDINGS PLC	1,656	4.43	7,344.36	
TNT EXPRESS NV	40,593	9.25	375,485.25	
VOPAK	8,700	46.05	400,678.50	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	40,067	68.65	2,750,599.55	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE(BMW)AG-PFD	6,640	44.68	296,675.20	
CONTINENTAL AG	9,978	70.64	704,845.92	
DAIMLER AG	109,203	41.77	4,561,409.31	
FIAT INDUSTRIAL SPA	92,404	8.27	764,181.08	
FIAT SPA	88,416	4.14	366,219.07	
MICHELIN (CGDE)-B	21,825	54.23	1,183,569.75	
NOKIAN RENKAAT OYJ	13,483	36.19	487,949.77	
PIRELLI & C.	26,902	8.95	240,772.90	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PREF	18,365	43.50	798,877.50	
PSA PEUGEOT CITROEN	28,455	10.37	295,078.35	
RENAULT SA	23,025	37.35	860,098.87	
VOLKSWAGEN AG	3,357	118.85	398,979.45	
VOLKSWAGEN AG PFD	17,328	131.25	2,274,300.00	
ADIDAS AG	25,079	59.54	1,493,203.66	
CHRISTIAN DIOR SA	6,530	116.85	763,030.50	
LUXOTTICA GROUP SPA	15,130	26.63	402,911.90	
LVMH MOET HENNESSY LOUI V SA	30,578	129.90	3,972,082.20	
ACCOR SA	18,467	25.73	475,248.24	
AUTOGRILL SPA	12,900	7.54	97,266.00	
OPAP SA	31,906	6.68	213,132.08	
SODEXO	10,906	59.70	651,088.20	
AXEL SPRINGER AG	4,000	36.99	147,960.00	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	16,100	27.53	443,313.50	
JC DECAUX S.A.	7,300	22.58	164,834.00	
KABEL DEUTSCHLAND HOLDINGS AG	11,100	46.90	520,590.00	

LAGARDERE S.C.A.	14,271	21.98	313,747.93	
MEDIASET SPA	80,634	1.84	149,011.63	
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-PFD	10,000	19.18	191,800.00	
PUBLICIS GROUPE	16,750	41.17	689,681.25	
REED ELSEVIER NV	82,346	9.30	765,817.80	
SANOMA OYJ	10,500	8.40	88,252.50	
SES	37,196	18.59	691,659.62	
TELEVISION FRANCAISE (T.F.1)	13,876	8.43	117,085.68	
WOLTERS KLUWER-CVA	35,815	13.57	486,009.55	
INDITEX	26,203	70.82	1,855,696.46	
PPR	9,229	125.55	1,158,700.95	
CARREFOUR SA	67,333	16.17	1,089,111.27	
CASINO GUICHARD PERRACHON	6,860	71.70	491,862.00	
COLRUYT NV	8,445	30.02	253,518.90	
DELHAIZE GROUP	12,898	37.06	478,064.37	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	71,633	3.47	248,566.51	
JERONIMO MARTINS SGPS S.A.	26,900	15.39	413,991.00	
KESKO OYJ-B SHS	8,334	23.14	192,848.76	
KONINKLIJKE AHOLD NV	138,833	10.28	1,427,203.24	
METRO AG	16,048	25.80	414,038.40	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	96,504	54.70	5,278,768.80	
COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	25,629	13.33	341,634.57	
DANONE	69,765	50.86	3,548,247.90	
HEINEKEN HOLDING NV	13,839	35.40	489,900.60	
HEINEKEN NV	31,100	41.95	1,304,800.50	
KERRY GROUP PLC-A	17,898	33.45	598,688.10	
PERNOD-RICARD SA	24,174	76.90	1,858,980.60	
SUEDZUCKER AG	8,500	23.73	201,705.00	
UNILEVER NV-CVA	196,234	24.70	4,846,979.80	
BEIERSDORF AG	11,510	49.13	565,486.30	
HENKEL AG & CO KGAA	15,170	46.30	702,371.00	
HENKEL AG & CO KGAA	21,683	54.76	1,187,361.08	
L'OREAL	29,244	91.09	2,663,835.96	
CELESIO AG	11,704	13.07	153,029.80	
ESSILOR INTERNATIONAL	24,303	66.25	1,610,073.75	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	25,040	52.86	1,323,614.40	
FRESENIUS SE & CO KGAA	13,310	75.30	1,002,243.00	
BAYER AG	99,527	51.79	5,154,503.33	
ELAN CORPORATION PLC	66,166	10.45	691,434.70	
GRIFOLS S.A.	15,950	16.05	256,077.25	
MERCK KGAA	8,169	82.23	671,736.87	
ORION OYJ	10,798	14.59	157,542.82	
QIAGEN N.V.	27,800	11.49	319,422.00	
SANOFI	137,070	55.93	7,666,325.10	
UCB SA	11,247	34.12	383,803.87	
BANCA CARIGE S.P.A	84,000	0.88	74,004.00	

BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	553,414	0.28	156,892.86	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	559,615	5.50	3,080,120.96	
BANCO DE SABADELL SA	263,475	1.90	502,446.82	
BANCO ESPIRITO SANTO,S.A(BES)	72,900	1.04	76,107.60	
BANCO POPOLARE SPA	217,182	1.20	262,355.85	
BANCO POPULAR ESPANOL	125,047	2.50	312,867.59	
BANCO SANTANDER SA	1,033,113	5.23	5,403,180.99	
BANKIA SAU	111,000	2.62	291,708.00	
BANKINTER,S.A.	29,000	3.49	101,355.00	
BNP PARIBAS	116,122	32.07	3,724,613.15	
COMMERZBANK AG	450,990	1.71	773,898.84	
CREDIT AGRICOLE SA	114,158	4.11	469,874.32	
ERSTE GROUP BANK AG	22,583	16.41	370,587.03	
INTESA SANPAOLO	1,223,240	1.22	1,494,799.28	
INTESA SANPAOLO-RSP	108,503	1.06	115,013.18	
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	96,000	0.00	96.00	3
KBC GROUPE SA	20,101	15.05	302,620.55	
NATIXIS	120,051	2.52	302,768.62	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	5,550	24.12	133,866.00	
SOCIETE GENERALE	78,148	18.90	1,476,997.20	
UNICREDIT SPA	481,112	3.22	1,553,029.53	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	102,494	2.78	285,548.28	
AGEAS	268,000	1.52	408,432.00	
CAIXABANK	85,507	2.66	228,132.67	
DEUTSCHE BANK AG -REG	111,783	35.16	3,930,290.28	
DEUTSCHE BOERSE AG	23,917	49.32	1,179,706.02	
EURAZEO	3,570	37.55	134,053.50	
EXOR SPA	7,897	18.07	142,698.79	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	10,155	55.53	563,907.15	
ING GROEP NV-CVA	460,081	5.64	2,596,697.16	
MEDIOBANCA SPA	62,143	3.97	246,707.71	
POHJOLA BANK PLC	17,903	7.82	140,090.97	
AEGON NV	205,288	3.73	765,929.52	
ALLIANZ SE-REG	54,735	84.07	4,601,571.45	
ASSICURAZIONI GENERALI	140,673	10.73	1,509,421.29	
AXA SA	211,673	11.26	2,384,496.34	
CNP ASSURANCES	19,484	10.97	213,836.90	
DELTA LLOYD NV	12,600	12.16	153,279.00	
HANNOVER RUECKVERSICHERUNGS AG	7,300	44.00	321,236.50	
MAPFRE SA	93,649	2.36	221,292.58	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	21,511	111.55	2,399,552.05	
SAMPO OYJ-A SHS	51,254	21.00	1,076,334.00	
SCOR SE	21,658	19.81	429,153.27	
VIENNA INSURANCE GROUP AG WIENER VERSICH	4,800	31.50	151,200.00	
IMMOFINANZ AG	127,200	2.66	339,496.80	
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	37,050	14.07	521,478.75	

ATOS	5,781	43.37	250,721.97	
CAP GEMINI SA	18,704	31.53	589,830.64	
DASSAULT SYSTEMES SA	7,283	68.48	498,739.84	
INDRA SISTEMAS SA	11,428	8.39	95,903.77	
SAP AG	110,803	50.67	5,614,388.01	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	12,300	13.90	170,970.00	
ALCATEL-LUCENT	275,385	1.57	433,731.37	
NEOPOST SA	3,495	46.00	160,770.00	
NOKIA OYJ	454,780	3.03	1,380,712.08	
BELGACOM SA	17,881	23.60	422,081.00	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	335,660	8.73	2,930,311.80	
ELISA OYJ	17,422	15.70	273,525.40	
FRANCE TELECOM SA	221,401	10.38	2,299,249.38	
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	57,349	3.09	177,208.41	
ILIAD SA	2,500	100.05	250,125.00	
KONINKLIJKE KPN NV	177,458	7.73	1,373,347.46	
MOBISTAR SA	4,149	35.52	147,372.48	
PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	75,052	3.77	282,946.04	
TELECOM ITALIA SPA	1,107,901	0.82	916,234.12	
TELECOM ITALIA-RNC	712,811	0.68	488,275.53	
TELEFONICA S.A.	494,694	11.60	5,740,923.87	
TELEKOM AUSTRIA AG	43,354	8.60	373,147.87	
VIVENDI SA	150,175	12.85	1,929,748.75	
A2A S.P.A.	131,000	0.51	67,137.50	
ACCIONA S.A.	3,430	48.60	166,698.00	
E.ON AG	216,415	17.07	3,694,204.05	
EDP RENOVAVEIS SA	27,000	3.50	94,500.00	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	234,624	2.06	484,498.56	
ELECTRICITE DE FRANCE(EDF)	29,749	16.55	492,345.95	
ENAGAS	21,200	13.96	295,952.00	
ENEL GREEN POWER SPA	213,000	1.37	291,810.00	
ENEL SPA	800,395	2.49	1,992,983.55	
FORTUM OYJ	51,911	16.57	860,165.27	
GAS NATURAL SDG SA	39,546	11.24	444,497.04	
GDF SUEZ	147,898	18.36	2,715,407.28	
IBERDROLA SA	462,378	3.90	1,803,274.20	
RED ELECTRICA CORPORATION S.A.	13,200	32.70	431,706.00	
RWE AG	59,830	34.63	2,071,912.90	
RWE AG-NON VTG PFD	4,413	32.27	142,407.51	
SNAM SPA	197,376	3.47	684,894.72	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	33,900	10.52	356,797.50	
TERNA SPA	135,846	2.87	389,878.02	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	45,030	11.20	504,561.15	
VERBUND AG	7,470	21.79	162,808.65	
ASML HOLDING NV	51,852	37.14	1,926,042.54	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	132,349	7.54	998,308.50	

