

**【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22年7月8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】** 古池 典生

**【電話番号】** 03-5405-0739

**【届出の対象とした募集内国投資信託受益証 スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035  
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ターゲットイヤーファンド2035

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。格付けは取得しておりません。

### （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、「DC2035」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

**（５）【申込手数料】**

無手数料です。

**（６）【申込単位】**

1円以上1円単位

**（７）【申込期間】**

平成22年7月9日から平成23年7月7日まで

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

**（８）【申込取扱場所】**

販売会社において申込みを取り扱います。

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

**（９）【払込期日】**

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

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

**（１０）【払込取扱場所】**

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

**（１１）【振替機関に関する事項】**

当ファンドの振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

**（１２）【その他】**

イ 申込証拠金

ありません。

ロ わが国以外の地域における募集

ありません。

#### 八 クーリングオフ制度（金融商品取引法第37条の6）の適用

ありません。

#### 二 振替受益権について

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

（参考：投資信託振替制度）

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

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

イ 当ファンドは、国内株式インデックス・マザーファンド（B号）、国内債券パッシブ・マザーファンド、外国株式インデックス・マザーファンド、外国債券パッシブ・マザーファンド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、西暦2035年（以下「ターゲットイヤー」といいます。）に向けて、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。ターゲットイヤー到達後は、安定した収益の獲得を目指します。

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

ロ 委託会社は、受託会社と合意の上、金1兆円を限度として信託金を追加することができます。この限度額は、委託会社、受託会社の合意により変更できます。

ハ 当ファンドが該当する商品分類、属性区分は次の通りです。

##### (イ) 当ファンドが該当する商品分類

項目	該当する商品分類	内容
単位型・追加型	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	内外	目論見書または信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産 (収益の源泉)	資産複合	目論見書または信託約款において、株式、債券、不動産投信、その他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

##### (ロ) 当ファンドが該当する属性区分

項目	該当する属性区分	内容
投資対象資産	その他資産（投資信託証券（資産複合（株式、債券、円短期金融資産）資産配分変更型））	目論見書または信託約款において、主として投資信託証券に投資する旨の記載があるものをいいます。「投資信託証券」以下のカッコ内は投資信託証券の先の実質投資対象について記載しています。なお、組み入れる資産そのものは投資信託証券ですが、投資信託証券の先の実質投資対象は株式、債券および円短期金融資産であり、ファンドの収益はそれぞれの市場の動向に左右されるものであるため、商品分類上の投資対象資産（収益の源泉）は「資産複合」となります。
決算頻度	年1回	目論見書または信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。

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

## 《商品分類表》

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単 位 型	国 内	株 式
		債 券
	海 外	不 動 産 投 信
		そ の 他 資 産
追 加 型	内 外	( )
		資 産 複 合

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

## 《属性区分表》

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株 式	年 1 回	グ ロー バ ル		
一 般		(日本を含む)		
大 型 株	年 2 回	日 本		
中 小 型 株	年 4 回	北 米		
債 券	年 6 回 (隔月)	欧 州	ファミリーファンド	あ り
一 般		ア ジ ア		
公 債	年 12 回 (毎月)	オ セ ア ニ ア		
社 債	日 々	中 南 米		
その他債券	そ の 他	ア フ リ カ	ファンド・オブ・ファンズ	な し
クレジット属性	( )	中 近 東 (中 東)		
( )		エ マ ー ジ ン グ		
不動産投信				
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)				
資産複合				
( )				
資産配分固定型				
資産配分変更型				

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

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

## （２）【ファンドの沿革】

平成20年3月31日

信託契約締結、設定、運用開始。

## （３）【ファンドの仕組み】

イ 当ファンドの関係法人とその役割

（イ）委託会社「三井住友アセットマネジメント株式会社」

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

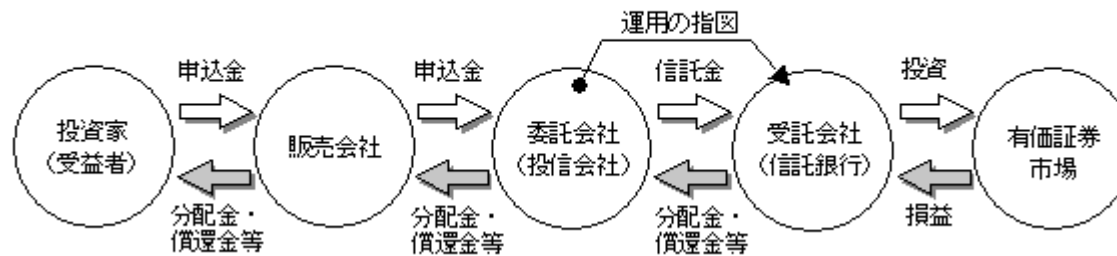
（ロ）受託会社「住友信託銀行株式会社」

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

（ハ）販売会社

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

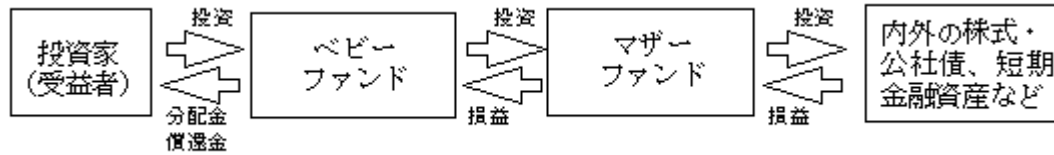
### 運営の仕組み



当ファンドの運用は、「ファミリーファンド方式」で行われます。

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





## □ 委託会社の概況

### (イ) 資本金の額

2,000百万円（平成22年5月31日現在）

### (ロ) 会社の沿革

昭和60年7月15日 三生投資顧問株式会社設立

昭和62年2月20日 証券投資顧問業の登録

昭和62年6月10日 投資一任契約にかかる業務の認可

平成11年1月1日 三井生命保険相互会社の特別勘定運用部門と統合

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

平成12年1月27日 証券投資信託委託業の認可取得

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

### (ハ) 大株主の状況

（平成22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	東京都千代田区有楽町一丁目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、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、ターゲットイヤーに向けて、信託財産の着実な成長を目指した運用を行います。ターゲットイヤー到達後は、安定した収益の獲得を目指します。

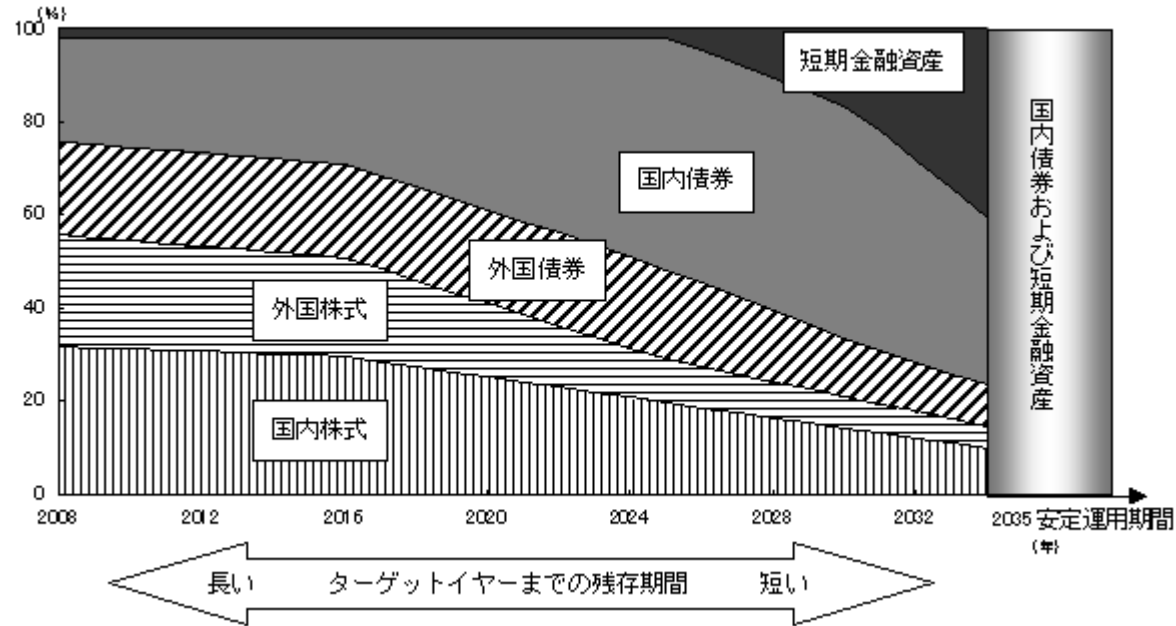
#### ロ 投資態度

(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) 長期的な視点に基づき時間的経過に従い資産配分を変更し、値上がり益の獲得と配当等収益の獲得により、信託財産の着実な成長を目指した運用を目指します。
- (ハ) 基本資産配分は、西暦2035年をターゲットイヤーとし、ターゲットイヤーまでの残存期間が長いほど値上がり益の獲得を重視し、ターゲットイヤーに近づくに従い配当等収益を重視した比率とし、原則として年1回決算時に変更します。
- なお、ターゲットイヤー到達後は、主として国内債券パッシブ・マザーファンドおよびマネーインカム・マザーファンドに投資することにより安定した収益の獲得を目指します。
- (ニ) 組入資産の時価変動により生ずる実際の資産構成比率と基本資産配分との乖離は、資産毎に必要な応じて調整を行うものとします。
- (ホ) 実質外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
- (ヘ) 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。

#### 基本資産配分のイメージ図



上記の図は、各決算時点での基本資産配分を表しています。2034年の決算日以降2035年の決算日までは、安定運用期間に向けて、順次、国内株式、外国株式および外国債券への配分を低減していきます。

また、現時点で予定している基本資産配分をもとに作成したイメージ図であり、将来、実際に上記の通りの運用を行うことを保証するものではありません。

#### 2010年5月現在の基本資産配分

国内株式	国内債券	外国株式	外国債券	短期金融資産
31%	24%	23%	20%	2%

#### <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 - B P I（総合）と連動する投資成果を目指して運用を行います。ポートフォリオの作成にあたっては、マルチファクターモデルおよび当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 - B P I（総合）に近づけたポートフォリオを構築します。なお事業債の銘柄選択については、当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 - B P I（総合）から外れる可能性が高い銘柄については、組入対象から除外することがあります。NOMURA - B P I（総合）との連動性を随時チェックし、必要に応じてマルチファクターモデルおよび当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 - K O K U S A Iインデックス（円ベース）と連動する投資成果を目指して運用を行います。ポートフォリオの作成にあたっては、原則として投資不適格銘柄および低流動性銘柄を除外した上で、マルチファクターモデルを活用した最適化法により推定トラッキングエラーの低減のみならず、制約条件を加えることで実績トラッキングエラーを抑えることを目指してポートフォリオを構築します。MSCI - K O K U S A Iインデックス（円ベース）との連動性を随時チェックし、必要に応じてマルチファクターモデルを使用してポートフォリオのリバランスを行います。

#### 外国債券パッシブ・マザーファンド

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

(口) 特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

## 1．為替手形

## □ 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（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- 6．特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- 7．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
- 8．協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
- 9．特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
- 10．コマーシャル・ペーパー
- 11．新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- 12．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
- 13．投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- 14．投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
- 15．外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- 16．オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限り、有価証券にかかるとは限りません。）
- 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、有価証券にかかるとは限りません。）
- 20．貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの

21．外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第1号の証券または証書、第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券および第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するもの、および第14号の証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、第13号の証券および第14号の証券（ただし、投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

#### 八 投資対象とする金融商品

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

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

### （3）【運用体制】

#### イ 運用体制

当ファンドの運用は、次のプロセスに基づいて行われます。

##### （イ）計画（Plan）

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

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

##### （ロ）実行（Do）

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

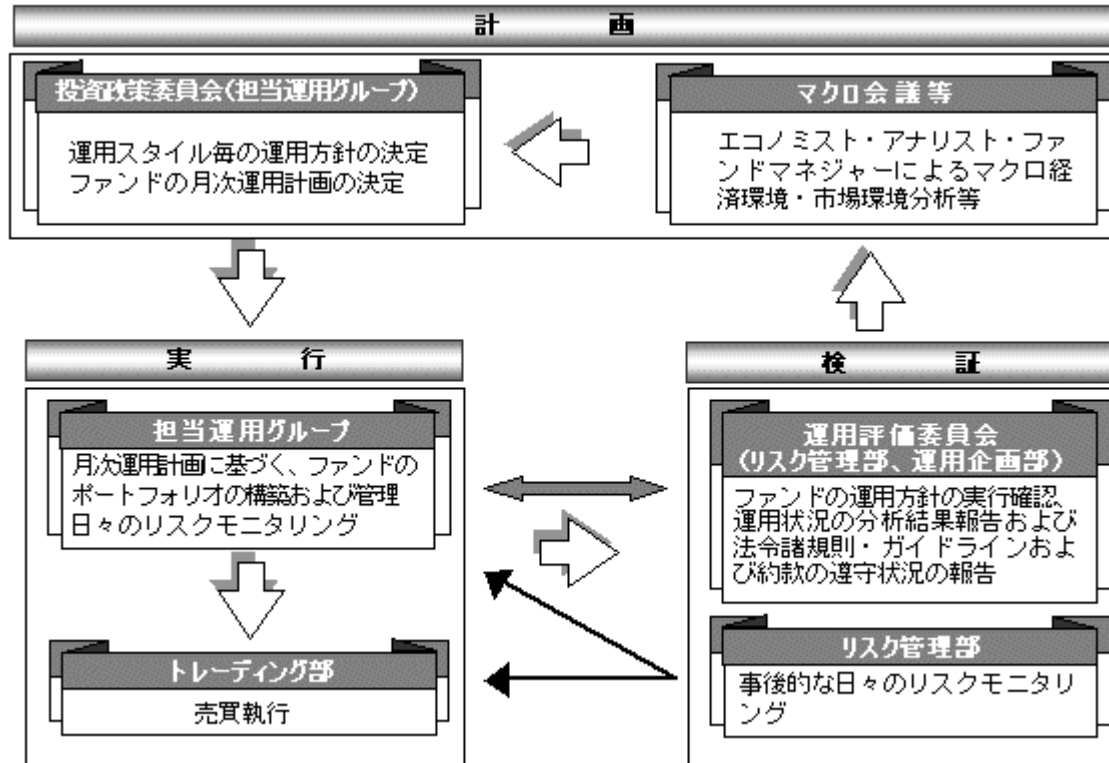
売買執行については、組織的に分離されたトレーディング部が、最良と思われる手法をもって売買を執行します。

##### （ハ）検証（Check）

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

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

## 【ファンドの運用体制】



リスク管理部は8名程度、運用企画部は9名程度で構成されています。

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

□ 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

（４）【分配方針】

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

イ 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と有価証券売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

ロ 収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合等には、委託会社の判断により収益分配を行わない場合があります。

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

**（５）【投資制限】****ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限**

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

**ファンドの信託約款に基づくその他の投資制限**

- イ 投資する株式等の範囲
  - （イ）委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場している株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
  - （ロ）上記（イ）にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録することが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができるものとします。
- ロ 信用取引の指図
  - （イ）委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
  - （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。

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

#### 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、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、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、
- (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、
- (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、
- (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、
  2. 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債

の額面金額の合計額を超えないものとします。

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

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

ト 有価証券の空売りの指図

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

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

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

チ 有価証券の借入れの指図

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

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

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

(ニ) 借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

リ 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

ヌ 外国為替予約取引の指図

(イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、ならびに信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

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

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

(ニ) 上記(ロ)において、信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額

にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

#### ル 資金の借入れ

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとし、
- (ロ) 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。
- (ハ) 収益分配金の再投資にかかる借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- (ニ) 借入金の利息は、信託財産中から支弁します。

#### 法令に基づく投資制限

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

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

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

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

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

## イ 基本方針

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

## ロ 投資態度

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

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

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

**（2）投資対象**

## イ 投資対象とする資産の種類

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

## ロ 投資対象とする有価証券

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

## ハ 投資対象とする金融商品

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

**（3）投資制限**

## イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

（イ）外貨建資産への投資は行いません。

（ロ）株式への投資割合には制限を設けません。

## ロ 法令に基づく投資制限

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

**（国内債券バッシブ・マザーファンド）****（１）投資方針等**

## イ 基本方針

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

## ロ 投資態度

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

**（２）投資対象**

## イ 投資対象とする資産の種類

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

## ロ 投資対象とする有価証券

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

## ハ 投資対象とする金融商品

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

**（３）投資制限**

## イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

## ロ 法令に基づく投資制限

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

## （外国株式インデックス・マザーファンド）

### （１）投資方針等

#### イ 基本方針

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

#### ロ 投資態度

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

（ロ）外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行わないものとします。

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

### （２）投資対象

#### イ 投資対象とする資産の種類

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

#### ロ 投資対象とする有価証券

前記「２ 投資方針（２）投資対象 ロ 投資対象とする有価証券」において記載したベビーファンドが投資対象とする有価証券の各号のうち、第1号、第2号、第4号、第5号、第10号から第21号に掲げるものに投資します（ただし、第14号に掲げるもののうち投資法人債券を除きます。）。

#### ハ 投資対象とする金融商品

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

### （３）投資制限

#### イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

（イ）株式への投資割合には制限を設けません。

（ロ）外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

#### ロ 法令に基づく投資制限

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

## （外国債券パッシブ・マザーファンド）

### （１）投資方針等

#### イ 基本方針

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

#### ロ 投資態度

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

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

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

（ニ）保有する外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

（ホ）公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

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

### （２）投資対象

#### イ 投資対象とする資産の種類

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

#### ロ 投資対象とする有価証券

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

#### ハ 投資対象とする金融商品

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

### （３）投資制限

#### イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

（ロ）投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

（ハ）外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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



内とします。

- (ホ) 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- (ヘ) 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ト) 同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。

□ 法令に基づく投資制限

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

**（マネーインカム・マザーファンド）****（１）投資方針等**

## イ 基本方針

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

## ロ 投資態度

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

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

**（２）投資対象**

## イ 投資対象とする資産の種類

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

## ロ 投資対象とする有価証券

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

## ハ 投資対象とする金融商品

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

**（３）投資制限**

## イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

（ロ）投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

（ハ）外貨建資産への投資は行いません。

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

## ロ 法令に基づく投資制限

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

### 3【投資リスク】

#### イ ファンドのもつリスクの特性

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

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

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

#### （イ）株式市場リスク

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

#### （ロ）債券市場リスク

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

#### （ハ）為替変動リスク

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

#### （ニ）信用リスク

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

#### （ホ）カントリーリスク

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

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

(ヘ) 市場流動性リスク

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

(ト) ファミリーファンド方式にかかる留意点

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

ロ 投資リスクの管理体制

リスク管理の実効性を高め、また、コンプライアンスの徹底を図るために、運用部門から独立した組織（リスク管理部および法務コンプライアンス部）を設置し、ファンドの投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかるチェックを行っています。リスク管理部では、主に投資信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングを行います。また、法務コンプライアンス部では、主に法令・諸規則等の遵守状況についてのチェックを行います。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価委員会、リスク管理委員会およびコンプライアンス委員会への報告が義務づけられています。

## 4【手数料等及び税金】

### (1)【申込手数料】

無手数料です。

### (2)【換金（解約）手数料】

解約手数料はありません。

### (3)【信託報酬等】

純資産総額に以下の率を乗じて得た金額が信託報酬として計算され、信託財産の費用として計上されます。信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。

信託報酬の実質的配分は以下の通りです。

決算期	総額	委託会社	販売会社	受託会社
第1期～第27期	年0.441% (0.42%)	年0.1995% (0.19%)	年0.21% (0.20%)	年0.0315% (0.03%)
第28期以降	年0.2205% (0.21%)	年0.084% (0.08%)	年0.105% (0.10%)	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金額を認識するものがあったりすることから、あらかじめ具体的に記載することはできません。

## （５）【課税上の取扱い】

### イ 個別元本について

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

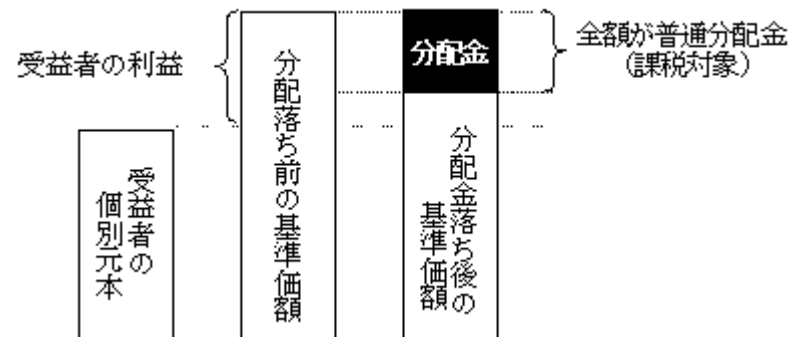
### ロ 一部解約時および償還時の課税について

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

### ハ 収益分配金の課税について

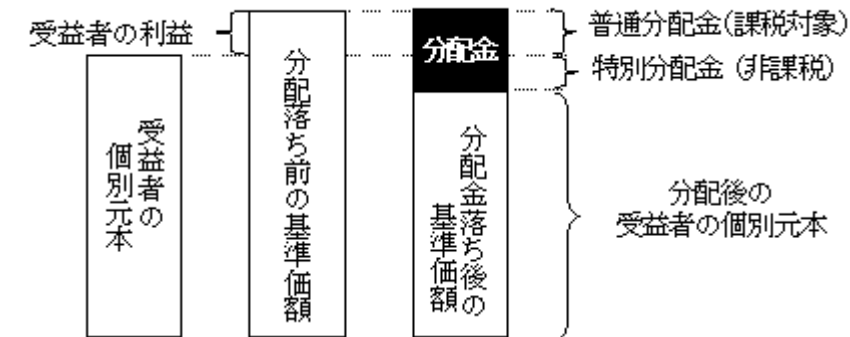
追加型株式投資信託の収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「特別分配金」（受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）の区分があります。

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



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

が特別分配金を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該特別分配金を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。



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

## 二 個人、法人別の課税の取扱いについて

### (イ) 個人の受益者に対する課税

#### ・収益分配時

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

#### ・一部解約時および償還時

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

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

### (ロ) 法人の受益者に対する課税

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

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

当ファンドは、受取配当にかかる益金不算入制度、配当控除の適用はありません。

当ファンドの外貨建資産割合および非株式割合

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%以下とします。

非株式割合に関する制限はありません(約款規定なし)。

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

上記「(5)課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、平成22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22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	584,313	31.15
国内債券パッシブ・マザーファンド受益証券	日本	441,153	23.52
外国株式インデックス・マザーファンド受益証券	日本	441,690	23.55
外国債券パッシブ・マザーファンド受益証券	日本	371,740	19.82
マネーインカム・マザーファンド受益証券	日本	37,146	1.98
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		148	0.01
合計(純資産総額)		1,875,894	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22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	国内株式インデックス・ マザーファンド(B号)	511,210	1.2556 641,879	1.1430 584,313	31.15
日本	親投資信託 受益証券	外国株式インデックス・ マザーファンド	374,536	1.3130 491,776	1.1793 441,690	23.55
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	409,689	1.0690 437,984	1.0768 441,153	23.52
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	323,281	1.2052 389,622	1.1499 371,740	19.82
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	36,870	1.0072 37,137	1.0075 37,146	1.98

以上が、当ファンドが保有する有価証券のすべてです。

## □ 種類別の投資比率

平成22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)	802,606	8,026
第1期(平成21年4月13日)(分配付)	802,606	8,026
第2期(平成22年4月13日)(分配落)	1,706,422	9,164
第2期(平成22年4月13日)(分配付)	1,706,422	9,164
平成21年5月末日	829,745	8,297
平成21年6月末日	845,677	8,457
平成21年7月末日	865,045	8,650
平成21年8月末日	874,309	8,743
平成21年9月末日	861,747	8,617
平成21年10月末日	1,334,223	8,641
平成21年11月末日	1,313,869	8,377
平成21年12月末日	1,574,976	8,785
平成22年1月末日	1,553,775	8,555
平成22年2月末日	1,545,186	8,508
平成22年3月末日	1,687,883	9,065
平成22年4月末日	1,726,673	9,166
平成22年5月末日	1,875,894	8,491

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

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

## 【分配の推移】

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

## 【収益率の推移】

計算期間	収益率（％）
第1期	19.7
第2期	14.2

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

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

#### （4）【設定及び解約の実績】

計算期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期	1,000,000	-
第2期	862,073	-

（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22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	306,582,043,968	97.10
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		9,143,785,967	2.90
合計(純資産総額)		315,725,829,935	100.00

当ファンドは、平成22年5月31日現在、株価指数先物取引を買建てしており、その評価額は9,136,400,000円（投資比率2.89%）です。

## （２）投資資産

## 投資有価証券の主要銘柄

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成22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〕	3,574,700	3,439.10 12,293,766,500	3,280.00 11,725,016,000	3.71
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ 〔銀行業〕	19,561,100	480.52 9,399,642,736	441.00 8,626,445,100	2.73
日本	株式	本田技研工業 〔輸送用機器〕	2,218,200	2,700.86 5,991,060,800	2,770.00 6,144,414,000	1.95
日本	株式	キヤノン 〔電気機器〕	1,612,800	3,331.43 5,372,930,376	3,745.00 6,039,936,000	1.91
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ 〔銀行業〕	1,955,300	2,872.85 5,617,286,125	2,703.00 5,285,175,900	1.67
日本	株式	三菱商事 〔卸売業〕	2,052,800	1,951.33 4,005,692,400	2,052.00 4,212,345,600	1.33
日本	株式	日本電信電話 〔情報・通信業〕	1,082,200	3,750.08 4,058,340,925	3,685.00 3,987,907,000	1.26

日本	株式	任天堂 〔その他製品〕	146,900	21,261.69 3,123,343,600	26,880.00 3,948,672,000	1.25
日本	株式	ソニー 〔電気機器〕	1,388,800	2,329.95 3,235,847,500	2,816.00 3,910,860,800	1.24
日本	株式	武田薬品工業 〔医薬品〕	1,022,100	3,601.09 3,680,676,500	3,795.00 3,878,869,500	1.23
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ 〔銀行業〕	22,779,700	162.22 3,695,445,800	164.00 3,735,870,800	1.18
日本	株式	東京電力 〔電気・ガス業〕	1,637,700	2,329.33 3,814,743,900	2,257.00 3,696,288,900	1.17
日本	株式	エヌ・ティ・ティ・ドコモ 〔情報・通信業〕	22,706	131,059.18 2,975,829,772	135,300.00 3,072,121,800	0.97
日本	株式	パナソニック 〔電気機器〕	2,539,700	1,111.66 2,823,283,400	1,161.00 2,948,591,700	0.93
日本	株式	野村ホールディングス 〔証券、商品先物取引業〕	5,149,200	621.54 3,200,480,400	566.00 2,914,447,200	0.92
日本	株式	三井物産 〔卸売業〕	2,214,900	1,145.93 2,538,135,900	1,294.00 2,866,080,600	0.91
日本	株式	東日本旅客鉄道 〔陸運業〕	485,100	6,096.42 2,957,377,500	5,880.00 2,852,388,000	0.90
日本	株式	東芝 〔電気機器〕	5,867,000	458.17 2,688,112,000	467.00 2,739,889,000	0.87
日本	株式	東京海上ホールディングス 〔保険業〕	1,046,100	2,485.66 2,600,252,100	2,549.00 2,666,508,900	0.84
日本	株式	ファナック 〔電気機器〕	269,500	7,167.61 1,931,671,400	9,610.00 2,589,895,000	0.82
日本	株式	三菱地所 〔不動産業〕	1,804,000	1,346.03 2,428,251,720	1,391.00 2,509,364,000	0.79
日本	株式	ソフトバンク 〔情報・通信業〕	1,125,100	2,071.35 2,330,482,200	2,181.00 2,453,843,100	0.78
日本	株式	新日本製鐵 〔鉄鋼〕	7,637,000	320.99 2,451,419,000	319.00 2,436,203,000	0.77

日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス 〔小売業〕	1,096,200	1,934.46 2,120,565,600	2,099.00 2,300,923,800	0.73
日本	株式	関西電力 〔電気・ガス業〕	1,064,000	2,149.48 2,287,048,800	2,086.00 2,219,504,000	0.70
日本	株式	日立製作所 〔電気機器〕	5,961,000	236.89 1,412,148,200	372.00 2,217,492,000	0.70
日本	株式	日産自動車 〔輸送用機器〕	3,119,300	626.38 1,953,877,000	664.00 2,071,215,200	0.66
日本	株式	小松製作所 〔機械〕	1,210,200	1,698.23 2,055,207,800	1,709.00 2,068,231,800	0.66
日本	株式	信越化学工業 〔化学〕	448,500	4,690.02 2,103,474,800	4,580.00 2,054,130,000	0.65
日本	株式	日本たばこ産業 〔食料品〕	6,510	256,273.11 1,668,337,976	285,600.00 1,859,256,000	0.59

## □ 種類別・業種別の投資比率

平成22年 5月31日現在

種類	業種	投資 比率 (%)	種類	業種	投資 比率 (%)
株式（国内）	水産・農林業	0.09	株式（国内）	精密機器	1.44
	鉱業	0.36		その他製品	2.29
	建設業	1.91		電気・ガス業	4.88
	食料品	3.07		陸運業	3.81
	繊維製品	0.81		海運業	0.60
	パルプ・紙	0.40		空運業	0.32
	化学	5.62		倉庫・運輸関連業	0.23
	医薬品	3.95		情報・通信業	5.34
	石油・石炭製品	0.75		卸売業	4.95
	ゴム製品	0.57		小売業	3.57
	ガラス・土石製品	1.23		銀行業	9.32
	鉄鋼	2.47		証券、商品先物取引業	1.63
	非鉄金属	1.21		保険業	2.70
	金属製品	0.69		その他金融業	0.69
	機械	4.45		不動産業	2.20
	電気機器	14.49		サービス業	1.62
	輸送用機器	9.41		合計	97.10

## 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22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	1,040	9,535,385,300	9,136,400,000	2.89



## (注) 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については以下のように評価しております。

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

## 〔国内債券バッシブ・マザーファンド〕

## (1) 投資状況

平成22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	373,455,569,640	73.05
地方債証券	日本	34,100,800,809	6.67
特殊債券	日本	56,898,793,562	11.13
	韓国	199,176,000	0.04
	小計	57,097,969,562	11.17
社債券	日本	39,071,302,200	7.64
	アメリカ	3,835,871,000	0.75
	イギリス	203,032,000	0.04
	オランダ	100,634,000	0.02
	韓国	199,948,000	0.04
	小計	43,410,787,200	8.49
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,186,008,646	0.62
合計(純資産総額)		511,251,135,857	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22年5月31日現在

国 / 地域	種類	銘柄名	額面金額 (円)	帳簿価額 単価 / 金額 (円)	評価額 単価 / 金額 (円)	利率 / 償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第234回利付国債（10年）	13,336,000,000	101.65 13,556,065,000	101.62 13,552,843,360	1.4 2011/9/20	2.65
日本	国債証券	第236回利付国債（10年）	12,628,000,000	102.11 12,894,955,920	102.09 12,892,177,760	1.5 2011/12/20	2.52
日本	国債証券	第244回利付国債（10年）	11,452,000,000	102.08 11,690,201,600	102.05 11,687,109,560	1 2012/12/20	2.29

日本	国債証券	第268回利付国債（10年）	11,115,000,000	105.16 11,689,312,050	105.10 11,681,865,000	1.5 2015/3/20	2.28
日本	国債証券	第263回利付国債（10年）	10,782,000,000	105.35 11,359,699,560	105.31 11,355,063,300	1.6 2014/9/20	2.22
日本	国債証券	第247回利付国債（10年）	11,135,000,000	101.67 11,321,733,950	101.65 11,319,061,550	0.8 2013/3/20	2.21
日本	国債証券	第265回利付国債（10年）	10,650,000,000	105.04 11,187,612,000	104.98 11,180,689,500	1.5 2014/12/20	2.19
日本	国債証券	第260回利付国債（10年）	10,415,000,000	105.19 10,956,267,550	105.15 10,951,893,250	1.6 2014/6/20	2.14
日本	国債証券	第258回利付国債（10年）	9,513,000,000	103.84 9,878,869,980	103.81 9,875,445,300	1.3 2014/3/20	1.93
日本	国債証券	第253回利付国債（10年）	9,310,000,000	104.50 9,729,601,700	104.45 9,724,295,000	1.6 2013/9/20	1.90
日本	国債証券	第250回利付国債（10年）	9,565,000,000	100.86 9,647,878,550	100.84 9,646,015,550	0.5 2013/6/20	1.89
日本	国債証券	第239回利付国債（10年）	8,688,000,000	102.54 8,909,457,120	102.52 8,907,719,520	1.4 2012/6/20	1.74
日本	国債証券	第256回利付国債（10年）	8,310,000,000	104.06 8,647,552,200	104.00 8,642,981,700	1.4 2013/12/20	1.69
日本	国債証券	第306回利付国債（10年）	7,900,000,000	101.56 8,023,738,000	101.26 7,999,856,000	1.4 2020/3/20	1.56
日本	国債証券	第270回利付国債（10年）	7,487,000,000	104.27 7,807,017,950	104.22 7,802,951,400	1.3 2015/6/20	1.53
日本	国債証券	第242回利付国債（10年）	6,980,000,000	102.36 7,144,937,400	102.34 7,143,750,800	1.2 2012/9/20	1.40
日本	国債証券	第305回利付国債（10年）	7,060,000,000	101.02 7,132,298,400	100.72 7,111,326,200	1.3 2019/12/20	1.39
日本	国債証券	第237回利付国債（10年）	6,370,000,000	102.43 6,525,300,600	102.41 6,523,899,200	1.5 2012/3/20	1.28
日本	国債証券	第238回利付国債（10年）	5,900,000,000	102.25 6,033,163,000	102.23 6,031,983,000	1.4 2012/3/20	1.18

日本	国債証券	第303回利付国債（10年）	5,895,000,000	102.36 6,034,180,950	102.01 6,013,725,300	1.4 2019/9/20	1.18
日本	国債証券	第272回利付国債（10年）	5,595,000,000	104.87 5,867,524,500	104.78 5,862,441,000	1.4 2015/9/20	1.15
日本	国債証券	第277回利付国債（10年）	5,465,000,000	106.10 5,798,802,650	105.95 5,790,440,750	1.6 2016/3/20	1.13
日本	国債証券	第301回利付国債（10年）	5,595,000,000	103.55 5,793,734,400	103.20 5,774,375,700	1.5 2019/6/20	1.13
日本	国債証券	第274回利付国債（10年）	5,245,000,000	105.47 5,531,901,500	105.36 5,526,604,050	1.5 2015/12/20	1.08
日本	国債証券	第243回利付国債（10年）	5,250,000,000	102.13 5,361,930,000	102.11 5,361,142,500	1.1 2012/9/20	1.05
日本	国債証券	第288回利付国債（10年）	4,955,000,000	106.69 5,286,885,900	106.50 5,277,075,000	1.7 2017/9/20	1.03
日本	国債証券	第296回利付国債（10年）	5,043,000,000	104.39 5,264,841,570	104.11 5,250,267,300	1.5 2018/9/20	1.03
日本	国債証券	第289回利付国債（10年）	4,984,000,000	105.10 5,238,433,200	104.87 5,226,720,800	1.5 2017/12/20	1.02
日本	国債証券	第285回利付国債（10年）	4,888,000,000	106.81 5,221,019,440	106.65 5,213,443,040	1.7 2017/3/20	1.02
日本	国債証券	第290回利付国債（10年）	4,947,000,000	104.18 5,153,834,070	103.90 5,140,229,820	1.4 2018/3/20	1.01

□ 種類別の投資比率

平成22年5月31日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	73.05
地方債証券	6.67
特殊債券	11.17
社債券	8.49
合計	99.38

**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22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	121,262,567,869	53.02
	カナダ	12,790,474,293	5.59
	ドイツ	8,515,824,825	3.72
	イタリア	3,044,507,362	1.33
	フランス	10,216,305,949	4.47
	オーストラリア	8,427,887,866	3.68
	イギリス	22,634,737,835	9.90
	スイス	9,444,503,695	4.13
	バミューダ	687,793,855	0.30
	香港	2,412,948,829	1.06
	シンガポール	1,634,148,588	0.71
	ニュージーランド	114,008,368	0.05
	オランダ	3,046,458,617	1.33
	スペイン	3,873,097,771	1.69
	ベルギー	1,056,116,664	0.46
	スウェーデン	3,045,556,535	1.33
	ノルウェー	831,820,004	0.36
	オーストリア	352,897,600	0.15
	ルクセンブルク	575,385,499	0.25
	フィンランド	1,215,867,596	0.53
	デンマーク	1,090,882,052	0.48
	アイルランド	1,185,928,526	0.52
	ギリシャ	309,887,502	0.14
	キプロス	36,217,038	0.02
	イスラエル	969,966,786	0.42
	ポルトガル	285,882,449	0.12
	ケイマン諸島	265,791,023	0.12
	モーリシャス	29,302,790	0.01
	リベリア	49,970,219	0.02
	パナマ	60,464,011	0.03

	ジャージー	549,540,764	0.24
	ガンジー	27,227,193	0.01
	アンティル	831,423,990	0.36
	マン島	44,940,343	0.02
	小計	220,920,334,306	96.59
投資証券	アメリカ	2,047,786,159	0.90
	カナダ	354,367,748	0.15
	フランス	271,896,992	0.12
	オーストラリア	793,552,418	0.35
	イギリス	260,414,350	0.11
	香港	64,049,448	0.03
	シンガポール	66,233,217	0.03
	オランダ	32,989,762	0.01
	小計	3,891,290,094	1.70
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,903,170,921	1.71
合計(純資産総額)		228,714,795,321	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22年5月31日現在

国/ 地域	種類	銘柄名 / 業種	数量 (株)	帳簿価額 単価 / 金額 (円)	評価額 単価 / 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION 〔エネルギー〕	639,282	6,807.04 4,351,620,053	5,520.60 3,529,221,871	1.54
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〕	122,777	18,436.30 2,263,554,395	23,481.27 2,882,961,065	1.26
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP 〔ソフトウェア・サービス〕	1,069,002	2,661.90 2,845,578,271	2,355.79 2,518,352,773	1.10
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO 〔家庭用品・パーソナル用品〕	393,270	5,703.28 2,242,931,999	5,578.12 2,193,710,359	0.96
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO 〔資本財〕	1,444,543	1,456.77 2,104,368,216	1,492.91 2,156,584,968	0.94
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP 〔テクノロジー・ハードウェアおよび機器〕	175,906	11,478.94 2,019,215,865	11,437.49 2,011,923,221	0.88
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〕	373,576	5,737.11 2,143,250,139	5,323.37 1,988,684,391	0.87
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP 〔各種金融〕	1,360,479	1,427.50 1,942,087,436	1,437.21 1,955,306,812	0.85
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC 〔銀行〕	2,359,703	927.62 2,188,914,811	827.62 1,952,958,020	0.85
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED 〔食品・飲料・タバコ〕	469,900	3,816.13 1,793,202,757	4,140.15 1,945,456,485	0.85
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO 〔各種金融〕	538,263	3,770.84 2,029,704,196	3,614.04 1,945,309,287	0.85
アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION 〔エネルギー〕	271,907	7,127.32 1,937,969,947	6,745.06 1,834,031,666	0.80
アメリカ	株式	AT&T INC 〔電気通信サービス〕	799,951	2,458.31 1,966,534,408	2,218.83 1,774,957,677	0.78
アメリカ	株式	WELLS FARGO & COMPANY 〔銀行〕	666,832	2,476.12 1,651,161,391	2,619.68 1,746,889,054	0.76



イギリス	株式	BP PLC 〔エネルギー〕	2,542,318	765.28 1,945,597,270	652.29 1,658,340,912	0.73
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS INC 〔テクノロジー・ハードウェアおよび機器〕	775,431	2,134.54 1,655,194,873	2,114.73 1,639,834,642	0.72
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〕	1,092,816	1,660.62 1,814,755,560	1,390.65 1,519,725,991	0.66
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A 〔ソフトウェア・サービス〕	33,021	52,727.49 1,741,114,616	44,301.78 1,462,889,268	0.64
アメリカ	株式	INTEL CORP 〔半導体・半導体製造装置〕	747,922	1,749.06 1,308,161,385	1,955.86 1,462,830,872	0.64
アメリカ	株式	WAL-MART STORES INC 〔食品・生活必需品小売り〕	309,440	4,980.53 1,541,175,307	4,616.63 1,428,571,101	0.62
オーストラリア	株式	BHP BILLITON LTD 〔素材〕	455,430	3,120.45 1,421,150,437	3,013.16 1,372,283,640	0.60
アメリカ	株式	HEWLETT-PACKARD CO 〔テクノロジー・ハードウェアおよび機器〕	318,894	4,475.83 1,427,317,385	4,201.17 1,339,728,894	0.59
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE 〔食品・飲料・タバコ〕	280,887	5,210.37 1,463,526,389	4,693.33 1,318,296,507	0.58
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC 〔電気通信サービス〕	7,123,038	180.62 1,286,603,013	182.12 1,297,270,081	0.57
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〕	413,711	3,309.86 1,369,326,973	3,076.23 1,272,671,803	0.56
アメリカ	株式	PEPSICO INC 〔食品・飲料・タバコ〕	220,574	5,685.78 1,254,136,975	5,742.48 1,266,643,084	0.55
フランス	株式	TOTAL SA 〔エネルギー〕	286,396	4,687.57 1,342,502,617	4,278.74 1,225,416,025	0.54
スイス	株式	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN 〔医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス〕	95,170	13,137.71 1,250,316,023	12,562.39 1,195,563,417	0.52
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〕	285,883	4,385.58 1,253,765,104	4,148.03 1,185,852,975	0.52
イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS 〔エネルギー〕	480,306	2,412.76 1,158,864,341	2,403.26 1,154,300,629	0.50

## □ 種類別・業種別の投資比率

平成22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	11.07	株式（外国）	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.44
	素材	7.09		銀行	8.57
	資本財	7.37		各種金融	5.78
	商業・専門サービス	0.77		保険	4.07
	運輸	1.68		不動産	0.63
	自動車・自動車部品	1.05		ソフトウェア・サービス	4.51
	耐久消費財・アパレル	1.16		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	5.66
	消費者サービス	1.50		電気通信サービス	4.04
	メディア	2.53		公益事業	4.04
	小売	2.70		半導体・半導体製造装置	1.63
	食品・生活必需品小売り	2.59		新株予約権証券	0.00
	食品・飲料・タバコ	6.12		投資証券	1.70
	家庭用品・パーソナル用品	1.87		合計	98.29
	ヘルスケア機器・サービス	2.72			

## 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22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 10 / 06	買建	93	2,275,311,568	2,310,839,238	1.01
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 10 / 06	買建	62	412,948,115	423,957,370	0.19
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 10 / 06	買建	287	821,593,925	839,490,498	0.37

(注) 時価の算定方法

海外金融先物取引の時価については以下のように評価しております。

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

平成22年5月31日現在

種類	取引所等および 資産の名称	買建/ 売建	数量 (枚)	簿価(円)	時価(円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	市場外取引 米ドル	買建	28,545,378.81	2,595,567,858	2,606,193,084	1.14
為替予約取引	市場外取引 カナダドル	買建	2,114,578.92	183,524,304	183,397,429	0.08
為替予約取引	市場外取引 オーストラリアドル	買建	1,727,174.84	133,510,615	133,510,615	0.06
為替予約取引	市場外取引 英ポンド	買建	5,287,310.45	693,232,323	696,973,262	0.30
為替予約取引	市場外取引 スイスフラン	買建	1,461,353	115,300,751	115,242,297	0.05
為替予約取引	市場外取引 香港ドル	買建	3,199,337.03	37,519,921	37,496,229	0.02
為替予約取引	市場外取引 シンガポールドル	買建	471,129.56	30,100,467	30,656,400	0.01

為替予約取引	市場外取引 スウェーデンクローナ	買建	4,174,431.26	48,711,438	48,632,124	0.02
為替予約取引	市場外取引 ノルウェークローネ	買建	964,213.53	13,610,838	13,566,484	0.01
為替予約取引	市場外取引 デンマーククローネ	買建	1,295,733.19	19,573,345	19,539,656	0.01
為替予約取引	市場外取引 イスラエルシェケル	買建	41,515,513.94	978,935,818	987,654,076	0.43
為替予約取引	市場外取引 ユーロ	買建	4,273,092.21	480,295,564	479,398,215	0.21
為替予約取引	市場外取引 米ドル	売建	3,755,768.22	338,169,370	342,901,638	0.15
為替予約取引	市場外取引 カナダドル	売建	789,271.96	66,543,518	68,453,557	0.03
為替予約取引	市場外取引 オーストラリアドル	売建	145,591.74	10,826,201	11,255,697	0.00
為替予約取引	市場外取引 英ポンド	売建	291,860.21	37,845,513	38,473,012	0.02
為替予約取引	市場外取引 スイスフラン	売建	130,805.66	10,181,912	10,315,334	0.00
為替予約取引	市場外取引 シンガポールドル	売建	121,402.80	7,756,424	7,899,680	0.00
為替予約取引	市場外取引 スウェーデンクローナ	売建	5,885,230.85	66,550,190	68,562,939	0.03
為替予約取引	市場外取引 デンマーククローネ	売建	1,924,655.83	28,446,413	29,023,809	0.01
為替予約取引	市場外取引 ユーロ	売建	2,303,498.82	253,361,835	258,429,532	0.11

(注)

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

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

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

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

## 〔外国債券パッシブ・マザーファンド〕

## (1) 投資状況

平成22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	98,681,278,293	38.62
	カナダ	7,391,204,437	2.89
	ドイツ	24,655,764,027	9.65
	イタリア	25,405,007,746	9.94
	フランス	23,272,274,242	9.11
	オーストラリア	2,104,786,131	0.82
	イギリス	17,995,442,746	7.04
	スイス	1,434,143,228	0.56
	シンガポール	878,781,566	0.34
	マレーシア	1,327,976,272	0.52
	オランダ	6,152,438,754	2.41
	スペイン	10,637,343,380	4.16
	ベルギー	7,112,844,274	2.78
	スウェーデン	1,610,542,483	0.63
	ノルウェー	841,337,728	0.33
	オーストリア	4,294,757,940	1.68
	フィンランド	1,268,041,764	0.50
	デンマーク	2,091,432,712	0.82
	アイルランド	2,192,281,073	0.86
	ギリシャ	4,659,472,791	1.82
	ポーランド	2,095,009,896	0.82
バルトガル	2,628,336,612	1.03	
	小 計	248,730,498,095	97.34
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,788,157,002	2.66
合計(純資産総額)		255,518,655,097	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22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 3.625% 19/08/15	16,000,000	9,148.20 1,463,713,567	9,380.67 1,500,908,125	3.625 2019/8/15	0.59
アメリカ	国債証券	US T 3.125% 19/05/15	16,000,000	8,807.13 1,409,141,575	9,046.82 1,447,491,775	3.125 2019/5/15	0.57
アメリカ	国債証券	US T 3.625% 20/02/15	15,000,000	9,110.72 1,366,608,349	9,369.26 1,405,389,304	3.625 2020/2/15	0.55
アメリカ	国債証券	US T 3.375% 19/11/15	15,000,000	8,873.14 1,330,971,654	9,188.06 1,378,210,312	3.375 2019/11/15	0.54
アメリカ	国債証券	US T 2.75% 19/02/15	15,000,000	8,567.44 1,285,116,914	8,829.96 1,324,494,351	2.75 2019/2/15	0.52
アメリカ	国債証券	US T 3.75% 18/11/15	13,000,000	9,299.35 1,208,915,865	9,564.72 1,243,413,925	3.75 2018/11/15	0.49
アメリカ	国債証券	US T 0.875% 12/01/31	12,000,000	9,145.62 1,097,474,863	9,158.82 1,099,058,527	0.875 2012/1/31	0.43
アメリカ	国債証券	US T 0.75% 11/11/30	12,000,000	9,125.17 1,095,020,907	9,138.84 1,096,661,639	0.75 2011/11/30	0.43
イギリス	国債証券	UKT 5% 12/03/07	7,560,000	14,178.31 1,071,880,727	14,133.62 1,068,502,135	5 2012/3/7	0.42
アメリカ	国債証券	US T 2.375% 15/02/28	11,000,000	9,193.22 1,011,254,551	9,279.37 1,020,731,662	2.375 2015/2/28	0.40
アメリカ	国債証券	US T 1% 11/07/31	11,000,000	9,177.36 1,009,510,524	9,185.21 1,010,373,684	1 2011/7/31	0.40
アメリカ	国債証券	US T 1% 12/03/31	11,000,000	9,159.53 1,007,548,781	9,177.36 1,009,510,524	1 2012/3/31	0.40
アメリカ	国債証券	US T 1% 11/10/31	11,000,000	9,154.81 1,007,030,015	9,175.94 1,009,353,585	1 2011/10/31	0.40
イタリア	国債証券	BTPS 6% 31/05/01	7,900,000	13,182.37 1,041,407,862	12,772.84 1,009,054,992	6 2031/5/1	0.39

アメリカ	国債証券	US T 4.625% 40/02/15	10,000,000	9,329.69 932,969,946	9,755.90 975,590,281	4.625 2040/2/15	0.38
アメリカ	国債証券	US T 2.125% 14/11/30	10,500,000	8,971.47 942,005,321	9,199.48 965,945,662	2.125 2014/11/30	0.38
アメリカ	国債証券	US T 2.625% 14/07/31	10,000,000	9,297.92 929,792,609	9,424.90 942,490,406	2.625 2014/7/31	0.37
イギリス	国債証券	UKT 2.25% 14/03/07	7,000,000	13,026.12 911,828,561	13,371.51 936,006,183	2.25 2014/3/7	0.37
イタリア	国債証券	BTPS 6.5% 27/11/01	6,960,000	13,874.65 965,675,779	13,411.26 933,424,113	6.5 2027/11/1	0.37
アメリカ	国債証券	US T 1.75% 12/08/15	10,000,000	9,263.68 926,368,484	9,316.47 931,647,343	1.75 2012/8/15	0.36
アメリカ	国債証券	US T 2.375% 14/09/30	10,000,000	9,180.22 918,022,184	9,310.76 931,076,656	2.375 2014/9/30	0.36
アメリカ	国債証券	US T 1.75% 13/04/15	10,000,000	9,183.78 918,378,859	9,267.25 926,725,168	1.75 2013/4/15	0.36
アメリカ	国債証券	US T 1.375% 12/11/15	10,000,000	9,144.98 914,498,184	9,213.03 921,303,637	1.375 2012/11/15	0.36
アメリカ	国債証券	US T 1.125% 11/06/30	10,000,000	9,199.48 919,948,250	9,196.62 919,662,906	1.125 2011/6/30	0.36
アメリカ	国債証券	US T 1.375% 2013/01/15	10,000,000	9,129.50 912,950,194	9,190.92 919,092,218	1.375 2013/1/15	0.36
アメリカ	国債証券	US T 1.375% 13/02/15	10,000,000	9,137.42 913,742,023	9,182.36 918,236,187	1.375 2013/2/15	0.36
アメリカ	国債証券	US T 1.00% 2011/12/31	10,000,000	9,166.23 916,623,995	9,180.22 918,022,184	1 2011/12/31	0.36
アメリカ	国債証券	US T 0.875% 11/04/30	10,000,000	9,167.38 916,738,137	9,168.45 916,845,134	0.875 2011/4/30	0.36
ドイツ	国債証券	DBR 5% 12/07/04	7,220,000	12,199.50 880,804,333	12,256.72 884,935,761	5 2012/7/4	0.35
イタリア	国債証券	BTPS 4.25 13/08/01	7,310,000	11,969.49 874,970,157	11,825.88 864,471,828	4.25 2013/8/1	0.34



## □ 種類別の投資比率

平成22年 5月31日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	97.34
合計	97.34

**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。

## 〔マネーインカム・マザーファンド〕

## (1) 投資状況

平成22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	188,487,460	95.97
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		7,912,129	4.03
合計(純資産総額)		196,399,589	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22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223回利付国債(10年)	94,000,000	100.57 94,542,840	100.47 94,444,620	1.7 2010/9/20	48.09
日本	国債証券	第231回利付国債(10年)	31,000,000	101.25 31,390,290	101.21 31,377,270	1.3 2011/6/20	15.98
日本	国債証券	第227回利付国債(10年)	31,000,000	101.35 31,421,050	101.17 31,362,700	1.6 2011/3/21	15.97
日本	国債証券	第225回利付国債(10年)	31,000,000	101.19 31,371,750	100.97 31,302,870	1.9 2010/12/20	15.94

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22年5月31日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	95.97
合計	95.97

## 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2010年5月31日

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

## 基準価額・純資産の推移



※ 基準価額は、1万円当たり、信託報酬控除後です。

基準価額	8,491円
純資産総額	0.02億円

## 分配の推移

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

※ 分配金は1万円当たり、税引前です。  
 ※ 直近計算期間および設定来の累計を記載しています。

## 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。  
 ファンドにはベンチマークはありません。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### イ 申込方法

（イ）ファンドの取得申込者は、お申込みを取り扱う販売会社に取引口座を開設の上、当ファンドの取得申込みを行っていただきます。

（ロ）原則として午後3時までに取得申込みが行われ、販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の申込受付分とします。

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

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

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

ファンドのお買付けに関しましては、クーリングオフ制度の適用はありません。

#### ロ 申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

#### ハ 申込手数料

無手数料です。

#### ニ 申込単位

1円以上1円単位

#### ホ 照会先

手続き等のご不明な点についての委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

#### ヘ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

#### ト 払込期日

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

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

### 2【換金（解約）手続等】

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

お買付けの販売会社にお申し出ください。

解約請求のお申込みに関しては、原則として午後3時までに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、「DC2035」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

#### (2)【保管】

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

#### (3)【信託期間】

平成20年3月31日から下記「(5)その他 イ 信託の終了」に記載された各事由が生じた場合における信託終了の日までとなります。

#### (4)【計算期間】

毎年4月14日から翌年4月13日までとすることを原則としますが、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始するものとします。なお、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

#### (5)【その他】

##### イ 信託の終了

##### (イ) 信託契約の解約

a. 委託会社は、当ファンドの信託契約を解約することが受益者にとって有利であると認めるとき、残存口数が1億口を下回ることとなったとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

b. 委託会社は、上記aの事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知られたる受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

- c. 書面決議において、受益者(委託会社等を除きます。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行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。
- (ニ) 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い
- a. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。また、受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたこと、その他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。
  - b. 上記により受託会社が辞任し、または解任された場合は、委託会社は新受託会社を選任します。
  - c. 委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。
- ロ 収益分配金、償還金の支払い
- (イ) 収益分配金
- a. 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。分配対象額が少額の場合等には委託会社の判断により分配を行わないことがあります。
  - b. 分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日の翌営業日に再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。
- (ロ) 償還金
- 償還金は、信託終了後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として償還日から起算して5営業日目まで)から、販売会社において、原則として、償還日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として)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、当ファンドの知られたる受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- (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。
- (ニ) 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せん。)

- (ホ) 上記(ロ)から(二)までの取扱いは、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- (ヘ) 上記にかかわらず、当ファンドと他のファンドとの併合の場合は、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、相手方となる他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、併合を行うことはできません。

## 二 反対者の買取請求権

当ファンドの信託契約の解約または重大な信託約款の変更等が行われる場合において、書面決議において当該議案に反対した受益者は、自己に帰属する受益権を、受託会社に信託財産をもって買い取るよう請求をすることができます。

## ホ 販売会社との契約の更改等

委託会社と販売会社との間で締結される販売契約(名称の如何を問わず、ファンドの募集・販売の取扱い、受益者からの一部解約実行請求の受付け、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を規定するもの)は、期間満了の3ヵ月前に当事者のいずれからも、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 手続等 2 換金(解約)手続等」の記載をご参照ください。

### 二 書面決議における議決権および受益権の買取請求権

委託会社が、当ファンドの解約(監督官庁の命令による解約等の場合を除きます。)または、重大な信託約款の変更等を行おうとする場合において、受益者は、それぞれの書面決議手続きにおいて、受益権の口数に応じて議決権を有しこれを行使することができます。

書面決議の結果、当ファンドの解約または重大な信託約款の変更等が行われる場合は、書面決議において当



該議案に反対した受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買い取るべき旨の請求ができます。

ホ 帳簿閲覧・謄写請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（以下「財務諸表等規則」といいます）（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（以下「投資信託財産計算規則」といいます）（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

また、第1期（平成20年3月31日から平成21年4月13日まで）については、改正前の財務諸表等規則および投資信託財産計算規則に基づき、第2期（平成21年4月14日から平成22年4月13日まで）については、改正後の財務諸表等規則および投資信託財産計算規則に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期（平成20年3月31日から平成21年4月13日まで）および第2期（平成21年4月14日から平成22年4月13日まで）の財務諸表について、あずさ監査法人により監査を受けております。

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

## 1【財務諸表】

【スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 (平成21年4月13日現在)	第2期 (平成22年4月13日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	-	3,230
親投資信託受益証券	804,357	1,706,309
流動資産合計	804,357	1,709,539
資産合計	804,357	1,709,539
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬	164	201
未払委託者報酬	1,587	2,915
その他未払費用	-	1
流動負債合計	1,751	3,117
負債合計	1,751	3,117
純資産の部		
元本等		
元本	1,000,000	1,862,073
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	197,394	155,651
元本等合計	802,606	1,706,422
純資産合計	802,606	1,706,422
負債純資産合計	804,357	1,709,539

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第1期 自 平成20年3月31日 至 平成21年4月13日	第2期 自 平成21年4月14日 至 平成22年4月13日
営業収益		
有価証券売買等損益	193,432	158,703
営業収益合計	193,432	158,703
営業費用		
受託者報酬	345	356
委託者報酬	3,617	4,563
その他費用	-	1
営業費用合計	3,962	4,920
営業利益又は営業損失( )	197,394	153,783
経常利益又は経常損失( )	197,394	153,783
当期純利益又は当期純損失( )	197,394	153,783
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	-	-
期首剰余金又は期首欠損金( )	-	197,394
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	112,040
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	112,040
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金( )	197,394	155,651

**（３）【注記表】**

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項目	第 1 期	第 2 期
	自 平成20年 3月31日 至 平成21年 4月13日	自 平成21年 4月14日 至 平成22年 4月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券（売買目的有価証券） 移動平均法に基づき、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、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	親投資信託受益証券（売買目的有価証券） 同 左
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間の取扱い 当計算期間は、設定日の平成20年 3月31日から平成21年 4月13日までとなっております。	

（貸借対照表に関する注記）

項目	第 1 期	第 2 期
	（平成21年 4月13日現在）	（平成22年 4月13日現在）
1. 受益権総数	当該計算期間の末日における受益権の総数 1,000,000口	当該計算期間の末日における受益権の総数 1,862,073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 197,394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 155,651円
3. 1 単位当たり純資産額	0.8026円 （ 1 万口 = 8,026円）	0.9164円 （ 1 万口 = 9,164円）

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項目	第 1 期	第 2 期
	自 平成20年 3月31日 至 平成21年 4月13日	自 平成21年 4月14日 至 平成22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（23,430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（0円）、および分配準備積立金（0円）より、分配対象収益は23,430円（1万口当たり234.30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（25,615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（21,254円）、および分配準備積立金（23,430円）より、分配対象収益は70,299円（1万口当たり377.53円）であります。分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

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

・金融商品の状況に関する事項

項目	第2期 自平成21年4月14日 至平成22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。
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。 なお、当計算期間末の保有については、附属明細表に記載しております。</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ため、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。 なお、当計算期間末における残高については、「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</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理ならびにコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。リスクを管理する部署では、各種リスクごとに定められた頻度で、測定項目が上下限值（リミットあるいは注意レベル）内に収まっているかどうかのモニタリングを行っております。上下限値を越えていることが発見された場合は、原則として速やかに修正を行うよう、リスク管理を行う部署から関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われます。また、是正勧告あるいは報告を受けた関連運用グループでは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、リスク管理を行う部署は、上下限値に抵触した事実ならびにその後の対処結果、あるいは関連運用グループの対処方針の決定に関し、必要に応じて、リスク管理を行う部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員、およびリスク管理委員会へ報告する体制となっております。</p>

4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された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については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期
	自平成21年4月14日 至平成22年4月13日
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コールローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第1期（自平成20年3月31日至平成21年4月13日）

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	804,357円	182,902円
合計	804,357円	182,902円

第2期（自平成21年4月14日至平成22年4月13日）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	151,039円
合計	151,039円

## (デリバティブ取引に関する注記)

## . 取引の状況に関する事項

項目	第1期 自平成20年3月31日 至平成21年4月13日
1. 取引の内容	<p>当ファンドの行うことのできるデリバティブ取引は、次の通りです。</p> <p>a. わが国の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。</p> <p>b. わが国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。</p> <p>c. わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。</p> <p>異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（「スワップ取引」）。</p> <p>金利先渡取引および為替先渡取引。</p> <p>外国為替の売買の予約取引。</p>
2. 取引に対する取組方針	デリバティブ取引につきましては信託約款等に従っており、その制限を遵守しております。
3. 取引の利用目的	信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため。
4. 取引に係るリスクの内容	デリバティブ取引に伴いファンドに影響を与える主なリスクとしてマーケットリスクがあげられます。マーケットリスクについては、ポジションや時価、予想損失額の把握が重要だと考えております。
5. 取引に係るリスクの管理体制	リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理ならびにコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。
6. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	該当事項はありません。

## . 取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

第1期（平成21年4月13日現在）

第1期末現在、デリバティブ取引は行っておりません。



第2期(平成22年4月13日現在)

第2期末現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第1期（自 平成20年3月31日 至 平成21年4月13日）

該当事項はありません。

第2期（自 平成21年4月14日 至 平成22年4月13日）

該当事項はありません。

（その他の注記）

項目	第1期	第2期
	（平成21年4月13日現在）	（平成22年4月13日現在）
期首元本額	1,000,000円	1,000,000円
期中追加設定元本額	- 円	862,073円
期中一部解約元本額	- 円	- 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

種別	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）	419,952円	1.2832円	538,882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	360,281円	1.0679円	384,744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	307,131円	1.3628円	418,558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	273,794円	1.2162円	332,988円

親投資信託 受益証券	マネーインカム・マザーファンド	30,912円	1.0073円	31,137円
合計		1,392,070円		1,706,309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22年 5月31日現在

資産総額	1,876,860 円
負債総額	966 円
純資産総額( - )	1,875,894 円
発行済口数	2,209,238 口
1口当たり純資産額( / )	0.8491 円
( 1万口当たり純資産額	8,491 円)

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

### イ 名義書換

該当事項はありません。

### ロ 受益者名簿

作成しません。

### ハ 受益者に対する特典

ありません。

### ニ 受益権の譲渡および譲渡制限等

#### (イ) 受益権の譲渡

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

#### (ロ) 受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件

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

### ホ 受益権の再分割

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

### ヘ 償還金

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

ト 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### イ 資本金の額および株式数

	平成22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、

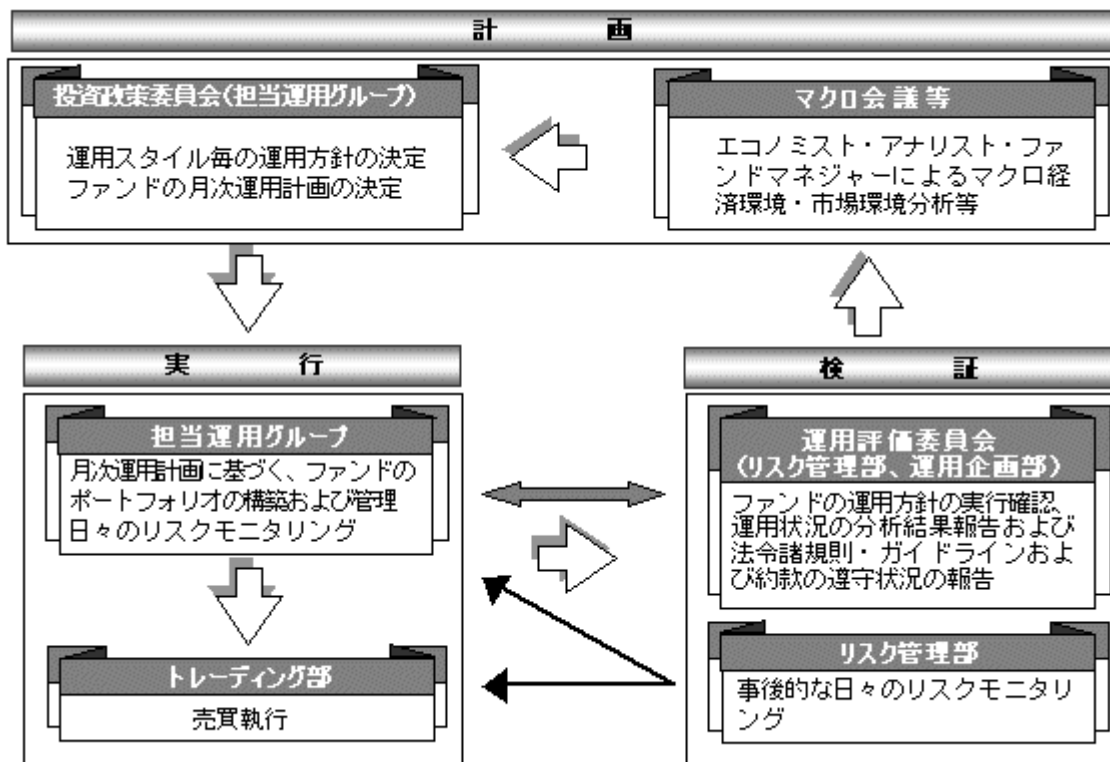
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

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22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22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	67 ( 1)	162,998 ( 182)
	追加型	245 ( 111)	4,166,499 ( 2,421,610)
	計	312 ( 112)	4,329,497 ( 2,421,791)
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		312 ( 112)	4,329,497 ( 2,421,791)

( )内は、私募投資信託分であり、内書き表記しております。



### 3【委託会社等の経理状況】

- 1 当社の財務諸表は、第24期（平成20年4月1日から平成21年3月31日まで）については、改正前の「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しており、第25期（平成21年4月1日から平成22年3月31日まで）については、改正後の「財務諸表等規則」並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
- 2 当社は、第24期（平成20年4月1日から平成21年3月31日まで）及び第25期（平成21年4月1日から平成22年3月31日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、あずさ監査法人の監査を受けております。  
なお、あずさ監査法人は、監査法人の種類の変更により平成22年7月1日をもって有限責任あずさ監査法人となっております。

## (1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第 24 期 (平成21年 3月31日現在)	第 25 期 (平成22年 3月31日現在)
(資産の部)		
流動資産		
現金及び預金	2 15,883,303	15,484,883
有価証券	2,998,947	2,999,185
前払費用	323,949	248,594
未収入金	3,593	6,524
未収委託者報酬	2,158,082	3,405,895
未収運用受託報酬	635,902	456,672
未収投資助言報酬	2 406,959	426,716
未収収益	8,062	7,020
未収還付法人税等	1,068,737	-
未収還付消費税等	182,000	-
繰延税金資産	68,795	244,770
その他の流動資産	2,641	1,392
流動資産計	23,740,977	23,281,654
固定資産		
有形固定資産	1	
建物	169,629	173,574
器具備品	200,701	150,631
有形固定資産合計	370,331	324,206
無形固定資産	1	
電話加入権	161	150
商標権	8,104	6,160
無形固定資産合計	8,266	6,310
投資その他の資産		
投資有価証券	2,542,125	6,923,150
関係会社株式	236,178	236,178
長期差入保証金	783,231	681,764
長期前払費用	14,643	7,822
会員権	20,113	20,113
繰延税金資産	34,393	524,820
投資その他の資産合計	3,630,686	8,393,850
固定資産計	4,009,284	8,724,367
資産合計	27,750,261	32,006,022

	第 24 期 (平成21年 3月31日現在)	第 25 期 (平成22年 3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	44,497	46,362
未払金		
未払収益分配金	947	943
未払償還金	23,376	18,453
未払手数料	2 891,493	1,523,402
その他未払金	112,743	71,728
未払費用	612,126	869,497
未払消費税等	-	74,053
未払法人税等	-	1,264,485
賞与引当金	291,836	293,651
流動負債計	1,977,020	4,162,578
固定負債		
退職給付引当金	972,202	1,137,766
固定負債計	972,202	1,137,766
負債合計	2,949,223	5,300,344
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金	8,628,984	8,628,984
資本剰余金合計	8,628,984	8,628,984
利益剰余金		
利益準備金	284,245	284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金	60,000	60,000
別途積立金	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金	12,356,655	14,172,932
利益剰余金合計	14,177,860	15,994,137
株主資本計	24,806,844	26,623,121
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	5,805	82,556
評価・換算差額等計	5,805	82,556
純資産合計	24,801,038	26,705,677
負債・純資産合計	27,750,261	32,006,022

## （２）【損益計算書】

（単位：千円）

	第 24 期 （自 平成20年 4 月 1 日 至 平成21年 3 月31日）	第 25 期 （自 平成21年 4 月 1 日 至 平成22年 3 月31日）
営業収益		
委託者報酬	20,072,582	21,113,167
運用受託報酬	3,506,635	2,492,177
投資助言報酬	2,048,748	1,893,038
その他営業収益		
情報提供コンサルタント業務報酬	5,000	5,000
投資法人運用受託報酬	60,260	43,853
その他	2,749	12,348
営業収益計	25,695,976	25,559,586
営業費用		
支払手数料	9,326,200	9,706,627
広告宣伝費	529,276	420,508
公告費	1,227	2,339
調査費		
調査費	538,515	579,477
委託調査費	1,310,113	1,556,961
営業雑経費		
通信費	30,202	31,515
印刷費	302,661	278,539
協会費	23,322	19,271
諸会費	14,373	12,955
情報機器関連費	2,036,426	2,005,507
販売促進費	55,223	13,183
その他	55,485	66,833
営業費用計	14,223,029	14,693,722
一般管理費		
給料		
役員報酬	174,486	155,835
給料・手当	4,004,575	4,192,414
賞与	1,051,279	719,290
賞与引当金繰入額	291,836	293,651
交際費	23,229	19,087
寄付金	4,000	23
事務委託費	356,543	195,150
旅費交通費	258,981	197,842
租税公課	81,166	86,095
不動産賃借料	762,812	714,209
退職給付費用	262,634	197,352
固定資産減価償却費	119,811	97,916
諸経費	281,968	280,916
一般管理費計	7,673,326	7,149,786
営業利益	3,799,620	3,716,077

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

## (3)【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	第 24 期 (自 平成20年 4月 1日 至 平成21年 3月31日)	第 25 期 (自 平成21年 4月 1日 至 平成22年 3月31日)
株主資本		
資本金		
前期末残高	2,000,000	2,000,000
当期末残高	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金		
前期末残高	8,628,984	8,628,984
当期末残高	8,628,984	8,628,984
資本剰余金合計		
前期末残高	8,628,984	8,628,984
当期末残高	8,628,984	8,628,984
利益剰余金		
利益準備金		
前期末残高	284,245	284,245
当期末残高	284,245	284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金		
前期末残高	60,000	60,000
当期末残高	60,000	60,000
別途積立金		
前期末残高	1,476,959	1,476,959
当期末残高	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金		
前期末残高	13,483,283	12,356,655
当期変動額		
剰余金の配当	2,822,400	846,720
当期純利益	1,695,771	2,662,997
当期変動額合計	1,126,628	1,816,277
当期末残高	12,356,655	14,172,932
利益剰余金合計		
前期末残高	15,304,488	14,177,860
当期変動額		
剰余金の配当	2,822,400	846,720
当期純利益	1,695,771	2,662,997
当期変動額合計	1,126,628	1,816,277
当期末残高	14,177,860	15,994,137
株主資本合計		
前期末残高	25,933,472	24,806,844
当期変動額		
剰余金の配当	2,822,400	846,720
当期純利益	1,695,771	2,662,997

当期変動額合計	1,126,628	1,816,277
当期末残高	24,806,844	26,623,121

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



## 重要な会計方針

項目	第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)
1 有価証券の評価基準及び評価方法	満期保有目的の債券 償却原価法 子会社株式及び関連会社株式 移動平均法による原価法 其他有価証券 時価のあるもの 決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により 処理し、売却原価は移動平均法に より算定) 時価のないもの 移動平均法による原価法	満期保有目的の債券 同左 子会社株式及び関連会社株式 同左 其他有価証券 時価のあるもの 同左 時価のないもの 同左
2 固定資産の減価償却の方法	有形固定資産 定率法によっております。但し、建物（建 物附属設備を除く）については、定額法 によっております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりで あります。  建物 3～50年 器具備品 3～20年  無形固定資産 定額法によっております。	有形固定資産 同左    無形固定資産 同左
3 引当金の計上基準 (1) 賞与引当金  (2) 退職給付引当金	従業員賞与の支給に充てるため、将来の 支給見込額のうち当期の負担額を計上し ております。  従業員の退職金支給に備えるため、当事 業年度末における退職給付債務に基づき 計上しております。 過去勤務債務については、その発生時に おいて一時に費用処理しております。 数理計算上の差異については、その発生 時において一時に費用処理してありま す。	同左  従業員の退職金支給に備えるため、当事 業年度末における退職給付債務に基づき 計上しております。 過去勤務債務については、その発生時に おいて一時に費用処理しております。 数理計算上の差異については、その発生 時において一時に費用処理してありま す。 (会計方針の変更) 当事業年度より、「退職給付に係る会計 基準」の一部改正（その3）（企業会計 基準第19号 平成20年7月31日）を適用 しております。この変更が当事業年度の 損益に与える影響はありません。また、本 会計基準の適用に伴い発生する退職給付 債務の差額はありません。
4 リース取引の処理方法	所有権移転外ファイナンス・リース取引 のうち、リース取引開始日が平成20年4 月1日前に開始する事業年度に属するも のについては、通常の賃貸借取引に係る 方法に準じた会計処理によってありま す。	-
5 その他財務諸表作成のため の基本となる重要な事項	消費税等の会計処理は税抜方式によって おります。	同左

## 会計方針の変更

## （会計処理の変更）

第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)
<p>リース取引に関する会計基準</p> <p>所有権移転外ファイナンス・リース取引については、従来、賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっておりましたが、企業会計基準第13号「リース取引に関する会計基準」（平成19年3月30日 企業会計基準委員会）及び企業会計基準適用指針第16号「リース取引に関する会計基準の適用指針」（同前）が平成20年4月1日以後開始する事業年度から適用されることになったことに伴い、当事業年度から同会計基準及び適用指針を適用しております。</p> <p>当事業年度において、通常の売買取引に係る方法に準じた会計処理による取引はありません。</p>	-