STMICROELECTRONICS NV	74,601	5.48	409,410.28	
ユーロ 小計	20,812,343		252,767,134.52	
(邦貨換算額)			(27,003,112,980)	(単位 : 円)
英ポンド				
AMEC PLC	40,935	10.97	449,056.95	
BG GROUP PLC	408,786	14.07	5,751,619.02	
BP PLC	2,282,750	4.44	10,154,813.37	
ESSAR ENERGY PLC	42,000	1.59	66,864.00	
PETROFAC LIMITED	31,900	17.20	548,680.00	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	438,713	21.25	9,322,651.25	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	320,566	21.74	6,969,104.84	
TULLOW OIL PLC	107,394	14.75	1,584,061.50	
ANGLO AMERICAN PLC	159,500	22.72	3,623,840.00	
ANTOFAGASTA PLC	46,670	11.40	532,038.00	
BHP BILLITON PLC	254,144	19.06	4,845,255.36	
EURASIAN NATURAL RESOURCES CORPORATION	28,187	5.85	165,034.88	
FRESNILLO PLC	22,000	16.15	355,300.00	
GLENORE INTERNATIONAL PLC	171,100	4.04	692,783.90	
JOHNSON MATTHEY PLC	26,901	23.59	634,594.59	
KAZAKHMYS PLC	25,600	8.96	229,504.00	
LONMIN PLC	18,656	10.07	187,865.92	
RANDGOLD RESOURCES LTD	10,742	56.10	602,626.20	
REXAM PLC	107,049	4.21	451,425.63	
RIO TINTO PLC	165,222	34.87	5,761,291.14	
VEDANTA RESOURCES PLC	14,200	12.13	172,246.00	
XSTRATA PLC	248,337	11.05	2,745,365.53	
BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC	43,100	8.35	359,885.00	
BAE SYSTEMS PLC	385,792	2.96	1,144,644.86	
BALFOUR BEATTY PLC	86,839	2.80	243,496.55	
BUNZL PLC	41,608	9.99	415,663.92	
COBHAM PLC	122,074	2.37	289,559.52	
INVENSYS PLC	99,258	1.96	194,545.68	
MEGGITT PLC	88,000	4.06	358,072.00	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	228,403	8.28	1,891,176.84	
SMITHS GROUP PLC	46,066	10.45	481,389.70	
WEIR GROUP PLC/THE	25,900	17.17	444,703.00	
WOLSELEY PLC	34,407	23.65	813,725.55	
AGGREKO PLC	32,193	22.26	716,616.18	
CAPITA PLC	75,599	7.34	554,896.66	
EXPERIAN PLC	121,694	9.93	1,209,029.89	
G4S PLC	161,927	2.84	461,330.02	
INTERTEK GROUP PLC	19,600	25.16	493,136.00	
SERCO GROUP PLC	59,528	5.47	325,618.16	
GKN PLC	177,000	2.03	359,841.00	
BURBERRY GROUP PLC	52,837	15.85	837,466.45	

CARNIVAL PLC	21,247	19.61	416,653.67	
COMPASS GROUP PLC	225,045	6.47	1,457,166.37	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	36,249	14.71	533,222.79	
TUI TRAVEL PLC	62,000	1.99	123,814.00	
WHITBREAD PLC	21,656	18.52	401,069.12	
BRITISH SKY BROADCASTING PLC	138,321	6.62	915,685.02	
ITV PLC	436,592	0.86	375,905.71	
PEARSON PLC	99,353	11.34	1,126,663.02	
REED ELSEVIER PLC	144,148	5.38	776,236.98	
WPP PLC	152,050	8.59	1,306,869.75	
KINGFISHER PLC	291,225	3.03	883,867.87	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	191,699	3.75	719,446.34	
NEXT PLC	20,794	29.80	619,661.20	
SAINSBURY (J) PLC	148,638	3.02	449,332.67	
TESCO PLC	966,101	3.25	3,148,040.10	
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	256,042	2.91	746,106.38	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	44,100	12.00	529,200.00	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	237,291	31.56	7,490,090.41	
DIAGEO PLC	300,657	15.37	4,621,098.09	
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	121,096	25.00	3,027,400.00	
SABMILLER PLC	114,714	25.38	2,911,441.32	
TATE & LYLE PLC	58,000	7.03	408,030.00	
UNILEVER PLC	154,307	20.14	3,107,742.98	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	73,918	35.20	2,601,913.60	
SMITH & NEPHEW PLC	111,283	6.12	681,608.37	
ASTRAZENECA PLC	156,791	28.07	4,401,123.37	
GLAXOSMITHKLINE PLC	608,033	14.20	8,634,068.60	
SHIRE PLC	67,463	19.52	1,316,877.76	
BARCLAYS PLC	1,389,018	2.23	3,103,760.72	
HSBC HOLDINGS PLC	2,150,961	5.48	11,787,266.28	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,915,412	0.31	1,568,753.73	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	2,080,673	0.25	540,142.71	
STANDARD CHARTERED PLC	286,782	15.18	4,354,784.67	
3I GROUP PLC	118,000	2.01	237,416.00	
ICAP PLC	71,716	3.76	269,795.59	
INVESTEC PLC	65,000	3.61	234,780.00	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	18,902	10.53	199,038.06	
MAN GROUP PLC	219,744	1.15	253,584.57	
SCHRODERS PLC	14,200	14.74	209,308.00	
ADMIRAL GROUP PLC	23,300	12.17	283,561.00	
AVIVA PLC	349,709	3.13	1,095,988.00	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	703,945	1.25	879,931.25	
OLD MUTUAL PLC	658,351	1.55	1,023,077.45	
PRUDENTIAL PLC	310,761	7.38	2,293,416.18	
RESOLUTION LTD	167,468	2.48	416,157.98	
RSA INSURANCE GROUP PLC	433,885	1.03	450,372.63	

STANDARD LIFE PLC	290,048	2.24	649,997.56	
SAGE GROUP PLC (THE)	167,463	2.95	494,853.16	
ARM HOLDINGS PLC	161,000	5.91	952,315.00	
BT GROUP PLC	931,771	2.19	2,045,237.34	
INMARSAT PLC	53,800	4.30	231,501.40	
VODAFONE GROUP PLC	6,057,697	1.69	10,292,027.20	
CENTRICA PLC	630,081	3.15	1,988,535.63	
INTERNATIONAL POWER PLC	191,253	4.02	770,367.08	
NATIONAL GRID PLC	426,167	6.47	2,757,300.49	
SEVERN TRENT PLC	27,494	15.70	431,655.80	
SSE PLC	112,308	13.39	1,503,804.12	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	82,091	6.00	492,956.45	
英ポンド 小計	35,240,990		172,982,840.60	
(邦貨換算額)			(22,370,140,946)	(単位 : 円)
スイスフラン				
TRANSOCEAN LTD	41,955	45.08	1,891,331.40	
GIVAUDAN-REG	992	895.00	887,840.00	
HOLCIM LTD-REG	29,555	57.60	1,702,368.00	
SIKA AG	242	1,910.00	462,220.00	
SYNGENTA AG	11,410	319.20	3,642,072.00	
ABB LTD	263,719	18.22	4,804,960.18	
GEBERIT AG-REG	4,810	184.30	886,483.00	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,540	108.10	274,574.00	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	5,750	110.20	633,650.00	
SULZER AG	2,850	122.50	349,125.00	
ADECCO SA-REG	16,534	45.50	752,297.00	
SGS SA	659	1,747.00	1,151,273.00	
KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	6,552	121.80	798,033.60	
CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-BR A	62,533	56.90	3,558,127.70	
THE SWATCH GROUP AG-B	3,701	427.00	1,580,327.00	
THE SWATCH GROUP AG-REG	5,400	74.35	401,490.00	
ARYZTA AG	9,800	43.15	422,870.00	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	230	852.50	196,075.00	
LINDT & SPRUENGLI AG	116	2,883.00	334,428.00	
LINDT & SPRUENGLI AG-REG	13	34,000.00	442,000.00	
NESTLE SA-REGISTERED	397,390	55.80	22,174,362.00	
SONOVA HOLDING AG	6,192	101.10	626,011.20	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	970	148.10	143,657.00	
SYNTHES INC	7,734	157.20	1,215,784.80	
ACTELION LTD	13,316	33.27	443,023.32	
LONZA GROUP AG-REG	5,487	42.90	235,392.30	
NOVARTIS AG-REG SHS	280,958	50.00	14,047,900.00	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	84,675	156.70	13,268,572.50	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	137,035	24.53	3,361,468.55	
GAM HOLDING LTD	23,073	12.95	298,795.35	

JULIUS BAER GROUP LTD	25,969	36.16	939,039.04	
PARGESA HOLDING SA-BR	3,100	61.35	190,185.00	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	1,700	173.20	294,440.00	
UBS AG-REGISTERED	438,608	11.80	5,175,574.40	
BALOISE HOLDING AG	5,470	70.85	387,549.50	
SWISS LIFE HOLDING AG	3,540	102.00	361,080.00	
SWISS RE LTD	41,737	57.15	2,385,269.55	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	17,773	219.50	3,901,173.50	
SWISSCOM AG-REG	2,746	340.20	934,189.20	
スイスフラン 小計	1,966,834		95,555,012.09	
(邦貨換算額)			(8,494,840,574)	(単位 : 円)
スウェーデンクローナ				
LUNDIN PETROLEUM AB	26,200	134.10	3,513,420.00	
BOLIDEN AB	34,500	105.00	3,622,500.00	
HOLMEN AB-B SHARES	6,133	178.20	1,092,900.60	
SSAB AB-A SHARES	18,042	61.00	1,100,562.00	
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	70,567	112.90	7,967,014.30	
ALFA LAVAL AB	39,252	139.20	5,463,878.40	
ASSA ABLOY AB-B	37,416	206.60	7,730,145.60	
ATLAS COPCO AB-A SHS	80,809	162.10	13,099,138.90	
ATLAS COPCO AB-B SHS	45,896	144.00	6,609,024.00	
HEXAGON AB-B SHS	28,400	130.80	3,714,720.00	
SANDVIK AB	120,654	93.50	11,281,149.00	
SCANIA AB-B SHS	38,532	136.60	5,263,471.20	
SKANSKA AB-B SHS	49,890	115.00	5,737,350.00	
SKF AB-B SHARES	48,438	159.30	7,716,173.40	
VOLVO AB-B SHS	167,894	90.60	15,211,196.40	
SECURITAS AB-B SHS	37,257	62.40	2,324,836.80	
ELECTROLUX AB-SER B	30,383	138.80	4,217,160.40	
HUSQVARNA AB-B SHS	51,983	39.15	2,035,134.45	
MODERN TIMES GROUP-B SHS	6,400	363.60	2,327,040.00	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	122,444	234.70	28,737,606.80	
SWEDISH MATCH AB	25,271	272.70	6,891,401.70	
GETINGE AB-B SHS	23,838	177.30	4,226,477.40	
NORDEA BANK AB	318,587	57.10	18,191,317.70	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A	170,423	45.21	7,704,823.83	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	59,016	210.00	12,393,360.00	
SWEDBANK AB - A SHARES	101,864	100.30	10,216,959.20	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	12,800	96.55	1,235,840.00	
INVESTOR AB-B SHS	54,949	142.40	7,824,737.60	
KINNEVIK INVESTMENT AB-B	23,800	148.90	3,543,820.00	
RATOS AB-B SHS	24,400	88.10	2,149,640.00	
ERICSSON LM-B SHS	364,069	66.50	24,210,588.50	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	8,850	736.50	6,518,025.00	
TELE2 AB -B SHS	36,598	131.60	4,816,296.80	

TELIASONERA AB	265,671	43.32	11,508,867.72	
スウェーデンクローナ 小計	2,551,226		260,196,577.70	
(邦貨換算額)			(3,127,562,863)	(単位 : 円)
ノルウェークローネ				
AKER SOLUTIONS ASA	20,600	92.70	1,909,620.00	
SEADRILL LID	39,501	214.50	8,472,964.50	
STATOIL ASA	133,306	150.50	20,062,553.00	
SUBSEA 7 SA	34,800	149.20	5,192,160.00	
NORSK HYDRO ASA	109,597	30.42	3,333,940.74	
YARA INTERNATIONAL ASA	22,812	274.00	6,250,488.00	
ORKLA ASA	94,550	43.27	4,091,178.50	
DNB ASA	118,019	70.55	8,326,240.45	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	24,200	67.70	1,638,340.00	
TELENOR ASA	86,692	103.60	8,981,291.20	
ノルウェークローネ 小計	684,077		68,258,776.39	
(邦貨換算額)			(959,035,808)	(単位 : 円)
デンマーククローネ				
NOVOZYMES A/S-B SHARES	28,515	159.50	4,548,142.50	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	21,462	50.55	1,084,904.10	
A P MOLLER - MAERSK A/S	165	42,480.00	7,009,200.00	
A P MOLLER-MAERSK A/S-A	67	40,400.00	2,706,800.00	
DSV A/S	23,480	125.20	2,939,696.00	
CARLSBERG AS-B	13,086	461.30	6,036,571.80	
COLOPLAST-B	2,581	980.00	2,529,380.00	
WILLIAM DEMANT HOLDING	2,860	546.00	1,561,560.00	
NOVO NORDISK A/S-B	51,233	825.50	42,292,841.50	
DANSKE BANK A/S	76,838	92.65	7,119,040.70	
TRYG A/S	3,368	313.00	1,054,184.00	
TDC A/S	61,300	39.96	2,449,548.00	
デンマーククローネ 小計	284,955		81,331,868.60	
(邦貨換算額)			(1,167,925,633)	(単位 : 円)
オーストラリアドル				
CALTEX AUSTRALIA LIMITED	18,000	13.65	245,700.00	
ORIGIN ENERGY LIMITED	129,659	13.27	1,720,574.93	
SANTOS LTD	112,611	14.00	1,576,554.00	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	77,388	34.22	2,648,217.36	
WORLEY PARSONS LIMITED	23,500	28.15	661,525.00	
ALUMINA LTD	276,977	1.18	328,217.74	
AMCOR LIMITED	144,377	7.50	1,082,827.50	
BHP BILLITON LTD	386,857	33.90	13,114,452.30	
BORAL LIMITED	94,596	3.81	360,410.76	
FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	146,000	5.68	829,280.00	
ILUKA RESOURCES LIMITED	50,400	17.27	870,408.00	