## 注 記 事 項

## （貸借対照表関係）

第24期 (平成21年3月31日現在)	第25期 (平成22年3月31日現在)
<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建 物 150,704千円</p> <p>器具備品 941,423千円</p> <p>無形固定資産の減価償却累計額</p> <p>電話加入権 72千円</p> <p>商標権 11,337千円</p>	<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建 物 172,855千円</p> <p>器具備品 863,358千円</p> <p>無形固定資産の減価償却累計額</p> <p>電話加入権 83千円</p> <p>商標権 13,282千円</p>
<p>2 関係会社に対する債権債務</p> <p>現金及び預金 10,311,398千円</p> <p>未収投資助言報酬 398,818千円</p> <p>未払手数料 331,400千円</p>	<p>2 関係会社に対する債権債務</p> <p>現金及び預金 10,591,647千円</p> <p>未収投資助言報酬 295,911千円</p> <p>未払手数料 441,536千円</p>
<p>3 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座貸越契約を締結しております。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。当事業年度末における当座貸越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。</p> <p>当座貸越極度額の総額 10,000,000千円</p> <p>借入実行残高 - 千円</p> <p>差引額 10,000,000千円</p>
<p>4 当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York)Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成27年6月までの賃借料総額128,926千円の支払保証を行っております。</p>	<p>4 当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York)Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成27年6月までの賃借料総額102,815千円の支払保証を行っております。</p>

## （損益計算書関係）

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

## （株主資本等変動計算書関係）

第24期(自平成20年4月1日至平成21年3月31日)

## 1.発行済株式数に関する事項

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

## 2.剰余金の配当に関する事項

## (1) 配当金支払額等

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成20年6月23日 定時株主総会	普通株式	2,822,400	160,000	平成20年 3月31日	平成20年 6月24日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生が翌事業年度になるもの  
平成21年6月30日開催の第24回定時株主総会において次の通り付議いたします。

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

第25期(自平成21年4月1日至平成22年3月31日)

## 1.発行済株式数に関する事項

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

## 2.剰余金の配当に関する事項

## (1) 配当金支払額等

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

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生が翌事業年度になるもの  
平成22年6月24日開催の第25回定時株主総会において次の通り付議いたします。

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

## (リース取引関係)

第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)																														
<p>1. リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引 (借主側)</p> <p>リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額(単位:千円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="text-align: left;">器具備品</th> <th style="text-align: right;">合計</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>取得価額相当額</td> <td style="text-align: right;">5,330 5,330</td> </tr> <tr> <td>減価償却累計額相当額</td> <td style="text-align: right;">5,330 5,330</td> </tr> <tr> <td>期末残高相当額</td> <td style="text-align: right;">- -</td> </tr> </tbody> </table> <p>未経過リース料期末残高相当額(単位:千円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tbody> <tr> <td>1年以内</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> <tr> <td>合計</td> <td style="text-align: right;">-</td> </tr> </tbody> </table> <p>支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額 (単位:千円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tbody> <tr> <td>支払リース料</td> <td style="text-align: right;">2,067</td> </tr> <tr> <td>減価償却費相当額</td> <td style="text-align: right;">1,900</td> </tr> <tr> <td>支払利息相当額</td> <td style="text-align: right;">37</td> </tr> </tbody> </table> <p>減価償却費相当額及び利息相当額の算定方法</p> <p>減価償却費相当額の算定方法</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。</li> </ul> <p>利息相当額の算定方法</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>・リース料総額とリース物件の取得価額相当額との差額を利息相当額とし、各期への配分方法については、利息法によっております。</li> </ul> <p>2. オペレーティング・リース取引 (借主側)</p> <p>未経過リース料(解約不能のもの)(単位:千円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tbody> <tr> <td>1年以内</td> <td style="text-align: right;">710,121</td> </tr> <tr> <td>1年超</td> <td style="text-align: right;">962,627</td> </tr> <tr> <td>合計</td> <td style="text-align: right;">1,672,748</td> </tr> </tbody> </table>	器具備品	合計	取得価額相当額	5,330 5,330	減価償却累計額相当額	5,330 5,330	期末残高相当額	- -	1年以内	-	合計	-	支払リース料	2,067	減価償却費相当額	1,900	支払利息相当額	37	1年以内	710,121	1年超	962,627	合計	1,672,748	<p style="text-align: center;">-</p> <p>1. オペレーティング・リース取引 (借主側)</p> <p>未経過リース料(解約不能のもの)(単位:千円)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tbody> <tr> <td>1年以内</td> <td style="text-align: right;">667,234</td> </tr> <tr> <td>1年超</td> <td style="text-align: right;">1,608,004</td> </tr> <tr> <td>合計</td> <td style="text-align: right;">2,275,239</td> </tr> </tbody> </table>	1年以内	667,234	1年超	1,608,004	合計	2,275,239
器具備品	合計																														
取得価額相当額	5,330 5,330																														
減価償却累計額相当額	5,330 5,330																														
期末残高相当額	- -																														
1年以内	-																														
合計	-																														
支払リース料	2,067																														
減価償却費相当額	1,900																														
支払利息相当額	37																														
1年以内	710,121																														
1年超	962,627																														
合計	1,672,748																														
1年以内	667,234																														
1年超	1,608,004																														
合計	2,275,239																														

## （金融商品関係）

第25期(自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

## (1) 金融商品に対する取組方針

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

## (2) 金融商品の内容及びそのリスク

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

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

営業債務である未払手数料は、すべて1年以内の支払期日であります。

## (3) 金融商品に係るリスク管理体制

## 信用リスクの管理

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

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

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

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

## 市場リスクの管理

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

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

## (4) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

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

（単位：千円）

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

## （注1）金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資産

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

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

## (5)有価証券及び投資有価証券

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

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

## (6)長期差入保証金

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

負債

## (1)未払金

## 未払手数料

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

## （注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

（単位：千円）

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

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

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

(注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位:千円)

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

(追加情報)

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

(有価証券関係)

第24期(平成21年3月31日現在)

1. 満期保有目的の債券で時価のあるもの

(単位:千円)

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)貸借対照表日の時価が貸借対照表計上額を超えるもの	-	-	-
小計	-	-	-
(2)貸借対照表日の時価が貸借対照表計上額を超えないもの	2,998,947	2,998,800	147
小計	2,998,947	2,998,800	147
合計	2,998,947	2,998,800	147

2. その他有価証券で時価のあるもの

(単位:千円)

区分	取得原価	貸借対照表計上額	差額
(1)貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
投資信託等	329,907	346,809	16,902
小計	329,907	346,809	16,902
(2)貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
投資信託等	2,117,725	2,095,017	22,707
小計	2,117,725	2,095,017	22,707
合計	2,447,632	2,441,827	5,805

## 3. 時価評価されていない有価証券の内容及び貸借対照表計上額

(単位:千円)

	貸借対照表計上額	摘要
(1)子会社株式 子会社株式	236,178	
合計	236,178	
(2)その他有価証券 非上場株式 投資証券	298 100,000	
合計	100,298	

## 4. 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位:千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
882,530	122	464,272

## 5. その他有価証券のうち満期があるもの及び満期保有目的の債券の決算日後における償還予定額

(単位:千円)

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
(1)満期保有目的の債券 国債・地方債等	3,000,000	-	-	-
小計	3,000,000	-	-	-
(2)その他有価証券	-	-	-	-
小計	-	-	-	-
合計	3,000,000	-	-	-



第25期(平成22年3月31日現在)

## 1. 満期保有目的の債券

(単位：千円)

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

## 2. 子会社株式及び関連会社株式

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

## 3. その他有価証券

(単位：千円)

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

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

## 4. 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：千円)

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

(デリバティブ取引関係)

第24期(自平成20年4月1日至平成21年3月31日)

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

第25期(自平成21年4月1日至平成22年3月31日)

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

(退職給付関係)

第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)																														
<p>1. 採用している退職給付制度の概要 当社は、確定給付型の制度として、退職一時金制度を設けております。</p> <p>2. 退職給付債務の額 (単位：千円)</p> <table style="width: 100%;"> <tr> <td style="width: 70%;">退職給付債務</td> <td style="text-align: right;">972,202</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td style="text-align: right;"><u>972,202</u></td> </tr> </table> <p>3. 退職給付費用の額 (単位：千円)</p> <table style="width: 100%;"> <tr> <td style="width: 70%;">勤務費用</td> <td style="text-align: right;">145,258</td> </tr> <tr> <td>利息費用</td> <td style="text-align: right;">12,449</td> </tr> <tr> <td>過去勤務債務の費用処理額</td> <td style="text-align: right;">87,363</td> </tr> <tr> <td>数理計算上の差異の費用処理額</td> <td style="text-align: right;">6,153</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;"><u>11,409</u></td> </tr> <tr> <td>退職給付費用</td> <td style="text-align: right;"><u>262,634</u></td> </tr> </table> <p>4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項 退職給付見込額の期間配分方法 勤務期間を基準とする方法 割引率 1.5% 過去勤務債務の額の処理年数 1年（発生時において費用処理する方法） 数理計算上の差異の処理年数 1年（発生時において費用処理する方法）</p>	退職給付債務	972,202	退職給付引当金	<u>972,202</u>	勤務費用	145,258	利息費用	12,449	過去勤務債務の費用処理額	87,363	数理計算上の差異の費用処理額	6,153	その他	<u>11,409</u>	退職給付費用	<u>262,634</u>	<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%;"> <tr> <td style="width: 70%;">退職給付債務</td> <td style="text-align: right;">1,137,766</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td style="text-align: right;"><u>1,137,766</u></td> </tr> </table> <p>3. 退職給付費用の額 (単位：千円)</p> <table style="width: 100%;"> <tr> <td style="width: 70%;">勤務費用</td> <td style="text-align: right;">154,625</td> </tr> <tr> <td>利息費用</td> <td style="text-align: right;">14,583</td> </tr> <tr> <td>数理計算上の差異の費用処理額</td> <td style="text-align: right;">12,466</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;"><u>15,677</u></td> </tr> <tr> <td>退職給付費用</td> <td style="text-align: right;"><u>197,352</u></td> </tr> </table> <p>(注) その他は、その他の関係会社からの出向者の年金掛金負担分と退職給付引当額相当額負担分になります。</p> <p>4. 退職給付債務等の計算の基礎に関する事項 退職給付見込額の期間配分方法 勤務期間を基準とする方法 割引率 1.5% 過去勤務債務の額の処理年数 1年（発生時において費用処理する方法） 数理計算上の差異の処理年数 1年（発生時において費用処理する方法）</p>	退職給付債務	1,137,766	退職給付引当金	<u>1,137,766</u>	勤務費用	154,625	利息費用	14,583	数理計算上の差異の費用処理額	12,466	その他	<u>15,677</u>	退職給付費用	<u>197,352</u>
退職給付債務	972,202																														
退職給付引当金	<u>972,202</u>																														
勤務費用	145,258																														
利息費用	12,449																														
過去勤務債務の費用処理額	87,363																														
数理計算上の差異の費用処理額	6,153																														
その他	<u>11,409</u>																														
退職給付費用	<u>262,634</u>																														
退職給付債務	1,137,766																														
退職給付引当金	<u>1,137,766</u>																														
勤務費用	154,625																														
利息費用	14,583																														
数理計算上の差異の費用処理額	12,466																														
その他	<u>15,677</u>																														
退職給付費用	<u>197,352</u>																														

## (税効果会計関係)

第24期 (平成21年3月31日現在)	第25期 (平成22年3月31日現在)																																																																																												
<p>1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 (単位：千円)</p> <p>(1) 流動の部</p> <table> <tr><td>繰延税金資産</td><td></td></tr> <tr><td>賞与引当金</td><td style="text-align: right;">118,748</td></tr> <tr><td>未払社会保険料</td><td style="text-align: right;">12,792</td></tr> <tr><td>未払事業所税</td><td style="text-align: right;">6,134</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;"><u>5,436</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産計</td><td style="text-align: right;">143,111</td></tr> <tr><td>評価性引当額</td><td style="text-align: right;">-</td></tr> <tr><td>繰延税金資産合計</td><td style="text-align: right;">143,111</td></tr> <tr><td>繰延税金負債</td><td></td></tr> <tr><td>未収還付税金</td><td style="text-align: right;"><u>74,316</u></td></tr> <tr><td>繰延税金負債合計</td><td style="text-align: right;"><u>74,316</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産の純額</td><td style="text-align: right;"><u>68,795</u></td></tr> </table> <p>(2) 固定の部</p> <table> <tr><td>繰延税金資産</td><td></td></tr> <tr><td>退職給付引当金</td><td style="text-align: right;">395,589</td></tr> <tr><td>ソフトウェア償却</td><td style="text-align: right;">101,933</td></tr> <tr><td>投資有価証券評価損</td><td style="text-align: right;">56,627</td></tr> <tr><td>特定外国子会社留保金額</td><td style="text-align: right;">193,760</td></tr> <tr><td>その他有価証券評価差額金</td><td style="text-align: right;">2,362</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;"><u>14,742</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産計</td><td style="text-align: right;">765,014</td></tr> <tr><td>評価性引当額</td><td style="text-align: right;"><u>730,620</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産合計</td><td style="text-align: right;"><u>34,393</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産の純額</td><td style="text-align: right;"><u>34,393</u></td></tr> </table>	繰延税金資産		賞与引当金	118,748	未払社会保険料	12,792	未払事業所税	6,134	その他	<u>5,436</u>	繰延税金資産計	143,111	評価性引当額	-	繰延税金資産合計	143,111	繰延税金負債		未収還付税金	<u>74,316</u>	繰延税金負債合計	<u>74,316</u>	繰延税金資産の純額	<u>68,795</u>	繰延税金資産		退職給付引当金	395,589	ソフトウェア償却	101,933	投資有価証券評価損	56,627	特定外国子会社留保金額	193,760	その他有価証券評価差額金	2,362	その他	<u>14,742</u>	繰延税金資産計	765,014	評価性引当額	<u>730,620</u>	繰延税金資産合計	<u>34,393</u>	繰延税金資産の純額	<u>34,393</u>	<p>1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 (単位：千円)</p> <p>(1) 流動の部</p> <table> <tr><td>繰延税金資産</td><td></td></tr> <tr><td>賞与引当金</td><td style="text-align: right;">119,486</td></tr> <tr><td>未払社会保険料</td><td style="text-align: right;">12,746</td></tr> <tr><td>未払事業税</td><td style="text-align: right;">100,639</td></tr> <tr><td>未払事業所税</td><td style="text-align: right;">6,089</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;"><u>5,807</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産計</td><td style="text-align: right;">244,770</td></tr> <tr><td>評価性引当額</td><td style="text-align: right;">-</td></tr> <tr><td>繰延税金資産合計</td><td style="text-align: right;"><u>244,770</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産の純額</td><td style="text-align: right;"><u>244,770</u></td></tr> </table> <p>(2) 固定の部</p> <table> <tr><td>繰延税金資産</td><td></td></tr> <tr><td>退職給付引当金</td><td style="text-align: right;">462,957</td></tr> <tr><td>ソフトウェア償却</td><td style="text-align: right;">111,245</td></tr> <tr><td>投資有価証券評価損</td><td style="text-align: right;">73,440</td></tr> <tr><td>特定外国子会社留保金額</td><td style="text-align: right;">213,896</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;"><u>8,735</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産計</td><td style="text-align: right;">870,274</td></tr> <tr><td>評価性引当額</td><td style="text-align: right;"><u>289,785</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産合計</td><td style="text-align: right;">580,489</td></tr> <tr><td>繰延税金負債</td><td></td></tr> <tr><td>その他有価証券評価差額金</td><td style="text-align: right;"><u>55,668</u></td></tr> <tr><td>繰延税金負債合計</td><td style="text-align: right;"><u>55,668</u></td></tr> <tr><td>繰延税金資産の純額</td><td style="text-align: right;"><u>524,820</u></td></tr> </table>	繰延税金資産		賞与引当金	119,486	未払社会保険料	12,746	未払事業税	100,639	未払事業所税	6,089	その他	<u>5,807</u>	繰延税金資産計	244,770	評価性引当額	-	繰延税金資産合計	<u>244,770</u>	繰延税金資産の純額	<u>244,770</u>	繰延税金資産		退職給付引当金	462,957	ソフトウェア償却	111,245	投資有価証券評価損	73,440	特定外国子会社留保金額	213,896	その他	<u>8,735</u>	繰延税金資産計	870,274	評価性引当額	<u>289,785</u>	繰延税金資産合計	580,489	繰延税金負債		その他有価証券評価差額金	<u>55,668</u>	繰延税金負債合計	<u>55,668</u>	繰延税金資産の純額	<u>524,820</u>
繰延税金資産																																																																																													
賞与引当金	118,748																																																																																												
未払社会保険料	12,792																																																																																												
未払事業所税	6,134																																																																																												
その他	<u>5,436</u>																																																																																												
繰延税金資産計	143,111																																																																																												
評価性引当額	-																																																																																												
繰延税金資産合計	143,111																																																																																												
繰延税金負債																																																																																													
未収還付税金	<u>74,316</u>																																																																																												
繰延税金負債合計	<u>74,316</u>																																																																																												
繰延税金資産の純額	<u>68,795</u>																																																																																												
繰延税金資産																																																																																													
退職給付引当金	395,589																																																																																												
ソフトウェア償却	101,933																																																																																												
投資有価証券評価損	56,627																																																																																												
特定外国子会社留保金額	193,760																																																																																												
その他有価証券評価差額金	2,362																																																																																												
その他	<u>14,742</u>																																																																																												
繰延税金資産計	765,014																																																																																												
評価性引当額	<u>730,620</u>																																																																																												
繰延税金資産合計	<u>34,393</u>																																																																																												
繰延税金資産の純額	<u>34,393</u>																																																																																												
繰延税金資産																																																																																													
賞与引当金	119,486																																																																																												
未払社会保険料	12,746																																																																																												
未払事業税	100,639																																																																																												
未払事業所税	6,089																																																																																												
その他	<u>5,807</u>																																																																																												
繰延税金資産計	244,770																																																																																												
評価性引当額	-																																																																																												
繰延税金資産合計	<u>244,770</u>																																																																																												
繰延税金資産の純額	<u>244,770</u>																																																																																												
繰延税金資産																																																																																													
退職給付引当金	462,957																																																																																												
ソフトウェア償却	111,245																																																																																												
投資有価証券評価損	73,440																																																																																												
特定外国子会社留保金額	213,896																																																																																												
その他	<u>8,735</u>																																																																																												
繰延税金資産計	870,274																																																																																												
評価性引当額	<u>289,785</u>																																																																																												
繰延税金資産合計	580,489																																																																																												
繰延税金負債																																																																																													
その他有価証券評価差額金	<u>55,668</u>																																																																																												
繰延税金負債合計	<u>55,668</u>																																																																																												
繰延税金資産の純額	<u>524,820</u>																																																																																												
<p>2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳</p> <p style="text-align: right;">(%)</p> <table> <tr><td>法定実効税率</td><td style="text-align: right;">40.7</td></tr> <tr><td>(調整)</td><td></td></tr> <tr><td>評価性引当額の増減</td><td style="text-align: right;">5.4</td></tr> <tr><td>交際費等永久に損金に算入されない項目</td><td style="text-align: right;">0.5</td></tr> <tr><td>住民税均等割等</td><td style="text-align: right;">0.2</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;"><u>1.4</u></td></tr> <tr><td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td><td style="text-align: right;"><u>48.2</u></td></tr> </table>	法定実効税率	40.7	(調整)		評価性引当額の増減	5.4	交際費等永久に損金に算入されない項目	0.5	住民税均等割等	0.2	その他	<u>1.4</u>	税効果会計適用後の法人税等の負担率	<u>48.2</u>	<p>2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳</p> <p style="text-align: right;">(%)</p> <table> <tr><td>法定実効税率</td><td style="text-align: right;">40.7</td></tr> <tr><td>(調整)</td><td></td></tr> <tr><td>評価性引当額の増減</td><td style="text-align: right;">11.6</td></tr> <tr><td>交際費等永久に損金に算入されない項目</td><td style="text-align: right;">0.2</td></tr> <tr><td>住民税均等割等</td><td style="text-align: right;">0.1</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;"><u>0.2</u></td></tr> <tr><td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td><td style="text-align: right;"><u>29.1</u></td></tr> </table>	法定実効税率	40.7	(調整)		評価性引当額の増減	11.6	交際費等永久に損金に算入されない項目	0.2	住民税均等割等	0.1	その他	<u>0.2</u>	税効果会計適用後の法人税等の負担率	<u>29.1</u>																																																																
法定実効税率	40.7																																																																																												
(調整)																																																																																													
評価性引当額の増減	5.4																																																																																												
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.5																																																																																												
住民税均等割等	0.2																																																																																												
その他	<u>1.4</u>																																																																																												
税効果会計適用後の法人税等の負担率	<u>48.2</u>																																																																																												
法定実効税率	40.7																																																																																												
(調整)																																																																																													
評価性引当額の増減	11.6																																																																																												
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.2																																																																																												
住民税均等割等	0.1																																																																																												
その他	<u>0.2</u>																																																																																												
税効果会計適用後の法人税等の負担率	<u>29.1</u>																																																																																												

## （関連当事者情報）

第24期(自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)

## 1. 親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等

（単位：千円）

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金、出資金又は基金	事業の内容又は職業	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
その他の関係会社	住友生命保険(相)	大阪府 大阪市 中央区	199,000,000	生命保険業	% (被所有) 直接40	当社の主要顧客 投信の販売委託	投資助言報酬 委託販売手数料	1,151,492 227,288	未収投資助言報酬 未払手数料	267,215 34,564
その他の関係会社	(株)三井住友銀行	東京都 千代田区	664,986,500	銀行業	% (被所有) 直接27.5	投信の販売委託 役員の兼任	委託販売手数料	2,114,655	未払手数料	180,287

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(1)投資助言契約の受託については、当社規定の投資助言料率に基づき決定しております。

(2)その他営業取引については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

## （追加情報）

当事業年度から平成18年10月17日公表の、「関連当事者の開示に関する会計基準」（企業会計基準委員会 企業会計基準第11号）及び「関連当事者の開示に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準委員会 企業会計基準第13号）を適用しております。

第25期(自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)

## 1. 親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等

（単位：千円）

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

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

## 2. その他の関係会社の子会社等

（単位：千円）

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

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

## 2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

## ( 1株当たり情報 )

第24期 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)	第25期 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)
1株当たり純資産額 1,405,954円57銭 1株当たり当期純利益 96,132円19銭	1株当たり純資産額 1,513,927円30銭 1株当たり当期純利益 150,963円55銭
なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	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 24,801,038千円 普通株式に係る純資産額 24,801,038千円 普通株式の発行済株式数 17,640株 1株当たり純資産額の算定に用いられた普通株式の数 17,640株	( 1株当たり純資産額の算定上の基礎 ) 貸借対照表の純資産の部の合計額 26,705,677千円 普通株式に係る純資産額 26,705,677千円 普通株式の発行済株式数 17,640株 1株当たり純資産額の算定に用いられた普通株式の数 17,640株
( 1株当たり当期純利益の算定上の基礎 ) 損益計算書上の当期純利益 1,695,771千円 普通株式に係る当期純利益 1,695,771千円 普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。 普通株式の期中平均株式数 17,640株	( 1株当たり当期純利益の算定上の基礎 ) 損益計算書上の当期純利益 2,662,997千円 普通株式に係る当期純利益 2,662,997千円 普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。 普通株式の期中平均株式数 17,640株

## ( 重要な後発事象 )

第24期(自平成20年4月1日至平成21年3月31日)

該当事項はありません。

第25期(自平成21年4月1日至平成22年3月31日)

該当事項はありません。

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

#### 5【その他】

##### イ 定款の変更、その他の重要事項

平成22年6月24日に開催された定時株主総会において、監査体制の一層の充実を図るため、監査役の員数を1名増員し5名以内とする定款の変更が決議されました。

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

イ 受託会社

（イ）名称 住友信託銀行株式会社

（ロ）資本金の額 342,037百万円（平成22年3月末現在）

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

#### 【参考情報：再信託受託会社の概要】

・ 名称 日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

・ 資本金の額 51,000百万円（平成22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 369,000百万円（平成22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】

- 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。
- 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。
- 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。
- 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。
- 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。
- 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。
- 評価機関等から当ファンドに対する評価を取得し、使用することがあります。





## （参考情報）

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」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、監査の対象外となっております。

「国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）」の状況

## （１）貸借対照表

対象年月日	（平成21年4月13日現在）	（平成22年4月13日現在）
科目	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	6,697,945,226	6,077,571,323
株式	266,124,701,700	345,374,324,198
派生商品評価勘定	282,868,717	155,157,700
未収入金	4,691,082	-
未収配当金	2,949,052,736	3,130,205,295
未収利息	14,680	8,325
流動資産合計	276,059,274,141	354,737,266,841
資産合計	276,059,274,141	354,737,266,841
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	27,586,800
前受金	283,895,000	127,930,000
未払金	10,415,000	47,795,250
未払解約金	51,135,617	576,674,976
流動負債合計	345,445,617	779,987,026
負債合計	345,445,617	779,987,026
純資産の部		

元本等		
1 元本		
元本	254,319,939,520	275,836,932,817
元本合計	254,319,939,520	275,836,932,817
2 剰余金		
剰余金	21,393,889,004	78,120,346,998
剰余金合計	21,393,889,004	78,120,346,998
元本等合計	275,713,828,524	353,957,279,815
純資産合計	275,713,828,524	353,957,279,815
負債・純資産合計	276,059,274,141	354,737,266,841

(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21年4月13日ならびに平成22年4月13日現在における同マザーファンドの状況です。

## (2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自平成20年3月31日 至平成21年4月13日	自平成21年4月14日 至平成22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）、ジャスダック証券取引所が発表する基準値段または金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	株式（売買目的有価証券） 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、または金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。	先物取引 同左
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。	受取配当金の計上基準 同左

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成21年4月13日現在)	(平成22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: center;">10,244,000,000円</td> </tr> </table>	<u>担保資産</u>	<u>金額</u>	株式	10,244,000,000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: center;">4,446,000,000円</td> </tr> </table>	<u>担保資産</u>	<u>金額</u>	株式	4,446,000,000円
<u>担保資産</u>	<u>金額</u>									
株式	10,244,000,000円									
<u>担保資産</u>	<u>金額</u>									
株式	4,446,000,000円									
2. 受益権総数	平成21年4月13日現在における受益権の総数 254,319,939,520口	平成22年4月13日現在における受益権の総数 275,836,932,817口								
3. 1単位当たり純資産額	1.0841円 (1万口 = 10,841円)	1.2832円 (1万口 = 12,832円)								

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

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

・金融商品の状況に関する事項

項目	自平成21年4月14日 至平成22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。
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。 なお、当計算期間末の保有については、附属明細表に記載しております。</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ため、ならびに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。 なお、当計算期間末における残高については、「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</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理ならびにコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。リスクを管理する部署では、各種リスクごとに定められた頻度で、測定項目が上下限值（リミットあるいは注意レベル）内に収まっているかどうかのモニタリングを行っております。上下限値を越えていることが発見された場合は、原則として速やかに修正を行うよう、リスク管理を行う部署から関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われます。また、是正勧告あるいは報告を受けた関連運用グループでは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、リスク管理を行う部署は、上下限値に抵触した事実ならびにその後の対処結果、あるいは関連運用グループの対処方針の決定に関し、必要に応じて、リスク管理を行う部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員、およびリスク管理委員会へ報告する体制となっております。</p>

4. 金融商品の時価等に関する事項について  
金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	自平成21年4月14日 至平成22年4月13日
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（株式） 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コールローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## 取引の状況に関する事項

項目	自平成20年3月31日 至平成21年4月13日
1. 取引の内容	当ファンドの行うことのできるデリバティブ取引は、次の通りです。 わが国の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。
2. 取引に対する取組方針	デリバティブ取引につきましては信託約款等に従っており、その制限を遵守しております。
3. 取引の利用目的	信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、および価格変動リスクを回避するため。
4. 取引に係るリスクの内容	デリバティブ取引に伴いファンドに影響を与える主なリスクとして価格変動リスクがあります。
5. 取引に係るリスクの管理体制	リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理ならびにコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。
6. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	該当事項はありません。

## ．取引の時価等に関する事項

## デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

## 株式関連

（平成21年4月13日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 （TOPIX先物）				
	買建	9,273,055,000 (9,274,081,283)	- (-)	9,556,950,000	283,895,000 (282,868,717)
	買建 合計	9,273,055,000 (9,274,081,283)	- (-)	9,556,950,000	283,895,000 (282,868,717)

（平成22年4月13日現在）

## １．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 株式関連

（単位：円）

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

（注）１．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については以下のように評価しております。

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

評価しております。

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

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

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20年3月31日 至 平成21年4月13日 )

該当事項はありません。

( 自 平成21年4月14日 至 平成22年4月13日 )

該当事項はありません。

## （その他の注記）

(平成21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	164,301,406,709円
同期中における追加設定元本額	103,039,454,046円
同期中における一部解約元本額	13,020,921,235円
平成21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	5,843,648,760円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	200,776,198円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	1,109,630,927円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	648,705,460円
スミセイ・DCバランスファンド（機動的資産配分型）	2,931,591円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	175,991円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	212,074円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	228,860円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	235,153円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	238,656円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	274,529円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	78,297,630,791円
バランスファンドVA（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	1,454,293,240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＞	57,685,365,632円
SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	19,967,435,196円
SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	9,071,247,548円
SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	30,175,904,791円
SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	190,021,403円
SMAM・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	610,215,767円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	111,342,622円
SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	2,775,293,405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＞	124,854,675円
SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	889,305,248円
SMAM・インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞	3,204,273,525円
SMAM・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	5,408,859,280円
SMAM・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	12,082,172,968円
SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	1,462,428,556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）	4,531,390,068円
SMAM・グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	217,963,490円
SMAM・バランスファンドVA20＜適格機関投資家専用＞	1,790,927,994円



三井住友・7資産バランスファンド・V A S ( 適格機関投資家専用 )	16,461,955,122円
合 計	254,319,939,520円

(平成22年 4月13日現在)

本有価証券報告書における開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	254,319,939,520円
同期中における追加設定元本額	63,002,395,920円
同期中における一部解約元本額	41,485,402,623円
平成22年 4月13日現在における元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	6,709,083,714円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	250,023,428円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	1,407,096,431円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	901,850,730円
スミセイ・DCバランスファンド（機動的資産配分型）	11,392,343円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	2,549,053円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	338,059円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	2,926,011円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	419,952円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	241,579円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	891,908円
国内株式指数ファンド（TOPIX）	83,036,427円
SMAM・国内株式バッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	72,694,779,420円
バランスファンドVA（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	1,051,808,715円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型＜適格機関投資家限定＞	50,610,519,734円
SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	16,849,761,449円
SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	8,238,559,246円
SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	27,937,268,563円
SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	169,568,801円
SMAM・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	557,484,160円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	105,360,772円
SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	2,579,791,777円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型＜適格機関投資家限定＞	124,104,806円
SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	1,068,445,668円
SMAM・インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞	3,615,048,459円
SMAM・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	4,882,590,404円
SMAM・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	12,098,902,936円
SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	1,366,607,879円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	10,285,570,403円
SMAM・グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	216,627,919円
SMAM・バランスファンドVA20＜適格機関投資家専用＞	2,962,375,576円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	44,344,558,865円

SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	299,434,358円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	153,743,885円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	60,311,161円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	900,325,560円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	1,588,872,617円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	544,371,625円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	81,983,940円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	35,699,579円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	8,704,256円
SMAM・アセットバランスファンドVA30L2<適格機関投資家専用>	37,571,176円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L2<適格機関投資家専用>	996,329,473円
合計	275,836,932,817円

## (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	123,000	192	23,616,000	
日本水産	313,200	275	86,130,000	
マルハニチロホールディングス	631,000	135	85,185,000	
サカタのタネ	43,700	1,260	55,062,000	
ホクト	32,200	1,913	61,598,600	
住石ホールディングス	79,800	110	8,778,000	
日鉄鉱業	83,000	444	36,852,000	
三井松島産業	175,000	219	38,325,000	
国際石油開発帝石	1,439	710,000	1,021,690,000	
日本海洋掘削	5,000	5,110	25,550,000	
関東天然瓦斯開発	29,000	510	14,790,000	
石油資源開発	49,700	4,830	240,051,000	
ショーボンドホールディングス	28,300	1,726	48,845,800	
ダイセキ環境ソリューション	43	126,600	5,443,800	
間組	144,000	90	12,960,000	
東急建設	109,620	292	32,009,040	
コムシスホールディングス	128,200	931	119,354,200	
ミサワホーム	42,400	335	14,204,000	
高松コンストラクショングループ	24,600	1,139	28,019,400	
東建コーポレーション	11,230	2,863	32,151,490	
ヤマウラ	15,500	200	3,100,000	
大成建設	1,413,300	210	296,793,000	
大林組	818,000	430	351,740,000	
清水建設	829,000	395	327,455,000	
長谷工コーポレーション	1,855,500	94	174,417,000	

松井建設	37,000	358	13,246,000	
鹿島建設	1,295,000	230	297,850,000	
鉄建建設	202,000	91	18,382,000	
安藤建設	110,000	131	14,410,000	
太平工業	44,000	426	18,744,000	
西松建設	403,000	141	56,823,000	
三井住友建設	191,500	91	17,426,500	
大豊建設	103,000	96	9,888,000	
前田建設工業	218,000	290	63,220,000	
佐田建設	80,000	48	3,840,000	
ナカノフドー建設	28,500	194	5,529,000	
奥村組	282,000	321	90,522,000	
大和小田急建設	20,000	279	5,580,000	
東鉄工業	36,000	541	19,476,000	
イチケン	46,000	126	5,796,000	
浅沼組	116,000	79	9,164,000	
戸田建設	345,000	347	119,715,000	
熊谷組	264,000	73	19,272,000	
青木あすなる建設	24,000	425	10,200,000	
北野建設	73,000	217	15,841,000	
植木組	49,000	133	6,517,000	
三井ホーム	32,000	512	16,384,000	
矢作建設工業	40,000	564	22,560,000	
ピーエス三菱	25,700	322	8,275,400	
大東建託	126,200	4,620	583,044,000	
新日本建設	47,200	176	8,307,200	
N I P P O	63,000	731	46,053,000	
東亜道路工業	56,000	172	9,632,000	
前田道路	81,000	789	63,909,000	
日本道路	93,000	238	22,134,000	
東亜建設工業	273,000	113	30,849,000	

東洋建設	434,000	56	24,304,000	
五洋建設	340,500	142	48,351,000	
大林道路	44,000	221	9,724,000	
世紀東急工業	110,000	66	7,260,000	
福田組	53,000	179	9,487,000	
住友林業	215,800	777	167,676,600	
日本基礎技術	39,600	216	8,553,600	
日成ビルド工業	108,000	75	8,100,000	
エス・パイ・エル	168,000	62	10,416,000	
巴コーポレーション	49,400	244	12,053,600	
パナホーム	102,000	621	63,342,000	
大和ハウス工業	732,000	1,037	759,084,000	
ライト工業	72,600	225	16,335,000	
積水ハウス	885,000	911	806,235,000	
日特建設	90,000	57	5,130,000	
北陸電気工事	16,000	257	4,112,000	
コミュニューチャ	24,000	559	13,416,000	
ユアテック	47,000	484	22,748,000	
西部電気工業	23,000	360	8,280,000	
四電工	25,000	449	11,225,000	
中電工	37,500	1,213	45,487,500	
関電工	125,000	609	76,125,000	
大明	34,500	707	24,391,500	
きんでん	184,000	825	151,800,000	
東京エネシス	35,000	668	23,380,000	
トーエネック	39,000	511	19,929,000	
住友電設	21,900	461	10,095,900	
日本電設工業	57,000	766	43,662,000	
協和エクシオ	101,600	791	80,365,600	
新日本空調	22,100	648	14,320,800	
東電通	49,000	163	7,987,000	

日本電話施設	48,000	285	13,680,000	
九電工	54,000	560	30,240,000	
三機工業	67,000	678	45,426,000	
日揮	293,000	1,680	492,240,000	
中外炉工業	97,000	272	26,384,000	
ヤマト	30,000	327	9,810,000	
太平電業	38,000	854	32,452,000	
高砂熱学工業	82,900	761	63,086,900	
三晃金属工業	41,000	235	9,635,000	
NEC ネットエスアイ	22,000	1,235	27,170,000	
朝日工業社	34,000	386	13,124,000	
大気社	43,100	1,645	70,899,500	
ダイダン	39,000	508	19,812,000	
日比谷総合設備	42,200	822	34,688,400	
東芝プラントシステム	43,000	1,052	45,236,000	
東洋エンジニアリング	186,000	359	66,774,000	
千代田化工建設	229,000	919	210,451,000	
新興ブランテック	52,900	878	46,446,200	
日本製粉	182,000	464	84,448,000	
日清製粉グループ本社	284,500	1,207	343,391,500	
日東富士製粉	22,000	348	7,656,000	
昭和産業	128,000	285	36,480,000	
鳥越製粉	24,300	758	18,419,400	
協同飼料	127,000	121	15,367,000	
中部飼料	31,000	836	25,916,000	
日本配合飼料	98,000	120	11,760,000	
ユニ・チャーム ペットケア	18,500	3,080	56,980,000	
東洋精糖	57,000	126	7,182,000	
日本甜菜製糖	162,000	226	36,612,000	
三井製糖	115,000	318	36,570,000	
森永製菓	311,000	207	64,377,000	

中村屋	74,000	461	34,114,000	
江崎グリコ	113,000	1,081	122,153,000	
名糖産業	14,100	1,309	18,456,900	
不二家	179,000	205	36,695,000	
山崎製パン	231,000	1,172	270,732,000	
第一屋製パン	44,000	126	5,544,000	
モロゾフ	45,000	303	13,635,000	
森永乳業	263,000	366	96,258,000	
ヤクルト本社	169,300	2,513	425,450,900	
明治ホールディングス	93,200	3,565	332,258,000	
雪印メグミルク	63,100	1,524	96,164,400	
プリマハム	176,000	104	18,304,000	
日本ハム	218,000	1,242	270,756,000	
伊藤ハム	193,000	346	66,778,000	
林兼産業	106,000	123	13,038,000	
丸大食品	132,000	265	34,980,000	
米久	26,000	811	21,086,000	
S Foods	17,500	789	13,807,500	
サッポロホールディングス	447,000	487	217,689,000	
アサヒビール	548,200	1,750	959,350,000	
キリンホールディングス	1,289,000	1,368	1,763,352,000	
宝ホールディングス	246,000	534	131,364,000	
オエノンホールディングス	92,000	190	17,480,000	
メルシャン	98,000	194	19,012,000	
養命酒製造	22,000	901	19,822,000	
三国コカ・コーラボトリング	33,000	758	25,014,000	
コカ・コーラウエスト	77,200	1,590	122,748,000	
コカ・コーラ セントラル ジャパン	34,100	1,237	42,181,700	
ダイトードリンコ	13,400	3,360	45,024,000	
伊藤園	79,500	1,477	117,421,500	
キーコーヒー	23,900	1,580	37,762,000	



ジャパンフーズ	4,400	887	3,902,800	
日清オイリオグループ	121,000	466	56,386,000	
不二製油	76,500	1,295	99,067,500	
J - オイルミルズ	123,000	291	35,793,000	
キッコーマン	240,000	1,110	266,400,000	
味の素	794,000	887	704,278,000	
キューピー	161,700	1,028	166,227,600	
ハウス食品	116,100	1,352	156,967,200	
カゴメ	113,200	1,587	179,648,400	
焼津水産化学工業	15,100	1,161	17,531,100	
アリアケジャパン	26,600	1,387	36,894,200	
ニチレイ	329,000	374	123,046,000	
東洋水産	136,000	2,332	317,152,000	
日清食品ホールディングス	102,100	3,175	324,167,500	
永谷園	25,000	868	21,700,000	
フジッコ	28,000	1,069	29,932,000	
ロック・フィールド	13,500	1,390	18,765,000	
日本たばこ産業	6,548	329,500	2,157,566,000	
わらべや日洋	16,900	1,144	19,333,600	
なとり	9,700	824	7,992,800	
ミヨシ油脂	112,000	149	16,688,000	
片倉工業	33,900	904	30,645,600	
グンゼ	204,000	359	73,236,000	
川島織物セルコン	123,000	85	10,455,000	
東洋紡績	984,000	148	145,632,000	
ユニチカ	630,000	83	52,290,000	
富士紡ホールディングス	130,000	158	20,540,000	
日清紡ホールディングス	194,000	983	190,702,000	
倉敷紡績	290,000	161	46,690,000	
シキボウ	186,000	148	27,528,000	
日本毛織	100,000	745	74,500,000	

トーア紡コーポレーション	125,000	84	10,500,000	
ダイドーリミテッド	38,100	722	27,508,200	
帝国繊維	30,000	472	14,160,000	
帝人	1,035,000	316	327,060,000	
東レ	1,834,000	537	984,858,000	
三菱レイヨン	266,000	400	106,400,000	
サカイオーベックス	88,000	106	9,328,000	
住江織物	78,000	233	18,174,000	
日本フェルト	13,100	428	5,606,800	
イチカワ	28,000	184	5,152,000	
日本バイリーン	37,000	432	15,984,000	
日東製網	42,000	122	5,124,000	
芦森工業	73,000	145	10,585,000	
アツギ	273,000	124	33,852,000	
ダイニック	60,000	177	10,620,000	
セーレン	70,600	562	39,677,200	
小松精練	45,000	378	17,010,000	
ワコールホールディングス	162,000	1,183	191,646,000	
ホギメディカル	13,100	4,650	60,915,000	
サンエー・インターナショナル	14,500	1,367	19,821,500	
レナウン	15,000	187	2,805,000	
クラウディア	3,300	1,268	4,184,400	
三陽商会	129,000	346	44,634,000	
オンワードホールディングス	180,000	785	141,300,000	
ルック	64,000	107	6,848,000	
ゴールドウイン	76,000	205	15,580,000	
東京スタイル	97,000	701	67,997,000	
デサント	78,000	585	45,630,000	
ヤマトインターナショナル	14,400	378	5,443,200	
特種東海ホールディングス	190,000	258	49,020,000	
王子製紙	1,208,000	429	518,232,000	

三菱製紙	403,000	117	47,151,000	
北越紀州製紙	182,500	493	89,972,500	
中越バルブ工業	117,000	180	21,060,000	
巴川製紙所	11,000	200	2,200,000	
大王製紙	124,000	781	96,844,000	
日本製紙グループ本社	122,000	2,551	311,222,000	
レンゴー	222,000	540	119,880,000	
トーモク	92,000	223	20,516,000	
ザ・バック	19,000	1,501	28,519,000	
クラレ	400,500	1,222	489,411,000	
旭化成	1,588,000	505	801,940,000	
共和レザー	15,500	414	6,417,000	
コープケミカル	52,000	147	7,644,000	
昭和電工	1,833,000	205	375,765,000	
住友化学	1,879,000	475	892,525,000	
日本化成	63,000	187	11,781,000	
住友精化	53,000	357	18,921,000	
日産化学工業	181,000	1,310	237,110,000	
ラサ工業	124,000	116	14,384,000	
クレハ	178,000	440	78,320,000	
テイカ	42,000	253	10,626,000	
石原産業	508,000	88	44,704,000	
片倉チッカリン	15,000	288	4,320,000	
日本曹達	179,000	415	74,285,000	
東ソー	684,000	250	171,000,000	
トクヤマ	457,000	533	243,581,000	
セントラル硝子	278,000	484	134,552,000	
東亜合成	324,000	395	127,980,000	
ダイソー	119,000	239	28,441,000	
関東電化工業	65,000	733	47,645,000	
電気化学工業	575,000	402	231,150,000	

信越化学工業	452,700	5,510	2,494,377,000	
日本カーバイド工業	70,000	209	14,630,000	
堺化学工業	103,000	439	45,217,000	
エア・ウォーター	219,000	1,030	225,570,000	
大陽日酸	387,000	857	331,659,000	
日本化学工業	110,000	243	26,730,000	
日本パーカライズン	64,000	1,210	77,440,000	
高圧ガス工業	41,000	557	22,837,000	
チタン工業	38,000	269	10,222,000	
四国化成工業	39,000	547	21,333,000	
戸田工業	45,000	725	32,625,000	
ステラ ケミファ	14,000	3,710	51,940,000	
保土谷化学工業	67,000	369	24,723,000	
日本触媒	162,000	838	135,756,000	
大日精化工業	108,000	361	38,988,000	
カネカ	368,000	601	221,168,000	
三菱瓦斯化学	464,000	556	257,984,000	
三井化学	1,068,000	297	317,196,000	
J S R	268,000	1,954	523,672,000	
東京応化工業	49,300	1,913	94,310,900	
三菱ケミカルホールディングス	1,574,500	487	766,781,500	
日本合成化学工業	70,000	614	42,980,000	
ダイセル化学工業	352,000	621	218,592,000	
住友ベークライト	252,000	520	131,040,000	
積水化学工業	565,000	654	369,510,000	
日本ゼオン	253,000	521	131,813,000	
アイカ工業	72,100	993	71,595,300	
宇部興産	1,238,000	245	303,310,000	
積水樹脂	36,000	821	29,556,000	
タキロン	66,000	279	18,414,000	
旭有機材工業	95,000	232	22,040,000	

日立化成工業	126,500	1,992	251,988,000	
ニチバン	26,000	328	8,528,000	
リケンテクノス	52,000	295	15,340,000	
大倉工業	73,000	262	19,126,000	
積水化成成品工業	78,000	430	33,540,000	
群栄化学工業	79,000	226	17,854,000	
タイガースポリマー	16,700	357	5,961,900	
日本カーリット	23,800	449	10,686,200	
日本化薬	207,000	833	172,431,000	
日本精化	24,300	719	17,471,700	
A D E K A	116,900	912	106,612,800	
日油	245,000	367	89,915,000	
ハリマ化成	26,000	543	14,118,000	
花王	754,000	2,382	1,796,028,000	
第一工業製薬	53,000	259	13,727,000	
三洋化成工業	81,000	555	44,955,000	
大日本塗料	177,000	108	19,116,000	
日本ペイント	255,000	594	151,470,000	
関西ペイント	331,000	750	248,250,000	
中国塗料	80,000	661	52,880,000	
日本特殊塗料	23,900	382	9,129,800	
藤倉化成	33,900	492	16,678,800	
太陽インキ製造	21,500	2,586	55,599,000	
D I C	896,000	214	191,744,000	
サカタインクス	60,000	453	27,180,000	
東洋インキ製造	267,000	413	110,271,000	
富士フイルムホールディングス	583,600	3,245	1,893,782,000	
資生堂	500,300	2,023	1,012,106,900	
ライオン	339,000	481	163,059,000	
高砂香料工業	86,000	482	41,452,000	
マンダム	27,800	2,572	71,501,600	

ミルボン	13,300	2,179	28,980,700	
ファンケル	56,100	1,795	100,699,500	
コーセー	42,800	2,226	95,272,800	
ドクターシーラボ	188	225,800	42,450,400	
エステー	17,100	1,055	18,040,500	
コニシ	22,100	1,078	23,823,800	
長谷川香料	37,000	1,450	53,650,000	
小林製薬	40,600	3,935	159,761,000	
荒川化学工業	22,100	1,119	24,729,900	
メック	23,700	550	13,035,000	
日本高純度化学	80	308,000	24,640,000	
荏原ユーザライト	4,000	1,614	6,456,000	
アース製薬	20,200	2,810	56,762,000	
イハラケミカル工業	54,000	278	15,012,000	
北興化学工業	29,000	308	8,932,000	
大成ラミック	6,600	2,291	15,120,600	
クミアイ化学工業	67,000	289	19,363,000	
日本農薬	64,000	550	35,200,000	
アキレス	226,000	145	32,770,000	
有沢製作所	39,900	708	28,249,200	
日東電工	227,500	3,680	837,200,000	
レック	8,800	1,603	14,106,400	
アロン化成	20,000	399	7,980,000	
きもと	24,100	801	19,304,100	
藤森工業	20,600	1,381	28,448,600	
前澤化成工業	19,200	948	18,201,600	
J S P	20,500	1,118	22,919,000	
エフビコ	12,900	4,165	53,728,500	
天馬	21,400	1,153	24,674,200	
信越ポリマー	52,100	699	36,417,900	
東リ	65,000	180	11,700,000	

ニフコ	61,700	2,083	128,521,100	
日本バルカー工業	118,000	210	24,780,000	
ユニ・チャーム	54,100	9,200	497,720,000	
協和発酵キリン	353,000	1,014	357,942,000	
武田薬品工業	1,033,500	4,165	4,304,527,500	
アステラス製薬	581,200	3,445	2,002,234,000	
大日本住友製薬	209,500	860	180,170,000	
塩野義製薬	400,100	1,794	717,779,400	
田辺三菱製薬	245,000	1,320	323,400,000	
わかもと製薬	35,000	326	11,410,000	
あすか製薬	33,000	651	21,483,000	
日本新薬	70,000	1,070	74,900,000	
中外製薬	293,900	1,812	532,546,800	
科研製薬	127,000	775	98,425,000	
エーザイ	337,200	3,390	1,143,108,000	
ロート製薬	126,000	1,062	133,812,000	
小野薬品工業	136,800	4,040	552,672,000	
久光製薬	83,200	3,555	295,776,000	
有機合成薬品工業	32,000	248	7,936,000	
持田製薬	108,000	907	97,956,000	
大正製薬	235,000	1,719	403,965,000	
参天製薬	84,000	2,924	245,616,000	
扶桑薬品工業	105,000	304	31,920,000	
日本ケミファ	51,000	284	14,484,000	
ツムラ	81,800	2,772	226,749,600	
キッセイ薬品工業	56,000	2,050	114,800,000	
生化学工業	53,200	979	52,082,800	
栄研化学	20,900	906	18,935,400	
日水製薬	10,300	686	7,065,800	
鳥居薬品	17,700	1,784	31,576,800	
東和薬品	13,900	5,170	71,863,000	

沢井製薬	18,400	7,120	131,008,000	
ゼリア新薬工業	44,000	968	42,592,000	
第一三共	867,500	1,751	1,518,992,500	
キョーリン	74,000	1,355	100,270,000	
昭和シェル石油	263,900	669	176,549,100	
コスモ石油	739,000	248	183,272,000	
ニチレキ	35,000	450	15,750,000	
東燃ゼネラル石油	393,000	810	318,330,000	
ユシロ化学工業	14,000	1,209	16,926,000	
ビーピー・カストロール	15,300	352	5,385,600	
AOCホールディングス	68,300	630	43,029,000	
出光興産	31,500	7,470	235,305,000	
JXホールディングス	2,830,470	546	1,545,436,620	
横浜ゴム	299,000	416	124,384,000	
東洋ゴム工業	268,000	215	57,620,000	
ブリヂストン	852,200	1,525	1,299,605,000	
住友ゴム工業	205,300	792	162,597,600	
藤倉ゴム工業	16,500	373	6,154,500	
オカモト	107,000	382	40,874,000	
フコク	12,900	810	10,449,000	
ニッタ	27,100	1,516	41,083,600	
東海ゴム工業	46,300	1,214	56,208,200	
三ツ星ベルト	73,000	445	32,485,000	
バンドー化学	107,000	307	32,849,000	
日東紡績	241,000	211	50,851,000	
旭硝子	1,345,000	1,065	1,432,425,000	
日本板硝子	824,000	276	227,424,000	
石塚硝子	38,000	213	8,094,000	
日本山村硝子	112,000	327	36,624,000	
日本電気硝子	478,000	1,313	627,614,000	
オハラ	11,600	1,627	18,873,200	



住友大阪セメント	479,000	164	78,556,000	
太平洋セメント	1,073,000	129	138,417,000	
デイ・シイ	28,800	214	6,163,200	
日本ヒューム	6,000	301	1,806,000	
日本コンクリート工業	47,000	147	6,909,000	
東海カーボン	276,000	546	150,696,000	
日本カーボン	148,000	305	45,140,000	
東洋炭素	14,700	5,260	77,322,000	
ノリタケカンパニーリミテド	152,000	298	45,296,000	
TOTO	422,000	652	275,144,000	
日本碍子	324,000	1,832	593,568,000	
日本特殊陶業	241,000	1,224	294,984,000	
MARUWA	8,200	1,987	16,293,400	
品川リフラクトリーズ	76,000	329	25,004,000	
黒崎播磨	65,000	504	32,760,000	
東京窯業	27,000	232	6,264,000	
ニッカトー	12,300	438	5,387,400	
フジミインコーポレーテッド	27,100	1,590	43,089,000	
エーアンドエーマテリアル	83,000	79	6,557,000	
ニチアス	145,000	412	59,740,000	
ニチハ	32,600	830	27,058,000	
新日本製鐵	7,716,000	359	2,770,044,000	
住友金属工業	5,032,000	282	1,419,024,000	
神戸製鋼所	3,798,000	212	805,176,000	
日新製鋼	1,041,000	195	202,995,000	
中山製鋼所	154,000	156	24,024,000	
合同製鐵	159,000	214	34,026,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	589,900	3,675	2,167,882,500	
東京製鐵	136,500	1,191	162,571,500	
共英製鋼	28,300	1,933	54,703,900	
大和工業	68,800	3,200	220,160,000	

東京鐵鋼	59,000	291	17,169,000	
大阪製鐵	17,600	1,549	27,262,400	
淀川製鋼所	211,000	433	91,363,000	
東洋鋼鈑	64,000	558	35,712,000	
住友鋼管	16,500	617	10,180,500	
丸一鋼管	81,800	1,868	152,802,400	
モリ工業	55,000	295	16,225,000	
大同特殊鋼	454,000	380	172,520,000	
日本高周波鋼業	135,000	120	16,200,000	
日本金属工業	87,000	152	13,224,000	
日本冶金工業	169,000	353	59,657,000	
山陽特殊製鋼	149,000	395	58,855,000	
愛知製鋼	160,000	415	66,400,000	
日立金属	159,000	959	152,481,000	
日本金属	89,000	174	15,486,000	
大平洋金属	204,000	797	162,588,000	
日本電工	129,000	687	88,623,000	
栗本鐵工所	165,000	168	27,720,000	
日本鑄鉄管	39,000	154	6,006,000	
三菱製鋼	179,000	224	40,096,000	
日亜鋼業	41,000	266	10,906,000	
日本精線	27,000	311	8,397,000	
シンニッタン	29,400	299	8,790,600	
新家工業	72,000	133	9,576,000	
日本輕金属	688,000	133	91,504,000	
大紀アルミニウム工業所	50,000	283	14,150,000	
三井金属鋳業	805,000	273	219,765,000	
東邦亜鉛	145,000	474	68,730,000	
三菱マテリアル	1,628,000	276	449,328,000	
住友金属鋳山	710,000	1,427	1,013,170,000	
DOWAホールディングス	328,000	562	184,336,000	

古河機械金属	514,000	121	62,194,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	29,500	3,935	116,082,500	
東邦チタニウム	48,000	2,256	108,288,000	
住友軽金属工業	241,000	101	24,341,000	
古河スカイ	130,000	239	31,070,000	
古河電気工業	864,000	473	408,672,000	
住友電気工業	899,900	1,165	1,048,383,500	
フジクラ	410,000	529	216,890,000	
昭和電線ホールディングス	373,000	104	38,792,000	
タツタ電線	50,000	229	11,450,000	
日立電線	234,000	269	62,946,000	
沖電線	47,000	129	6,063,000	
カナレ電気	2,700	1,205	3,253,500	
平河ヒューテック	6,800	758	5,154,400	
リョービ	171,000	334	57,114,000	
アサヒホールディングス	40,900	1,630	66,667,000	
稲葉製作所	14,800	947	14,015,600	
三協・立山ホールディングス	362,000	146	52,852,000	
トーカロ	14,600	1,982	28,937,200	
アルファＣｏ	11,100	917	10,178,700	
SUMCO	157,900	2,032	320,852,800	
川田テクノロジーズ	7,200	1,654	11,908,800	
東洋製罐	208,800	1,681	350,992,800	
ホッカンホールディングス	70,000	263	18,410,000	
コロナ	14,500	1,173	17,008,500	
横河ブリッジホールディングス	58,000	678	39,324,000	
駒井鉄工	50,000	216	10,800,000	
三和ホールディングス	268,000	319	85,492,000	
文化シャッター	78,000	272	21,216,000	
東洋シャッター	10,200	540	5,508,000	
住生活グループ	360,690	1,905	687,114,450	

日本ファイルコン	25,500	500	12,750,000	
ノーリツ	45,400	1,425	64,695,000	
長府製作所	31,500	2,173	68,449,500	
リンナイ	47,100	4,690	220,899,000	
ダイニチ工業	13,100	666	8,724,600	
日東精工	43,000	304	13,072,000	
三洋工業	57,000	139	7,923,000	
岡部	57,500	369	21,217,500	
中国工業	53,000	110	5,830,000	
東プレ	58,700	759	44,553,300	
高周波熱錬	44,600	756	33,717,600	
東京製綱	187,000	266	49,742,000	
バイオラックス	13,200	2,012	26,558,400	
日本発條	193,000	826	159,418,000	
中央発條	42,000	358	15,036,000	
三益半導体工業	22,400	1,417	31,740,800	
アタカ大機	14,000	240	3,360,000	
日本製鋼所	420,000	1,041	437,220,000	
日立ツール	16,600	976	16,201,600	
三浦工業	39,400	2,372	93,456,800	
タクマ	116,000	236	27,376,000	
ツガミ	83,000	614	50,962,000	
オークマ	190,000	714	135,660,000	
東芝機械	150,000	426	63,900,000	
アマダ	449,000	769	345,281,000	
アイダエンジニアリング	70,000	393	27,510,000	
牧野フライス製作所	136,000	688	93,568,000	
オーエスジー	121,000	1,031	124,751,000	
ダイジェット工業	50,000	145	7,250,000	
旭ダイヤモンド工業	73,000	936	68,328,000	
森精機製作所	135,000	1,178	159,030,000	

ディスコ	26,600	6,230	165,718,000	
日東工器	16,100	2,075	33,407,500	
豊和工業	180,000	81	14,580,000	
大阪機工	113,000	147	16,611,000	
東洋機械金属	11,300	257	2,904,100	
オーエム製作所	23,000	371	8,533,000	
津田駒工業	64,000	186	11,904,000	
島精機製作所	36,000	2,260	81,360,000	
日本スピンドル製造	44,000	160	7,040,000	
日阪製作所	32,000	968	30,976,000	
やまびこ	12,500	1,149	14,362,500	
ペガサスミシン製造	31,500	286	9,009,000	
ナブテスコ	111,000	1,217	135,087,000	
三井海洋開発	20,700	1,736	35,935,200	
レオン自動機	31,000	257	7,967,000	
S M C	87,800	12,590	1,105,402,000	
新川	23,700	1,392	32,990,400	
ホソカワミクロン	49,000	393	19,257,000	
ユニオンツール	18,400	2,670	49,128,000	
オイレス工業	32,900	1,457	47,935,300	
サトー	32,100	1,192	38,263,200	
日本エアーテック	12,600	500	6,300,000	
日精樹脂工業	26,700	324	8,650,800	
ワイエイシイ	14,900	840	12,516,000	
小松製作所	1,219,200	1,883	2,295,753,600	
住友重機械工業	580,000	554	321,320,000	
日立建機	119,900	2,208	264,739,200	
日工	42,000	239	10,038,000	
巴工業	10,700	1,315	14,070,500	
井関農機	286,000	304	86,944,000	
T O W A	29,500	717	21,151,500	

丸山製作所	77,000	196	15,092,000	
北川鉄工所	138,000	177	24,426,000	
クボタ	1,122,000	840	942,480,000	
荏原実業	6,500	1,270	8,255,000	
三菱化工機	77,000	252	19,404,000	
月島機械	46,000	686	31,556,000	
帝国電機製作所	9,800	1,874	18,365,200	
東京機械製作所	105,000	115	12,075,000	
新東工業	55,000	788	43,340,000	
澁谷工業	17,300	763	13,199,900	
アイチ コーポレーション	47,700	434	20,701,800	
小森コーポレーション	77,400	1,257	97,291,800	
鶴見製作所	22,000	659	14,498,000	
住友精密工業	47,000	306	14,382,000	
酒井重工業	63,000	167	10,521,000	
荏原製作所	554,000	479	265,366,000	
石井鐵工所	47,000	186	8,742,000	
西島製作所	26,200	1,978	51,823,600	
ダイキン工業	306,700	3,780	1,159,326,000	
オルガノ	51,000	620	31,620,000	
トーヨーカネツ	150,000	194	29,100,000	
栗田工業	150,200	2,626	394,425,200	
椿本チエイン	153,000	442	67,626,000	
大同工業	60,000	164	9,840,000	
日本コンベヤ	109,000	97	10,573,000	
木村化工機	26,400	853	22,519,200	
アネスト岩田	49,000	330	16,170,000	
ダイフク	110,500	748	82,654,000	
加藤製作所	65,000	202	13,130,000	
油研工業	59,000	202	11,918,000	
タダノ	126,000	489	61,614,000	

フジテック	75,000	542	40,650,000	
シーケーディ	70,700	752	53,166,400	
キトー	93	119,900	11,150,700	
平和	51,500	941	48,461,500	
理想科学工業	24,600	1,114	27,404,400	
SANKYO	76,300	4,350	331,905,000	
日本金銭機械	25,000	867	21,675,000	
マースエンジニアリング	12,800	1,894	24,243,200	
福島工業	8,000	855	6,840,000	
キヤノンファインテック	22,700	1,619	36,751,300	
オーイズミ	13,200	210	2,772,000	
ダイコク電機	9,800	1,715	16,807,000	
アマノ	76,300	847	64,626,100	
サンデン	164,000	337	55,268,000	
蛇の目マシン工業	257,000	79	20,303,000	
マックス	47,000	1,046	49,162,000	
グローリー	78,900	2,330	183,837,000	
大和冷機工業	36,000	497	17,892,000	
セガサミーホールディングス	297,600	1,173	349,084,800	
日本ピストンリング	117,000	120	14,040,000	
リケン	115,000	348	40,020,000	
帝国ピストンリング	37,100	697	25,858,700	
ホシザキ電機	57,000	1,361	77,577,000	
大豊工業	20,300	808	16,402,400	
日本精工	530,000	719	381,070,000	
NTN	608,000	403	245,024,000	
ジェイテクト	253,800	1,132	287,301,600	
不二越	290,000	288	83,520,000	
日本トムソン	93,000	634	58,962,000	
THK	175,800	2,035	357,753,000	
ユーシン精機	13,200	1,411	18,625,200	

前澤給装工業	8,700	1,275	11,092,500	
イーグル工業	33,000	682	22,506,000	
日本ビラー工業	33,000	641	21,153,000	
キッツ	130,000	532	69,160,000	
日立工機	73,500	991	72,838,500	
マキタ	170,600	2,990	510,094,000	
日立造船	1,186,000	133	157,738,000	
三菱重工業	4,413,000	384	1,694,592,000	
I H I	1,928,000	166	320,048,000	
イビデン	184,400	3,340	615,896,000	
コニカミノルタホールディングス	604,000	1,107	668,628,000	
ブラザー工業	363,900	1,121	407,931,900	
ミネベア	386,000	548	211,528,000	
日立製作所	6,019,702	370	2,227,289,740	
東芝	5,916,000	494	2,922,504,000	
三菱電機	2,434,000	843	2,051,862,000	
富士電機ホールディングス	729,000	300	218,700,000	
東洋電機製造	48,000	658	31,584,000	
安川電機	310,000	823	255,130,000	
シンフォニアテクノロジー	163,000	218	35,534,000	
明電舎	265,000	447	118,455,000	
オリジン電気	42,000	383	16,086,000	
デンヨー	25,000	745	18,625,000	
東芝テック	175,000	372	65,100,000	
芝浦メカトロニクス	44,000	392	17,248,000	
マブチモーター	38,100	5,290	201,549,000	
日本電産	126,600	9,560	1,210,296,000	
高岳製作所	113,000	361	40,793,000	
ダイヘン	145,000	421	61,045,000	
日新電機	49,000	494	24,206,000	
大崎電気工業	42,000	902	37,884,000	



オムロン	313,500	2,055	644,242,500	
日東工業	42,300	1,026	43,399,800	
I D E C	38,000	892	33,896,000	
エルピーダメモリ	265,400	2,123	563,444,200	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	509,000	677	344,593,000	
サクサホールディングス	79,000	170	13,430,000	
メルコホールディングス	14,000	2,151	30,114,000	
テクノメディカ	19	282,900	5,375,100	
日本電気	3,410,000	282	961,620,000	
富士通	2,708,000	627	1,697,916,000	
沖電気工業	923,000	92	84,916,000	
岩崎通信機	126,000	94	11,844,000	
電気興業	75,000	478	35,850,000	
サンケン電気	154,000	359	55,286,000	
ナカヨ通信機	31,000	203	6,293,000	
アイホン	17,200	1,646	28,311,200	
ルネサスエレクトロニクス	66,800	997	66,599,600	
セイコーエプソン	209,400	1,510	316,194,000	
ワコム	530	143,600	76,108,000	
アルバック	52,600	2,325	122,295,000	
ナナオ	22,000	2,296	50,512,000	
日本信号	65,900	850	56,015,000	
京三製作所	61,000	477	29,097,000	
能美防災	30,000	589	17,670,000	
ホーチキ	27,000	506	13,662,000	
マスプロ電工	18,400	905	16,652,000	
日本無線	103,000	234	24,102,000	
パナソニック	2,568,000	1,407	3,613,176,000	
シャープ	1,260,000	1,199	1,510,740,000	
アンリツ	141,000	415	58,515,000	
富士通ゼネラル	71,000	406	28,826,000	

日立国際電気	64,000	937	59,968,000	
ソニー	1,402,700	3,395	4,762,166,500	
T D K	135,900	6,220	845,298,000	
帝国通信工業	68,000	235	15,980,000	
三洋電機	2,679,000	154	412,566,000	
宮越商事	9,700	622	6,033,400	
ミツミ電機	83,700	2,164	181,126,800	
タムラ製作所	76,000	325	24,700,000	
アルプス電気	225,500	661	149,055,500	
池上通信機	98,000	88	8,624,000	
パイオニア	307,100	359	110,248,900	
日本電波工業	19,200	1,971	37,843,200	
日本トリム	3,700	1,880	6,956,000	
ローランド ディー . ジー .	12,000	1,482	17,784,000	
フォスター電機	23,700	2,538	60,150,600	
クラリオン	63,000	199	12,537,000	
S M K	88,000	486	42,768,000	
ヨコオ	24,100	630	15,183,000	
東光	131,000	184	24,104,000	
ティアック	164,000	53	8,692,000	
ホシデン	70,800	1,219	86,305,200	
ヒロセ電機	45,400	10,430	473,522,000	
日本航空電子工業	59,000	701	41,359,000	
T O A	34,000	542	18,428,000	
ユニデン	92,000	320	29,440,000	
アルパイン	56,300	1,185	66,715,500	
スミダコーポレーション	20,800	1,067	22,193,600	
アイコム	14,100	2,499	35,235,900	
船井電機	22,300	3,930	87,639,000	
横河電機	281,800	812	228,821,600	
新電元工業	95,000	328	31,160,000	

山武	72,200	2,233	161,222,600	
日本光電工業	48,900	1,901	92,958,900	
チノー	58,000	234	13,572,000	
共和電業	32,000	280	8,960,000	
日本電子材料	12,800	628	8,038,400	
堀場製作所	45,500	2,645	120,347,500	
アドバンテスト	192,000	2,430	466,560,000	
小野測器	37,000	348	12,876,000	
エスベック	29,600	778	23,028,800	
サンクス	27,100	469	12,709,900	
キーエンス	53,000	22,190	1,176,070,000	
日置電機	13,500	1,780	24,030,000	
シスメックス	49,300	5,500	271,150,000	
メガチップス	22,300	1,431	31,911,300	
O B A R A	19,900	1,123	22,347,700	
日本電産コパル電子	29,100	694	20,195,400	
ミヤチテクノス	15,600	725	11,310,000	
東京電波	10,700	732	7,832,400	
澤藤電機	29,000	152	4,408,000	
コーセル	38,600	1,322	51,029,200	
日立メディコ	18,000	819	14,742,000	
新日本無線	19,000	326	6,194,000	
オブテックス	19,800	1,105	21,879,000	
千代田インテグレ	16,100	1,386	22,314,600	
東光電気	20,000	665	13,300,000	
スタンレー電気	174,900	1,708	298,729,200	
岩崎電気	103,000	208	21,424,000	
ウシオ電機	159,000	1,611	256,149,000	
岡谷電機産業	19,000	327	6,213,000	
ヘリオス テクノ ホールディング	30,300	310	9,393,000	
日本セラミック	18,400	1,135	20,884,000	

新神戸電機	24,000	1,026	24,624,000	
日本デジタル研究所	22,400	1,055	23,632,000	
古河電池	19,000	747	14,193,000	
双信電機	15,800	431	6,809,800	
山一電機	2,700	426	1,150,200	
図研	20,400	740	15,096,000	
日本電子	109,000	352	38,368,000	
カシオ計算機	291,600	714	208,202,400	
ファナック	271,800	10,250	2,785,950,000	
日本シイエムケイ	57,200	662	37,866,400	
エンブラス	15,600	1,800	28,080,000	
ローム	130,800	6,850	895,980,000	
浜松ホトニクス	102,800	2,622	269,541,600	
三井ハイテック	39,200	828	32,457,600	
新光電気工業	72,700	1,531	111,303,700	
京セラ	216,900	9,370	2,032,353,000	
太陽誘電	107,000	1,482	158,574,000	
村田製作所	294,900	5,300	1,562,970,000	
ユーシン	32,700	721	23,576,700	
双葉電子工業	48,500	1,888	91,568,000	
北陸電気工業	116,000	187	21,692,000	
パナソニック電工	458,000	1,196	547,768,000	
ニチコン	90,800	1,130	102,604,000	
日本ケミコン	143,000	374	53,482,000	
K O A	37,300	894	33,346,200	
市光工業	78,000	161	12,558,000	
小糸製作所	127,000	1,368	173,736,000	
ミツバ	51,000	565	28,815,000	
アロカ	15,500	777	12,043,500	
スター精密	54,500	1,022	55,699,000	
大日本スクリーン製造	293,000	454	133,022,000	

キヤノン電子	25,000	2,121	53,025,000	
キヤノン	1,629,100	4,275	6,964,402,500	
リコー	779,000	1,496	1,165,384,000	
日本電産サンキョー	69,000	869	59,961,000	
MUTOHホールディングス	42,000	160	6,720,000	
東京エレクトロン	220,800	6,360	1,404,288,000	
トヨタ紡織	82,000	1,606	131,692,000	
鬼怒川ゴム工業	62,000	472	29,264,000	
ユニプレス	40,200	1,241	49,888,200	
豊田自動織機	226,900	2,610	592,209,000	
モリタホールディングス	39,000	460	17,940,000	
三櫻工業	31,200	720	22,464,000	
デンソー	616,900	2,686	1,656,993,400	
東海理化電機製作所	66,100	1,851	122,351,100	
三井造船	1,086,000	235	255,210,000	
佐世保重工業	186,000	199	37,014,000	
川崎重工業	2,040,000	255	520,200,000	
日本車輛製造	105,000	571	59,955,000	
日本輸送機	34,000	195	6,630,000	
近畿車輛	44,000	651	28,644,000	
日産自動車	3,154,100	813	2,564,283,300	
いすゞ自動車	1,777,000	264	469,128,000	
トヨタ自動車	3,610,500	3,705	13,376,902,500	
日野自動車	348,000	393	136,764,000	
三菱自動車工業	5,803,000	131	760,193,000	
エフテック	9,700	1,431	13,880,700	
武蔵精密工業	27,200	1,842	50,102,400	
トヨタ車体	50,500	1,556	78,578,000	
日産車体	108,000	715	77,220,000	
関東自動車工業	42,200	728	30,721,600	
新明和工業	118,000	374	44,132,000	

極東開発工業	51,800	372	19,269,600	
日信工業	45,200	1,430	64,636,000	
トピー工業	230,000	218	50,140,000	
ティラド	90,000	250	22,500,000	
曙ブレーキ工業	109,600	482	52,827,200	
タチエス	37,600	1,065	40,044,000	
N O K	136,900	1,393	190,701,700	
フタバ産業	84,500	788	66,586,000	
カヤバ工業	180,000	336	60,480,000	
シロキ工業	60,000	247	14,820,000	
大同メタル工業	40,000	349	13,960,000	
プレス工業	132,000	248	32,736,000	
カルソニックカンセイ	187,000	261	48,807,000	
太平洋工業	59,000	520	30,680,000	
ケーヒン	51,600	1,769	91,280,400	
河西工業	37,000	390	14,430,000	
アイシン精機	231,300	2,688	621,734,400	
マツダ	1,710,000	267	456,570,000	
ダイハツ工業	260,000	863	224,380,000	
愛知機械工業	65,000	384	24,960,000	
今仙電機製作所	20,700	1,193	24,695,100	
本田技研工業	2,241,700	3,255	7,296,733,500	
スズキ	520,300	1,996	1,038,518,800	
富士重工業	887,000	496	439,952,000	
ヤマハ発動機	326,000	1,270	414,020,000	
ショーワ	59,200	729	43,156,800	
T B K	31,000	229	7,099,000	
エクセディ	33,600	2,209	74,222,400	
豊田合成	78,900	2,473	195,119,700	
愛三工業	29,500	809	23,865,500	
ヨロズ	15,800	1,433	22,641,400	

エフ・シー・シー	37,400	1,664	62,233,600	
シマノ	107,700	4,060	437,262,000	
タカタ	43,000	2,246	96,578,000	
テイ・エス テック	54,000	1,668	90,072,000	
日本電産トーソク	9,200	1,278	11,757,600	
テルモ	202,200	5,080	1,027,176,000	
クリエートメディック	5,900	904	5,333,600	
日機装	83,000	655	54,365,000	
島津製作所	310,000	775	240,250,000	
JMS	35,000	389	13,615,000	
クボテック	106	27,400	2,904,400	
モリテックス	9,200	291	2,677,200	
長野計器	17,400	622	10,822,800	
東京計器	106,000	173	18,338,000	
愛知時計電機	26,000	307	7,982,000	
東京精密	54,600	1,637	89,380,200	
ニコン	489,600	2,045	1,001,232,000	
トプコン	58,000	522	30,276,000	
オリンパス	308,000	2,926	901,208,000	
理研計器	18,300	642	11,748,600	
タムロン	25,600	1,654	42,342,400	
HOYA	607,000	2,520	1,529,640,000	
ノーリツ鋼機	21,900	714	15,636,600	
エー・アンド・デイ	24,700	436	10,769,200	
日本電産コパル	27,900	1,426	39,785,400	
シチズンホールディングス	307,300	673	206,812,900	
リズム時計工業	142,000	166	23,572,000	
セイコーホールディングス	102,000	229	23,358,000	
ニプロ	55,300	1,810	100,093,000	
SRIスポーツ	157	91,400	14,349,800	
バンダイナムコホールディングス	306,300	924	283,021,200	