INCITEC PIVOT LTD	198,000	3.12	617,760.00	
JAMES HARDIE INDUSTRIES SE	56,003	7.72	432,343.16	
LYNAS CORPORATION LIMITED	235,000	1.03	242,050.00	
NEWCREST MINING LIMITED	92,679	28.97	2,684,910.63	
ORICA LIMITED	43,423	27.10	1,176,763.30	
OZ MINERALS LIMITED	38,746	9.39	363,824.94	
RIO TINTO LIMITED	52,191	64.46	3,364,231.86	
SIMS METAL MANAGEMENT LTD	18,995	14.63	277,896.85	
LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	19,905	20.78	413,625.90	
BRAMBLES LIMITED	175,132	7.10	1,243,437.20	
CAMPBELL BROTHERS LTD	8,300	64.94	539,002.00	
ASCIANO LTD	104,666	4.70	491,930.20	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	133,138	1.65	220,343.39	
QR NATIONAL LTD	209,000	3.60	752,400.00	
TOLL HOLDINGS LIMITED	83,620	5.73	479,142.60	
CROWN LTD	50,965	8.79	447,982.35	
ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD	79,545	4.46	354,770.70	
TABCORP HOLDINGS LIMITED	77,545	2.80	217,126.00	
TATTS GROUP LTD	174,000	2.45	426,300.00	
FAIRFAX MEDIA LTD	265,729	0.74	197,968.10	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	57,850	1.91	110,782.75	
METCASH LTD	92,000	3.91	359,720.00	
WESFARMERS LIMITED	119,846	29.26	3,506,693.96	
WOOLWORTHS LIMITED	147,048	25.59	3,762,958.32	
COCA-COLA AMATIL LIMITED	70,617	12.39	874,944.63	
COCHLEAR LIMITED	7,113	61.65	438,516.45	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	15,000	19.66	294,900.00	
SONIC HEALTHCARE LTD	43,226	12.46	538,595.96	
CSL LIMITED	64,014	35.80	2,291,701.20	
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	317,353	22.98	7,292,771.94	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	47,400	7.46	353,604.00	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	189,866	49.76	9,447,732.16	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	264,923	24.58	6,511,807.34	
WESTPAC BANKING CORPORATION	364,684	22.05	8,041,282.20	
ASX LTD	21,610	31.89	689,142.90	
MACQUARIE GROUP LTD	42,221	28.20	1,190,632.20	
AMP LIMITED	351,825	4.23	1,488,219.75	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	250,006	3.42	855,020.52	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	131,981	13.59	1,793,621.79	
SUNCORP GROUP LTD	155,981	8.10	1,263,446.10	
COMPUTERSHARE LIMITED	55,229	8.63	476,626.27	
TELSTRA CORPORATION LIMITED	526,987	3.37	1,775,946.19	
AGL ENERGY LIMITED	55,969	14.86	831,699.34	
APA GROUP	68,000	5.20	353,600.00	
オーストラリアドル 小計	7,037,696		92,925,942.74	
(邦貨換算額)			(7,865,251,793)	(単位 : 円)

ニュージーランドドル				
FLETCHER BUILDING LTD	81,457	6.15	500,960.55	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	130,557	2.47	323,128.57	
SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP	61,890	3.87	239,514.30	
TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	249,909	2.51	627,271.59	
CONTACT ENERGY LIMITED	36,256	4.83	175,116.48	
ニュージーランドドル 小計	560,069		1,865,991.49	
(邦貨換算額)			(125,618,547)	(単位 : 円)
香港ドル				
HUTCHISON WHAMPOA LTD	259,000	74.60	19,321,400.00	
NWS HOLDINGS LTD	160,500	11.78	1,890,690.00	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	143,000	22.65	3,238,950.00	
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	144,000	13.22	1,903,680.00	
MTR CORPORATION	182,500	26.85	4,900,125.00	
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	21,500	57.55	1,237,325.00	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	96,000	27.30	2,620,800.00	
SANDS CHINA LTD	298,000	30.45	9,074,100.00	
SHANGRI-LA ASIA LTD.	162,000	16.74	2,711,880.00	
SJM HOLDINGS LIMITED	213,000	16.20	3,450,600.00	
WYNN MACAU LTD	178,000	22.15	3,942,700.00	
LI & FUNG LTD	673,200	16.56	11,148,192.00	
LIFESTYLE INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED	73,000	19.08	1,392,840.00	
BANK OF EAST ASIA	180,020	28.75	5,175,575.00	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	431,500	22.45	9,687,175.00	
HANG SENG BANK LTD	89,000	101.60	9,042,400.00	
WING HANG BANK LIMITED	22,000	78.20	1,720,400.00	
FIRST PACIFIC COMPANY	280,000	9.03	2,528,400.00	
HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	124,300	129.00	16,034,700.00	
AIA GROUP LTD	1,022,000	27.30	27,900,600.00	
CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	165,000	97.05	16,013,250.00	
HANG LUNG GROUP LTD	110,000	49.45	5,439,500.00	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	304,000	28.75	8,740,000.00	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	111,000	43.70	4,850,700.00	
HOPEWELL HOLDINGS LTD	72,000	21.30	1,533,600.00	
HYSAN DEVELOPMENT CO	74,000	31.95	2,364,300.00	
KERRY PROPERTIES LTD	91,500	35.15	3,216,225.00	
NEW WORLD DEVELOPMENT	449,000	9.19	4,126,310.00	
SINO LAND CO	356,200	12.96	4,616,352.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	171,000	95.20	16,279,200.00	
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	84,000	86.75	7,287,000.00	
WHARF HOLDINGS LTD	187,000	42.15	7,882,050.00	
WHEELOCK&COMPANY LTD	107,000	24.05	2,573,350.00	
FOXCONN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	260,000	5.03	1,307,800.00	
PCCW LIMITED	510,000	2.83	1,443,300.00	

CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	61,000	45.80	2,793,800.00	
CLP HOLDINGS LTD	230,100	65.55	15,083,055.00	
HONG KONG & CHINA GAS	566,741	20.15	11,419,831.15	
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	170,000	57.00	9,690,000.00	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	20,900	113.20	2,365,880.00	
香港ドル 小計	8,852,961		267,948,035.15	
(邦貨換算額)			(2,794,698,006)	(単位：円)
シンガポールドル				
COSCO CORP SINGAPORE LTD	150,000	1.11	166,500.00	
FRASER & NEAVE LTD	104,000	6.69	695,760.00	
KEPPEL CORP LTD	173,400	11.24	1,949,016.00	
NOBLE GROUP LTD	474,400	1.33	630,952.00	
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	123,820	5.29	655,007.80	
SEMBCORP MARINE LTD	103,400	5.16	533,544.00	
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG	176,000	3.20	563,200.00	
YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	245,000	1.24	305,025.00	
COMFORTDELGRO CORP LTD	199,000	1.52	302,480.00	
NEPTUNE ORIENT LINES LTD	98,000	1.37	134,260.00	
SINGAPORE AIRLINES LTD	66,266	10.43	691,154.38	
GENTING SINGAPORE PLC	761,000	1.68	1,282,285.00	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	185,250	3.89	720,622.50	
CYCLE & CARRIAGE LTD	12,000	47.16	565,920.00	
OLAM INTERNATIONAL LTD	176,000	2.31	406,560.00	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	796,600	0.77	613,382.00	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	243,000	4.85	1,178,550.00	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	213,000	13.42	2,858,460.00	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	305,000	8.83	2,693,150.00	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	149,000	18.31	2,728,190.00	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	104,000	6.66	692,640.00	
CAPITALAND LTD	298,000	2.96	882,080.00	
CAPITAMALLS ASIA LTD	190,000	1.57	299,250.00	
CITY DEVELOPMENTS LTD	61,000	10.80	658,800.00	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LIMITED	213,000	2.17	462,210.00	
KEPPEL LAND LTD	90,000	3.35	301,500.00	
UOL GROUP LIMITED	62,000	4.66	288,920.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	959,015	3.11	2,982,536.65	
STARHUB LIMITED	55,000	3.16	173,800.00	
シンガポールドル 小計	6,786,151		26,415,755.33	
(邦貨換算額)			(1,715,439,151)	(単位：円)
イスラエルシュケル				
DELEK GROUP LTD	530	761.90	403,807.00	
ISRAEL CHEMICALS LIMITED	54,000	42.50	2,295,000.00	
ISRAEL CORPORATION LTD/THE	245	2,454.00	601,230.00	
ELBIT SYSTEMS LTD	3,000	142.50	427,500.00	

TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	113,123	165.80	18,755,793.40	
BANK HAPOALIM BM	122,000	14.09	1,718,980.00	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	136,000	11.74	1,596,640.00	
ISRAEL DISCOUNT BANK-A	113,700	4.99	567,817.80	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	16,000	33.70	539,200.00	
NICE SYSTEMS LTD	8,200	146.20	1,198,840.00	
BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD	203,000	5.83	1,183,490.00	
CELLCOM ISRAEL LTD	6,700	43.06	288,502.00	
PARTNER COMMUNICATIONS COMPANY LTD	11,000	26.48	291,280.00	
イスラエルシュケル 小計	787,498		29,868,080.20	
(邦貨換算額)			(646,345,255)	(単位 : 円)
合計	126,347,076		212,115,436,192	単位 : 円
(外貨建有価証券邦貨換算額合計)			(212,115,436,192)	(単位 : 円)

(注)

- 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券にかかるもので、内書きであります。
- 米ドル表示の株式については、561銘柄、信託財産純資産総額に対する比率56.6%、合計に対する比率58.4%です。
カナダドル表示の株式については、101銘柄、信託財産純資産総額に対する比率5.5%、合計に対する比率5.6%です。
ユーロ表示の株式については、244銘柄、信託財産純資産総額に対する比率12.3%、合計に対する比率12.7%です。
英ポンド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10.2%、合計に対する比率10.5%です。
スイスフラン表示の株式については、39銘柄、信託財産純資産総額に対する比率3.9%、合計に対する比率4.0%です。
スウェーデンクローナ表示の株式については、34銘柄、信託財産純資産総額に対する比率1.4%、合計に対する比率1.5%です。
ノルウェークローネ表示の株式については、10銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.4%、合計に対する比率0.5%です。
デンマーククローネ表示の株式については、12銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.5%、合計に対する比率0.6%です。
オーストラリアドル表示の株式については、55銘柄、信託財産純資産総額に対する比率3.6%、合計に対する比率3.7%です。
ニュージーランドドル表示の株式については、5銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.1%、合計に対する比率0.1%です。
香港ドル表示の株式については、40銘柄、信託財産純資産総額に対する比率1.3%、合計に対する比率1.3%です。
シンガポールドル表示の株式については、29銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.8%、合計に対する比率0.8%です。
イスラエルシュケル表示の株式については、13銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.3%、合計に対する比率0.3%です。
- 売買停止措置がとられている銘柄であって、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額としております。

(b) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	口数	評価額	備考
投資証券	米ドル			
	AMERICAN TOWER CORP	47,986	3,061,986.66	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	114,698	1,811,081.42	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,599	1,619,916.34	
	BOSTON PROPERTIES INC	18,166	1,853,113.66	
	DIGITAL REALTY TRUST INC	13,000	943,410.00	
	DUKE REALTY CORP	31,773	450,541.14	
	EQUITY RESIDENTIAL	35,655	2,157,840.60	
	FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	7,254	699,865.92	
	GENERAL GROWTH PROPERTIES	49,720	834,301.60	
	HCP,INC.	49,853	1,948,255.24	
	HEALTH CARE REIT INC	24,840	1,333,411.20	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	86,838	1,424,143.20	
	HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	592,000	438,080.00	
	KIMCO REALTY CORPORATION	49,732	911,587.56	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	14,665	522,074.00	
	MACERICH COMPANY/THE	16,339	950,603.02	
	PLUM CREEK TIMBER COMPANY	18,443	764,093.49	
	PROLOGIS INC	54,327	1,840,598.76	
	PUBLIC STORAGE	17,451	2,407,714.47	
	RAYONIER INC	14,000	609,840.00	
	REGENCY CENTERS CORP	11,400	491,682.00	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	35,330	5,148,640.90	
	VENTAS INC	35,220	1,975,489.80	
	VORNADO REALTY TRUST	20,243	1,640,290.29	
	米ドル 小計	1,370,532	35,838,561.27	
	(邦貨換算額)		(2,902,565,077)	(単位：円)
	カナダドル			
	H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	9,500	225,815.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	15,100	404,378.00	
	カナダドル 小計	24,600	630,193.00	
	(邦貨換算額)		(51,322,917)	(単位：円)
	ユーロ			
	CORIO NV	8,248	306,083.28	
	FONCIERE DES REGIONS	3,150	183,676.50	
	GECINA SA	2,880	207,561.60	
	ICADE	2,770	180,077.70	
	KLEPIERRE	12,332	316,130.82	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	11,169	1,617,829.65	
	ユーロ 小計	40,549	2,811,359.55	
	(邦貨換算額)		(300,337,540)	(単位：円)

	英ポンド			
	BRITISH LAND CO PLC	105,605	503,207.82	
	CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP PLC	64,855	210,000.49	
	HAMMERSON PLC	84,997	350,867.61	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	94,127	678,655.67	
	SEGRO PLC	86,434	204,070.67	
	英ポンド 小計	436,018	1,946,802.26	
	(邦貨換算額)		(251,760,468)	(単位：円)
	オーストラリアドル			
	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	213,612	393,046.08	
	DEXUS PROPERTY GROUP	610,804	543,615.56	
	GOODMAN GROUP-NEW	171,000	598,500.00	
	GPT GROUP	208,494	658,841.04	
	LEND LEASE GROUP	65,372	455,642.84	
	MIRVAC GROUP	389,710	463,754.90	
	SP AUSNET	155,000	164,300.00	
	STOCKLAND	275,614	810,305.16	
	SYDNEY AIRPORT	51,000	142,800.00	
	TRANSURBAN GROUP	158,032	884,979.20	
	WESTFIELD GROUP	266,227	2,326,823.98	
	WESTFIELD RETAIL TRUST	339,993	880,581.87	
	オーストラリアドル 小計	2,904,858	8,323,190.63	
	(邦貨換算額)		(704,474,854)	(単位：円)
	香港ドル			
	HKT TRUST AND HKT LTD NEW	11,086	67,846.32	
	LINK REIT	272,500	8,011,500.00	
	香港ドル 小計	283,586	8,079,346.32	
	(邦貨換算額)		(84,267,582)	(単位：円)
	シンガポールドル			
	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	223,000	446,000.00	
	CAPITAMALL TRUST	280,000	501,200.00	
	シンガポールドル 小計	503,000	947,200.00	
	(邦貨換算額)		(61,511,168)	(単位：円)
	合計		4,356,239,606	単位：円
	(外貨建有価証券邦貨換算額合計)		(4,356,239,606)	(単位：円)

(注)

1. 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券にかかるもので、内書きであります。
2. 米ドル表示の投資証券については、24銘柄、信託財産純資産総額に対する比率1.3%、合計に対する比率66.6%です。
カナダドル表示の投資証券については、2銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.0%、合計に対する比率1.2%です。
ユーロ表示の投資証券については、6銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.1%、合計に対する比率6.9%です。

英ポンド表示の投資証券については、5銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.1%、合計に対する比率5.8%です。

オーストラリアドル表示の投資証券については、12銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.3%、合計に対する比率16.2%です。

香港ドル表示の投資証券については、2銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.0%、合計に対する比率1.9%です。

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

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

「外国債券パッシブ・マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

対象年月日	(平成23年4月13日現在)	(平成24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	1,161,738,581	3,242,880,891
コール・ローン	652,878,598	1,178,688,095
国債証券	259,537,988,320	245,124,630,662
未収利息	3,431,191,043	2,912,044,379
前払費用	182,805,635	97,919,956
流動資産合計	264,966,602,177	252,556,163,983
資産合計	264,966,602,177	252,556,163,983
負債の部		
流動負債		
未払解約金	89,607,454	6,909,514
流動負債合計	89,607,454	6,909,514
負債合計	89,607,454	6,909,514
純資産の部		
元本等		
元本		
元本	228,852,611,475	217,156,318,934
剰余金		
剰余金又は欠損金()	36,024,383,248	35,392,935,535
元本等合計	264,876,994,723	252,549,254,469
純資産合計	264,876,994,723	252,549,254,469
負債純資産合計	264,966,602,177	252,556,163,983

(注) 「外国債券パッシブ・マザーファンド」は、毎年12月17日(ただし、休業日の場合は翌営業日)に決算を行います。上記の貸借対照表は平成23年4月13日ならびに平成24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

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成23年4月14日 至平成24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。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。

(追加情報)

自平成23年4月14日 至平成24年4月13日
当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成23年4月13日現在)	(平成24年4月13日現在)
1. 受益権総数	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	平成24年4月13日現在における受益権の 総数 217,156,318,934口
2. 1単位当たり純資産額	1.1574円 (1万口 = 11,574円)	1.1630円 (1万口 = 11,630円)

（金融商品に関する注記）

. 金融商品の状況に関する事項

項目	自平成22年4月14日 至平成23年4月13日	自平成23年4月14日 至平成24年4月13日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。当ファンドにおけるデリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>	<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>

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

金融商品の時価等に関する事項

項目	（平成23年4月13日現在）	（平成24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） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<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。

（平成24年4月13日現在）

平成24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。

（自 平成23年4月14日 至 平成24年4月13日）

該当事項はありません。

(その他の注記)

(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

(平成24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	228,852,611,475円
同期中における追加設定元本額	14,006,743,946円
同期中における一部解約元本額	25,703,036,487円
平成24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	2,940,352,240円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	218,447,260円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	619,539,465円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	291,157,739円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	31,332,999円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	4,474,872円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	4,942,862円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	3,666,600円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	4,103,305円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	3,494,230円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	2,173,257円
SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定>	2,784,286,156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>	11,756,880,190円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	36,977,049,946円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	11,433,567,140円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	24,430,597,098円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	85,985,806円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	176,913,226円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	42,758,003円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	1,346,639,758円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	181,037,481円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	2,230,337,710円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	2,962,479,291円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	6,963,939,734円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	15,088,463,167円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,242,006,429円
SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	23,246,322,516円
三井住友・外国債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	2,099,565,852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)	10,047,273,025円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	414,204,825円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	10,806,443,520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)	42,215,328,702円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	294,003,741円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	90,136,498円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	22,868,534円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	383,390,593円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	1,344,668,843円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	382,724,925円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	344,139,271円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	91,396,793円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	13,193,042円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	3,260,134,903円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T2<適格機関投資家専用>	89,443,849円
SMAM・FG新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定>	127,132,965円
SMAM・FGグローバルバランス25VA<適格機関投資家限定>	57,320,573円
合計	217,156,318,934円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル			
	US T 0.125% 13/08/31	5,000,000.00	4,991,015.65	
	US T 0.125% 130930	8,500,000.00	8,482,734.37	
	US T 0.25% 13/10/31	9,000,000.00	8,997,890.67	
	US T 0.25% 13/11/30	3,000,000.00	2,998,593.75	
	US T 0.25% 14/09/15	6,000,000.00	5,983,125.00	
	US T 0.25% 14/12/15	7,000,000.00	6,974,296.91	
	US T 0.25% 15/01/15	13,000,000.00	12,946,171.94	
	US T 0.375% 13/07/31	5,000,000.00	5,007,812.50	
	US T 0.375% 130630	8,000,000.00	8,012,500.00	
	US T 0.375% 14/11/15	9,000,000.00	8,997,187.50	
	US T 0.375% 15/03/15	4,000,000.00	3,993,750.00	
	US T 0.5% 13/10/15	5,000,000.00	5,017,578.15	
	US T 0.5% 13/11/15	7,000,000.00	7,024,609.41	
	US T 0.5% 14/08/15	8,000,000.00	8,028,125.04	
	US T 0.5% 14/10/15	10,000,000.00	10,031,250.00	
	US T 0.625% 13/02/28	5,000,000.00	5,018,359.40	
	US T 0.625% 140715	7,000,000.00	7,044,296.91	
	US T 0.75% 13/08/15	8,000,000.00	8,053,125.04	
	US T 0.75% 13/09/15	6,000,000.00	6,041,250.00	
	US T 0.75% 13/12/15	7,000,000.00	7,054,140.66	
	US T 0.75% 140615	9,000,000.00	9,081,562.50	
	US T 0.875% 16/12/31	11,000,000.00	11,017,187.50	
	US T 0.875% 170131	10,000,000.00	10,007,031.30	
	US T 1 14/01/15	3,000,000.00	3,037,265.64	
	US T 1% 13/07/15	8,000,000.00	8,076,250.00	
	US T 1% 14/05/15	11,000,000.00	11,157,265.68	
	US T 1% 16/08/31	8,000,000.00	8,081,875.04	
	US T 1% 16/09/30	5,000,000.00	5,048,437.50	
	US T 1% 16/10/31	4,000,000.00	4,035,937.52	
	US T 1.125% 2013/06/15	6,000,000.00	6,061,875.00	
	US T 1.25% 14/02/15	4,000,000.00	4,070,000.00	
	US T 1.25% 14/03/15	6,000,000.00	6,109,687.50	
	US T 1.25% 14/04/15	5,000,000.00	5,094,140.65	
	US T 1.25% 15/08/31	8,000,000.00	8,189,375.04	
	US T 1.25% 15/09/30	7,000,000.00	7,165,703.16	
	US T 1.25% 15/10/31	5,000,000.00	5,116,796.90	
	US T 1.375% 13/02/15	10,000,000.00	10,097,656.30	