共立印刷	30,100	133	4,003,300	
フランスベッドホールディングス	195,000	145	28,275,000	
パイロットコーポレーション	248	134,200	33,281,600	
トッパン・フォームズ	49,200	1,000	49,200,000	
フジシールインターナショナル	26,200	1,869	48,967,800	
タカラトミー	82,000	715	58,630,000	
廣済堂	25,100	198	4,969,800	
タカノ	11,600	565	6,554,000	
プロネクサス	30,600	569	17,411,400	
ホクシン	27,700	135	3,739,500	
ウッドワン	56,000	287	16,072,000	
大建工業	119,000	257	30,583,000	
凸版印刷	792,000	843	667,656,000	
大日本印刷	795,000	1,286	1,022,370,000	
図書印刷	48,000	189	9,072,000	
共同印刷	86,000	276	23,736,000	
日本写真印刷	43,400	3,550	154,070,000	
光村印刷	28,000	332	9,296,000	
宝印刷	10,300	771	7,941,300	
コンビ	15,500	694	10,757,000	
アシックス	244,000	933	227,652,000	
ツツミ	12,300	2,269	27,908,700	
ローランド	20,700	1,224	25,336,800	
小松ウオール工業	8,000	1,008	8,064,000	
ヤマハ	189,900	1,217	231,108,300	
河合楽器製作所	111,000	198	21,978,000	
クリナップ	31,600	772	24,395,200	
ビジョン	16,300	3,475	56,642,500	
パラマウントベッド	28,100	1,793	50,383,300	
兼松日産農林	47,000	152	7,144,000	
キングジム	19,300	723	13,953,900	



リンテック	60,800	1,776	107,980,800	
イトーキ	64,300	234	15,046,200	
任天堂	148,300	31,300	4,641,790,000	
三菱鉛筆	22,700	1,413	32,075,100	
タカラスタンダード	128,000	596	76,288,000	
コクヨ	146,900	782	114,875,800	
ナカバヤシ	59,000	204	12,036,000	
グローブライド	153,000	118	18,054,000	
岡村製作所	110,000	551	60,610,000	
美津濃	142,000	416	59,072,000	
アデランスホールディングス	31,200	1,083	33,789,600	
東京電力	1,652,400	2,440	4,031,856,000	
中部電力	883,800	2,276	2,011,528,800	
関西電力	1,073,100	2,103	2,256,729,300	
中国電力	388,500	1,797	698,134,500	
北陸電力	269,200	1,985	534,362,000	
東北電力	657,300	1,910	1,255,443,000	
四国電力	291,100	2,563	746,089,300	
九州電力	578,800	1,951	1,129,238,800	
北海道電力	244,900	1,739	425,881,100	
沖縄電力	18,200	4,910	89,362,000	
電源開発	174,600	2,900	506,340,000	
東京瓦斯	3,305,000	399	1,318,695,000	
大阪瓦斯	2,824,000	325	917,800,000	
東邦瓦斯	734,000	482	353,788,000	
北海道瓦斯	48,000	244	11,712,000	
西部瓦斯	316,000	261	82,476,000	
静岡瓦斯	83,000	516	42,828,000	
東武鉄道	1,124,000	519	583,356,000	
相鉄ホールディングス	392,000	388	152,096,000	
東京急行電鉄	1,437,000	402	577,674,000	

京浜急行電鉄	723,000	768	555,264,000	
小田急電鉄	835,000	780	651,300,000	
京王電鉄	730,000	614	448,220,000	
京成電鉄	390,000	578	225,420,000	
富士急行	80,000	443	35,440,000	
新京成電鉄	35,000	370	12,950,000	
東日本旅客鉄道	488,700	6,510	3,181,437,000	
西日本旅客鉄道	2,273	341,000	775,093,000	
東海旅客鉄道	2,250	742,000	1,669,500,000	
アートコーポレーション	7,100	1,490	10,579,000	
西日本鉄道	368,000	359	132,112,000	
ハマキョウレックス	8,600	2,512	21,603,200	
サカイ引越センター	4,500	1,982	8,919,000	
近畿日本鉄道	2,392,000	290	693,680,000	
阪急阪神ホールディングス	1,773,000	426	755,298,000	
南海電気鉄道	551,000	365	201,115,000	
京阪電気鉄道	591,000	385	227,535,000	
名糖運輸	8,800	796	7,004,800	
名古屋鉄道	920,000	266	244,720,000	
日本通運	1,111,000	425	472,175,000	
ヤマトホールディングス	530,700	1,323	702,116,100	
山九	312,000	456	142,272,000	
丸運	10,800	244	2,635,200	
丸全昭和運輸	83,000	344	28,552,000	
センコー	91,000	332	30,212,000	
トナミホールディングス	70,000	209	14,630,000	
日本梱包運輸倉庫	79,000	1,057	83,503,000	
日本石油輸送	26,000	207	5,382,000	
福山通運	194,000	461	89,434,000	
セイノーホールディングス	201,000	670	134,670,000	
神奈川中央交通	30,000	501	15,030,000	

日立物流	49,700	1,273	63,268,100	
日本郵船	1,930,000	375	723,750,000	
商船三井	1,265,000	667	843,755,000	
川崎汽船	794,000	372	295,368,000	
新和海運	99,000	283	28,017,000	
乾汽船	29,000	689	19,981,000	
明治海運	28,000	463	12,964,000	
飯野海運	128,200	565	72,433,000	
共栄タンカー	21,000	224	4,704,000	
第一中央汽船	183,000	282	51,606,000	
全日本空輸	3,740,000	291	1,088,340,000	
パスコ	35,000	194	6,790,000	
国際航業ホールディングス	21,000	242	5,082,000	
日新	110,000	213	23,430,000	
三菱倉庫	184,000	1,192	219,328,000	
三井倉庫	100,000	355	35,500,000	
住友倉庫	187,000	415	77,605,000	
澁澤倉庫	75,000	326	24,450,000	
東陽倉庫	39,000	203	7,917,000	
日本トランスシティ	59,000	287	16,933,000	
ケイヒン	58,000	110	6,380,000	
安田倉庫	21,500	580	12,470,000	
東洋埠頭	84,000	168	14,112,000	
宇徳	20,000	272	5,440,000	
上組	310,000	749	232,190,000	
サンリツ	7,500	603	4,522,500	
キムラユニティー	5,200	792	4,118,400	
キューソー流通システム	5,900	884	5,215,600	
郵船航空サービス	21,500	1,463	31,454,500	
近鉄エクスプレス	22,200	2,388	53,013,600	
東海運	19,500	227	4,426,500	

バンテック	140	117,300	16,422,000	
シスプロカテナ	213	66,100	14,079,300	
新日鉄ソリューションズ	24,400	1,797	43,846,800	
コア	11,200	723	8,097,600	
I Tホールディングス	85,312	1,218	103,910,016	
コーエーテクモホールディングス	58,300	693	40,401,900	
ドワンゴ	165	166,700	27,505,500	
ベリサーブ	25	191,300	4,782,500	
マクロミル	155	142,700	22,118,500	
ティーガイア	242	140,100	33,904,200	
GMOペイメントゲートウェイ	81	150,000	12,150,000	
ザッパラス	122	163,000	19,886,000	
インターネットイニシアティブ	175	228,500	39,987,500	
ソネットエンタテインメント	146	246,800	36,032,800	
S R Aホールディングス	14,100	843	11,886,300	
J B I Sホールディングス	34,200	317	10,841,400	
朝日ネット	18,000	284	5,112,000	
パナソニック電工インフォメーションシステムズ	5,900	2,393	14,118,700	
フェイス	1,170	11,220	13,127,400	
野村総合研究所	157,600	2,224	350,502,400	
サイバネットシステム	245	38,600	9,457,000	
インテージ	8,900	1,615	14,373,500	
シンプレクス・テクノロジー	412	51,300	21,135,600	
クレスコ	8,800	485	4,268,000	
フジ・メディア・ホールディングス	2,899	147,500	427,602,500	
オービック	8,780	17,150	150,577,000	
ティーディーシーソフトウェアエンジニアリング	6,800	731	4,970,800	
ヤフー	15,259	35,650	543,983,350	
トレンドマイクロ	110,500	3,355	370,727,500	
日本オラクル	44,500	4,400	195,800,000	
アルファシステムズ	7,900	1,883	14,875,700	

フューチャーアーキテクト	312	37,500	11,700,000	
シーエーシー	17,300	739	12,784,700	
ソフトバンク・テクノロジー	7,500	720	5,400,000	
トーセ	8,700	652	5,672,400	
オービックビジネスコンサルタント	7,450	4,790	35,685,500	
日立ビジネスソリューション	10,200	653	6,660,600	
伊藤忠テクノソリューションズ	39,300	3,250	127,725,000	
アイティフォー	34,300	335	11,490,500	
東計電算	4,200	1,210	5,082,000	
エクスネット	23	136,600	3,141,800	
大塚商会	22,200	6,120	135,864,000	
サイボウズ	410	36,800	15,088,000	
アグレックス	5,900	753	4,442,700	
電通国際情報サービス	19,700	590	11,623,000	
ウェザーニューズ	8,200	1,150	9,430,000	
C I J	23,800	304	7,235,200	
ネットワンシステムズ	551	130,000	71,630,000	
アルゴグラフィックス	10,900	1,032	11,248,800	
エイベックス・グループ・ホールディングス	41,900	811	33,980,900	
日本ユニシス	71,400	671	47,909,400	
兼松エレクトロニクス	13,400	830	11,122,000	
東京放送ホールディングス	150,300	1,518	228,155,400	
日本テレビ放送網	24,390	13,420	327,313,800	
テレビ朝日	714	148,500	106,029,000	
テレビ東京	11,800	1,879	22,172,200	
スカパーJ S A Tホールディングス	2,167	38,700	83,862,900	
アイ・ティー・シーネットワーク	26,000	515	13,390,000	
イー・アクセス	1,139	75,300	85,766,700	
N E C モバイルリング	9,200	2,290	21,068,000	
日本電信電話	1,092,800	3,980	4,349,344,000	
K D D I	4,303	484,000	2,082,652,000	

光通信	37,200	1,710	63,612,000	
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	23,012	146,900	3,380,462,800	
インボイス	3,593	1,444	5,188,292	
GMOインターネット	30,100	386	11,618,600	
学研ホールディングス	134,000	211	28,274,000	
ゼンリン	38,800	1,188	46,094,400	
昭文社	18,700	689	12,884,300	
角川グループホールディングス	25,000	2,124	53,100,000	
インプレスホールディングス	34,800	231	8,038,800	
アイネット	13,400	475	6,365,000	
松竹	158,000	778	122,924,000	
東宝	198,100	1,490	295,169,000	
東映	108,000	472	50,976,000	
葵プロモーション	14,500	505	7,322,500	
エヌ・ティ・ティ・データ	1,716	318,000	545,688,000	
D T S	28,600	1,018	29,114,800	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	71,200	2,000	142,400,000	
シーイーシー	18,400	498	9,163,200	
カプコン	59,600	1,836	109,425,600	
ジャステック	17,700	539	9,540,300	
住商情報システム	29,500	1,427	42,096,500	
日本システムウエア	15,500	381	5,905,500	
アイネス	37,600	705	26,508,000	
T K C	25,400	1,686	42,824,400	
富士ソフト	36,000	1,571	56,556,000	
日本システムディベロップメント	58,600	1,149	67,331,400	
コナミ	113,000	1,899	214,587,000	
福井コンピュータ	12,300	357	4,391,100	
J B C Cホールディングス	23,400	575	13,455,000	
ソフトバンク	1,134,100	2,241	2,541,518,100	
ハウスイ	35,000	128	4,480,000	

インターニックス	14,600	376	5,489,600	
高千穂交易	6,400	941	6,022,400	
伊藤忠食品	7,000	3,005	21,035,000	
エレマテック	15,800	1,179	18,628,200	
JALUX	6,600	690	4,554,000	
トーメンデバイス	3,600	1,853	6,670,800	
双日	1,864,500	184	343,068,000	
アルフレッサ ホールディングス	67,800	4,425	300,015,000	
横浜冷凍	50,000	656	32,800,000	
神栄	37,000	153	5,661,000	
山下医科器械	3,000	1,330	3,990,000	
ラサ商事	9,000	350	3,150,000	
あい ホールディングス	63,200	339	21,424,800	
ダイワボウホールディングス	256,000	208	53,248,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	36,600	592	21,667,200	
UKCホールディングス	16,300	1,364	22,233,200	
日本コークス工業	246,500	185	45,602,500	
ミタチ産業	8,500	519	4,411,500	
JFE商事ホールディングス	188,000	424	79,712,000	
シップヘルスケアホールディングス	356	55,000	19,580,000	
富士興産	101,000	86	8,686,000	
協栄産業	39,000	213	8,307,000	
小野建	23,200	871	20,207,200	
佐島電機	20,700	743	15,380,100	
エコートレーディング	6,200	1,025	6,355,000	
伯東	17,200	956	16,443,200	
中山福	6,800	587	3,991,600	
ナガイレーベン	16,100	2,115	34,051,500	
菱食	27,600	2,243	61,906,800	
松田産業	17,900	1,755	31,414,500	
メディパルホールディングス	278,700	1,157	322,455,900	

アドヴァン	17,100	652	11,149,200	
S P K	5,300	1,320	6,996,000	
アズワン	16,200	1,646	26,665,200	
スズデン	6,800	545	3,706,000	
尾家産業	8,500	880	7,480,000	
シモジマ	18,100	1,266	22,914,600	
ドウシシャ	13,400	2,359	31,610,600	
高速	14,600	696	10,161,600	
黒田電気	37,900	1,312	49,724,800	
丸文	24,700	657	16,227,900	
ハピネット	6,800	1,139	7,745,200	
トーメンエレクトロニクス	8,900	1,199	10,671,100	
エクセル	12,600	1,296	16,329,600	
マルカキカイ	9,100	709	6,451,900	
ガリバーインターナショナル	6,850	3,390	23,221,500	
日本エム・ディ・エム	29,200	270	7,884,000	
進和	15,000	1,056	15,840,000	
エスケイジャパン	4,100	335	1,373,500	
ダイトエレクトロン	13,400	541	7,249,400	
シークス	17,300	1,176	20,344,800	
田中商事	5,600	366	2,049,600	
オーハシテクニカ	14,200	616	8,747,200	
マクニカ	12,100	1,850	22,385,000	
白銅	7,300	899	6,562,700	
伊藤忠商事	1,795,900	883	1,585,779,700	
丸紅	2,125,000	592	1,258,000,000	
高島	53,000	160	8,480,000	
F & A アクアホールディングス	21,400	963	20,608,200	
長瀬産業	144,000	1,145	164,880,000	
蝶理	197,000	116	22,852,000	
豊田通商	246,400	1,515	373,296,000	



三共生興	51,900	288	14,947,200	
兼松	593,000	85	50,405,000	
ツカモトコーポレーション	60,000	91	5,460,000	
三井物産	2,234,300	1,634	3,650,846,200	
日本紙パルプ商事	141,000	365	51,465,000	
日立ハイテクノロジーズ	84,500	2,110	178,295,000	
カメイ	32,000	457	14,624,000	
東都水産	56,000	172	9,632,000	
スターゼン	87,000	250	21,750,000	
山善	110,400	409	45,153,600	
椿本興業	24,000	202	4,848,000	
住友商事	1,419,000	1,131	1,604,889,000	
内田洋行	66,000	305	20,130,000	
三菱商事	2,072,200	2,479	5,136,983,800	
第一実業	59,000	258	15,222,000	
キヤノンマーケティングジャパン	91,800	1,257	115,392,600	
西華産業	107,000	213	22,791,000	
佐藤商事	24,900	551	13,719,900	
菱洋エレクトロ	30,300	959	29,057,700	
東京産業	19,000	281	5,339,000	
ユアサ商事	301,000	98	29,498,000	
神鋼商事	73,000	210	15,330,000	
阪和興業	280,000	398	111,440,000	
カナデン	28,000	505	14,140,000	
菱電商事	38,000	545	20,710,000	
フルサト工業	16,000	663	10,608,000	
岩谷産業	280,000	272	76,160,000	
すてきナイスグループ	126,000	207	26,082,000	
昭光通商	109,000	136	14,824,000	
ニチモウ	50,000	154	7,700,000	
極東貿易	33,000	164	5,412,000	

イワキ	36,000	250	9,000,000	
三愛石油	65,000	408	26,520,000	
稲畑産業	70,300	467	32,830,100	
G S Iクレオス	84,000	132	11,088,000	
明和産業	26,200	223	5,842,600	
東邦ホールディングス	70,300	1,421	99,896,300	
サンゲツ	46,800	2,118	99,122,400	
ミツウロコ	42,800	673	28,804,400	
シナネン	62,000	393	24,366,000	
伊藤忠エネクス	60,400	485	29,294,000	
ザ・トーカイ	67,000	532	35,644,000	
サンリオ	76,300	981	74,850,300	
サンワテクノス	16,600	508	8,432,800	
リョーサン	42,600	2,544	108,374,400	
新光商事	26,400	916	24,182,400	
トーホー	45,000	343	15,435,000	
三信電気	28,300	842	23,828,600	
東陽テクニカ	42,100	811	34,143,100	
モスフードサービス	34,000	1,521	51,714,000	
加賀電子	29,000	1,018	29,522,000	
ソーダニッカ	26,000	349	9,074,000	
立花エレテック	17,000	749	12,733,000	
太平洋興発	103,000	93	9,579,000	
ヤマタネ	132,000	138	18,216,000	
丸紅建材リース	38,000	121	4,598,000	
トラスコ中山	31,400	1,528	47,979,200	
オートバックスセブン	32,300	3,070	99,161,000	
加藤産業	40,400	1,485	59,994,000	
イエローハット	28,600	633	18,103,800	
富士エレクトロニクス	15,200	1,113	16,917,600	
J Kホールディングス	23,500	352	8,272,000	

ユニダックス	14,000	490	6,860,000	
日伝	11,300	2,534	28,634,200	
北沢産業	31,500	201	6,331,500	
杉本商事	12,800	897	11,481,600	
因幡電機産業	27,800	2,208	61,382,400	
住金物産	126,000	217	27,342,000	
ミスミグループ本社	93,900	1,872	175,780,800	
江守商事	2,700	773	2,087,100	
アルテック	15,700	356	5,589,200	
タキヒヨー	46,000	492	22,632,000	
スズケン	98,000	3,500	343,000,000	
ジェコス	15,800	377	5,956,600	
ローソン	78,500	4,135	324,597,500	
サンエー	9,500	3,680	34,960,000	
麒麟堂	12,100	413	4,997,300	
ダイユーエイト	5,400	591	3,191,400	
カワチ薬品	18,000	1,810	32,580,000	
エービーシー・マート	29,600	3,400	100,640,000	
ハードオフコーポレーション	9,700	429	4,161,300	
アスクル	20,600	1,662	34,237,200	
ゲオ	480	93,500	44,880,000	
ポイント	24,760	5,870	145,341,200	
シー・ヴィ・エス・バイエリア	30,000	138	4,140,000	
くらコーポレーション	76	333,000	25,308,000	
キャンドゥ	115	96,900	11,143,500	
バル	7,800	2,327	18,150,600	
エディオン	110,500	952	105,196,000	
サーラコーポレーション	26,500	566	14,999,000	
バルス	122	93,500	11,407,000	
あみやき亭	54	268,000	14,472,000	
ハニーズ	26,030	1,039	27,045,170	

アルペン	22,300	1,527	34,052,100	
ビックカメラ	725	34,150	24,758,750	
D C M J a p a nホールディングス	141,300	574	81,106,200	
M o n o t a R O	1,800	1,600	2,880,000	
ユニバース	3,200	1,320	4,224,000	
J . フロント リテイリング	658,000	597	392,826,000	
ドトール・日レスホールディングス	43,100	1,259	54,262,900	
マツモトキヨシホールディングス	46,000	2,144	98,624,000	
ココカラファイン ホールディングス	21,600	1,809	39,074,400	
三越伊勢丹ホールディングス	483,300	1,079	521,480,700	
クリエイトSDホールディングス	9,400	1,810	17,014,000	
C H Iグループ	16,700	376	6,279,200	
ブックオフコーポレーション	12,400	923	11,445,200	
あさひ	12,100	1,485	17,968,500	
サークルKサンクス	53,700	1,273	68,360,100	
日本調剤	3,730	2,973	11,089,290	
コスモス薬品	13,200	2,004	26,452,800	
セブン&アイ・ホールディングス	1,108,000	2,418	2,679,144,000	
ツルハホールディングス	21,100	3,410	71,951,000	
サンマルクホールディングス	8,000	3,545	28,360,000	
フェリシモ	7,200	1,348	9,705,600	
トリドール	76	184,400	14,014,400	
総合メディカル	5,900	2,047	12,077,300	
はるやま商事	14,400	428	6,163,200	
カッパ・クリエイト	18,650	1,947	36,311,550	
ライトオン	20,500	717	14,698,500	
ジーンズメイト	10,000	388	3,880,000	
良品計画	29,300	4,320	126,576,000	
三城ホールディングス	36,300	885	32,125,500	
コナカ	37,300	345	12,868,500	
ハウス オブ ローゼ	600	1,271	762,600	

G - 7ホールディングス	8,200	626	5,133,200	
イオン北海道	20,100	279	5,607,900	
コジマ	39,300	802	31,518,600	
コーナン商事	25,600	1,169	29,926,400	
エコス	11,100	589	6,537,900	
ワタミ	28,500	1,677	47,794,500	
マルシェ	5,400	709	3,828,600	
ドン・キホーテ	44,100	2,452	108,133,200	
メガネトップ	25,700	747	19,197,900	
西松屋チェーン	60,200	1,036	62,367,200	
ゼンショー	105,400	693	73,042,200	
幸楽苑	14,100	1,219	17,187,900	
ハークスレイ	7,600	646	4,909,600	
サイゼリヤ	41,800	1,808	75,574,400	
ポプラ	9,000	590	5,310,000	
ユナイテッドアローズ	30,200	1,148	34,669,600	
ハイデイ日高	10,200	1,096	11,179,200	
京都きもの友禅	17,000	854	14,518,000	
コロワイド	80,500	464	37,352,000	
壱番屋	9,400	2,293	21,554,200	
トップカルチャー	10,600	367	3,890,200	
スギホールディングス	39,400	2,273	89,556,200	
スクロール	29,800	378	11,264,400	
ファミリーマート	85,200	3,100	264,120,000	
木曽路	29,000	1,907	55,303,000	
千趣会	50,400	525	26,460,000	
タカキュー	29,000	172	4,988,000	
ケーヨー	52,700	469	24,716,300	
上新電機	60,000	867	52,020,000	
日本瓦斯	30,200	1,381	41,706,200	
ベスト電器	92,000	275	25,300,000	

マルエツ	58,000	436	25,288,000	
ロイヤルホールディングス	43,500	943	41,020,500	
東天紅	29,000	152	4,408,000	
いなげや	30,000	971	29,130,000	
島忠	62,800	2,032	127,609,600	
チヨダ	37,700	1,211	45,654,700	
鈴丹	6,200	215	1,333,000	
ライフコーポレーション	17,300	1,622	28,060,600	
カスミ	52,400	486	25,466,400	
さが美	33,000	138	4,554,000	
MrMax	29,000	417	12,093,000	
テンアライド	19,500	310	6,045,000	
AOKIホールディングス	25,600	1,305	33,408,000	
オークワ	35,000	1,070	37,450,000	
コメリ	34,000	2,554	86,836,000	
青山商事	65,300	1,652	107,875,600	
しまむら	29,100	9,230	268,593,000	
CFSコーポレーション	24,500	566	13,867,000	
高島屋	347,000	847	293,909,000	
松屋	51,200	912	46,694,400	
エイチ・ツー・オー リテイリング	147,000	663	97,461,000	
丸栄	51,000	137	6,987,000	
ニッセンホールディングス	60,200	382	22,996,400	
バルコ	72,800	843	61,370,400	
丸井グループ	306,200	760	232,712,000	
原信ナルスホールディングス	14,300	1,098	15,701,400	
ダイエー	119,450	475	56,738,750	
イズミヤ	93,000	509	47,337,000	
イオン	909,500	1,072	974,984,000	
ユニー	209,500	851	178,284,500	
イズミ	76,600	1,365	104,559,000	

東武ストア	24,000	276	6,624,000	
平和堂	50,800	1,223	62,128,400	
フジ	30,900	1,748	54,013,200	
ヤオコー	11,900	2,773	32,998,700	
ゼビオ	30,000	1,980	59,400,000	
ケーズホールディングス	53,260	2,351	125,214,260	
O l y m p i c	18,900	620	11,718,000	
元気寿司	5,800	1,172	6,797,600	
ヤマダ電機	126,560	6,790	859,342,400	
アークランドサカモト	17,600	1,139	20,046,400	
ニトリ	49,850	7,010	349,448,500	
グルメ杵屋	18,000	516	9,288,000	
愛眼	16,700	485	8,099,500	
吉野家ホールディングス	745	98,000	73,010,000	
松屋フーズ	10,900	1,368	14,911,200	
サガミチェーン	34,000	564	19,176,000	
ブレナス	30,900	1,270	39,243,000	
ミニストップ	18,900	1,141	21,564,900	
アークス	33,000	1,329	43,857,000	
パロー	48,500	813	39,430,500	
ベルク	9,700	859	8,332,300	
大庄	15,200	1,159	17,616,800	
ファーストリテイリング	55,600	14,970	832,332,000	
サンドラッグ	53,500	2,282	122,087,000	
ヤマザワ	6,400	1,279	8,185,600	
やまや	2,700	768	2,073,600	
ベルーナ	38,250	494	18,895,500	
新生銀行	1,270,000	121	153,670,000	
あおぞら銀行	881,000	135	118,935,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	19,752,400	508	10,034,219,200	
りそなホールディングス	741,000	1,212	898,092,000	

中央三井トラスト・ホールディングス	1,451,000	367	532,517,000	
三井住友フィナンシャルグループ	1,974,400	3,265	6,446,416,000	
第四銀行	364,000	331	120,484,000	
北越銀行	285,000	156	44,460,000	
西日本シティ銀行	906,000	272	246,432,000	
札幌北洋ホールディングス	384,700	434	166,959,800	
千葉銀行	1,014,000	591	599,274,000	
横浜銀行	1,784,000	487	868,808,000	
常陽銀行	1,007,000	407	409,849,000	
群馬銀行	647,000	520	336,440,000	
武蔵野銀行	42,300	2,767	117,044,100	
千葉興業銀行	54,900	730	40,077,000	
筑波銀行	91,600	290	26,564,000	
東京都民銀行	50,400	1,281	64,562,400	
七十七銀行	433,000	543	235,119,000	
青森銀行	200,000	221	44,200,000	
秋田銀行	187,000	374	69,938,000	
山形銀行	160,000	407	65,120,000	
岩手銀行	18,600	5,300	98,580,000	
東邦銀行	239,000	304	72,656,000	
東北銀行	152,000	144	21,888,000	
みちのく銀行	141,000	189	26,649,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	1,054,000	399	420,546,000	
静岡銀行	806,000	818	659,308,000	
十六銀行	341,000	374	127,534,000	
スルガ銀行	269,000	889	239,141,000	
八十二銀行	523,000	527	275,621,000	
山梨中央銀行	177,000	408	72,216,000	
大垣共立銀行	368,000	312	114,816,000	
福井銀行	236,000	297	70,092,000	
北國銀行	293,000	343	100,499,000	



清水銀行	9,500	3,620	34,390,000	
滋賀銀行	260,000	582	151,320,000	
南都銀行	262,000	521	136,502,000	
百五銀行	253,000	433	109,549,000	
京都銀行	462,000	839	387,618,000	
三重銀行	119,000	264	31,416,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	1,822,000	196	357,112,000	
広島銀行	763,000	388	296,044,000	
山陰合同銀行	166,000	768	127,488,000	
中国銀行	228,000	1,239	282,492,000	
鳥取銀行	92,000	257	23,644,000	
伊予銀行	316,000	879	277,764,000	
百十四銀行	306,000	370	113,220,000	
四国銀行	206,000	306	63,036,000	
阿波銀行	228,000	553	126,084,000	
鹿児島銀行	178,000	647	115,166,000	
大分銀行	185,000	343	63,455,000	
宮崎銀行	180,000	282	50,760,000	
肥後銀行	218,000	515	112,270,000	
佐賀銀行	159,000	283	44,997,000	
十八銀行	183,000	277	50,691,000	
沖縄銀行	21,100	3,720	78,492,000	
琉球銀行	55,200	1,014	55,972,800	
住友信託銀行	2,337,000	577	1,348,449,000	
みずほ信託銀行	2,192,000	96	210,432,000	
八千代銀行	15,300	2,062	31,548,600	
みずほフィナンシャルグループ	22,783,300	188	4,283,260,400	
紀陽ホールディングス	1,046,000	129	134,934,000	
山口フィナンシャルグループ	257,000	992	254,944,000	
長野銀行	106,000	190	20,140,000	
名古屋銀行	255,000	373	95,115,000	

愛知銀行	10,200	7,260	74,052,000	
第三銀行	105,000	270	28,350,000	
中京銀行	117,000	266	31,122,000	
東日本銀行	152,000	189	28,728,000	
愛媛銀行	176,000	272	47,872,000	
トマト銀行	116,000	195	22,620,000	
みなと銀行	295,000	126	37,170,000	
京葉銀行	225,000	446	100,350,000	
関西アーバン銀行	328,000	151	49,528,000	
栃木銀行	141,000	413	58,233,000	
北日本銀行	9,100	2,584	23,514,400	
東和銀行	57,000	73	4,161,000	
福島銀行	365,000	57	20,805,000	
大東銀行	199,000	72	14,328,000	
トモニホールディングス	167,000	359	59,953,000	
フィデアホールディングス	139,100	164	22,812,400	
池田泉州ホールディングス	1,103,100	174	191,939,400	
S B Iホールディングス	24,945	19,270	480,690,150	
ジャフコ	38,000	2,420	91,960,000	
大和証券グループ本社	2,443,000	512	1,250,816,000	
野村ホールディングス	5,190,800	702	3,643,941,600	
みずほ証券	709,000	287	203,483,000	
みずほインベスターズ証券	665,000	103	68,495,000	
岡三証券グループ	233,000	447	104,151,000	
丸三証券	83,700	572	47,876,400	
東洋証券	112,000	192	21,504,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	290,000	383	111,070,000	
光世証券	76,000	106	8,056,000	
水戸証券	78,000	234	18,252,000	
いちよし証券	60,500	664	40,172,000	
松井証券	168,000	709	119,112,000	

だいこう証券ビジネス	15,500	414	6,417,000	
マネックスグループ	2,094	46,100	96,533,400	
カブドットコム証券	89,200	480	42,816,000	
極東証券	35,700	854	30,487,800	
岩井証券	24,600	575	14,145,000	
小林洋行	1,800	297	534,600	
N K S J ホールディングス	2,059,400	713	1,468,352,200	
M S & A D インシュアランスグループホールディングス	773,840	2,681	2,074,665,040	
ソニーフィナンシャルホールディングス	899	303,500	272,846,500	
富士火災海上保険	174,000	149	25,926,000	
東京海上ホールディングス	1,056,700	2,815	2,974,610,500	
T & D ホールディングス	467,950	2,410	1,127,759,500	
クレディセゾン	199,000	1,471	292,729,000	
セディナ	255,500	177	45,223,500	
芙蓉総合リース	25,600	2,727	69,811,200	
興銀リース	41,900	1,914	80,196,600	
東京センチュリーリース	68,800	1,285	88,408,000	
日本証券金融	125,200	686	85,887,200	
大阪証券金融	68,900	209	14,400,100	
アイフル	82,600	149	12,307,400	
ポケットカード	55,000	264	14,520,000	
リコーリース	21,600	2,288	49,420,800	
イオンクレジットサービス	129,600	1,102	142,819,200	
アコム	74,020	1,541	114,064,820	
プロミス	97,650	960	93,744,000	
ジャックス	197,000	225	44,325,000	
日立キャピタル	70,000	1,374	96,180,000	
オリックス	135,340	8,270	1,119,261,800	
三菱UFJリース	71,870	3,365	241,842,550	
アサックス	109	92,900	10,126,100	
N E C キャピタルソリューション	13,600	1,234	16,782,400	

日本駐車場開発	3,913	4,630	18,117,190	
昭栄	51,000	736	37,536,000	
東京建物不動産販売	20,900	291	6,081,900	
野村不動産ホールディングス	135,000	1,538	207,630,000	
ヒューリック	81,000	669	54,189,000	
エコナック	129,000	49	6,321,000	
パーク24	158,700	955	151,558,500	
三井不動産	1,153,000	1,622	1,870,166,000	
三菱地所	1,820,000	1,572	2,861,040,000	
平和不動産	202,500	296	59,940,000	
東京建物	532,000	376	200,032,000	
ダイビル	74,000	818	60,532,000	
サンケイビル	51,900	612	31,762,800	
東急不動産	516,000	373	192,468,000	
京阪神不動産	34,700	455	15,788,500	
住友不動産	623,000	1,806	1,125,138,000	
東宝不動産	30,700	504	15,472,800	
大京	295,000	197	58,115,000	
テーオーシー	114,900	355	40,789,500	
東京楽天地	46,000	365	16,790,000	
レオパレス21	187,700	513	96,290,100	
フジ住宅	38,900	333	12,953,700	
空港施設	30,200	522	15,764,400	
住友不動産販売	10,650	4,530	48,244,500	
ゴールドクレスト	19,820	2,583	51,195,060	
東栄住宅	18,900	859	16,235,100	
日本エスリード	14,100	865	12,196,500	
東急リバブル	28,300	905	25,611,500	
飯田産業	12,400	1,671	20,720,400	
アーネストワン	28,300	863	24,422,900	
サンヨーハウジング名古屋	149	83,500	12,441,500	

イオンモール	127,600	1,915	244,354,000	
タクトホーム	154	74,800	11,519,200	
リサ・パートナーズ	413	51,600	21,310,800	
エヌ・ティ・ティ都市開発	1,774	77,400	137,307,600	
ランドビジネス	322	19,700	6,343,400	
日本空港ビルデング	68,300	1,404	95,893,200	
日本工営	101,000	277	27,977,000	
日本M & Aセンター	59	331,000	19,529,000	
アコーディア・ゴルフ	757	99,100	75,018,700	
パソナグループ	286	63,000	18,018,000	
リンクアンドモチベーション	107	41,000	4,387,000	
テンブホールディングス	41,800	805	33,649,000	
学情	14,600	320	4,672,000	
スタジオアリス	15,000	843	12,645,000	
シミック	480	23,000	11,040,000	
N E Cフィールドディング	24,500	1,317	32,266,500	
総合警備保障	99,700	1,052	104,884,400	
カカクコム	182	344,500	62,699,000	
ルネサンス	17,400	329	5,724,600	
セキュアード・キャピタル・ジャパン	75	86,400	6,480,000	
新日本科学	19,200	618	11,865,600	
エムスリー	119	332,500	39,567,500	
ディー・エヌ・エー	338	727,000	245,726,000	
博報堂D Yホールディングス	37,390	5,330	199,288,700	
ぐるなび	157	173,700	27,270,900	
一休	220	42,350	9,317,000	
ジャパンベストレスキューシステム	87	70,000	6,090,000	
ジェイコムホールディングス	41	99,700	4,087,700	
パシフィックゴルフグループインターナショナル	654	63,400	41,463,600	
イーピーエス	166	226,800	37,648,800	
アミューズ	6,500	966	6,279,000	

T A C	16,800	377	6,333,600	
ケネディクス	1,463	26,590	38,901,170	
電通	267,000	2,679	715,293,000	
イオンファンタジー	10,300	1,190	12,257,000	
みらかホールディングス	56,400	2,972	167,620,800	
アルプス技研	14,000	766	10,724,000	
サニックス	31,100	187	5,815,700	
ダイオーズ	1,000	500	500,000	
日本空調サービス	2,300	762	1,752,600	
オリエンタルランド	71,400	6,680	476,952,000	
ダスキン	81,700	1,650	134,805,000	
明光ネットワークジャパン	24,900	690	17,181,000	
ファルコ S Dホールディングス	16,200	940	15,228,000	
秀英予備校	8,900	615	5,473,500	
田谷	4,300	690	2,967,000	
ラウンドワン	43,000	660	28,380,000	
リゾートトラスト	42,400	1,338	56,731,200	
ビー・エム・エル	15,200	2,375	36,100,000	
ワタベウェディング	8,900	1,093	9,727,700	
もしもしホットライン	18,700	1,917	35,847,900	
東急コミュニティー	5,200	2,234	11,616,800	
リソー教育	2,895	5,250	15,198,750	
ウェアハウス	6,000	360	2,160,000	
ユー・エス・エス	37,200	6,390	237,708,000	
東京個別指導学院	26,900	180	4,842,000	
カルチャア・コンビニエンス・クラブ	102,600	508	52,120,800	
テー・オー・ダブリュー	6,800	542	3,685,600	
セントラルスポーツ	8,500	878	7,463,000	
リゾートソリューション	34,000	170	5,780,000	
エイチ・アイ・エス	27,900	1,925	53,707,500	
共立メンテナンス	12,100	1,410	17,061,000	