	US T 1.375% 13/03/15	8,000,000.00	8,085,625.04	
	US T 1.375% 13/05/15	8,000,000.00	8,100,000.00	
	US T 1.375% 15/11/30	5,000,000.00	5,139,062.50	
	US T 1.375% 18/09/30	7,500,000.00	7,537,500.00	
	US T 1.375% 18/11/30	5,000,000.00	5,011,328.15	
	US T 1.375% 190228	14,000,000.00	13,972,656.32	
	US T 1.5% 13/12/31	7,000,000.00	7,144,921.91	
	US T 1.5% 16/07/31	8,000,000.00	8,253,125.04	
	US T 1.5% 160630	7,000,000.00	7,221,484.41	
	US T 1.5% 18/08/31	2,000,000.00	2,027,031.26	
	US T 1.75% 13/04/15	10,000,000.00	10,153,125.00	
	US T 1.75% 14/01/31	6,500,000.00	6,669,609.37	
	US T 1.75% 14/03/31	8,000,000.00	8,227,500.00	
	US T 1.75% 15/7/31	5,000,000.00	5,201,562.50	
	US T 1.75% 160531	3,000,000.00	3,126,562.50	
	US T 1.75% 18/10/31	6,000,000.00	6,163,125.00	
	US T 1.875% 14/02/28	6,000,000.00	6,176,718.78	
	US T 1.875% 14/04/30	8,000,000.00	8,254,375.04	
	US T 1.875% 17/08/31	3,000,000.00	3,134,531.25	
	US T 1.875% 17/09/30	6,000,000.00	6,264,375.00	
	US T 1.875% 17/10/31	6,000,000.00	6,261,093.78	
	US T 1.875% 2015/06/30	7,000,000.00	7,307,890.66	
	US T 11.25% 15/02/15	2,000,000.00	2,608,593.76	
	US T 2% 13/11/30	7,000,000.00	7,194,140.66	
	US T 2% 16/01/31	7,000,000.00	7,359,843.75	
	US T 2% 21/11/15	3,000,000.00	2,997,187.50	
	US T 2% 220215	3,000,000.00	2,986,171.89	
	US T 2.125 15/12/31	3,000,000.00	3,168,046.89	
	US T 2.125% 14/11/30	10,500,000.00	10,975,781.25	
	US T 2.125% 16/02/29	3,000,000.00	3,169,687.50	
	US T 2.125% 2015/05/31	8,000,000.00	8,409,375.04	
	US T 2.125% 21/08/15	11,000,000.00	11,152,109.43	
	US T 2.25% 14/05/31	7,000,000.00	7,286,015.66	
	US T 2.25% 15/01/31	10,000,000.00	10,508,593.80	
	US T 2.25% 17/11/30	4,000,000.00	4,255,312.52	
	US T 2.25% 18/07/31	4,000,000.00	4,241,250.00	
	US T 2.375% 14/08/31	8,000,000.00	8,379,375.04	
	US T 2.375% 14/09/30	10,000,000.00	10,489,843.80	
	US T 2.375% 14/10/31	8,000,000.00	8,402,500.00	
	US T 2.375% 15/02/28	9,000,000.00	9,496,406.25	
	US T 2.375% 16/03/31	5,500,000.00	5,864,375.00	
	US T 2.375% 17/7/31	5,000,000.00	5,355,468.75	
	US T 2.375% 180630	2,000,000.00	2,137,343.76	
	US T 2.5% 13/03/31	4,500,000.00	4,598,789.08	
	US T 2.5% 15/03/31	9,000,000.00	9,542,812.50	
	US T 2.5% 15/04/30	10,000,000.00	10,617,968.80	

	US T 2.50% 2017/06/30	5,000,000.00	5,387,500.00	
	US T 2.625% 14/06/30	9,000,000.00	9,456,328.17	
	US T 2.625% 14/07/31	6,000,000.00	6,313,593.78	
	US T 2.625% 16/02/29	5,000,000.00	5,377,734.40	
	US T 2.625% 16/04/30	5,000,000.00	5,385,546.90	
	US T 2.625% 18/01/31	4,000,000.00	4,338,437.52	
	US T 2.625% 18/04/30	4,000,000.00	4,338,750.00	
	US T 2.625% 20/11/15	18,000,000.00	19,196,718.84	
	US T 2.625% 20/8/15	15,000,000.00	16,027,734.45	
	US T 2.625% 2014/12/31	8,000,000.00	8,478,125.04	
	US T 2.75 17/12/31	4,000,000.00	4,367,500.00	
	US T 2.75% 13/02/28	3,700,000.00	3,782,382.83	
	US T 2.75% 13/10/31	5,500,000.00	5,710,546.87	
	US T 2.75% 16/11/30	7,000,000.00	7,608,671.91	
	US T 2.75% 19/02/15	9,000,000.00	9,812,812.50	
	US T 2.75% 2017/05/31	7,000,000.00	7,632,734.41	
	US T 2.875% 13/01/31	4,000,000.00	4,085,312.52	
	US T 2.875% 18/03/31	4,000,000.00	4,397,187.52	
	US T 3% 16/08/31	7,000,000.00	7,670,468.75	
	US T 3% 16/09/30	7,000,000.00	7,678,125.00	
	US T 3% 17/02/28	7,000,000.00	7,706,562.50	
	US T 3.125% 13/04/30	4,500,000.00	4,636,054.71	
	US T 3.125% 13/08/31	5,500,000.00	5,716,992.21	
	US T 3.125% 13/09/30	6,500,000.00	6,771,679.72	
	US T 3.125% 16/10/31	6,000,000.00	6,617,812.50	
	US T 3.125% 17/01/31	7,000,000.00	7,741,015.66	
	US T 3.125% 17/04/30	7,000,000.00	7,757,421.91	
	US T 3.125% 19/05/15	10,000,000.00	11,142,187.50	
	US T 3.125% 21/05/15	11,000,000.00	12,136,953.18	
	US T 3.125% 41/11/15	2,000,000.00	1,970,000.00	
	US T 3.125% 420215	3,000,000.00	2,951,250.00	
	US T 3.25% 16/05/31	4,000,000.00	4,412,812.52	
	US T 3.25% 16/06/30	6,000,000.00	6,623,437.50	
	US T 3.25% 16/07/31	5,000,000.00	5,529,687.50	
	US T 3.25% 17/03/31	4,000,000.00	4,455,000.00	
	US T 3.25% 2016/12/31	6,000,000.00	6,665,625.00	
	US T 3.375% 13/06/30	5,000,000.00	5,189,843.75	
	US T 3.375% 13/07/31	5,500,000.00	5,722,578.12	
	US T 3.375% 19/11/15	11,000,000.00	12,434,296.93	
	US T 3.5% 13/05/31	5,000,000.00	5,184,375.00	
	US T 3.5% 18/02/15	8,500,000.00	9,632,890.62	
	US T 3.5% 20/05/15	12,500,000.00	14,235,351.62	
	US T 3.5% 39/02/15	6,000,000.00	6,395,625.00	
	US T 3.625% 13/05/15	3,650,000.00	3,784,308.61	
	US T 3.625% 19/08/15	9,000,000.00	10,337,343.75	
	US T 3.625% 20/02/15	14,000,000.00	16,081,406.32	

	US T 3.625% 21/02/15	13,000,000.00	14,907,343.75	
	US T 3.75% 18/11/15	7,000,000.00	8,085,546.91	
	US T 3.75% 41/08/15	5,000,000.00	5,543,750.00	
	US T 3.875% 13/02/15	3,800,000.00	3,916,671.89	
	US T 3.875% 18/05/15	6,000,000.00	6,950,625.00	
	US T 3.875% 40/8/15	11,000,000.00	12,482,421.93	
	US T 4% 14/02/15	6,500,000.00	6,941,289.09	
	US T 4% 18/08/15	6,000,000.00	7,018,593.78	
	US T 4% 2015/02/15	7,700,000.00	8,471,203.12	
	US T 4.125 15/05/15	4,200,000.00	4,669,218.75	
	US T 4.25% 13/08/15	7,000,000.00	7,373,515.66	
	US T 4.25% 13/11/15	6,900,000.00	7,333,406.25	
	US T 4.25% 14/08/15	5,400,000.00	5,888,531.25	
	US T 4.25% 14/11/15	6,100,000.00	6,704,757.84	
	US T 4.25% 17/11/15	5,000,000.00	5,864,062.50	
	US T 4.25% 39/05/15	7,000,000.00	8,453,593.75	
	US T 4.25% 40/11/15	11,000,000.00	13,279,921.93	
	US T 4.375% 38/02/15	4,200,000.00	5,168,625.00	
	US T 4.375% 39/11/15	9,000,000.00	11,087,578.17	
	US T 4.375% 40/05/15	11,000,000.00	13,550,625.00	
	US T 4.375% 41/05/15	6,000,000.00	7,392,187.50	
	US T 4.5 15/11/15	5,800,000.00	6,604,296.90	
	US T 4.5% 160215	4,400,000.00	5,040,750.00	
	US T 4.5% 17/05/15	3,000,000.00	3,531,562.50	
	US T 4.5% 36/02/15	3,500,000.00	4,375,820.33	
	US T 4.5% 38/05/15	4,500,000.00	5,645,390.62	
	US T 4.5% 39/08/15	4,000,000.00	5,023,437.52	
	US T 4.625% 16/11/15	5,200,000.00	6,089,687.50	
	US T 4.625% 17/02/15	3,000,000.00	3,533,437.50	
	US T 4.625% 40/02/15	7,000,000.00	8,961,093.75	
	US T 4.75% 14/05/15	6,400,000.00	6,988,000.00	
	US T 4.75% 17/08/15	5,000,000.00	5,975,390.65	
	US T 4.75% 37/02/15	4,000,000.00	5,184,687.52	
	US T 4.75% 41/02/15	11,000,000.00	14,361,015.68	
	US T 4.875% 16/08/15	4,900,000.00	5,762,859.37	
	US T 5% 37/05/15	2,000,000.00	2,685,468.76	
	US T 5.125% 16/05/15	5,700,000.00	6,717,984.37	
	US T 5.25% 28/11/15	2,000,000.00	2,665,937.50	
	US T 5.25% 29/02/15	2,000,000.00	2,671,406.26	
	US T 5.375% 31/02/15	3,020,000.00	4,148,253.12	
	US T 5.5% 28/08/15	2,000,000.00	2,729,531.26	
	US T 6% 26/02/15	1,000,000.00	1,403,203.13	
	US T 6.125% 27/11/15	1,000,000.00	1,439,609.38	
	US T 6.125% 29/08/15	1,100,000.00	1,610,726.56	
	US T 6.25% 23/08/15	3,500,000.00	4,916,953.12	
	US T 6.25% 30/05/15	3,000,000.00	4,481,250.00	

	US T 6.5% 26/11/15	1,000,000.00	1,473,828.13	
	US T 6.625% 27/02/15	2,000,000.00	2,987,187.50	
	US T 6.75% 26/08/15	1,000,000.00	1,501,875.00	
	US T 6.875% 25/08/15	2,000,000.00	3,003,281.26	
	US T 7.125% 23/02/15	1,400,000.00	2,079,546.88	
	US T 7.25% 16/05/15	4,000,000.00	5,054,687.52	
	US T 7.25% 22/08/15	2,500,000.00	3,717,968.75	
	US T 7.5% 16/11/15	2,400,000.00	3,124,687.51	
	US T 7.5% 24/11/15	1,000,000.00	1,560,468.75	
	US T 7.625% 25/02/15	2,000,000.00	3,158,437.50	
	US T 7.875% 21/02/15	2,000,000.00	3,002,500.00	
	US T 8% 21/11/15	2,800,000.00	4,302,156.26	
	US T 8.125% 21/05/15	1,000,000.00	1,530,078.13	
	US T 8.75% 17/05/15	3,000,000.00	4,170,234.39	
	US T 8.75% 20/08/15	1,000,000.00	1,553,671.88	
	US T 8.875% 17/08/15	2,000,000.00	2,824,687.50	
	US T 8.875% 190215	2,100,000.00	3,142,125.00	
	米ドル 小計	1,151,870,000.00	1,253,473,424.14	
	(邦貨換算額)		(101,518,812,621)	(単位 : 円)
	カナダドル			
	CAN 1.5% 12/12/01	3,000,000.00	3,008,310.00	
	CAN 1.5% 170301	2,000,000.00	1,993,800.00	
	CAN 1.75% 2013/03/01	4,000,000.00	4,023,000.00	
	CAN 2% 14/03/01	3,000,000.00	3,042,870.00	
	CAN 2% 14/12/01	4,000,000.00	4,068,880.00	
	CAN 2% 16/06/01	2,000,000.00	2,038,840.00	
	CAN 2.5% 13/09/01	2,000,000.00	2,036,480.00	
	CAN 2.5% 2015/06/01	2,000,000.00	2,067,340.00	
	CAN 2.75% 16/09/01	2,000,000.00	2,103,040.00	
	CAN 3% 14/06/01	4,500,000.00	4,665,105.00	
	CAN 3% 15/12/01	3,000,000.00	3,162,960.00	
	CAN 3.25% 21/06/01	3,000,000.00	3,298,500.00	
	CAN 3.5% 13/06/01	4,500,000.00	4,619,925.00	
	CAN 3.5% 20/06/01	3,000,000.00	3,352,140.00	
	CAN 3.75% 19/06/01	4,000,000.00	4,518,400.00	
	CAN 4% 16/06/01	3,000,000.00	3,297,180.00	
	CAN 4% 17/06/01	2,000,000.00	2,234,620.00	
	CAN 4% 41/06/01	4,000,000.00	5,138,000.00	
	CAN 4.25% 18/06/01	2,500,000.00	2,869,000.00	
	CAN 4.5% 15/06/01	2,000,000.00	2,189,160.00	
	CAN 5% 14/06/01	2,500,000.00	2,696,275.00	
	CAN 5% 37/06/01	4,000,000.00	5,736,840.00	
	CAN 5.25% 13/06/01	2,000,000.00	2,092,340.00	
	CAN 5.75% 29/06/01	2,800,000.00	4,075,568.00	
	CAN 5.75% 33/06/01	3,000,000.00	4,540,620.00	

	CAN 8% 23/06/01	1,400,000.00	2,198,420.00	
	CAN 8% 27/06/01	1,000,000.00	1,710,130.00	
	CAN 9% 25/06/01	1,480,000.00	2,599,708.80	
	カナダドル 小計	77,680,000.00	89,377,451.80	
	(邦貨換算額)		(7,278,899,674)	(単位：円)
	メキシコペソ			
	MEX BONOS 8% 200611	50,000,000.00	57,095,900.00	
	MEX BONOS 8.5% 290531	50,000,000.00	57,916,050.00	
	MEX BONOS 8.5% 381118	65,000,000.00	72,598,240.00	
	MEX BONOS 9% 121220	70,000,000.00	72,172,940.00	
	MEX BONOS 9.5% 141218	80,000,000.00	89,764,400.00	
	メキシコペソ 小計	315,000,000.00	349,547,530.00	
	(邦貨換算額)		(2,170,690,161)	(単位：円)
	ユーロ			
	BGB 2.75% 16/03/28	2,000,000.00	2,064,600.00	
	BGB 3.25% 16/09/28	3,500,000.00	3,668,000.00	
	BGB 3.5% 15/03/28	1,500,000.00	1,583,970.00	
	BGB 3.5% 17/06/28	2,000,000.00	2,105,260.00	
	BGB 3.75% 15/09/28	3,300,000.00	3,523,740.00	
	BGB 3.75% 20/09/28	4,000,000.00	4,181,600.00	
	BGB 4% 13/03/28	2,800,000.00	2,889,264.00	
	BGB 4% 14/03/28	3,200,000.00	3,372,576.00	
	BGB 4% 17/03/28	2,500,000.00	2,697,750.00	
	BGB 4% 18/03/28	2,500,000.00	2,690,750.00	
	BGB 4% 19/03/28	3,000,000.00	3,218,700.00	
	BGB 4% 2022/03/28	3,000,000.00	3,162,510.00	
	BGB 4.25% 13/09/28	3,000,000.00	3,144,840.00	
	BGB 4.25% 14/09/28	2,500,000.00	2,673,950.00	
	BGB 4.25% 2041/03/28	2,000,000.00	2,109,160.00	
	BGB 4.25% 21/09/28	3,000,000.00	3,221,250.00	
	BGB 4.5% 26/03/28	1,000,000.00	1,094,770.00	
	BGB 5% 35/03/28	3,000,000.00	3,496,350.00	
	BGB 5.5% 17/09/28	1,740,000.00	2,004,915.00	
	BGB 5.5% 28/03/28	4,000,000.00	4,847,320.00	
	BGB 8% 15/03/28	2,000,000.00	2,369,260.00	
	BKO 1.5% 13/03/15	5,000,000.00	5,064,600.00	
	BTNS 1.75% 170225	2,000,000.00	2,003,500.00	
	BTNS 2% 13/09/25	2,500,000.00	2,557,625.00	
	BTNS 2% 15/07/12	5,000,000.00	5,151,250.00	
	BTNS 2.25% 16/02/25	4,000,000.00	4,137,880.00	
	BTNS 2.5% 14/01/12	6,500,000.00	6,723,925.00	
	BTNS 2.5% 15/01/15	4,500,000.00	4,702,725.00	
	BTNS 2.5% 16/07/25	3,600,000.00	3,749,940.00	
	BTNS 3% 14/07/12	5,500,000.00	5,785,065.00	

	BTNS 4.5% 13/07/12	5,500,000.00	5,783,800.00	
	BTPS 2% 13/06/01	4,000,000.00	3,974,720.00	
	BTPS 2.25% 13/11/01	3,000,000.00	2,973,990.00	
	BTPS 3 14/04/01	4,000,000.00	3,986,120.00	
	BTPS 3% 15/04/15	5,000,000.00	4,895,400.00	
	BTPS 3% 15/06/15	4,000,000.00	3,912,000.00	
	BTPS 3% 15/11/01	4,000,000.00	3,888,800.00	
	BTPS 3.5% 14/06/01	5,000,000.00	5,010,400.00	
	BTPS 3.75% 13/12/15	5,000,000.00	5,059,150.00	
	BTPS 3.75% 15/08/01	6,200,000.00	6,188,964.00	
	BTPS 3.75% 16/04/15	3,000,000.00	2,962,290.00	
	BTPS 3.75% 16/08/01	6,000,000.00	5,901,300.00	
	BTPS 3.75% 21/03/01	6,000,000.00	5,426,580.00	
	BTPS 3.75% 21/08/01	6,300,000.00	5,648,139.00	
	BTPS 4% 17/02/01	6,000,000.00	5,911,500.00	
	BTPS 4% 20/09/01	5,500,000.00	5,116,375.00	
	BTPS 4% 37/02/01	6,500,000.00	5,035,745.00	
	BTPS 4.25 13/08/01	5,810,000.00	5,917,659.30	
	BTPS 4.25 19/02/01	5,400,000.00	5,230,602.00	
	BTPS 4.25% 13/04/15	4,500,000.00	4,578,885.00	
	BTPS 4.25% 14/07/01	1,300,000.00	1,321,840.00	
	BTPS 4.25% 14/08/01	6,900,000.00	7,007,157.00	
	BTPS 4.25% 15/02/01	5,000,000.00	5,082,900.00	
	BTPS 4.25% 19/09/01	7,000,000.00	6,716,500.00	
	BTPS 4.25% 20/03/01	5,000,000.00	4,767,400.00	
	BTPS 4.5% 18/02/01	6,000,000.00	5,945,580.00	
	BTPS 4.5% 18/08/01	5,000,000.00	4,929,000.00	
	BTPS 4.5% 19/03/01	6,000,000.00	5,880,300.00	
	BTPS 4.5% 20/02/01	5,500,000.00	5,332,415.00	
	BTPS 4.5% 26/03/01	3,000,000.00	2,672,490.00	
	BTPS 4.75% 16/09/15	4,500,000.00	4,574,610.00	
	BTPS 4.75% 21/09/01	6,000,000.00	5,794,680.00	
	BTPS 4.75% 23/08/01	5,500,000.00	5,175,390.00	
	BTPS 5% 25/03/01	5,000,000.00	4,731,500.00	
	BTPS 5% 34/08/01	4,970,000.00	4,406,153.50	
	BTPS 5% 39/08/01	4,000,000.00	3,493,400.00	
	BTPS 5% 40/09/01	5,000,000.00	4,351,650.00	
	BTPS 5.25 17/08/01	5,000,000.00	5,147,650.00	
	BTPS 5.25% 29/11/01	7,200,000.00	6,766,344.00	
	BTPS 5.5% 22/09/01	2,000,000.00	2,001,700.00	
	BTPS 5.75% 33/02/01	3,700,000.00	3,603,430.00	
	BTPS 6% 31/05/01	6,900,000.00	6,917,112.00	
	BTPS 6.5% 27/11/01	5,960,000.00	6,291,078.00	
	BTPS 7.25% 26/11/01	2,000,000.00	2,277,060.00	
	BTPS 9.00% 23/11/01	3,000,000.00	3,777,000.00	
	BUNDES Obliga 2% 16/02/26	3,000,000.00	3,179,850.00	

	BUNDESSCHA 1.75% 130614	3,000,000.00	3,057,510.00	
	BUNDESSCHATZ 0.75% 130913	1,700,000.00	1,715,589.00	
	DBR 2.25% 20/09/04	4,000,000.00	4,249,200.00	
	DBR 2.25% 21/09/04	3,000,000.00	3,154,110.00	
	DBR 2.5% 21/01/04	4,000,000.00	4,320,400.00	
	DBR 3% 20/07/04	7,000,000.00	7,855,260.00	
	DBR 3.25% 15/07/04	5,500,000.00	6,019,585.00	
	DBR 3.25% 20/01/04	5,500,000.00	6,275,500.00	
	DBR 3.25% 21/07/04	5,000,000.00	5,702,750.00	
	DBR 3.25% 42/07/04	2,000,000.00	2,351,100.00	
	DBR 3.5% 160104	5,200,000.00	5,794,256.00	
	DBR 3.5% 19/07/04	5,000,000.00	5,782,900.00	
	DBR 3.75% 13/07/04	5,800,000.00	6,056,940.00	
	DBR 3.75% 15/01/04	6,000,000.00	6,572,880.00	
	DBR 3.75% 17/01/04	5,000,000.00	5,716,500.00	
	DBR 3.75% 19/01/04	6,000,000.00	7,023,300.00	
	DBR 4% 18/01/04	6,000,000.00	7,036,680.00	
	DBR 4% 37/01/04	5,200,000.00	6,664,840.00	
	DBR 4.00% 16/07/04	3,900,000.00	4,463,550.00	
	DBR 4.25% 14/01/04	5,700,000.00	6,104,301.00	
	DBR 4.25% 14/07/04	6,500,000.00	7,087,470.00	
	DBR 4.25% 17/07/04	4,000,000.00	4,708,520.00	
	DBR 4.25% 18/07/04	5,200,000.00	6,214,416.00	
	DBR 4.25% 39/07/04	3,500,000.00	4,748,730.00	
	DBR 4.75% 28/07/04	3,000,000.00	3,930,450.00	
	DBR 4.75% 34/07/04	4,600,000.00	6,365,388.00	
	DBR 4.75% 40/07/04	4,000,000.00	5,868,400.00	
	DBR 5.5% 31/01/04	3,300,000.00	4,780,050.00	
	DBR 5.625% 28/01/04	2,980,000.00	4,233,984.00	
	DBR 6% 16/06/20	890,000.00	1,087,651.20	
	DBR 6.25% 24/01/04	2,200,000.00	3,171,124.00	
	DBR 6.25% 300104	2,200,000.00	3,389,430.00	
	DBR 6.5% 27/07/04	3,000,000.00	4,595,040.00	
	FINNISH GO 1.75% 160415	2,000,000.00	2,068,200.00	
	FINNISH GO 3.875% 170915	2,000,000.00	2,263,300.00	
	FRANCE 3.75% 17/04/25	8,000,000.00	8,766,240.00	
	FRANCE 3.75% 19/10/25	5,000,000.00	5,443,000.00	
	FRANCE O.A.T.3.5% 150425	5,600,000.00	6,028,008.00	
	FRANCE O.A.T.3.5% 200425	7,000,000.00	7,472,850.00	
	FRANCE O.A.T.4% 600425	2,000,000.00	2,106,960.00	
	FRANCE OAT4% 141025	5,000,000.00	5,405,900.00	
	FRTR 2.5% 20/10/25	7,000,000.00	6,917,960.00	
	FRTR 3.0% 15/10/25	9,000,000.00	9,562,320.00	
	FRTR 3.0% 220425	2,000,000.00	2,020,200.00	
	FRTR 3.25% 16/04/25	6,700,000.00	7,188,966.00	
	FRTR 3.25% 21/10/25	7,000,000.00	7,271,250.00	