イチネンホールディングス	29,900	408	12,199,200	
建設技術研究所	13,900	507	7,047,300	
燦ホールディングス	3,400	1,584	5,385,600	
スバル興業	11,000	270	2,970,000	
東京テアトル	112,000	160	17,920,000	
ホリプロ	7,500	719	5,392,500	
よみうりランド	61,000	316	19,276,000	
東京都競馬	202,000	141	28,482,000	
常磐興産	86,000	141	12,126,000	
カナモト	37,000	504	18,648,000	
東京ドーム	210,000	283	59,430,000	
トランス・コスモス	37,500	813	30,487,500	
乃村工藝社	61,000	339	20,679,000	
藤田観光	78,000	389	30,342,000	
日本管財	10,300	1,507	15,522,100	
白洋舎	35,000	265	9,275,000	
セコム	264,400	4,030	1,065,532,000	
セントラル警備保障	9,800	884	8,663,200	
丹青社	37,000	233	8,621,000	
メイテック	39,600	1,917	75,913,200	
アサツー ディ・ケイ	52,200	2,195	114,579,000	
応用地質	32,700	803	26,258,100	
船井総合研究所	26,100	544	14,198,400	
進学会	12,100	323	3,908,300	
ベネッセホールディングス	93,000	4,090	380,370,000	
イオンディライト	22,100	1,443	31,890,300	
ナック	4,800	877	4,209,600	
ニチイ学館	56,000	840	47,040,000	
ダイセキ	47,600	1,907	90,773,200	
合計	391,685,034		345,374,324,198	

差入委託証拠金代用有価証券1,200,000株

## (b)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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



「国内債券パッシブ・マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

対象年月日	(平成21年4月13日現在)	(平成22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	9,234,585,929	1,565,069,993
国債証券	193,525,719,470	378,192,699,380
地方債証券	15,965,830,796	33,864,446,895
特殊債券	32,370,004,962	57,716,041,325
社債券	16,892,638,300	44,178,581,000
未収入金	555,203,000	96,260,000
未収利息	531,318,135	1,453,627,999
前払費用	194,414,139	43,721,209
流動資産合計	269,269,714,731	517,110,447,801
資産合計	269,269,714,731	517,110,447,801
負債の部		
流動負債		
未払金	9,098,895,259	610,840,000
未払解約金	292,000	6,027,093
流動負債合計	9,099,187,259	616,867,093
負債合計	9,099,187,259	616,867,093
純資産の部		
元本等		
1 元本		
元本	250,471,635,464	483,635,046,295
元本合計	250,471,635,464	483,635,046,295
2 剰余金		
剰余金	9,698,892,008	32,858,534,413

剰余金合計	9,698,892,008	32,858,534,413
元本等合計	260,170,527,472	516,493,580,708
純資産合計	260,170,527,472	516,493,580,708
負債・純資産合計	269,269,714,731	517,110,447,801

（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21年4月13日ならびに平成22年4月13日現在における同マザーファンドの状況です。

## (2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自平成20年3月31日 至平成21年4月13日	自平成21年4月14日 至平成22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・社債券（売買目的有価証券） 個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。	国債証券・地方債証券・特殊債券・社債券（売買目的有価証券） 同左

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成21年4月13日現在)	(平成22年4月13日現在)
1. 受益権総数	平成21年4月13日現在における受益権の総数 250,471,635,464口	平成22年4月13日現在における受益権の総数 483,635,046,295口
2. 1単位当たり純資産額	1.0387円 (1万口 = 10,387円)	1.0679円 (1万口 = 10,679円)

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

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

・金融商品の状況に関する事項

項目	自平成21年4月14日 至平成22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。
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。 なお、当計算期間末の保有については、附属明細表に記載しております。</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ため、ならびに価格変動リスクの回避を目的としております。 なお、当計算期間末における残高については、「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</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理ならびにコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。リスクを管理する部署では、各種リスクごとに定められた頻度で、測定項目が上下限值（リミットあるいは注意レベル）内に収まっているかどうかのモニタリングを行っております。上下限値を越えていることが発見された場合は、原則として速やかに修正を行うよう、リスク管理を行う部署から関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われます。また、是正勧告あるいは報告を受けた関連運用グループでは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、リスク管理を行う部署は、上下限値に抵触した事実ならびにその後の対処結果、あるいは関連運用グループの対処方針の決定に関し、必要に応じて、リスク管理を行う部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員、およびリスク管理委員会へ報告する体制となっております。</p>

4. 金融商品の時価等に関する事項について  
金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。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については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。

## 金融商品の時価等に関する事項

項目	自平成21年4月14日 至平成22年4月13日
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券（国債証券、地方債証券、特殊債券および社債券） 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コールローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

## (デリバティブ取引に関する注記)

## 取引の状況に関する事項

項目	自平成20年3月31日 至平成21年4月13日
1. 取引の内容	当ファンドの行うことのできるデリバティブ取引は、次の通りです。 a. わが国の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。 b. わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。 異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（「スワップ取引」）。 金利先渡取引。
2. 取引に対する取組方針	デリバティブ取引につきましては信託約款等に従っており、その制限を遵守しております。
3. 取引の利用目的	信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため。
4. 取引に係るリスクの内容	デリバティブ取引に伴いファンドに影響を与える主なリスクとしてマーケットリスクがあげられます。マーケットリスクについては、ポジションや時価、予想損失額の把握が重要だと考えております。
5. 取引に係るリスクの管理体制	リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理ならびにコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。

6. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	該当事項はありません。
--------------------------	-------------

## ．取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

（平成21年4月13日現在）

平成21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22年4月13日現在）

平成22年4月13日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（関連当事者との取引に関する注記）

（自 平成20年3月31日 至 平成21年4月13日）

該当事項はありません。

（自 平成21年4月14日 至 平成22年4月13日）

該当事項はありません。

(その他の注記)

(平成21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	130,768,989,835円
同期中における追加設定元本額	156,314,487,815円
同期中における一部解約元本額	36,611,842,186円
平成21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)	523,647,401円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,065,889,891円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	196,056,115円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	8,317,796円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	385,320円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	269,450円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	194,776円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	171,945円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	145,762円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	163,864円
S M A M ・ バランスファンド V A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	50,747,721,457円
S M A M ・ バランスファンド V A 3 7 . 5 < 適格機関投資家専用 >	12,979,037,983円
S M A M ・ バランスファンド V A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	28,752,304,705円
S M A M ・ バランスファンド V L 3 0 < 適格機関投資家限定 >	563,128,650円
S M A M ・ バランスファンド V L 5 0 < 適格機関投資家限定 >	794,782,303円
世界6資産バランスファンド V A < 適格機関投資家限定 >	193,567,294円
S M A M ・ バランスファンド V A 7 5 < 適格機関投資家専用 >	395,479,838円
S M A M ・ バランスファンド V L 国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	121,190,698円
S M A M ・ インデックス・バランス V A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	2,303,010,106円
S M A M ・ インデックス・バランス V A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	2,961,865,885円
S M A M ・ バランスファンド V A 4 0 < 適格機関投資家専用 >	7,626,803,538円
S M A M ・ バランスファンド V A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	20,724,783,605円
S M A M ・ バランス V A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	1,376,919,029円
三井住友・国内債券インデックスファンド・ V A S ( 適格機関投資家専用 )	6,686,301,430円



三井住友・5資産バランスファンド・V A S ( 適格機関投資家専用 )	27,503,330,032円
S M A M ・ グローバルバランス40VA < 適格機関投資家限定 >	888,219,541円
S M A M ・ バランスファンドVA20 < 適格機関投資家専用 >	7,265,135,352円
三井住友・7資産バランスファンド・V A S ( 適格機関投資家専用 )	76,792,811,698円
合 計	250,471,635,464円

(平成22年4月13日現在)

## 本有価証券報告書における開示対象ファンドの

期首における当該親投資信託の元本額	250,471,635,464円
同期中における追加設定元本額	250,463,404,925円
同期中における一部解約元本額	17,299,994,094円

## 平成22年4月13日現在における元本の内訳

三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	768,939,695円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	1,606,105,756円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	323,668,967円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	31,710,901円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	7,374,023円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	561,475円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	2,976,380円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	360,281円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	170,157円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	625,337円
S M A M ・ バランスファンド V A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	51,226,932,121円
S M A M ・ バランスファンド V A 3 7 . 5 < 適格機関投資家専用 >	13,883,950,287円
S M A M ・ バランスファンド V A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	31,415,444,970円
S M A M ・ バランスファンド V L 3 0 < 適格機関投資家限定 >	592,464,622円
S M A M ・ バランスファンド V L 5 0 < 適格機関投資家限定 >	839,237,551円
世界6資産バランスファンド V A < 適格機関投資家限定 >	207,311,452円
S M A M ・ バランスファンド V A 7 5 < 適格機関投資家専用 >	409,425,545円
S M A M ・ バランスファンド V L 国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	137,626,758円
S M A M ・ インデックス・バランス V A 2 5 < 適格機関投資家専用 >	3,430,261,206円
S M A M ・ インデックス・バランス V A 5 0 < 適格機関投資家専用 >	4,346,399,194円
S M A M ・ バランスファンド V A 4 0 < 適格機関投資家専用 >	8,180,482,274円
S M A M ・ バランスファンド V A 3 5 < 適格機関投資家専用 >	24,226,238,933円
S M A M ・ バランス V A 株 4 0 T < 適格機関投資家限定 >	1,475,988,511円
三井住友・国内債券インデックスファンド・ V A S ( 適格機関投資家専用 )	9,644,593,671円

三井住友・5資産バランスファンド・V A S ( 適格機関投資家専用 )	70,240,957,667円
S M A M ・ グローバルバランス40VA < 適格機関投資家限定 >	993,721,714円
S M A M ・ バランスファンドVA20 < 適格機関投資家専用 >	13,516,228,619円
三井住友・7資産バランスファンド・V A S ( 適格機関投資家専用 )	224,654,008,375円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20A < 適格機関投資家専用 >	1,454,236,844円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA35A < 適格機関投資家専用 >	341,999,565円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA50A < 適格機関投資家専用 >	66,469,866円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20L < 適格機関投資家専用 >	4,859,563,152円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA25L < 適格機関投資家専用 >	5,782,406,786円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20T < 適格機関投資家専用 >	4,399,383,938円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA20A2 < 適格機関投資家専用 >	426,008,453円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA35A2 < 適格機関投資家専用 >	85,941,963円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA50A2 < 適格機関投資家専用 >	9,568,046円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA30L2 < 適格機関投資家専用 >	106,121,062円
S M A M ・ アセットバランスファンドVA25L2 < 適格機関投資家専用 >	3,939,580,178円
合 計	483,635,046,295円

## (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)	1,020,000,000	1,058,892,600	
	第2回利付国債(40年)	752,000,000	740,351,520	
	第231回利付国債(10年)	10,745,000,000	10,892,851,200	
	第234回利付国債(10年)	14,601,000,000	14,863,525,980	
	第236回利付国債(10年)	13,128,000,000	13,427,055,840	
	第237回利付国債(10年)	6,370,000,000	6,535,110,400	
	第238回利付国債(10年)	5,100,000,000	5,222,400,000	
	第239回利付国債(10年)	8,688,000,000	8,920,838,400	
	第242回利付国債(10年)	6,980,000,000	7,152,196,600	
	第243回利付国債(10年)	5,250,000,000	5,366,812,500	
	第244回利付国債(10年)	11,452,000,000	11,696,156,640	
	第247回利付国債(10年)	12,235,000,000	12,441,282,100	
	第250回利付国債(10年)	9,565,000,000	9,638,841,800	
	第253回利付国債(10年)	9,310,000,000	9,724,201,900	
	第256回利付国債(10年)	9,710,000,000	10,087,621,900	
	第258回利付国債(10年)	9,513,000,000	9,857,180,340	
	第260回利付国債(10年)	9,815,000,000	10,296,818,350	
	第263回利付国債(10年)	10,782,000,000	11,322,932,940	
	第265回利付国債(10年)	10,650,000,000	11,144,586,000	
	第268回利付国債(10年)	10,315,000,000	10,800,423,900	
	第270回利付国債(10年)	5,487,000,000	5,692,707,630	
	第272回利付国債(10年)	5,345,000,000	5,572,750,450	
	第274回利付国債(10年)	5,245,000,000	5,495,186,500	

第277回利付国債(10年)	6,265,000,000	6,597,045,000	
第280回利付国債(10年)	4,717,000,000	5,050,680,580	
第282回利付国債(10年)	4,950,000,000	5,238,436,500	
第284回利付国債(10年)	5,067,000,000	5,357,845,800	
第285回利付国債(10年)	4,988,000,000	5,268,724,640	
第286回利付国債(10年)	5,080,000,000	5,391,861,200	
第288回利付国債(10年)	5,005,000,000	5,269,163,900	
第289回利付国債(10年)	4,934,000,000	5,111,722,680	
第290回利付国債(10年)	5,097,000,000	5,231,356,920	
第293回利付国債(10年)	4,110,000,000	4,337,241,900	
第296回利付国債(10年)	5,043,000,000	5,190,608,610	
第297回利付国債(10年)	5,073,000,000	5,164,922,760	
第299回利付国債(10年)	3,050,000,000	3,070,862,000	
第300回利付国債(10年)	2,500,000,000	2,559,425,000	
第301回利付国債(10年)	5,595,000,000	5,712,495,000	
第303回利付国債(10年)	6,295,000,000	6,350,521,900	
第305回利付国債(10年)	6,160,000,000	6,136,222,400	
第306回利付国債(10年)	3,100,000,000	3,106,758,000	
第2回利付国債(30年)	570,000,000	596,043,300	
第4回利付国債(30年)	300,000,000	338,397,000	
第5回利付国債(30年)	290,000,000	292,740,500	
第7回利付国債(30年)	549,000,000	561,753,270	
第10回利付国債(30年)	985,000,000	790,945,150	
第12回利付国債(30年)	500,000,000	491,130,000	
第14回利付国債(30年)	1,000,000,000	1,034,590,000	
第16回利付国債(30年)	965,000,000	1,017,467,050	
第18回利付国債(30年)	920,000,000	933,303,200	
第19回利付国債(30年)	875,000,000	887,731,250	
第21回利付国債(30年)	605,000,000	613,415,550	
第22回利付国債(30年)	685,000,000	721,900,950	
第23回利付国債(30年)	679,000,000	715,211,070	

第24回利付国債(30年)	680,000,000	716,482,000	
第25回利付国債(30年)	810,000,000	820,854,000	
第26回利付国債(30年)	1,073,000,000	1,109,278,130	
第27回利付国債(30年)	1,060,000,000	1,118,215,200	
第28回利付国債(30年)	1,646,000,000	1,737,418,840	
第29回利付国債(30年)	1,472,000,000	1,523,490,560	
第30回利付国債(30年)	1,820,000,000	1,844,005,800	
第31回利付国債(30年)	2,080,000,000	2,063,401,600	
第32回利付国債(30年)	100,000,000	101,438,000	
第32回利付国債(20年)	70,000,000	82,140,800	
第35回利付国債(20年)	170,000,000	197,759,300	
第37回利付国債(20年)	302,000,000	348,027,820	
第39回利付国債(20年)	458,000,000	510,876,100	
第40回利付国債(20年)	390,000,000	425,610,900	
第42回利付国債(20年)	480,000,000	535,473,600	
第43回利付国債(20年)	1,370,000,000	1,563,320,700	
第46回利付国債(20年)	1,005,000,000	1,080,988,050	
第48回利付国債(20年)	1,135,000,000	1,252,177,400	
第50回利付国債(20年)	918,000,000	955,169,820	
第52回利付国債(20年)	990,000,000	1,047,964,500	
第54回利付国債(20年)	1,265,000,000	1,350,311,600	
第56回利付国債(20年)	1,598,000,000	1,666,538,220	
第59回利付国債(20年)	1,395,000,000	1,403,049,150	
第61回利付国債(20年)	1,575,000,000	1,448,937,000	
第64回利付国債(20年)	1,525,000,000	1,558,336,500	
第65回利付国債(20年)	1,530,000,000	1,559,620,800	
第70回利付国債(20年)	1,970,000,000	2,121,473,300	
第72回利付国債(20年)	1,853,000,000	1,921,060,690	
第74回利付国債(20年)	2,284,000,000	2,363,551,720	
第75回利付国債(20年)	1,800,000,000	1,858,050,000	
第78回利付国債(20年)	1,600,000,000	1,605,664,000	

	第 8 2 回利付国債（ 2 0 年）	1,450,000,000	1,489,933,000	
	第 8 4 回利付国債（ 2 0 年）	1,850,000,000	1,871,201,000	
	第 8 5 回利付国債（ 2 0 年）	2,210,000,000	2,261,272,000	
	第 8 8 回利付国債（ 2 0 年）	2,097,000,000	2,200,780,530	
	第 9 0 回利付国債（ 2 0 年）	1,980,000,000	2,046,686,400	
	第 9 2 回利付国債（ 2 0 年）	2,219,000,000	2,260,872,530	
	第 9 3 回利付国債（ 2 0 年）	2,217,000,000	2,224,027,890	
	第 9 5 回利付国債（ 2 0 年）	2,140,000,000	2,234,930,400	
	第 9 7 回利付国債（ 2 0 年）	2,027,000,000	2,083,431,680	
	第 9 9 回利付国債（ 2 0 年）	2,188,000,000	2,212,243,040	
	第 1 0 0 回利付国債（ 2 0 年）	1,387,000,000	1,420,787,320	
	第 1 0 1 回利付国債（ 2 0 年）	1,415,000,000	1,491,650,550	
	第 1 0 2 回利付国債（ 2 0 年）	2,382,000,000	2,507,340,840	
	第 1 0 5 回利付国債（ 2 0 年）	2,360,000,000	2,372,602,400	
	第 1 0 7 回利付国債（ 2 0 年）	2,448,000,000	2,456,225,280	
	第 1 0 9 回利付国債（ 2 0 年）	2,420,000,000	2,348,077,600	
	第 1 1 1 回利付国債（ 2 0 年）	2,496,000,000	2,533,564,800	
	第 1 1 3 回利付国債（ 2 0 年）	4,222,000,000	4,213,260,460	
	第 1 1 4 回利付国債（ 2 0 年）	2,383,000,000	2,374,730,990	
	第 1 1 6 回利付国債（ 2 0 年）	600,000,000	607,146,000	
	国債証券 小計	366,925,000,000	378,192,699,380	
地方債証券	第 1 回東京都公募公債（ 2 0 年）	100,000,000	97,125,000	
	第 1 回東京都公募公債（ 3 0 年）	100,000,000	97,825,000	
	第 2 回東京都公募公債（ 3 年）	200,000,000	201,748,000	
	第 6 回東京都公募公債（ 2 0 年）	100,000,000	100,949,000	
	第 7 回東京都公募公債（ 2 0 年）	100,000,000	102,490,000	
	第 8 回東京都公募公債（ 2 0 年）	100,000,000	104,791,000	
	第 5 7 6 回東京都公募公債	100,000,000	101,629,000	
	第 5 7 7 回東京都公募公債	100,000,000	101,712,000	
	第 5 7 9 回東京都公募公債	100,000,000	101,758,000	

第582回東京都公募公債	100,000,000	102,381,000	
第583回東京都公募公債	648,500,000	664,556,860	
第584回東京都公募公債	100,000,000	102,381,000	
第588回東京都公募公債	100,000,000	102,479,000	
第596回東京都公募公債	100,000,000	101,177,000	
第598回東京都公募公債	200,000,000	201,108,000	
第602回東京都公募公債	200,000,000	207,114,000	
第603回東京都公募公債	200,000,000	207,924,000	
第604回東京都公募公債	100,000,000	103,995,000	
第608回東京都公募公債	600,000,000	626,580,000	
第610回東京都公募公債	100,000,000	105,520,000	
第613回東京都公募公債	100,000,000	104,535,000	
第623回東京都公募公債	200,000,000	206,878,000	
第628回東京都公募公債	100,000,000	104,865,000	
第629回東京都公募公債	100,000,000	104,072,000	
第634回東京都公募公債	106,000,000	112,760,680	
第642回東京都公募公債	200,000,000	212,326,000	
第643回東京都公募公債	100,000,000	105,148,000	
第646回東京都公募公債	100,000,000	106,978,000	
第652回東京都公募公債	200,000,000	208,874,000	
第653回東京都公募公債	200,000,000	206,670,000	
第660回東京都公募公債	700,000,000	722,813,000	
第662回東京都公募公債	100,000,000	103,727,000	
第668回東京都公募公債	200,000,000	204,168,000	
平成13年度第1回北海道公募公債	113,800,000	115,450,100	
平成16年度第3回北海道公募公債	100,000,000	104,068,000	
平成17年度第4回北海道公募公債	100,000,000	102,708,000	
平成17年度第9回北海道公募公債	100,000,000	103,617,000	
平成18年度第8回北海道公募公債（5年）	100,000,000	101,900,000	
平成19年度第2回北海道公募公債	100,000,000	105,048,000	
平成19年度第7回北海道公募公債	100,000,000	104,499,000	



平成20年度第4回北海道公募公債	100,000,000	105,130,000	
平成20年度第9回北海道公募公債（5年）	300,000,000	312,504,000	
平成20年度第12回北海道公募公債	100,000,000	102,761,000	
平成20年度第15回北海道公募公債（5年）	200,000,000	205,040,000	
第1回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	108,415,000	
第3回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	101,933,000	
第7回神奈川県公募公債（20年）	100,000,000	102,202,000	
第25回神奈川県公募公債（5年）	400,000,000	408,240,000	
第26回神奈川県公募公債（5年）	100,000,000	102,494,000	
第27回神奈川県公募公債（5年）	100,000,000	102,203,000	
第122回神奈川県公募公債	200,000,000	208,310,000	
第129回神奈川県公募公債	100,000,000	104,660,000	
第143回神奈川県公募公債	100,000,000	105,588,000	
第144回神奈川県公募公債	300,000,000	317,898,000	
第147回神奈川県公募公債	100,000,000	106,767,000	
第149回神奈川県公募公債	100,000,000	105,667,000	
第157回神奈川県公募公債	115,600,000	118,632,188	
第3回大阪府公募公債（7年）	200,000,000	208,100,000	
第26回大阪府公募公債（5年）	200,000,000	203,360,000	
第31回大阪府公募公債（5年）	100,000,000	102,756,000	
第52回大阪府公募公債（5年）	400,000,000	404,700,000	
第261回大阪府公募公債（10年）	105,000,000	108,778,950	
第262回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,248,000	
第267回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	104,145,000	
第277回大阪府公募公債（10年）	600,000,000	619,908,000	
第299回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	211,516,000	
第303回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	105,773,000	
第306回大阪府公募公債（10年）	200,000,000	209,702,000	
第313回大阪府公募公債（10年）	100,000,000	103,111,000	
平成14年度第2回京都府公募公債	300,000,000	305,661,000	
平成19年度第1回京都府公募公債	130,260,000	137,245,843	

平成14年度第5回兵庫県公募公債	100,000,000	101,223,000	
平成15年度第4回兵庫県公募公債	100,000,000	102,210,000	
平成16年度第12回兵庫県公募公債	100,000,000	103,467,000	
平成17年度第2回兵庫県公募公債	200,000,000	206,836,000	
平成17年度第6回兵庫県公募公債	101,000,000	103,931,020	
平成18年度第2回兵庫県公募公債（5年）	200,000,000	202,476,000	
平成19年度第8回兵庫県公募公債（5年）	100,000,000	102,232,000	
平成20年度第5回兵庫県公募公債	100,000,000	105,247,000	
平成21年度第3回兵庫県公募公債	200,000,000	203,638,000	
平成21年度第11回兵庫県公募公債	200,000,000	204,150,000	
平成21年度第23回兵庫県公募公債	200,000,000	198,222,000	
平成18年度第2回静岡県公募公債	100,000,000	107,101,000	
平成18年度第3回静岡県公募公債（5年）	100,000,000	101,765,000	
平成18年度第5回静岡県公募公債	100,000,000	106,126,000	
平成19年度第7回静岡県公募公債	100,000,000	105,224,000	
平成20年度第1回静岡県公募公債	200,000,000	205,334,000	
平成20年度第7回静岡県公募公債	100,000,000	103,672,000	
平成21年度第5回静岡県公募公債	300,000,000	298,575,000	
平成14年度第2回愛知県公募公債（10年）	110,000,000	112,805,000	
平成17年度第2回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	103,266,000	
平成18年度第4回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	105,829,000	
平成19年度第3回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	106,025,000	
平成20年度第5回愛知県公募公債（5年）	500,000,000	511,530,000	
平成21年度第1回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	102,384,000	
平成21年度第7回愛知県公募公債（10年）	200,000,000	202,820,000	
平成19年度第3回広島県公募公債	200,000,000	207,600,000	
平成20年度第1回広島県公募公債	100,000,000	104,862,000	
平成15年度第3回埼玉県公募公債	205,670,000	214,186,794	
平成16年度第3回埼玉県公募公債	100,000,000	105,879,000	
平成16年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	103,760,000	
平成17年度第6回埼玉県公募公債	100,000,000	104,810,000	

平成18年度第7回埼玉県公募公債	100,000,000	106,015,000	
平成19年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	106,413,000	
平成21年度第1回埼玉県公募公債	100,000,000	101,735,000	
平成21年度第4回埼玉県公募公債	200,000,000	201,650,000	
平成18年度第1回福岡県公募公債	100,000,000	107,720,000	
平成19年度第2回福岡県公募公債	100,000,000	106,969,000	
平成20年度第9回福岡県公募公債	200,000,000	203,122,000	
平成16年度第9回千葉県公募公債	100,000,000	104,252,000	
平成18年度第1回千葉県公募公債	200,000,000	214,184,000	
平成18年度第4回千葉県公募公債	100,000,000	105,815,000	
平成19年度第1回千葉県公募公債	100,000,000	105,374,000	
平成21年度第2回千葉県公募公債	345,000,000	351,872,400	
平成13年度第1回新潟県公募公債	155,000,000	157,605,550	
平成14年度第1回新潟県公募公債	240,000,000	244,982,400	
平成17年度第1回新潟県公募公債	200,000,000	206,388,000	
平成19年度第1回岐阜県公募公債（10年）	200,000,000	211,350,000	
第1回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,116,000	
第2回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,811,000	
第4回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,416,000	
第6回共同発行市場公募地方債	200,000,000	208,276,000	
第7回共同発行市場公募地方債	319,400,000	330,531,090	
第12回共同発行市場公募地方債	437,000,000	452,933,020	
第15回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,525,000	
第20回共同発行市場公募地方債	300,000,000	312,654,000	
第21回共同発行市場公募地方債	300,000,000	311,292,000	
第22回共同発行市場公募地方債	200,000,000	207,500,000	
第23回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,269,000	
第27回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,269,000	
第29回共同発行市場公募地方債	300,000,000	311,343,000	
第30回共同発行市場公募地方債	200,000,000	206,464,000	
第31回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,286,000	

第3 2回共同発行市場公募地方債	300,000,000	314,430,000	
第3 3回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,793,000	
第3 5回共同発行市場公募地方債	400,000,000	419,096,000	
第3 6回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,752,000	
第3 8回共同発行市場公募地方債	200,000,000	214,184,000	
第4 0回共同発行市場公募地方債	300,000,000	323,175,000	
第4 6回共同発行市場公募地方債	200,000,000	211,444,000	
第5 5回共同発行市場公募地方債	200,000,000	211,214,000	
第5 6回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,586,000	
第5 7回共同発行市場公募地方債	300,000,000	312,036,000	
第6 2回共同発行市場公募地方債	200,000,000	208,762,000	
第6 4回共同発行市場公募地方債	300,000,000	313,710,000	
第6 5回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,237,000	
第7 3回共同発行市場公募地方債	300,000,000	306,783,000	
第7 5回共同発行市場公募地方債	900,000,000	922,482,000	
第7 7回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,902,000	
平成1 3年度第2回大阪市公募公債	100,000,000	101,085,000	
平成1 4年度第1 1回大阪市公募公債	100,000,000	101,115,000	
平成1 8年度第1回大阪市公募公債（5年）	500,000,000	506,040,000	
平成1 8年度第2回大阪市公募公債	200,000,000	212,852,000	
平成1 8年度第3回大阪市公募公債	100,000,000	107,029,000	
平成1 8年度第6回大阪市公募公債	300,000,000	319,092,000	
平成1 9年度第5回大阪市公募公債	100,000,000	106,002,000	
平成1 9年度第1 0回大阪市公募公債	100,000,000	103,834,000	
平成2 1年度第4回大阪市公募公債	300,000,000	303,573,000	
第1回名古屋市公募公債（20年）	200,000,000	203,842,000	
第3回名古屋市公募公債（20年）	100,000,000	100,878,000	
第1 1回名古屋市公募公債（5年）	300,000,000	306,195,000	
第1 2回ひ号名古屋市公募公債	100,000,000	103,260,000	
第4 5 5回名古屋市公募公債（10年）	100,000,000	106,489,000	
第1回京都市公募公債（30年）	100,000,000	103,067,000	

	第7回京都市公募公債（20年）	100,000,000	103,159,000	
	平成18年度第3回京都市公募公債	200,000,000	212,470,000	
	平成15年度第1回神戸市公募公債	100,000,000	100,659,000	
	平成19年度第10回神戸市公募公債	100,000,000	103,500,000	
	第4回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	101,180,000	
	第9回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	104,405,000	
	第14回横浜市公募公債（20年）	100,000,000	102,933,000	
	平成17年度第4回横浜市公募公債	200,000,000	208,750,000	
	平成17年度第3回横浜市公募公債	100,000,000	104,829,000	
	平成18年度第4回横浜市公募公債	300,000,000	318,681,000	
	平成18年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	106,610,000	
	平成18年度第3回横浜市公募公債	200,000,000	212,438,000	
	平成20年度第6回横浜市公募公債	200,000,000	203,572,000	
	第22回横浜市公募公債	100,000,000	102,870,000	
	平成13年度第2回札幌市公募公債	200,000,000	203,428,000	
	平成18年度第4回札幌市公募公債	200,000,000	211,662,000	
	第2回川崎市15年公募公債	100,000,000	101,338,000	
	第4回川崎市15年公募公債	100,000,000	104,869,000	
	第19回川崎市公募公債（5年）	100,000,000	103,372,000	
	平成15年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	103,859,000	
	平成19年度第2回北九州市公募公債	100,000,000	103,647,000	
	平成18年度第4回福岡市公募公債	100,000,000	105,689,000	
	平成18年度第5回福岡市公募公債（5年）	100,000,000	101,701,000	
	平成20年度第5回福岡市公募公債	100,000,000	102,457,000	
	平成21年度第7回福岡市公募公債	200,000,000	199,842,000	
	平成19年度第1回広島市公募公債	100,000,000	104,361,000	
	平成21年度第1回千葉市公募公債	200,000,000	204,112,000	
	地方債証券 小計	32,732,230,000	33,864,446,895	
特殊債券	第27回韓国産業銀行円貨債券（2007）	100,000,000	101,189,000	
	第1回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	103,214,000	

第2回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	202,906,000	
第3回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	207,500,000	
第5回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	101,667,000	
第5回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	100,000,000	101,092,000	
第9回日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,931,000	
第10回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,026,000	
第15回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,097,000	
第20回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,346,000	
第20回日本政策投資銀行債券	100,000,000	100,769,000	
第23回政府保証日本政策投資銀行債券	200,000,000	206,948,000	
第24回日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,752,000	
第27回日本政策投資銀行債券	100,000,000	106,572,000	
第30回日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,705,000	
第36回日本政策投資銀行債券	100,000,000	100,751,000	
第46回日本政策投資銀行債券	200,000,000	207,330,000	
第51回日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,617,000	
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	150,567,840	
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	205,816,000	
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	307,095,000	
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	166,059,580	
第7回道路債券	100,000,000	110,201,000	
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	105,108,000	
第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,928,000	
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	103,667,000	
第9回道路債券	100,000,000	107,609,000	
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	107,456,000	
第16回道路債券	200,000,000	203,570,000	
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	109,591,860	
第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,289,000	
第21回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,122,000	
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	301,752,000	

第 2 3 回道路債券	200,000,000	208,198,000	
第 2 3 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,696,000	
第 2 5 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	318,327,000	
第 2 6 回道路債券	300,000,000	313,161,000	
第 2 7 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	500,000,000	530,355,000	
第 2 7 回道路債券	100,000,000	106,080,000	
第 2 9 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,238,000	
第 3 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	210,754,000	
第 3 0 回道路債券	100,000,000	104,842,000	
第 3 4 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,260,000	
第 3 6 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	153,000,000	163,133,190	
第 3 7 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	319,593,000	
第 3 7 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,107,000	
第 3 9 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,217,000	
第 4 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	319,458,000	
第 4 0 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,463,000	
第 4 1 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	420,016,000	
第 4 2 回道路債券	100,000,000	102,728,000	
第 4 4 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,674,000	
第 4 5 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	205,020,000	
第 4 7 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,668,000	
第 4 8 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	400,000,000	411,312,000	
第 4 9 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,207,000	
第 5 2 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	207,854,000	
第 5 6 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,580,000	
第 5 8 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	500,000,000	522,585,000	
第 6 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,233,000	
第 6 2 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,367,000	
第 6 7 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	206,574,000	
第 6 9 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,217,000	
第 8 1 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	198,502,000	

第 8 8 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,390,000	
第 9 0 回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	297,510,000	
第 3 1 3 回政府保証道路債券	200,000,000	205,260,000	
第 3 2 5 回政府保証道路債券	100,000,000	103,444,000	
第 3 2 7 回政府保証道路債券	552,000,000	575,758,080	
第 3 2 9 回政府保証道路債券	300,000,000	314,304,000	
第 3 3 0 回政府保証道路債券	100,000,000	105,642,000	
第 3 3 5 回政府保証道路債券	100,000,000	104,023,000	
第 3 3 6 回政府保証道路債券	200,000,000	208,054,000	
第 3 3 7 回政府保証道路債券	100,000,000	103,542,000	
第 3 3 8 回政府保証道路債券	200,000,000	209,016,000	
第 3 3 9 回政府保証道路債券	100,000,000	104,053,000	
第 3 4 0 回政府保証道路債券	100,000,000	102,464,000	
第 3 4 1 回政府保証道路債券	100,000,000	103,552,000	
第 3 4 6 回政府保証道路債券	301,000,000	313,280,800	
第 1 回政府保証地方公営企業等金融機構債券	300,000,000	310,080,000	
第 1 回政府保証地方公共団体金融機構債券	300,000,000	305,415,000	
第 1 回公営企業債券（ 5 年 ）	500,000,000	511,195,000	
第 2 回公営企業債券	100,000,000	102,673,000	
第 2 回地方公営企業等金融機構債券（ 2 0 年 ）	100,000,000	101,274,000	
第 3 回公営企業債券（ 2 0 年 ）	100,000,000	91,153,000	
第 5 回公営企業債券（ 2 0 年 ）	100,000,000	103,344,000	
第 6 回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	100,402,000	
第 6 回公営企業債券	100,000,000	100,917,000	
第 7 回政府保証地方公営企業等金融機構債券	500,000,000	505,660,000	
第 7 回公営企業債券	400,000,000	414,996,000	
第 1 0 回公営企業債券	100,000,000	105,186,000	
第 1 1 回公営企業債券（ 2 0 年 ）	100,000,000	101,930,000	
第 1 2 回公営企業債券	100,000,000	104,260,000	
第 1 5 回公営企業債券	100,000,000	103,383,000	
第 1 6 回公営企業債券（ 2 0 年 ）	100,000,000	101,067,000	



第17回公営企業債券	100,000,000	104,621,000	
第17回公営企業債券(20年)	100,000,000	104,777,000	
第18回公営企業債券(20年)	100,000,000	107,285,000	
第20回公営企業債券	100,000,000	107,341,000	
第22回公営企業債券(20年)	100,000,000	103,169,000	
第24回公営企業債券(20年)	200,000,000	204,158,000	
第30回公営企業債券	100,000,000	106,017,000	
第799回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,252,000	
第801回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,271,000	
第803回政府保証公営企業債券	500,000,000	506,715,000	
第804回政府保証公営企業債券	200,000,000	202,600,000	
第805回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,667,000	
第806回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,757,000	
第809回政府保証公営企業債券	202,000,000	206,169,280	
第810回政府保証公営企業債券	200,000,000	204,356,000	
第813回政府保証公営企業債券	201,000,000	206,085,300	
第815回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,528,000	
第818回政府保証公営企業債券	102,000,000	104,598,960	
第821回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,253,000	
第823回政府保証公営企業債券	200,000,000	203,082,000	
第824回政府保証公営企業債券	600,000,000	609,336,000	
第825回政府保証公営企業債券	500,000,000	507,910,000	
第826回政府保証公営企業債券	300,000,000	303,843,000	
第827回政府保証公営企業債券	200,000,000	201,970,000	
第829回政府保証公営企業債券	500,000,000	512,905,000	
第833回政府保証公営企業債券	200,000,000	208,158,000	
第834回政府保証公営企業債券	200,000,000	208,288,000	
第836回政府保証公営企業債券	300,000,000	310,407,000	
第838回政府保証公営企業債券	100,000,000	104,283,000	
第840回政府保証公営企業債券	200,000,000	209,494,000	
第841回政府保証公営企業債券	100,000,000	105,650,000	