	FRTR 3.5% 26/04/25	6,000,000.00	6,090,180.00
	FRTR 3.75% 21/04/25	7,700,000.00	8,313,305.00
	FRTR 4% 13/04/25	5,700,000.00	5,917,170.00
	FRTR 4% 13/10/25	5,060,000.00	5,334,656.80
	FRTR 4% 14/04/25	5,300,000.00	5,662,149.00
	FRTR 4% 18/04/25	6,000,000.00	6,657,780.00
	FRTR 4% 38/10/25	6,700,000.00	7,048,065.00
	FRTR 4% 55/04/25	3,170,000.00	3,332,399.10
	FRTR 4.25% 17/10/25	4,500,000.00	5,049,225.00
	FRTR 4.25% 18/10/25	5,000,000.00	5,622,400.00
	FRTR 4.25% 19/04/25	6,900,000.00	7,757,670.00
	FRTR 4.25% 23/10/25	7,000,000.00	7,809,060.00
	FRTR 4.5% 41/04/25	4,000,000.00	4,556,800.00
	FRTR 4.75% 35/04/25	4,600,000.00	5,376,020.00
	FRTR 5% 16/10/25	7,600,000.00	8,732,400.00
	FRTR 5.5% 29/04/25	4,000,000.00	4,993,800.00
	FRTR 5.75% 32/10/25	4,700,000.00	6,152,770.00
	FRTR 6.00% 25/10/25	3,500,000.00	4,530,400.00
	FRTR 8.5% 19/10/25	2,550,000.00	3,618,832.50
	FRTR 8.5% 23/04/25	3,200,000.00	4,845,376.00
	IRISH 4% 14/01/15	2,500,000.00	2,466,700.00
	IRISH 4.4% 19/06/18	1,500,000.00	1,336,575.00
	IRISH 4.5% 18/10/18	2,000,000.00	1,821,260.00
	IRISH 4.5% 20/04/18	2,490,000.00	2,158,406.70
	IRISH 4.6% 16/04/18	2,800,000.00	2,743,356.00
	IRISH 5% 13/04/18	1,000,000.00	1,010,780.00
	IRISH 5% 2020/10/18	2,000,000.00	1,784,960.00
	IRISH 5.4% 25/03/13	2,000,000.00	1,773,760.00
	IRISH 5.9% 19/10/18	2,000,000.00	1,907,300.00
	ITALY 5.75% 16/07/25	1,000,000.00	1,031,050.00
	NETHER 1% 14/01/15	2,000,000.00	2,024,200.00
	NETHERLANDS 2.5% 170115	4,000,000.00	4,238,600.00
	NETHERLANDS 2.5% 330115	1,600,000.00	1,535,632.00
	NETHERLANDS 2.75 150115	3,500,000.00	3,707,830.00
	NETHERLANDS 3.25% 150715	3,600,000.00	3,891,168.00
	NETHERLANDS 3.25% 210715	4,200,000.00	4,599,630.00
	NETHERLANDS 3.5% 200715	3,000,000.00	3,346,440.00
	NETHERLANDS 3.75% 140715	3,400,000.00	3,652,110.00
	NETHERLANDS 3.75% 230115	2,000,000.00	2,272,700.00
	NETHERLANDS 3.75% 420115	3,000,000.00	3,669,390.00
	NETHERLANDS 4% 16/07/15	3,300,000.00	3,708,474.00
	NETHERLANDS 4% 18/07/15	3,500,000.00	4,002,180.00
	NETHERLANDS 4% 19/07/15	3,500,000.00	4,019,680.00
	NETHERLANDS 4.25% 130715	3,400,000.00	3,572,890.00
	NETHERLANDS 4.5% 170715	3,600,000.00	4,177,008.00
	NETHERLANDS 5.5% 280115	3,000,000.00	4,086,840.00

	NETHERLANDS 7.5% 230115	1,000,000.00	1,494,980.00	
	NETHERLANDS GOVT4%370115	2,500,000.00	3,078,575.00	
	OBL 1.75% 15/10/09	4,000,000.00	4,193,520.00	
	OBL 2.25% 14/04/11	4,000,000.00	4,169,520.00	
	OBL 2.25% 15/04/10	4,000,000.00	4,236,120.00	
	OBL 2.5% 14/10/10	4,000,000.00	4,230,720.00	
	OBL 2.5% 15/02/27	7,500,000.00	7,983,900.00	
	OBL 3.5% 13/04/12	4,500,000.00	4,651,560.00	
	OBL 4% 13/10/11	4,000,000.00	4,230,320.00	
	OBL-160 2.75% 16/04/08	4,000,000.00	4,358,720.00	
	OBL-161 1.25% 161014	2,000,000.00	2,056,600.00	
	RAGB 3.2% 17/02/20	2,700,000.00	2,896,695.00	
	RAGB 3.4% 14/10/20	2,000,000.00	2,136,500.00	
	RAGB 3.5% 15/07/15	3,200,000.00	3,456,800.00	
	RAGB 3.5% 21/09/15	4,000,000.00	4,269,080.00	
	RAGB 3.65% 22/04/20	2,000,000.00	2,151,760.00	
	RAGB 3.8% 13/10/20	3,000,000.00	3,152,100.00	
	RAGB 3.9% 20/07/15	4,500,000.00	4,951,575.00	
	RAGB 4% 16/09/15	1,000,000.00	1,107,850.00	
	RAGB 4.15% 37/03/15	2,000,000.00	2,223,200.00	
	RAGB 4.3% 14/07/15	2,400,000.00	2,598,240.00	
	RAGB 4.3% 17/09/15	1,500,000.00	1,689,450.00	
	RAGB 4.35% 19/03/15	2,200,000.00	2,492,996.00	
	RAGB 4.65% 18/01/15	2,000,000.00	2,293,940.00	
	RAGB 4.85% 26/03/15	2,000,000.00	2,360,700.00	
	RAGB 6.25% 27/07/15	2,000,000.00	2,700,700.00	
	RFGB 3.125% 14/09/15	1,500,000.00	1,598,070.00	
	RFGB 3.375% 20/04/15	2,000,000.00	2,207,260.00	
	RFGB 3.5% 21/04/15	1,000,000.00	1,110,700.00	
	RFGB 4% 25/07/04	1,000,000.00	1,157,750.00	
	RFGB 4.25% 15/07/04	1,300,000.00	1,446,900.00	
	RFGB 4.375% 19/07/04	1,000,000.00	1,174,050.00	
	RFGB 5.375% 13/07/04	1,500,000.00	1,594,770.00	
	SPGB 2.3% 2013/04/30	4,500,000.00	4,489,785.00	
	SPGB 2.5% 13/10/31	4,000,000.00	3,970,000.00	
	SPGB 3% 15/04/30	4,000,000.00	3,912,880.00	
	SPGB 3.15% 16/01/31	3,800,000.00	3,647,620.00	
	SPGB 3.25% 16/04/30	5,000,000.00	4,779,000.00	
	SPGB 3.3% 14/10/31	5,000,000.00	4,983,150.00	
	SPGB 3.4% 14/04/30	1,000,000.00	1,003,330.00	
	SPGB 3.8% 17/01/31	3,000,000.00	2,870,640.00	
	SPGB 4% 20/04/30	4,000,000.00	3,622,800.00	
	SPGB 4.1% 18/07/30	4,000,000.00	3,774,720.00	
	SPGB 4.2% 13/07/30	3,500,000.00	3,563,350.00	
	SPGB 4.2% 37/01/31	3,250,000.00	2,399,410.00	
	SPGB 4.25% 14/01/31	3,500,000.00	3,562,930.00	

	SPGB 4.25% 16/10/31	4,000,000.00	3,918,400.00	
	SPGB 4.3% 19/10/31	3,000,000.00	2,801,250.00	
	SPGB 4.4% 15/01/31	3,800,000.00	3,883,334.00	
	SPGB 4.6% 19/07/30	3,500,000.00	3,347,400.00	
	SPGB 4.65% 25/07/30	3,500,000.00	3,023,825.00	
	SPGB 4.7% 41/07/30	4,000,000.00	3,145,400.00	
	SPGB 4.75% 14/07/30	3,500,000.00	3,604,125.00	
	SPGB 4.8% 24/01/31	3,300,000.00	2,960,529.00	
	SPGB 4.85% 20/10/31	4,000,000.00	3,793,000.00	
	SPGB 4.9% 40/07/30	4,000,000.00	3,238,520.00	
	SPGB 5.5% 17/07/30	3,280,000.00	3,358,162.40	
	SPGB 5.5% 21/04/30	4,000,000.00	3,942,520.00	
	SPGB 5.75% 32/07/30	3,700,000.00	3,457,761.00	
	SPGB 5.85% 220131	2,000,000.00	2,006,440.00	
	SPGB 5.9% 26/07/30	1,000,000.00	966,880.00	
	SPGB 6% 29/01/31	4,900,000.00	4,750,942.00	
	SPGB 6.15% 13/01/31	1,000,000.00	1,030,700.00	
	ユーロ 小計	892,850,000.00	945,360,414.50	
	(邦貨換算額)		(100,992,853,081)	(単位 : 円)
	英ポンド			
	UKT 1.75% 17/01/22	3,000,000.00	3,110,520.00	
	UKT 2% 16/01/22	8,000,000.00	8,379,440.00	
	UKT 2.25% 14/03/07	6,000,000.00	6,208,680.00	
	UKT 2.75% 15/01/22	4,500,000.00	4,778,280.00	
	UKT 3.75% 19/09/07	5,000,000.00	5,762,150.00	
	UKT 3.75% 20/09/07	5,000,000.00	5,756,500.00	
	UKT 3.75% 21/09/07	5,000,000.00	5,751,450.00	
	UKT 3.75% 520722	1,300,000.00	1,417,445.90	
	UKT 4% 16/09/07	4,800,000.00	5,456,544.00	
	UKT 4% 22/03/07	3,000,000.00	3,509,880.00	
	UKT 4% 60/01/22	2,000,000.00	2,343,180.00	
	UKT 4.25% 27/12/07	3,800,000.00	4,538,872.00	
	UKT 4.25% 32/06/07	3,800,000.00	4,477,160.00	
	UKT 4.25% 36/03/07	3,800,000.00	4,465,532.00	
	UKT 4.25% 39/09/07	3,500,000.00	4,131,400.00	
	UKT 4.25% 40/12/07	3,500,000.00	4,130,315.00	
	UKT 4.25% 46/12/07	3,900,000.00	4,666,389.00	
	UKT 4.25% 49/12/07	3,500,000.00	4,205,600.00	
	UKT 4.25% 55/12/07	5,000,000.00	6,091,150.00	
	UKT 4.5% 19/03/07	4,200,000.00	5,050,500.00	
	UKT 4.5% 34/09/07	4,000,000.00	4,877,120.00	
	UKT 4.5% 42/12/07	4,000,000.00	4,951,680.00	
	UKT 4.75% 15/09/07	4,400,000.00	5,019,564.00	
	UKT 4.75% 20/03/07	5,200,000.00	6,385,340.00	
	UKT 4.75% 30/12/07	3,800,000.00	4,761,020.00	

	UKT 4.75% 38/12/07	3,500,000.00	4,452,000.00	
	UKT 5% 14/09/07	5,500,000.00	6,105,440.00	
	UKT 5% 18/03/07	3,500,000.00	4,258,800.00	
	UKT 5% 25/03/07	3,900,000.00	5,001,945.00	
	UKT 6.0% 281207	2,000,000.00	2,872,680.00	
	UKT 8% 13/09/27	1,500,000.00	1,664,070.00	
	UKT 8% 15/12/07	1,900,000.00	2,407,651.50	
	UKT 8% 21/06/07	2,620,000.00	3,975,588.00	
	UKT 8.75% 17/08/25	1,300,000.00	1,825,343.00	
	英ボンド 小計	129,720,000.00	152,789,229.40	
	(邦貨換算額)		(19,758,703,146)	(単位：円)
	スイスフラン			
	SWITZERLAND 2.5% 160312	2,000,000.00	2,185,600.00	
	SWITZERLAND 3% 180108	1,000,000.00	1,154,000.00	
	SWITZERLAND 3% 19/05/12	1,500,000.00	1,762,200.00	
	SWITZERLAND 4% 280408	900,000.00	1,296,090.00	
	SWITZERLAND 4%230211	2,000,000.00	2,660,000.00	
	SWITZERLAND 4.25% 140106	800,000.00	859,760.00	
	SWITZERLAND 4.25% 170605	1,000,000.00	1,204,700.00	
	スイスフラン 小計	9,200,000.00	11,122,350.00	
	(邦貨換算額)		(988,776,915)	(単位：円)
	スウェーデンクローナ			
	SGB 3% 16/07/12	11,000,000.00	11,756,800.00	
	SGB 3.5% 39/03/30	10,000,000.00	12,633,700.00	
	SGB 3.75% 17/08/12	13,200,000.00	14,769,480.00	
	SGB 4.25% 19/03/12	20,000,000.00	23,537,400.00	
	SGB 4.5% 15/08/12	13,000,000.00	14,361,100.00	
	SGB 5% 20/12/01	20,000,000.00	25,248,000.00	
	SGB 6.75% 14/05/05	19,100,000.00	21,262,120.00	
	スウェーデンクローナ 小計	106,300,000.00	123,568,600.00	
	(邦貨換算額)		(1,485,294,572)	(単位：円)
	ノルウェークローネ			
	NORWAY GOV 3.75% 210525	7,000,000.00	7,819,700.00	
	NORWAY GOV 4.25% 170519	10,000,000.00	11,155,000.00	
	NORWAY GOV 4.5% 19/05/22	6,000,000.00	6,924,000.00	
	NORWAY GOV 5% 150515	10,000,000.00	11,039,500.00	
	NORWAY GOV 6.5% 130515	16,000,000.00	16,860,800.00	
	ノルウェークローネ 小計	49,000,000.00	53,799,000.00	
	(邦貨換算額)		(755,875,950)	(単位：円)
	デンマーククローネ			
	DGB 2% 14/11/15	13,000,000.00	13,565,500.00	
	DGB 3% 21/11/15	6,000,000.00	6,657,000.00	

	DGB 4% 15/11/15	16,000,000.00	17,979,200.00	
	DGB 4% 17/11/15	15,000,000.00	17,496,000.00	
	DGB 4% 19/11/15	21,000,000.00	25,061,400.00	
	DGB 4.5% 39/11/15	27,000,000.00	38,520,900.00	
	DGB 5% 13/11/15	20,820,000.00	22,396,282.20	
	DGB 7% 24/11/10	5,080,000.00	7,830,312.00	
	デンマーククローネ 小計	123,900,000.00	149,506,594.20	
	(邦貨換算額)		(2,146,914,692)	(単位：円)
	ポーランドズロチ			
	POLGB 0% 12/10/25	6,000,000.00	5,853,000.00	
	POLGB 5% 16/04/25	4,000,000.00	3,992,000.00	
	POLGB 5.00% 13/10/24	6,500,000.00	6,519,500.00	
	POLGB 5.25% 13/04/25	5,000,000.00	5,020,000.00	
	POLGB 5.25% 17/10/25	8,000,000.00	8,064,800.00	
	POLGB 5.25% 2020/10/25	5,000,000.00	4,928,000.00	
	POLGB 5.5% 19/10/25	6,000,000.00	6,060,000.00	
	POLGB 5.5% 2015/04/25	8,000,000.00	8,120,000.00	
	POLGB 5.75% 14/04/25	8,000,000.00	8,144,000.00	
	POLGB 5.75% 22/09/23	10,200,000.00	10,303,020.00	
	POLGB 6.25% 15/10/24	7,500,000.00	7,801,500.00	
	ポーランドズロチ 小計	74,200,000.00	74,805,820.00	
	(邦貨換算額)		(1,916,525,108)	(単位：円)
	オーストラリアドル			
	ACGB 4.25% 170721	1,000,000.00	1,037,400.00	
	ACGB 4.5% 14/10/21	2,000,000.00	2,054,700.00	
	ACGB 4.5% 20/04/15	4,000,000.00	4,214,348.00	
	ACGB 4.75% 12/11/15	1,000,000.00	1,005,757.00	
	ACGB 4.75% 15/10/21	1,000,000.00	1,042,300.00	
	ACGB 4.75% 16/06/15	4,000,000.00	4,211,548.00	
	ACGB 5.25% 19/03/15	3,000,000.00	3,298,956.00	
	ACGB 5.5% 13/12/15	2,000,000.00	2,069,140.00	
	ACGB 5.5% 18/01/21	2,000,000.00	2,204,900.00	
	ACGB 5.5% 23/04/21	1,000,000.00	1,135,000.00	
	ACGB 5.75% 21/05/15	5,000,000.00	5,746,000.00	
	ACGB 5.75% 22/07/15	2,000,000.00	2,311,800.00	
	ACGB 6% 17/02/15	3,300,000.00	3,677,655.30	
	ACGB 6.25% 14/06/15	3,000,000.00	3,181,185.00	
	ACGB 6.25% 15/04/15	3,000,000.00	3,248,751.00	
	ACGB 6.5% 13/05/15	3,540,000.00	3,650,968.38	
	オーストラリアドル 小計	40,840,000.00	44,090,408.68	
	(邦貨換算額)		(3,731,812,190)	(単位：円)
	シンガポールドル			
	SIGB 1.625% 130401	3,000,000.00	3,042,888.00	

	SIGB 2.25% 21/06/01	1,500,000.00	1,582,251.00	
	SIGB 3.125% 22/09/01	1,000,000.00	1,122,989.00	
	SIGB 3.25% 20/09/01	2,000,000.00	2,267,216.00	
	SIGB 3.5% 27/03/01	2,000,000.00	2,289,940.00	
	SIGB 3.625 140701	2,500,000.00	2,691,287.50	
	SIGB 3.75% 160901	1,000,000.00	1,145,678.00	
	SIGB 4% 18/09/01	2,200,000.00	2,622,752.00	
	シンガポールドル 小計	15,200,000.00	16,765,001.50	
	(邦貨換算額)		(1,088,719,197)	(単位：円)
	マレーシアリングット			
	MALAYSIAN 3.502 27/05/31	9,000,000.00	8,570,898.00	
	MALAYSIAN 3.702 13/02/25	8,000,000.00	8,045,336.00	
	MALAYSIAN 3.741 15/02/27	10,000,000.00	10,155,140.00	
	MALAYSIAN 3.814% 17/02/15	2,000,000.00	2,041,974.00	
	MALAYSIAN 4.24 18/02/07	5,000,000.00	5,213,720.00	
	MALAYSIAN 4.262 16/09/15	3,000,000.00	3,119,439.00	
	MALAYSIAN 4.378 19/11/29	5,000,000.00	5,286,660.00	
	MALAYSIAN 5.094 14/04/30	6,000,000.00	6,237,774.00	
	マレーシアリングット 小計	48,000,000.00	48,670,941.00	
	(邦貨換算額)		(1,290,753,355)	(単位：円)
	合計		245,124,630,662	単位：円
	(外貨建有価証券邦貨換算額合計)		(245,124,630,662)	(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、192銘柄、信託財産純資産総額に対する比率40.2%、合計に対する比率41.4%です。
カナダドル表示の債券については、28銘柄、信託財産純資産総額に対する比率2.9%、合計に対する比率3.0%です。
メキシコペソ表示の債券については、5銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.9%、合計に対する比率0.9%です。
ユーロ表示の債券については、231銘柄、信託財産純資産総額に対する比率40.0%、合計に対する比率41.2%です。
英ポンド表示の債券については、34銘柄、信託財産純資産総額に対する比率7.8%、合計に対する比率8.1%です。
スイスフラン表示の債券については、7銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.4%、合計に対する比率0.4%です。
スウェーデンクローナ表示の債券については、7銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.6%、合計に対する比率0.6%です。
ノルウェークローネ表示の債券については、5銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.3%、合計に対する比率0.3%です。
デンマーククローネ表示の債券については、8銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.9%、合計に対する比率0.9%です。
ポーランドズロチ表示の債券については、11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。
オーストラリアドル表示の債券については、16銘柄、信託財産純資産総額に対する比率1.5%、合計に対する比率1.5%です。
シンガポールドル表示の債券については、8銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.4%、

合計に対する比率0.4%です。

マレーシアリングット表示の債券については、8銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.5%、

合計に対する比率0.5%です。

「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23年4月13日現在)	(平成24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	9,674,435	165,585,215
国債証券	591,152,160	1,679,805,940
未収利息	857,080	2,897,710
前払費用	963,217	1,551,580
流動資産合計	602,646,892	1,849,840,445
資産合計	602,646,892	1,849,840,445
負債の部		
流動負債		
未払金	-	143,038,765
未払解約金	-	4,300,000
流動負債合計	-	147,338,765
負債合計	-	147,338,765
純資産の部		
元本等		
元本		
元本	597,626,140	1,686,382,428
剰余金		
剰余金又は欠損金()	5,020,752	16,119,252
元本等合計	602,646,892	1,702,501,680
純資産合計	602,646,892	1,702,501,680
負債純資産合計	602,646,892	1,849,840,445

(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23年4月13日ならびに平成24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

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成23年4月14日 至平成24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。

(追加情報)

自平成23年4月14日 至平成24年4月13日
当計算期間の期首以後に行われる会計上の変更および過去の誤謬の訂正から、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）および「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

項目	（平成23年4月13日現在）	（平成24年4月13日現在）
1. 受益権総数	平成23年4月13日現在における受益権の 総数 597,626,140口	平成24年4月13日現在における受益権の 総数 1,686,382,428口
2. 1単位当たり純資産額	1.0084円 (1万円 = 10,084円)	1.0096円 (1万円 = 10,096円)

（金融商品に関する注記）

. 金融商品の状況に関する事項

項目	自平成22年4月14日 至平成23年4月13日	自平成23年4月14日 至平成24年4月13日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。	同左
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、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23年4月13日現在）	（平成24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） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<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。

（平成24年4月13日現在）

平成24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。

（自 平成23年4月14日 至 平成24年4月13日）

該当事項はありません。

(その他の注記)

(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CB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

(平成24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	597,626,140円
同期中における追加設定元本額	2,070,756,966円
同期中における一部解約元本額	982,000,678円
平成24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）	11,075,069円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	2,370,421円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	577,171円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	430,534円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	482,929円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	403,456円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	276,183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）	11,709,408円
S M A M円高期待ファンド（米ドル安型）	8,145,059円
S M A M円高期待ファンド（ユーロ安型）	11,707,385円
アジア高成長国C Bファンド	29,767,812円
日興ニューバークー米国小型ハイクオリティファンド（毎月決算型）	99,128円
日興ニューバークー米国小型ハイクオリティファンド（資産成長型）	297,384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＞	239,009,345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＞	793,236,688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＞	575,795,455円
合 計	1,686,382,428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239回利付国債（10年）	818,000,000	819,824,140	
	第241回利付国債（10年）	285,000,000	286,444,950	
	第244回利付国債（10年）	285,000,000	286,715,700	
	第247回利付国債（10年）	285,000,000	286,821,150	
	国債証券 小計	1,673,000,000	1,679,805,940	
	合 計		1,679,805,940	

独立監査人の監査報告書

平成24年6月12日

三井住友アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士 鈴木 敏夫 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているスミセイ・DCバランスファンド（機動的資産配分型）の平成23年4月14日から平成24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。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、スミセイ・DCバランスファンド（機動的資産配分型）の平成24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。

利害関係

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

以上

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

[委託会社の監査報告書\(当期\)へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成24年 6月15日

三井住友アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 鈴木 敏夫 印
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 辰巳 幸久 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友アセットマネジメント株式会社の平成23年4月1日から平成24年3月31日までの第27期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

利害関係

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

以上

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