第843回政府保証公営企業債券	100,000,000	104,415,000	
第844回政府保証公営企業債券	400,000,000	419,660,000	
第846回政府保証公営企業債券	100,000,000	104,043,000	
第847回政府保証公営企業債券	100,000,000	104,024,000	
第849回政府保証公営企業債券	100,000,000	104,515,000	
第851回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,544,000	
第852回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,563,000	
第858回政府保証公営企業債券	200,000,000	209,122,000	
第861回政府保証公営企業債券	300,000,000	315,273,000	
第863回政府保証公営企業債券	100,000,000	107,443,000	
第865回政府保証公営企業債券	300,000,000	322,296,000	
第866回政府保証公営企業債券	200,000,000	214,864,000	
第875回政府保証公営企業債券	200,000,000	210,572,000	
第883回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,341,000	
第884回政府保証公営企業債券	300,000,000	306,861,000	
第885回政府保証公営企業債券	200,000,000	209,012,000	
第886回政府保証公営企業債券	200,000,000	210,434,000	
第3回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	102,623,000	
第187回政府保証首都高速道路債券	193,000,000	200,930,370	
第195回政府保証首都高速道路債券	400,000,000	415,992,000	
第197回政府保証首都高速道路債券	300,000,000	313,494,000	
第199回政府保証首都高速道路債券	200,000,000	208,060,000	
第4回阪神高速道路債券	200,000,000	203,276,000	
第17回中小企業債券	100,000,000	101,364,000	
第23回中小企業債券	100,000,000	102,960,000	
第24回中小企業債券	200,000,000	203,098,000	
第150回政府保証中小企業債券	271,000,000	274,349,560	
第157回政府保証中小企業債券	200,000,000	202,588,000	
第165回政府保証中小企業債券	100,000,000	102,499,000	
第2回日本鉄道建設債券	100,000,000	103,019,000	
第2回国際協力銀行債券	500,000,000	508,560,000	

第 6 回国際協力銀行債券	100,000,000	102,153,000	
第 1 0 回国際協力銀行債券	300,000,000	311,103,000	
第 1 5 回国際協力銀行債券	200,000,000	209,954,000	
第 2 1 回国際協力銀行債券	100,000,000	104,496,000	
第 2 7 回国際協力銀行債券	100,000,000	105,193,000	
第 7 回政府保証都市再生債券	100,000,000	100,682,000	
第 8 回都市再生債券	200,000,000	208,186,000	
第 9 回政府保証都市再生債券	300,000,000	303,555,000	
第 1 7 回政府保証都市再生債券	500,000,000	503,205,000	
第 1 8 回政府保証都市再生債券	400,000,000	401,708,000	
第 1 9 回都市再生債券	100,000,000	105,971,000	
第 2 7 回都市再生債券	300,000,000	306,030,000	
第 3 回本州四国連絡橋債券	100,000,000	105,873,000	
第 7 回本州四国連絡橋債券	100,000,000	102,848,000	
第 3 3 2 回東京交通債券	100,000,000	110,797,000	
第 3 3 8 回東京交通債券	100,000,000	101,475,000	
第 3 4 2 回東京交通債券	100,000,000	107,389,000	
第 3 5 回政府保証電源開発債券	600,000,000	610,560,000	
第 1 3 回関西国際空港株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,271,000	
第 1 6 回関西国際空港株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,947,000	
第 3 8 回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	102,466,000	
第 5 1 回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	104,733,000	
第 1 4 回独立行政法人福祉医療機構債券	200,000,000	212,670,000	
第 1 7 回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	105,693,000	
第 1 0 5 回政府保証預金保険機構債券	100,000,000	101,082,000	
第 1 2 7 回政府保証預金保険機構債券	100,000,000	101,304,000	
第 1 4 3 回政府保証預金保険機構債券	100,000,000	101,594,000	
第 1 5 3 回政府保証預金保険機構債券	100,000,000	102,281,000	
第 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	69,238,000	70,144,325	
第 1 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	106,628,000	105,494,544	
第 1 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	139,834,000	142,785,895	

第2回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	109,928,000	109,339,885	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	215,403,000	222,410,059	
第3回貸付債権担保住宅金融公庫債券	38,050,000	38,616,945	
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	54,823,000	55,222,659	
第4回貸付債権担保住宅金融公庫債券	42,169,000	42,575,509	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	82,525,000	85,564,395	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	226,623,000	230,434,798	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	58,475,000	58,612,416	
第6回貸付債権担保住宅金融公庫債券	91,498,000	92,971,117	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	63,175,000	65,170,066	
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	191,259,000	197,210,980	
第7回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	78,465,000	79,515,646	
第8回貸付債権担保住宅金融公庫債券	47,122,000	47,003,723	
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	195,126,000	200,017,808	
第8回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	104,371,000	
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	131,248,000	134,825,820	
第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	82,738,000	85,190,354	
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券	49,078,000	48,110,181	
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	200,541,000	205,560,541	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	85,850,000	87,536,952	
第11回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	86,762,000	88,649,941	
第12回貸付債権担保住宅金融公庫債券	55,039,000	54,774,812	
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	89,958,000	91,301,072	
第14回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	209,870,000	
第16回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	184,592,000	186,293,938	
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	189,316,000	191,669,197	
第21回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	105,039,000	
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	188,440,000	196,105,739	
第25回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	205,534,000	
第26回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	285,768,000	292,917,915	
第27回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,554,000	97,328,437	

第 2 8 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	68,092,000	68,037,526	
第 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	96,940,000	98,083,892	
第 2 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	72,593,000	72,676,481	
第 2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,482,000	98,333,017	
第 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,461,000	98,476,543	
第 3 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	74,521,000	74,225,896	
第 3 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	76,005,000	75,702,500	
第 3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	198,110,000	197,674,158	
第 3 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	75,875,000	75,176,191	
第 3 4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	154,848,000	154,894,454	
第 3 5 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	77,654,000	77,466,853	
第 3 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,140,000	
第 3 6 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	76,759,000	77,069,106	
第 3 8 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	153,530,000	154,512,592	
第 3 9 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	77,436,000	77,512,661	
第 4 0 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	152,084,000	153,245,921	
第 4 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	78,487,000	79,928,806	
第 4 2 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	154,332,000	160,415,767	
第 4 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	154,762,000	159,844,384	
第 4 4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	77,619,000	80,293,750	
第 5 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	81,001,000	83,188,027	
第 5 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	82,521,000	83,948,613	
第 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	165,254,000	169,548,951	
第 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	164,952,000	169,884,064	
第 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	72,797,000	74,363,591	
第 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	83,987,000	86,100,952	
第 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	153,404,000	155,097,580	
第 1 5 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	181,310,000	183,480,280	
第 2 7 回国民生活債券	300,000,000	306,384,000	
第 3 6 回国民生活債券	100,000,000	102,292,000	
第 6 回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	104,614,000	

第10回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	108,359,000	
第1回新東京国際空港債券	300,000,000	305,772,000	
第3回新東京国際空港債券	100,000,000	102,768,000	
第4回政府保証新東京国際空港債券	100,000,000	102,575,000	
第5回新東京国際空港債券	100,000,000	104,443,000	
第7回日本学生支援債券	300,000,000	305,736,000	
第3回沖縄振興開発金融公庫債券	200,000,000	208,610,000	
第5回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	103,421,000	
い第682号商工債	300,000,000	305,856,000	
い第687号商工債	200,000,000	206,050,000	
い第703号商工債	200,000,000	207,108,000	
い第711号商工債	100,000,000	101,794,000	
い第712号商工債	100,000,000	101,112,000	
い第671号農林債券	100,000,000	101,319,000	
い第675号農林債	100,000,000	101,717,000	
い第679号農林債	200,000,000	203,732,000	
い第681号農林債	100,000,000	101,938,000	
い第682号農林債	200,000,000	203,628,000	
い第684号農林債	100,000,000	102,064,000	
い第687号農林債	100,000,000	102,855,000	
い第690号農林債	400,000,000	409,280,000	
い第695号農林債	200,000,000	204,234,000	
い第696号農林債	500,000,000	514,595,000	
い第697号農林債	200,000,000	206,568,000	
い第698号農林債	100,000,000	103,314,000	
い第704号農林債	200,000,000	205,514,000	
い第708号農林債	300,000,000	306,639,000	
い第714号農林債	400,000,000	404,080,000	
第597回あおぞら債	100,000,000	101,561,000	
第195回しんきん中金債券	50,000,000	50,360,500	
第197回しんきん中金債券	100,000,000	101,372,000	

第201回信金中金債（5年）	200,000,000	203,546,000	
第203回信金中金債（5年）	100,000,000	101,746,000	
第209回信金中金債（5年）	100,000,000	102,069,000	
第215回信金中金債（5年）	200,000,000	205,740,000	
第216回信金中金債（5年）	200,000,000	204,854,000	
第218回信金中金債（5年）	300,000,000	306,780,000	
第221回信金中金債（5年）	100,000,000	102,240,000	
第225回信金中金債（5年）	200,000,000	205,646,000	
第227回信金中金債（5年）	100,000,000	103,215,000	
第228回信金中金債（5年）	400,000,000	413,676,000	
第229回信金中金債（5年）	300,000,000	309,777,000	
第230回信金中金債（5年）	100,000,000	102,724,000	
第231回信金中金債（5年）	100,000,000	103,131,000	
第233回信金中金債（5年）	500,000,000	515,685,000	
第99号商工債（3年）	500,000,000	504,065,000	
第100号商工債（3年）	300,000,000	302,931,000	
第101号商工債（3年）	200,000,000	202,220,000	
第104号商工債（3年）	500,000,000	506,710,000	
第108号商工債（3年）	500,000,000	507,260,000	
第110号商工債（3年）	200,000,000	203,322,000	
第113号商工債（3年）	300,000,000	303,579,000	
第2回韓国中小企業銀行	100,000,000	100,270,000	
第1回政府保証東日本高速道路債券	137,000,000	143,977,410	
第3回政府保証東日本高速道路債券	100,000,000	107,399,000	
第5回東日本高速道路株式会社債	200,000,000	201,478,000	
第1回政府保証中日本高速道路債券	250,000,000	262,732,500	
第1回中日本高速道路株式会社債	100,000,000	103,990,000	
第3回政府保証中日本高速道路債券	163,000,000	171,257,580	
第5回中日本高速道路株式会社債	200,000,000	208,846,000	
第6回中日本高速道路株式会社債	100,000,000	103,073,000	
第10回政府保証中日本高速道路債券	100,000,000	106,135,000	

	第12回政府保証中日本高速道路債券	103,000,000	109,237,680	
	第14回政府保証中日本高速道路債券	100,000,000	106,577,000	
	第19回政府保証中日本高速道路債券	124,000,000	127,966,760	
	第21回政府保証中日本高速道路債券	200,000,000	208,932,000	
	第25回政府保証中日本高速道路債券	200,000,000	203,528,000	
	第5回西日本高速道路株式会社債	100,000,000	100,739,000	
	第8回政府保証西日本高速道路債券	233,000,000	245,220,850	
	第15回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	105,210,000	
	第19回政府保証西日本高速道路債券	100,000,000	101,092,000	
	第5回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	206,954,000	
	第18回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	204,952,000	
	第1回緑資源債券	100,000,000	101,991,000	
	第3回東京地下鉄株式会社債（一般担保付）	200,000,000	212,558,000	
	特殊債券 小計	56,074,041,000	57,716,041,325	
社債券	第9回株式会社ボスコ円貨社債（2006）	200,000,000	203,086,000	
	第1回メリルリンチ・アンド・カンパニー・インク	200,000,000	188,080,000	
	第13回メリルリンチ・アンド・カンパニー・インク	100,000,000	100,135,000	
	第14回メリルリンチ・アンド・カンパニー・インク	100,000,000	100,301,000	
	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	203,004,000	
	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	100,229,000	
	第13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	400,000,000	401,152,000	
	第1回ジェイ・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニー	100,000,000	99,947,000	
	第2回ジェー・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニー	100,000,000	99,020,000	
	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	295,689,000	
	第4回ジェイ・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニー	100,000,000	101,121,000	
	第5回ジェー・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニー	100,000,000	100,271,000	
	第2回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク	200,000,000	201,150,000	
	第8回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク	100,000,000	101,587,000	
	第9回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク	100,000,000	103,136,000	
	第10回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク	100,000,000	98,395,000	



第11回シティグループ・インク円貨社債(2003)	200,000,000	192,706,000	
第14回シティグループ・インク円貨債券	400,000,000	399,860,000	
第17回シティグループ・インク円貨債券	100,000,000	86,964,000	
第22回シティグループ・インク円貨債券	300,000,000	297,324,000	
第7回ザ・ベアー・スターズ・カンパニーズ・インク	200,000,000	202,880,000	
第3回バンク・オブ・アメリカ・コーポレーション	200,000,000	200,370,000	
第5回バンク・オブ・アメリカ・コーポレーション	100,000,000	100,148,000	
第6回バンク・オブ・アメリカ・コーポレーション	100,000,000	99,119,000	
第1回テレフォニカ・エセ・アー保証テレフォニカ・ヨーロッパ・ビー・ヴィ	100,000,000	101,150,000	
H S B C 銀行 P L C 第1回円貨社債	200,000,000	205,378,000	
第1回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	300,000,000	305,829,000	
第7回麒麟ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	201,914,000	
第2回サントリーホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,089,000	
第19回味の素株式会社無担保社債	100,000,000	103,171,000	
第4回日本たばこ産業株式会社社債(一般担保付)	200,000,000	205,990,000	
第23回王子製紙株式会社無担保社債	100,000,000	101,319,000	
第6回株式会社日本製紙グループ本社無担保社債	100,000,000	101,061,000	
第25回住友化学工業株式会社無担保社債	100,000,000	103,665,000	
第38回住友化学株式会社無担保社債	100,000,000	102,897,000	
第35回三菱化学株式会社無担保社債	100,000,000	105,360,000	
第22回三井化学株式会社無担保社債	200,000,000	202,318,000	
第35回三井化学株式会社無担保社債	100,000,000	104,243,000	
第26回新日本石油株式会社無担保社債	200,000,000	215,012,000	
第4回株式会社ブリヂストン無担保社債	200,000,000	202,522,000	
第16回住友ゴム工業株式会社無担保社債	100,000,000	105,800,000	
第12回旭硝子株式会社無担保社債	200,000,000	208,420,000	
第30回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	113,948,000	
第48回新日本製鐵株式会社無担保社債	200,000,000	204,266,000	
第49回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	101,075,000	
第55回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	102,916,000	
第47回住友金属工業株式会社無担保社債	100,000,000	101,536,000	

第52回住友金属工業株式会社無担保社債	100,000,000	103,024,000	
第4回株式会社神戸製鋼所無担保社債	100,000,000	104,796,000	
第46回株式会社神戸製鋼所無担保社債	100,000,000	103,680,000	
第9回ジェイエフイーホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,384,000	
第11回ジェイエフイーホールディングス株式会社	100,000,000	102,603,000	
第11回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	101,859,000	
第15回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	104,369,000	
第18回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	105,252,000	
第7回株式会社小松製作所無担保社債	100,000,000	102,374,000	
第12回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	100,594,000	
第38回日本電気株式会社無担保社債	100,000,000	102,199,000	
第24回富士通株式会社無担保社債	200,000,000	204,572,000	
第6回パナソニック株式会社無担保社債	300,000,000	304,626,000	
第7回パナソニック株式会社無担保社債	100,000,000	103,192,000	
第21回シャープ株式会社無担保社債	100,000,000	101,569,000	
第24回シャープ株式会社無担保社債	200,000,000	201,584,000	
第9回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	100,696,000	
第12回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	101,652,000	
第21回ソニー株式会社無担保社債	200,000,000	202,666,000	
第22回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	103,047,000	
第26回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	104,669,000	
第20回三洋電機株式会社無担保社債	200,000,000	209,838,000	
第5回株式会社デンソー無担保社債	100,000,000	102,976,000	
第20回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	102,609,000	
第22回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	105,657,000	
第44回日産自動車株式会社無担保社債	300,000,000	300,246,000	
第7回トヨタ自動車株式会社無担保社債	400,000,000	411,576,000	
第9回トヨタ自動車株式会社無担保社債	300,000,000	305,550,000	
第5回アイシン精機株式会社無担保社債	100,000,000	102,653,000	
第3回凸版印刷株式会社無担保社債	100,000,000	103,034,000	
第43回伊藤忠商事株式会社無担保社債	100,000,000	106,021,000	

第57回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	101,243,000	
第63回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	101,897,000	
第70回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	102,868,000	
第61回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	104,520,000	
第63回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	102,108,000	
第23回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,338,000	
第25回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	101,323,000	
第30回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	104,338,000	
第67回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	103,760,000	
第69回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	105,064,000	
第72回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	102,770,000	
第32回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	100,214,000	
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	105,851,000	
第2回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	400,000,000	407,160,000	
第3回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	300,000,000	305,154,000	
第4回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	200,000,000	203,730,000	
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	205,550,000	
第7回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	200,000,000	213,930,000	
第8回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	103,542,000	
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	205,692,000	
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	409,876,000	
株式会社東京三菱銀行第8回無担保社債	100,000,000	103,804,000	
第9回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	109,994,000	
第11回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	200,000,000	214,420,000	
株式会社三菱東京UFJ銀行第12回無担保社債	200,000,000	212,046,000	
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	200,000,000	202,108,000	
第56回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	102,520,000	
第72回株式会社東京三菱銀行無担保社債	100,000,000	103,705,000	
第84回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	300,000,000	304,959,000	
第85回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	101,844,000	
第89回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	200,000,000	200,634,000	

第90回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	102,849,000	
第92回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	400,000,000	411,572,000	
第95回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	102,233,000	
第100回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	200,000,000	206,236,000	
第103回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	200,000,000	202,880,000	
第104回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	103,221,000	
第105回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	100,661,000	
第110回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	99,863,000	
第4回株式会社りそな銀行無担保社債	200,000,000	214,812,000	
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	101,725,000	
第11回株式会社静岡銀行無担保社債	100,000,000	102,644,000	
第7回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	104,081,000	
第8回住友信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	98,125,000	
中央三井信託銀行第3回無担保社債	100,000,000	105,191,000	
第4回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	101,916,000	
第5回株式会社三井住友銀行無担保社債	300,000,000	314,253,000	
第7回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	105,026,000	
第8回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	105,153,000	
第9回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	104,262,000	
第20回株式会社三井住友銀行無担保社債	200,000,000	209,272,000	
第36回株式会社三井住友銀行無担保社債	200,000,000	203,252,000	
第37回株式会社三井住友銀行無担保社債	200,000,000	203,458,000	
第39回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	102,043,000	
第42回株式会社三井住友銀行無担保社債	200,000,000	204,084,000	
第43回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	102,359,000	
第45回株式会社三井住友銀行無担保社債	200,000,000	205,406,000	
第8回株式会社みずほ銀行無担保社債	200,000,000	209,110,000	
第9回株式会社みずほ銀行無担保社債	100,000,000	101,207,000	
第10回株式会社みずほ銀行無担保社債	100,000,000	104,383,000	
第30回エヌ・ティ・ティ・リース株式会社無担保社債	100,000,000	101,254,000	
第32回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	102,882,000	

第9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	100,457,000	
第8回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	101,312,000	
第11回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	101,282,000	
第17回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	101,511,000	
第21回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	106,394,000	
第26回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	102,102,000	
第34回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	200,000,000	202,984,000	
第43回アコム株式会社無担保社債	100,000,000	99,170,000	
第50回アコム株式会社無担保社債	100,000,000	92,440,000	
第18回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,252,000	
第36回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	101,121,000	
第111回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	99,554,000	
第113回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	93,005,000	
第115回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	99,383,000	
第6回三菱UFJリース株式会社無担保社債	100,000,000	101,437,000	
第6回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	101,816,000	
第3回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,602,000	
第5回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	203,124,000	
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	102,407,000	
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	512,375,000	
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	315,042,000	
第28回三井不動産株式会社無担保社債	300,000,000	310,668,000	
第58回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	107,229,000	
第65回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	92,238,000	
第66回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	101,019,000	
第87回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	103,862,000	
第53回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	101,118,000	
第58回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	101,534,000	
第63回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	106,338,000	
第28回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	104,440,000	
第41回小田急電鉄株式会社無担保社債	200,000,000	214,916,000	

第42回京成電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	105,737,000	
第2回東日本旅客鉄道株式会社社債	200,000,000	240,756,000	
第7回東日本旅客鉄道株式会社社債	200,000,000	231,398,000	
第9回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	114,338,000	
第15回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	110,682,000	
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	200,000,000	214,624,000	
第34回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,006,000	
第52回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	103,378,000	
第3回西日本旅客鉄道株式会社社債	200,000,000	232,370,000	
第5回西日本旅客鉄道株式会社社債	200,000,000	227,466,000	
第3回東海旅客鉄道株式会社普通社債	100,000,000	112,349,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	105,482,000	
第11回東海旅客鉄道株式会社無担保社債	100,000,000	93,150,000	
第19回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	204,792,000	
第21回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	105,186,000	
第28回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	106,148,000	
第41回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	99,745,000	
第42回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	200,000,000	203,548,000	
第48回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	104,525,000	
第51回日本電信電話株式会社電信電話債券	300,000,000	321,819,000	
第53回日本電信電話株式会社電信電話債券	300,000,000	308,910,000	
第56回日本電信電話株式会社電信電話債券	300,000,000	306,042,000	
第6回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	103,268,000	
第8回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	102,916,000	
第15回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	103,685,000	
第7回株式会社エヌ・ティ・ティ・ドコモ無担保社債	100,000,000	101,141,000	
第15回株式会社エヌ・ティ・ティ・ドコモ無担保社債	200,000,000	210,942,000	
第425回東京電力株式会社社債	100,000,000	118,885,000	
第483回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	101,355,000	
第485回東京電力株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	202,708,000	
第506回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,986,000	

第514回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	104,438,000	
第515回東京電力株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	207,754,000	
第516回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	103,818,000	
第522回東京電力株式会社社債（一般担保付）	300,000,000	322,053,000	
第524回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	105,520,000	
第526回東京電力株式会社社債（一般担保付）	300,000,000	315,834,000	
第527回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	104,046,000	
第528回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	104,696,000	
第532回東京電力株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	209,612,000	
第533回東京電力株式会社社債（一般担保付）	500,000,000	521,860,000	
第535回東京電力株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	209,622,000	
第537回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	103,233,000	
第541回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	102,253,000	
第544回東京電力株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	212,142,000	
第545回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	105,011,000	
第546回東京電力株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	208,240,000	
第547回東京電力株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	208,332,000	
第552回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	102,764,000	
第406回中部電力株式会社社債	200,000,000	231,114,000	
第408回中部電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	116,253,000	
第409回中部電力株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	236,602,000	
第455回中部電力株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	203,282,000	
第469回中部電力株式会社社債	100,000,000	103,812,000	
第471回中部電力株式会社社債	300,000,000	309,648,000	
第474回中部電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	105,174,000	
第475回中部電力株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	214,284,000	
第486回中部電力株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	207,240,000	
第432回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	102,539,000	
第433回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	103,272,000	
第440回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	103,711,000	
第449回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	108,014,000	

第451回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	106,039,000	
第453回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	106,000,000	
第459回関西電力株式会社社債（一般担保付）	300,000,000	307,563,000	
第465回関西電力株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	208,354,000	
第466回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	103,527,000	
第467回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	103,370,000	
第472回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	104,170,000	
第306回中国電力株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	233,880,000	
第310回中国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	115,106,000	
第340回中国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,854,000	
第349回中国電力株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	211,196,000	
第273回北陸電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	103,674,000	
第279回北陸電力株式会社社債（一般担保付）	30,000,000	31,338,000	
第284回北陸電力株式会社社債（一般担保付）	400,000,000	419,444,000	
第286回北陸電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	105,407,000	
第368回東北電力株式会社社債（一般担保付）	450,000,000	526,788,000	
第372回東北電力株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	240,606,000	
第376回東北電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	116,119,000	
第408回東北電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	102,510,000	
第431回東北電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	106,704,000	
第444回東北電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	102,801,000	
第445回東北電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	104,185,000	
第229回四国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	117,249,000	
第245回四国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	103,945,000	
第253回四国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	90,558,000	
第268回四国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	103,345,000	
第346回九州電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	105,932,000	
第372回九州電力株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	202,330,000	
第380回九州電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	105,154,000	
第384回九州電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	103,106,000	
第394回九州電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	105,598,000	



	第400回九州電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	102,642,000	
	第405回九州電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	104,185,000	
	第408回九州電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	102,676,000	
	第258回北海道電力株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	237,192,000	
	第268回北海道電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	102,877,000	
	第295回北海道電力株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	208,096,000	
	第299回北海道電力株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	205,488,000	
	第300回北海道電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	103,513,000	
	第11回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,508,000	
	第14回電源開発株式会社無担保社債	200,000,000	208,362,000	
	第19回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	105,879,000	
	第21回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	103,918,000	
	第23回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	104,495,000	
	第17回東京瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	222,084,000	
	第25回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	104,338,000	
	第18回大阪瓦斯株式会社無担保社債	200,000,000	193,294,000	
	第22回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	105,515,000	
	第27回東邦瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	92,091,000	
	第30回東邦瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	107,269,000	
	第20回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	500,000,000	511,170,000	
	社債券 小計	42,580,000,000	44,178,581,000	
	合計		513,951,768,600	

## 「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21年4月13日現在)	(平成22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	851,207,129	512,715,987
コール・ローン	3,157,465,457	429,019,179
株式	186,642,921,701	256,497,951,064
新株予約権証券	929,758	-
投資証券	2,580,155,655	4,168,153,684
派生商品評価勘定	395,260,271	40,405,524
未収入金	612,372,133	1,631,208
未収配当金	385,580,452	343,282,051
未収利息	6,920	587
差入委託証拠金	2,713,082,036	955,043,890
流動資産合計	197,338,981,512	262,948,203,174
資産合計	197,338,981,512	262,948,203,174
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	3,365,895	-
未払解約金	80,668,763	335,681,723
流動負債合計	84,034,658	335,681,723
負債合計	84,034,658	335,681,723
純資産の部		
元本等		
1 元本		
元本	198,715,843,917	192,707,244,458
元本合計	198,715,843,917	192,707,244,458
2 剰余金		
剰余金又は欠損金( )	1,460,897,063	69,905,276,993
剰余金合計	1,460,897,063	69,905,276,993
元本等合計	197,254,946,854	262,612,521,451
純資産合計	197,254,946,854	262,612,521,451
負債・純資産合計	197,338,981,512	262,948,203,174

(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21年4月13日ならびに平成22年4月13日現在における同マザーファンドの状況です。

## (2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自平成20年3月31日 至平成21年4月13日	自平成21年4月14日 至平成22年4月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式・新株予約権証券・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、取引所または店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、または金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお売買停止措置がとられている銘柄について、必要であると判断された場合は、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。	株式・新株予約権証券・投資証券（売買目的有価証券） 同左
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物売買相場の仲値によっております。	(1)先物取引 同左  (2)為替予約取引 同左
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、その金額が確定しているものについては当該金額、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。	受取配当金の計上基準 同左
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。	外貨建資産等の会計処理 同左

## （貸借対照表に関する注記）

項目	（平成21年4月13日現在）	（平成22年4月13日現在）
1. 受益権総数	平成21年4月13日現在における受益権の 総数 198,715,843,917口	平成22年4月13日現在における受益権の 総数 192,707,244,458口
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 1,460,897,063円	
3. 1単位当たり純資産額	0.9926円 （1万口=9,926円）	1.3628円 （1万口=13,628円）

## （金融商品に関する注記）

## （追加情報）

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

## . 金融商品の状況に関する事項

項目	自平成21年4月14日 至平成22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。
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。 なお、当計算期間末の保有については、附属明細表に記載しております。</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ため、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。 なお、当計算期間末における残高については、「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</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	自平成21年4月14日 至平成22年4月13日
1．貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2．時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（株式、新株予約権証券および投資証券） 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コールローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## (デリバティブ取引に関する注記)

## ．取引の状況に関する事項

項目	自平成20年3月31日 至平成21年4月13日
1．取引の内容	<p>当ファンドの行うことのできるデリバティブ取引は、次の通りです。</p> <p>a．わが国の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。</p> <p>b．わが国の取引所における通貨にかかる先物取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引。</p> <p>c．わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。</p> <p>異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（「スワップ取引」）。</p> <p>金利先渡し取引および為替先渡し取引。</p> <p>外国為替の売買の予約取引。</p>
2．取引に対する取組方針	<p>デリバティブ取引につきましては信託約款等に従っており、その制限を遵守しております。</p>
3．取引の利用目的	<p>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。</p>
4．取引に係るリスクの内容	<p>デリバティブ取引に伴いファンドに影響を与える主なリスクとしてマーケットリスクがあげられます。マーケットリスクについては、ポジションや時価、予想損失額の把握が重要だと考えております。</p>
5．取引に係るリスクの管理体制	<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、リスク管理ならびにコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p>
6．取引の時価等に関する事項についての補足説明	<p>該当事項はありません。</p>

## ・取引の時価等に関する事項

## デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

## 株式関連

(平成21年4月13日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	S P 5 0 0	4,404,538,210 (43,887,387.5米ドル)	( )	4,663,398,012 (46,466,700米ドル)	258,859,802 (2,579,312.5米ドル)
	D J E U R	1,768,910,396 (13,413,080ユーロ)	( )	1,890,526,176 (14,335,200ユーロ)	121,615,780 (922,170ユーロ)
	F T S E	836,493,824 (5,698,575英ポンド)	( )	847,912,618 (5,776,365英ポンド)	11,418,794 (77,790英ポンド)
買建 合計		7,009,942,430		7,401,836,806	391,894,376

(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。

(平成22年4月13日現在)

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 株式関連

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	S P 5 0 0	1,166,371,125 (12,541,625米ドル)	( )	1,192,301,850 (12,820,450米ドル)	25,930,725 (278,825米ドル)
	D J E U R	474,436,430 (3,758,210ユーロ)	( )	484,877,740 (3,840,920ユーロ)	10,441,310 (82,710ユーロ)
	F T S E	233,334,937 (1,634,685英ポンド)	( )	237,356,636 (1,662,860英ポンド)	4,021,699 (28,175英ポンド)
買建 合計		1,874,142,492		1,914,536,226	40,393,734

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については以下のように評価しております。

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

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

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

## 通貨関連

(単位：円)

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

(注) 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法について

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、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの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売買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電信売買相場の仲値で評価しています。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

(自 平成20年3月31日 至 平成21年4月13日)

該当事項はありません。

(自 平成21年4月14日 至 平成22年4月13日)

該当事項はありません。



(その他の注記)

(平成21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	117,363,450,080円
同期中における追加設定元本額	105,512,827,570円
同期中における一部解約元本額	24,160,433,733円
平成21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	1,060,854,885円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	113,870,438円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	533,043,164円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	295,264,607円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	1,553,482円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	101,221円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	153,629円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	190,722円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	201,120円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	218,631円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	289,215円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	52,420,343,293円
バランスファンドVA(安定運用型)〈適格機関投資家限定〉	804,698,790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〉	31,738,792,568円
SMAM・バランスファンドVA25〈適格機関投資家専用〉	14,552,224,171円
SMAM・バランスファンドVA37.5〈適格機関投資家専用〉	8,900,649,410円
SMAM・バランスファンドVA50〈適格機関投資家専用〉	33,757,290,311円
SMAM・バランスファンドVL30〈適格機関投資家限定〉	109,887,684円
SMAM・バランスファンドVL50〈適格機関投資家限定〉	464,438,955円
世界6資産バランスファンドVA〈適格機関投資家限定〉	95,341,820円
SMAM・バランスファンドVA75〈適格機関投資家専用〉	3,494,284,782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〉	210,009,010円
SMAM・インデックス・バランスVA25〈適格機関投資家専用〉	683,120,070円
SMAM・インデックス・バランスVA50〈適格機関投資家専用〉	3,659,763,222円
SMAM・バランスファンドVA40〈適格機関投資家専用〉	5,991,688,387円
SMAM・バランスファンドVA35〈適格機関投資家専用〉	10,123,484,519円
SMAM・バランスVA株40T〈適格機関投資家限定〉	1,671,443,826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)	1,877,343,318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)	5,030,172,564円
SMAM・グローバルバランス40VA〈適格機関投資家限定〉	715,676,387円
SMAM・バランスファンドVA20〈適格機関投資家専用〉	1,976,618,052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)	18,432,831,664円
合計	198,715,843,917円

(平成22年4月13日現在)

本有価証券報告書における開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	198,715,843,917円
同期中における追加設定元本額	43,790,153,324円
同期中における一部解約元本額	49,798,752,783円
平成22年4月13日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	2,059,807,945円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	121,578,534円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	584,569,674円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	347,941,507円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	6,695,387円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	1,260,739円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	208,291円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	2,022,524円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	307,131円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	169,360円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	769,708円
外国株式指数ファンド	62,211,301円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用)	40,317,784,305円
バランスファンドVA(安定運用型) < 適格機関投資家限定 >	499,925,866円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型 < 適格機関投資家限定 >	23,380,371,305円
SMAM・バランスファンドVA25 < 適格機関投資家専用 >	10,800,599,339円
SMAM・バランスファンドVA37.5 < 適格機関投資家専用 >	6,869,677,038円
SMAM・バランスファンドVA50 < 適格機関投資家専用 >	26,473,328,544円
SMAM・バランスファンドVL30 < 適格機関投資家限定 >	82,389,992円
SMAM・バランスファンドVL50 < 適格機関投資家限定 >	356,511,892円
世界6資産バランスファンドVA < 適格機関投資家限定 >	75,053,763円
SMAM・バランスファンドVA75 < 適格機関投資家専用 >	2,793,025,237円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型 < 適格機関投資家限定 >	174,465,464円
SMAM・インデックス・バランスVA25 < 適格機関投資家専用 >	674,724,688円
SMAM・インデックス・バランスVA50 < 適格機関投資家専用 >	3,429,164,574円
SMAM・バランスファンドVA40 < 適格機関投資家専用 >	4,598,470,940円
SMAM・バランスファンドVA35 < 適格機関投資家専用 >	8,668,656,399円
SMAM・バランスVA株40T < 適格機関投資家限定 >	1,260,322,794円
三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	2,136,667,100円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	9,765,547,573円
SMAM・グローバルバランス40VA < 適格機関投資家限定 >	611,332,491円
SMAM・バランスファンドVA20 < 適格機関投資家専用 >	2,806,914,802円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	42,102,403,181円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A < 適格機関投資家専用 >	97,451,371円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A < 適格機関投資家専用 >	58,721,176円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A < 適格機関投資家専用 >	24,153,726円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L < 適格機関投資家専用 >	288,763,640円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L < 適格機関投資家専用 >	661,182,172円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T < 適格機関投資家専用 >	512,092,985円
合計	192,707,244,458円

## (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	16,100	53.18	856,198.00	
ANADARKO PETROLEUM CORP	67,414	72.91	4,915,154.74	
APACHE CORPORATION	45,807	107.11	4,906,387.77	
ARCH COAL INC	22,977	26.12	600,159.24	
BAKER HUGHES INC	42,513	48.83	2,075,909.79	
BJ SERVICES CO	41,317	22.20	917,237.40	
CABOT OIL & GAS CORPORATION	14,620	39.63	579,390.60	
CAMERON INTERNATIONAL CORP	33,612	45.66	1,534,723.92	
CHESAPEAKE ENERGY CORPORATION	83,215	24.33	2,024,620.95	
CHEVRON CORPORATION	273,607	80.43	22,006,211.01	
CIMAREX ENERGY CO	10,800	63.18	682,344.00	
CONOCOPHILLIPS	191,696	55.96	10,727,308.16	
CONSOL ENERGY INC	24,962	46.26	1,154,742.12	
DENBURY RESOURCES INC	51,254	18.23	934,360.42	
DEVON ENERGY CORPORATION	57,894	67.32	3,897,424.08	
DIAMOND OFFSHORE DRILLING, INC.	9,856	91.33	900,148.48	
EL PASO CORPORATION	93,320	11.46	1,069,447.20	
EOG RESOURCES INC	34,708	107.18	3,720,003.44	
EXXON MOBIL CORPORATION	647,212	68.71	44,469,936.52	
FMC TECHNOLOGIES INC	16,415	67.79	1,112,772.85	
HALLIBURTON CO	122,481	31.50	3,858,151.50	
HELMERICH & PAYNE INC	13,600	38.81	527,816.00	
HESS CORPORATION	40,897	65.28	2,669,756.16	
KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	10,681	60.00	640,860.00	
MARATHON OIL CORP	95,623	32.20	3,079,060.60	
MURPHY OIL CORPORATION	24,837	61.29	1,522,259.73	
NABORS INDUSTRIES LTD	38,984	19.82	772,662.88	
NATIONAL-OILWELL VARCO INC.	56,753	42.89	2,434,136.17	
NEWFIELD EXPLORATION CO	18,587	54.36	1,010,389.32	
NOBLE CORPORATION	36,318	41.56	1,509,376.08	
NOBLE ENERGY INC	24,111	76.53	1,845,214.83	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	110,242	86.79	9,567,903.18	
PATTERSON-UTI ENERGY INC	20,600	14.30	294,580.00	
PEABODY ENERGY CORP	37,133	48.01	1,782,755.33	
PETROHAWK ENERGY CORP	41,122	22.61	929,768.42	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	16,315	60.84	992,604.60	
PLAINS EXPLORATION & PRODUCTION COMPANY	19,600	33.48	656,208.00	
PRIDE INTERNATIONAL INC	24,900	31.10	774,390.00	
RANGE RESOURCES CORPORATION	21,671	50.17	1,087,234.07	

ROWAN COMPANIES INC	15,145	30.23	457,833.35	
SCHLUMBERGER LTD	163,264	66.31	10,826,035.84	
SMITH INTERNATIONAL INC	34,072	44.72	1,523,699.84	
SOUTHWESTERN ENERGY COMPANY	47,761	41.76	1,994,499.36	
SPECTRA ENERGY CORPORATION	87,063	23.33	2,031,179.79	
SUNOCO INC	14,194	30.18	428,374.92	
TRANSOCEAN LTD	43,606	85.81	3,741,830.86	
ULTRA PETROLEUM CORP	21,448	48.83	1,047,305.84	
VALERO ENERGY CORP	77,995	19.60	1,528,702.00	
WEATHERFORD INTL LTD	99,545	16.47	1,639,506.15	
WILLIAMS COS INC	80,253	24.22	1,943,727.66	
XTO ENERGY INC	79,143	48.30	3,822,606.90	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	29,105	75.34	2,192,770.70	
AIRGAS INC	10,000	64.01	640,100.00	
ALCOA INC	134,995	14.57	1,966,877.15	
ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	12,280	55.94	686,943.20	
BALL CORPORATION	12,403	53.92	668,769.76	
CELANESE CORPORATION	19,923	33.58	669,014.34	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	6,100	92.03	561,383.00	
CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	18,170	73.98	1,344,216.60	
CROWN HOLDINGS INC	20,500	27.22	558,010.00	
DOW CHEMICAL	155,784	30.74	4,788,800.16	
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	123,808	38.90	4,816,131.20	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	9,827	66.02	648,778.54	
ECOLAB INC	32,597	45.00	1,466,865.00	
FMC CORPORATION	9,200	64.04	589,168.00	
FREEMONT-MCMORAN COPPER-B	58,681	84.40	4,952,676.40	
INTERNATIONAL PAPER CO	57,375	27.14	1,557,157.50	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	11,392	49.99	569,486.08	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,943	87.08	517,516.44	
MEADWESTVACO CORP	22,715	26.33	598,085.95	
MONSANTO CO	73,817	69.00	5,093,373.00	
MOSAIC CO/THE	20,843	56.75	1,182,840.25	
NEWMONT MINING CORP	65,488	53.55	3,506,882.40	
NUCOR CORP	43,606	47.15	2,056,022.90	
OWENS-ILLINOIS INC	23,739	37.08	880,242.12	
PACTIV CORPORATION	19,083	25.58	488,143.14	
PPG INDUSTRIES INC	22,923	68.89	1,579,165.47	
PRAXAIR INC	41,650	84.99	3,539,833.50	
SEALED AIR CORP	21,138	21.49	454,255.62	
SIGMA-ALDRICH	16,256	55.10	895,705.60	
THE LUBRIZOL CORPORATION	9,500	91.61	870,295.00	
UNITED STATES STEEL CORPORATION	19,109	63.92	1,221,447.28	
VULCAN MATERIALS CO	17,053	49.28	840,371.84	
WEYERHAEUSER CO	28,280	46.14	1,304,839.20	
3M COMPANY	91,409	83.28	7,612,541.52	

AGCO CORP	13,500	38.99	526,365.00	
AMETEK INC	15,360	42.48	652,492.80	
BOEING CO	93,836	71.92	6,748,685.12	
CATERPILLAR INC	84,840	66.73	5,661,373.20	
COOPER INDUSTRIES PLC-CL-A	22,752	48.01	1,092,323.52	
CUMMINS INC	26,388	65.13	1,718,650.44	
DANAHER CORP	36,992	80.36	2,972,677.12	
DEERE & CO	57,424	62.04	3,562,584.96	
DOVER CORP	24,974	47.82	1,194,256.68	
EATON CORP	21,776	79.93	1,740,555.68	
EMERSON ELECTRIC CO	102,838	50.79	5,223,142.02	
FASTENAL COMPANY	18,434	51.90	956,724.60	
FIRST SOLAR,INC.	6,440	127.86	823,418.40	
FLOWERVE CORPORATION	7,919	116.42	921,929.98	
FLUOR CORP	24,036	51.19	1,230,402.84	
FOSTER WHEELER AG	17,596	30.34	533,862.64	
GENERAL DYNAMICS CORP	44,671	77.30	3,453,068.30	
GENERAL ELECTRIC CO	1,451,943	18.71	27,165,853.53	
GOODRICH CORPORATION	16,757	72.04	1,207,174.28	
HARSCO CORP	12,000	32.89	394,680.00	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	97,562	45.99	4,486,876.38	
ILLINOIS TOOL WORKS	57,560	47.96	2,760,577.60	
INGERSOLL-RAND PLC	44,163	37.45	1,653,904.35	
ITT CORPORATION	23,666	54.67	1,293,820.22	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	17,490	46.74	817,482.60	
JOY GLOBAL INC	13,959	61.54	859,036.86	
KBR,INC.	23,385	22.81	533,411.85	
L-3 COMMUNICATIONS HLDGS INC	16,010	94.39	1,511,183.90	
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	43,987	82.92	3,647,402.04	
MASCO CORP	50,766	16.11	817,840.26	
MCDERMOTT INTERNATIONAL,INC,	32,455	27.43	890,240.65	
NORTHROP GRUMMAN CORP	40,738	66.22	2,697,670.36	
PACCAR INC	47,676	45.39	2,164,013.64	
PALL CORPORATION	15,576	39.74	618,990.24	
PARKER HANNIFIN CORPORATIOM	22,459	69.48	1,560,451.32	
PENTAIR INC	12,150	36.14	439,101.00	
PRECISION CASTPARTS CORP	19,380	125.75	2,437,035.00	
QUANTA SERVICES INC	26,559	20.00	531,180.00	
RAYTHEON COMPANY	52,081	57.43	2,991,011.83	
ROCKWELL AUTOMATION INC	19,098	59.61	1,138,431.78	
ROCKWELL COLLINS INC.	21,064	64.20	1,352,308.80	
ROPER INDUSTRIES INC	12,200	60.87	742,614.00	
SPX CORP	6,868	67.69	464,894.92	
SUNPOWER CORPORATION-CLASS A	7,371	18.32	135,036.72	
TEXTRON INC	36,318	22.59	820,423.62	
TYCO INTERNATIONAL LTD	64,370	39.44	2,538,752.80	

UNITED TECHNOLOGIES CORP	121,153	73.76	8,936,245.28	
URS CORPORATION	10,900	50.96	555,464.00	
WW GRAINGER INC	8,760	114.23	1,000,654.80	
AVERY DENNISON CORP	13,262	37.38	495,733.56	
CINTAS CORP	19,413	27.61	535,992.93	
DUN & BRADSTREET CORP	6,801	74.95	509,734.95	
EQUIFAX INC	17,342	35.40	613,906.80	
IHS INC-CLASS A	5,600	52.87	296,072.00	
IRON MOUNTAIN INC	26,022	26.50	689,583.00	
MANPOWER INC	11,192	58.28	652,269.76	
PITNEY BOWES INC	28,973	24.79	718,240.67	
REPUBLIC SERVICES INC	52,994	29.99	1,589,290.06	
ROBERT HALF INTL INC	19,091	31.12	594,111.92	
RR DONNELLEY & SONS CO	29,298	22.48	658,619.04	
STERICYCLE,INC.	11,300	55.57	627,941.00	
WASTE MANAGEMENT INC	62,924	34.92	2,197,306.08	
C.H.ROBINSON WORLDWIDE,INC.	23,460	56.44	1,324,082.40	
CSX CORP	53,206	52.88	2,813,533.28	
DELTA AIR LINES INC	28,000	14.93	418,040.00	
EXPEDITORS INTL WASH INC	29,678	36.98	1,097,492.44	
FEDEX CORP	40,421	90.82	3,671,035.22	
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	12,900	36.04	464,916.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	50,177	58.39	2,929,835.03	
SOUTHWEST AIRLINES	24,000	13.35	320,400.00	
UNION PACIFIC CORP	69,060	75.38	5,205,742.80	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	95,986	64.76	6,216,053.36	
BORGWARNER INC	16,100	38.74	623,714.00	
FORD MOTOR COMPANY	393,089	12.77	5,019,746.53	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	32,434	12.96	420,344.64	
HARLEY-DAVIDSON INC	32,786	32.75	1,073,741.50	
JOHNSON CONTROLS INC	90,783	32.35	2,936,830.05	
COACH INC	43,645	41.18	1,797,301.10	
D.R.HORTON INC	39,548	12.03	475,762.44	
FORTUNE BRANDS INC	21,202	51.05	1,082,362.10	
GARMIN LTD	17,116	37.61	643,732.76	
HASBRO INC	17,474	39.10	683,233.40	
LEGGETT & PLATT INC	20,215	21.83	441,293.45	
MATTEL INC	48,282	23.28	1,124,004.96	
MOHAWK INDUSTRIES INC	8,183	56.45	461,930.35	
NEWELL RUBBERMAID INC	37,444	16.71	625,689.24	
NIKE INC -CL B	50,582	75.53	3,820,458.46	
POLO RALPH LAUREN CORPORATION	7,678	89.47	686,950.66	
PULTE GROUP INC	43,751	11.23	491,323.73	
STANLEY BLACK & DECKER INC	19,928	60.37	1,203,053.36	
TOLL BROTHERS INC	20,139	20.33	409,425.87	
VF CORP	11,805	83.91	990,557.55	

WHIRLPOOL CORP	10,204	94.44	963,665.76	
APOLLO GROUP INC-CL A	18,073	62.57	1,130,827.61	
CARNIVAL CORP	59,588	38.82	2,313,206.16	
DARDEN RESTAURANTS INC	18,640	46.89	874,029.60	
DEVRY INC	8,600	65.06	559,516.00	
H&R BLOCK INC	46,692	18.44	861,000.48	
INTL GAME TECHNOLOGY	40,760	19.73	804,194.80	
ITT EDUCATIONAL SERVICES INC	4,950	108.78	538,461.00	
LAS VEGAS SANDS CORP	46,000	24.22	1,114,120.00	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	42,137	32.98	1,389,678.26	
MCDONALD'S CORPORATION	147,058	68.53	10,077,884.74	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	18,871	34.25	646,331.75	
STARBUCKS CORP	102,057	24.49	2,499,375.93	
STARWOOD HOTELS & RESORTS	26,064	49.10	1,279,742.40	
WYNN RESORTS LTD	10,121	86.90	879,514.90	
YUM! BRANDS INC	63,804	40.78	2,601,927.12	
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	34,320	25.92	889,574.40	
CBS CORP-CL B	77,893	15.20	1,183,973.60	
COMCAST CORP-CL A	279,629	18.63	5,209,488.27	
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	108,189	17.81	1,926,846.09	
DIRECTV-CLASS A	124,110	35.30	4,381,083.00	
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-A	18,130	34.69	628,929.70	
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-C	20,430	29.91	611,061.30	
DISH NETWORK CORP.	28,864	21.62	624,039.68	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	68,125	8.77	597,456.25	
LIBERTY GLOBAL INC-A	18,940	29.64	561,381.60	
LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	16,763	29.40	492,832.20	
MCGRAW-HILL COMPANIES INC	43,651	36.03	1,572,745.53	
NEWS CORP-CL A	248,722	15.03	3,738,291.66	
NEWS CORPORATION-CLASS B	60,031	17.66	1,060,147.46	
OMNICOM GROUP	41,669	39.24	1,635,091.56	
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	13,000	43.77	569,010.00	
THE WALT DISNEY CO.	249,929	35.89	8,969,951.81	
TIME WARNER CABLE,INC.	47,800	52.74	2,520,972.00	
TIME WARNER INC	159,950	32.70	5,230,365.00	
VIACOM INC-CLASS B	76,488	35.91	2,746,684.08	
VIRGIN MEDIA INC	39,577	17.45	690,618.65	
WASHINGTON POST CO B	817	492.10	402,045.70	
ABERCROMBIE & FITCH CO -CL A	11,771	49.07	577,602.97	
ADVANCE AUTO PARTS	13,538	42.41	574,146.58	
AMAZON.COM INC	47,162	141.20	6,659,274.40	
AMERICAN EAGLE OUTFITTERS INC	23,500	18.02	423,470.00	
AUTONATION INC	17,000	18.37	312,290.00	
AUTOZONE INC	4,078	175.42	715,362.76	
BED BATH & BEYOND INC	36,549	45.77	1,672,847.73	
BEST BUY COMPANY INC	47,626	45.23	2,154,123.98	

CARMAX INC	31,522	24.33	766,930.26	
DOLLAR TREE INC	12,500	59.37	742,125.00	
EXPEDIA INC	28,183	25.18	709,647.94	
FAMILY DOLLAR STORES	18,636	38.00	708,168.00	
GAMESTOP CORP-CL A	21,647	23.47	508,055.09	
GAP INC/THE	64,971	24.93	1,619,727.03	
GENUINE PARTS CO	21,284	43.22	919,894.48	
HOME DEPOT INC	232,966	33.48	7,799,701.68	
J.C.PENNEY CO INC (HLDG CO)	29,797	30.96	922,515.12	
KOHL'S CORP	39,057	55.98	2,186,410.86	
LIBERTY MEDIA-INTERACTIVE A	76,507	16.36	1,251,654.52	
LIMITED BRANDS	37,393	26.89	1,005,497.77	
LOWE'S COMPANIES INC	201,625	25.60	5,161,600.00	
MACY'S INC	58,548	22.94	1,343,091.12	
NORDSTROM INC	22,735	42.01	955,097.35	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	19,000	41.88	795,720.00	
PETSMART INC	16,691	32.31	539,286.21	
PRICELINE.COM INC	5,492	260.23	1,429,183.16	
ROSS STORES INC	17,036	56.01	954,186.36	
SEARS HOLDINGS CORP	6,310	106.06	669,238.60	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	13,090	72.31	946,537.90	
STAPLES INC	98,976	24.20	2,395,219.20	
TARGET CORP	97,819	55.98	5,475,907.62	
TIFFANY & CO	17,007	49.81	847,118.67	
TJX COMPANIES INC	58,095	45.61	2,649,712.95	
URBAN OUTFITTERS,INC.	17,100	38.05	650,655.00	
COSTCO WHOLESALE CORP	59,404	60.35	3,585,031.40	
CVS CAREMARK CORPORATION	191,953	36.98	7,098,421.94	
KROGER CO	85,469	22.53	1,925,616.57	
SAFEWAY INC	54,949	25.69	1,411,639.81	
SUPERVALU INC	30,030	16.83	505,404.90	
SYSCO CORP	79,785	29.87	2,383,177.95	
WAL-MART STORES INC	315,440	55.02	17,355,508.80	
WALGREEN CO	133,906	36.82	4,930,418.92	
WHOLE FOODS MARKET INC	19,000	38.80	737,200.00	
ALTRIA GROUP INC	283,356	21.10	5,978,811.60	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	78,192	28.37	2,218,307.04	
BROWN-FORMAN CORPORATION	11,315	60.13	680,370.95	
BUNGE LIMITED	18,238	61.63	1,124,007.94	
CAMPBELL SOUP CO	29,379	35.42	1,040,604.18	
COCA-COLA CO/THE	283,987	54.76	15,551,128.12	
COCA-COLA ENTERPRISES INC	39,304	28.39	1,115,840.56	
CONAGRA FOODS INC	61,263	25.00	1,531,575.00	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	27,523	17.15	472,019.45	
DEAN FOODS CO	24,379	16.66	406,154.14	
DR.PEPPER SNAPPLE GROUP,INC	34,137	35.02	1,195,477.74	



GENERAL MILLS INC	44,007	70.36	3,096,332.52	
HANSEN NATURAL CORPORATION	10,900	42.03	458,127.00	
HJ HEINZ CO	43,619	45.99	2,006,037.81	
HORMEL FOODS CORPORATION	10,000	41.78	417,800.00	
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	16,600	62.25	1,033,350.00	
KELLOGG CO	36,034	53.08	1,912,684.72	
KRAFT FOODS INC-A	238,811	30.34	7,245,525.74	
LORILLARD INC	21,620	77.50	1,675,550.00	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	16,630	38.37	638,093.10	
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	28,500	52.25	1,489,125.00	
MOLSON COORS BREWING COMPANY	21,025	44.01	925,310.25	
PEPSICO INC	221,574	66.32	14,694,787.68	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	258,952	52.95	13,711,508.40	
RALCORP HOLDINGS INC	7,450	66.43	494,903.50	
REYNOLDS AMERICAN INC	24,112	54.53	1,314,827.36	
SARA LEE CORP	92,511	14.21	1,314,581.31	
THE HERSHEY COMPANY	21,810	44.27	965,528.70	
TYSON FOODS INC-CL A	37,500	20.00	750,000.00	
AVON PRODUCTS INC	59,313	34.76	2,061,719.88	
CHURCH & DWIGHT CO INC	9,400	67.80	637,320.00	
CLOROX COMPANY	19,061	63.46	1,209,611.06	
COLGATE-PALMOLIVE CO	67,485	84.79	5,722,053.15	
ENERGIZER HOLDINGS INC	9,117	62.48	569,630.16	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	15,682	65.92	1,033,757.44	
KIMBERLY-CLARK CORP	56,690	61.39	3,480,199.10	
PROCTER & GAMBLE CO	397,770	62.70	24,940,179.00	
AETNA INC	58,202	32.92	1,916,009.84	
AMERISOURCEBERGEN CORP	38,218	29.34	1,121,316.12	
BARD(C.R.) INC	13,030	85.08	1,108,592.40	
BAXTER INTERNATIONAL INC	82,266	58.15	4,783,767.90	
BECKMAN COULTER INC	9,991	61.13	610,749.83	
BECTON DICKINSON & CO	32,516	79.00	2,568,764.00	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	208,125	6.94	1,444,387.50	
CARDINAL HEALTH INC	49,890	35.96	1,794,044.40	
CAREFUSION CORPORATION	25,345	26.44	670,121.80	
CERNER CORP	9,400	88.26	829,644.00	
CIGNA CORP	36,511	36.42	1,329,730.62	
COVENTRY HEALTH CARE INC	20,613	24.57	506,461.41	
COVIDIEN PLC	68,775	50.78	3,492,394.50	
DAVITA INC	13,808	65.67	906,771.36	
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	18,609	34.53	642,568.77	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	8,100	102.44	829,764.00	
EXPRESS SCRIPTS INC	35,762	102.43	3,663,101.66	
HENRY SCHEIN INC	12,050	59.26	714,083.00	
HOLOGIC INC	34,080	17.56	598,444.80	
HOSPIRA INC	21,733	56.11	1,219,438.63	

HUMANA INC.	23,643	44.51	1,052,349.93	
INTUITIVE SURGICAL INC	5,239	354.21	1,855,706.19	
LABORATORY CRP OF AMR HLDGS	14,856	76.67	1,139,009.52	
MCKESSON CORP	36,367	65.47	2,380,947.49	
MEDCO HEALTH SOLUTIONS INC	65,622	64.03	4,201,776.66	
MEDTRONIC INC	150,454	45.43	6,835,125.22	
OMNICARE INC	15,200	30.30	460,560.00	
PATTERSON COS INC	13,032	31.03	404,382.96	
QUEST DIAGNOSTICS	21,799	58.10	1,266,521.90	
ST JUDE MEDICAL INC	44,520	42.46	1,890,319.20	
STRYKER CORP	41,153	57.64	2,372,058.92	
UNITEDHEALTH GROUP INC	158,752	32.26	5,121,339.52	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	16,607	55.26	917,702.82	
WELLPOINT INC	62,360	61.34	3,825,162.40	
ZIMMER HOLDINGS INC	29,697	59.34	1,762,219.98	
ABBOTT LABORATORIES	210,294	52.67	11,076,184.98	
ALLERGAN INC	41,308	63.17	2,609,426.36	
AMGEN INC	137,393	60.37	8,294,415.41	
BIOGEN IDEC INC	39,897	56.00	2,234,232.00	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	234,039	26.29	6,152,885.31	
CELGENE CORP	62,772	60.40	3,791,428.80	
CEPHALON INC	10,463	67.98	711,274.74	
CHARLES RIVER LABORATORIES INC	9,360	40.15	375,804.00	
COVANCE INC	8,500	60.70	515,950.00	
ELI LILLY & CO	141,073	36.57	5,159,039.61	
FOREST LABORATORIES,INC.	41,830	28.36	1,186,298.80	
GENZYME CORP - GENL DIVISION	36,460	52.84	1,926,546.40	
GILEAD SCIENCES INC	123,514	45.87	5,665,587.18	
ILLUMINA INC	17,100	38.11	651,681.00	
JOHNSON & JOHNSON	376,076	65.11	24,486,308.36	
LIFE TECHNOLOGIES CORPORATION	24,615	51.38	1,264,718.70	
MERCK & CO. INC.	415,711	36.85	15,318,950.35	
MILLIPORE CORPORATION	7,786	106.00	825,316.00	
MYLAN INC	43,400	22.53	977,802.00	
MYRIAD GENETICS INC	6,200	22.98	142,476.00	
PERRIGO CO	10,300	59.91	617,073.00	
PFIZER INC	1,099,816	17.29	19,015,818.64	
PHARMACEUTICAL PRODUCT DEVELOPMENT INC	14,900	24.80	369,520.00	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	55,726	52.14	2,905,553.64	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	26,308	39.26	1,032,852.08	
WARNER CHILCOTT PLC	15,000	25.46	381,900.00	
WATERS CORP	13,441	68.80	924,740.80	
WATSON PHARMACEUTICALS INC	13,000	42.34	550,420.00	
BB & T CORPORATION	94,063	34.05	3,202,845.15	
COMERICA INC	23,950	41.73	999,433.50	
FIFTH THIRD BANCORP	101,738	14.36	1,460,957.68	

HUDSON CITY BANCORP INC	65,969	14.55	959,848.95
KEYCORP	125,115	8.34	1,043,459.10
M & T BANK CORP	10,268	85.31	875,963.08
MARSHALL & ILSLEY CORPORATION	70,652	8.98	634,454.96
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	56,700	17.66	1,001,322.00
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	49,800	16.60	826,680.00
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	70,801	65.27	4,621,181.27
REGIONS FINANCIAL CORPORATION	159,470	8.74	1,393,767.80
SUNTRUST BANKS INC	67,303	29.44	1,981,400.32
US BANCORP	260,790	27.51	7,174,332.90
WELLS FARGO & COMPANY	662,132	32.42	21,466,319.44
AMERICAN EXPRESS COMPANY	146,477	44.54	6,524,085.58
AMERIPRISE FINANCIAL INC	35,251	46.72	1,646,926.72
BANK OF AMERICA CORP	1,356,079	18.66	25,304,434.14
BANK OF NEW YORK MELLON CORP(THE)	164,301	32.54	5,346,354.54
BLACKROCK INC	3,250	205.80	668,850.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	61,386	45.18	2,773,419.48
CITIGROUP INC	2,882,518	4.64	13,374,883.52
CME GROUP INC.	9,160	310.49	2,844,088.40
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	74,281	15.60	1,158,783.60
EATON VANCE CORP	15,000	34.38	515,700.00
FRANKLIN RESOURCES INC	21,875	115.06	2,516,937.50
GOLDMAN SACHS GROUP INC	66,559	177.84	11,836,852.56
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	8,268	108.58	897,739.44
INVESCO LIMITED	56,639	22.11	1,252,288.29
JEFFERIES GROUP INC (NEW)	13,400	27.20	364,480.00
JPMORGAN CHASE & CO	537,263	46.14	24,789,314.82
LEGG MASON INC	20,303	31.32	635,889.96
LEUCADIA NATIONAL CORPORATION	27,056	26.84	726,183.04
MOODY'S CORP	27,916	28.63	799,235.08
MORGAN STANLEY	167,105	30.93	5,168,557.65
NASDAQ STOCK MARKET INC	19,080	22.06	420,904.80
NORTHERN TRUST CORP	30,305	58.77	1,781,024.85
NYSE EURONEXT	36,829	32.31	1,189,944.99
SCHWAB (CHARLES) CORP	134,212	19.55	2,623,844.60
SEI INVESTMENTS COMPANY	17,324	23.09	400,011.16
SLM CORPORATION	63,061	13.34	841,233.74
STATE STREET CORP	68,367	48.07	3,286,401.69
T ROWE PRICE GROUP INC	34,662	56.39	1,954,590.18
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	36,894	20.02	738,617.88
ACE LIMITED	46,008	53.05	2,440,724.40
AFLAC INC	63,845	55.56	3,547,228.20
ALLSTATE CORP	70,313	33.04	2,323,141.52
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	17,000	41.22	700,740.00
AON CORPORATION	34,539	43.42	1,499,683.38
ARCH CAPITAL GROUP LTD.	8,200	75.18	616,476.00

ASSURANT INC	15,089	34.96	527,511.44	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	19,003	31.38	596,314.14	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	77,800	80.48	6,261,344.00	
CHUBB CORP	46,291	51.57	2,387,226.87	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	20,133	29.21	588,084.93	
EVEREST RE GROUP LTD	8,503	81.96	696,905.88	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL INC-CL A	29,561	14.74	435,729.14	
FIRST AMERICAN CORPORATION	13,000	34.83	452,790.00	
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	66,000	18.29	1,207,140.00	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	56,586	27.89	1,578,183.54	
LINCOLN NATIONAL CORP	42,427	31.75	1,347,057.25	
LOEWS CORPORATION	48,010	38.46	1,846,464.60	
MARSH & MCLENNAN COS	72,756	24.53	1,784,704.68	
METLIFE INC	111,963	45.63	5,108,871.69	
OLD REPUBLIC INTL CORP	32,961	13.39	441,347.79	
PARTNERRE LTD	9,268	79.79	739,493.72	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	44,800	29.07	1,302,336.00	
PROGRESSIVE CORP	86,783	19.36	1,680,118.88	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	62,964	63.09	3,972,398.76	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	9,163	57.08	523,024.04	
TORCHMARK CORPORATION	10,839	54.38	589,424.82	
TRANSATLANTIC HOLDINGS INC	8,000	52.67	421,360.00	
TRAVELERS COS INC(THE)	74,778	52.02	3,889,951.56	
UNUM GROUP	45,070	25.54	1,151,087.80	
VALIDUS HOLDINGS LTD	14,000	26.88	376,320.00	
W.R.BERKLEY CORPORATION	19,643	26.31	516,807.33	
WHITE MOUNTAINS INSURANCE GROUP LTD.	1,050	360.00	378,000.00	
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	24,198	32.02	774,819.96	
XL CAPITAL LTD -CLASS A	48,500	19.21	931,685.00	
ACCENTURE PLC-CL A	83,843	43.07	3,611,118.01	
ACTIVISION BLIZZARD INC	81,020	12.50	1,012,750.00	
ADOBE SYSTEMS INC	70,616	35.02	2,472,972.32	
AKAMAI TECHNOLOGIES	23,506	33.51	787,686.06	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	6,950	64.88	450,916.00	
AUTODESK INC	31,634	31.43	994,256.62	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	68,976	44.21	3,049,428.96	
BMC SOFTWARE INC	25,378	39.33	998,116.74	
CA INC	57,113	23.06	1,317,025.78	
CITRIX SYSTEMS INC	24,998	48.77	1,219,152.46	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATION	40,045	51.96	2,080,738.20	
COMPUTER SCIENCES CORP	20,862	54.82	1,143,654.84	
DST SYSTEMS INC	6,000	42.26	253,560.00	
EBAY INC	157,431	26.63	4,192,387.53	
ELECTRONIC ARTS INC	46,181	19.40	895,911.40	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	43,712	24.79	1,083,620.48	
FISERV INC	21,376	51.77	1,106,635.52	

GOOGLE INC-CL A	33,151	572.73	18,986,572.23	
INTUIT INC	40,222	34.53	1,388,865.66	
LENDER PROCESSING SERVICES,INC.	12,100	37.61	455,081.00	
MASTERCARD INC-CL A	13,544	259.57	3,515,616.08	
MCAFEE INC	22,212	39.83	884,703.96	
MICROSOFT CORP	1,089,402	30.32	33,030,668.64	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	26,000	17.46	453,960.00	
ORACLE CORPORATION	545,929	26.20	14,303,339.80	
PAYCHEX INC	44,144	31.11	1,373,319.84	
RED HAT INC	26,700	30.81	822,627.00	
SAIC INC	54,200	17.40	943,080.00	
SALESFORCE.COM,INC.	15,775	80.51	1,270,045.25	
SYMANTEC CORPORATION	109,813	17.16	1,884,391.08	
SYNOPSYS INC	21,384	23.06	493,115.04	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	21,919	16.25	356,183.75	
VERISIGN INC	26,118	26.68	696,828.24	
VISA INC	63,516	93.19	5,919,056.04	
VMWARE INC	7,500	57.25	429,375.00	
WESTERN UNION COMPANY	94,046	17.47	1,642,983.62	
YAHOO! INC	181,210	17.64	3,196,544.40	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	47,758	34.21	1,633,801.18	
AMPHENOL CORPORATION -CL A	23,444	43.48	1,019,345.12	
APPLE INC	122,657	242.29	29,718,564.53	
ARROW ELECTRONICS INC	15,390	30.21	464,931.90	
AVNET INC	20,900	31.01	648,109.00	
CISCO SYSTEMS INC	783,731	26.53	20,792,383.43	
CORNING INC	211,902	19.98	4,233,801.96	
DELL INC	239,052	15.93	3,808,098.36	
DOLBY LABORATORIES INC-CL A	7,300	58.81	429,313.00	
EMC CORP/MASS	278,603	19.17	5,340,819.51	
FLEXTRONICS INTL LTD	109,331	8.11	886,674.41	
FLIR SYSTEMS INC	21,940	28.60	627,484.00	
HARRIS CORP	18,350	49.43	907,040.50	
HEWLETT-PACKARD CO	322,894	53.88	17,397,528.72	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	178,946	128.36	22,969,508.56	
JUNIPER NETWORKS INC	72,423	31.60	2,288,566.80	
MOTOROLA INC	316,579	7.42	2,349,016.18	
NETAPP INC	46,144	34.94	1,612,271.36	
QUALCOMM INC	227,520	42.23	9,608,169.60	
SANDISK CORP	30,800	36.25	1,116,500.00	
SEAGATE TECHNOLOGY	69,568	19.08	1,327,357.44	
TERADATA CORP	23,177	28.63	663,557.51	
TYCO ELECTRONICS LTD	63,029	28.85	1,818,386.65	
WESTERN DIGITAL CORP	29,723	41.08	1,221,020.84	
XEROX CORP	179,580	10.49	1,883,794.20	
AMERICAN TOWER CORPORATION -CL A	55,309	42.35	2,342,336.15	

AT&T INC	804,051	26.38	21,210,865.38
CENTURYTEL INC	39,312	36.11	1,419,556.32
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	40,922	37.59	1,538,257.98
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	210,000	1.72	361,200.00
METROPCS COMMUNICATIONS INC.	31,500	7.52	236,880.00
NII HOLDINGS INC	22,679	42.13	955,466.27
QWEST COMMUNICATIONS INTL	212,888	5.39	1,147,466.32
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	15,000	36.17	542,550.00
SPRINT NEXTEL CORP	397,323	4.15	1,648,890.45
TELEPHONE AND DATA SYSTEMS	6,500	34.53	224,445.00
VERIZON COMMUNICATIONS INC	386,820	29.94	11,581,390.80
WINDSTREAM CORPORATION	57,500	11.01	633,075.00
AES CORPORATION	89,266	11.28	1,006,920.48
ALLEGHENY ENERGY INC	23,612	23.23	548,506.76
ALLIANT ENERGY CORP	16,148	33.77	545,317.96
AMEREN CORPORATION	31,624	26.73	845,309.52
AMERICAN ELECTRIC POWER	64,450	34.08	2,196,456.00
AMERICAN WATER WORKS CO INC	24,600	21.55	530,130.00
CALPINE CORP	50,500	12.37	624,685.00
CENTERPOINT ENERGY INC	52,609	14.53	764,408.77
CONSOLIDATED EDISON INC	36,947	45.03	1,663,723.41
CONSTELLATION ENERGY GROUP	24,223	38.02	920,958.46
DOMINION RESOURCES INC/VA	81,025	41.80	3,386,845.00
DTE ENERGY COMPANY	21,773	46.25	1,007,001.25
DUKE ENERGY CORP	176,169	16.26	2,864,507.94
EDISON INTERNATIONAL	43,253	34.46	1,490,498.38
ENERGEN CORPORATION	8,700	48.32	420,384.00
ENTERGY CORP	26,079	82.21	2,143,954.59
EQT CORPORATION	16,780	44.91	753,589.80
EXELON CORP	90,556	44.58	4,036,986.48
FIRSTENERGY CORP	41,795	39.64	1,656,753.80
FPL GROUP INC	52,960	49.74	2,634,230.40
INTEGRYS ENERGY GROUP,INC.	9,700	47.96	465,212.00
MDU RESOURCES GROUP INC	22,800	22.00	501,600.00
MIRANT CORP	21,545	12.68	273,190.60
NISOURCE INC	37,692	16.28	613,625.76
NORTHEAST UTILITIES	24,100	27.80	669,980.00
NRG ENERGY INC	34,125	22.41	764,741.25
NSTAR	15,300	35.86	548,658.00
ONEOK INC	13,800	47.74	658,812.00
P G & E CORPORATION	50,874	43.13	2,194,195.62
PEPCO HOLDINGS INC	32,034	17.00	544,578.00
PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	13,244	37.90	501,947.60
PPL CORPORATION	51,644	28.14	1,453,262.16
PROGRESS ENERGY INC	38,076	39.18	1,491,817.68
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	68,548	31.03	2,127,044.44

QUESTAR CORP	24,511	45.53	1,115,985.83	
SCANA CORP	16,463	38.30	630,532.90	
SEMPRA ENERGY	32,561	50.48	1,643,679.28	
SOUTHERN CO	108,918	33.95	3,697,766.10	
WISCONSIN ENERGY CORP	16,316	50.84	829,505.44	
XCEL ENERGY INC	62,912	21.74	1,367,706.88	
ADVANCED MICRO DEVICES	75,085	9.42	707,300.70	
ALTERA CORPORATION	40,370	25.41	1,025,801.70	
ANALOG DEVICES	41,005	29.55	1,211,697.75	
APPLIED MATERIALS INC	184,729	13.63	2,517,856.27	
BROADCOM CORP-CL A	59,822	34.06	2,037,537.32	
CREE INC	14,000	79.32	1,110,480.00	
INTEL CORP	751,922	22.55	16,955,841.10	
KLA-TENCOR CORPORATION	24,324	31.66	770,097.84	
LAM RESEARCH CORP	17,964	38.61	693,590.04	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	30,958	29.34	908,307.72	
LSI CORPORATION	91,857	6.26	575,024.82	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	72,474	21.14	1,532,100.36	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	42,000	19.89	835,380.00	
MEMC ELECTRONIC MATERIALS	31,806	16.25	516,847.50	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	26,408	28.73	758,701.84	
MICRON TECHNOLOGY INC	111,541	10.82	1,206,873.62	
NATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	33,092	14.92	493,732.64	
NVIDIA CORP	75,794	17.30	1,311,236.20	
TEXAS INSTRUMENTS INC	169,641	25.69	4,358,077.29	
XILINX INC	37,753	26.63	1,005,362.39	
米ドル 小計	43,549,529		1,511,083,765.27	
( 邦貨換算額 )			(140,530,790,170)	( 単位 : 円 )
カナダドル				
CAMECO CORP	54,457	27.37	1,490,488.09	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	73,405	78.69	5,776,239.45	
CENOVUS ENERGY INC	102,148	29.36	2,999,065.28	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	24,900	40.62	1,011,438.00	
ENBRIDGE INC	49,529	49.75	2,464,067.75	
ENCANA CORP	102,348	32.10	3,285,370.80	
ENSIGN ENERGY SERVICES INC	20,400	15.07	307,428.00	
HUSKY ENERGY INC	36,342	30.19	1,097,164.98	
IMPERIAL OIL LTD	41,264	41.69	1,720,296.16	
NEXEN INC	72,208	25.82	1,864,410.56	
NIKO RESOURCES LTD	6,400	108.59	694,976.00	
PETROBAKKEN ENERGY LTD-A	8,900	27.42	244,038.00	
PETROBANK ENERGY & RESOURCES	11,600	56.05	650,180.00	
PROGRESS ENERGY RESOURCES CORP	21,000	12.11	254,310.00	
SUNCOR ENERGY INC	212,492	35.18	7,475,468.56	
TALISMAN ENERGY INC	141,232	17.44	2,463,086.08	

TRANSCANADA CORP	93,377	37.73	3,523,114.21	
TRICAN WELL SERVICE LTD	15,384	13.78	211,991.52	
AGNICO-EAGLE MINES	22,050	60.58	1,335,789.00	
AGRIUM INC	21,483	68.48	1,471,155.84	
BARRICK GOLD CORP	132,239	40.90	5,408,575.10	
ELDORADO GOLD CORPORATION	75,000	14.06	1,054,500.00	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	11,200	82.75	926,800.00	
FRANCO-NEVADA CORPORATION	15,500	27.66	428,730.00	
GOLDCORP INC	100,099	40.18	4,021,977.82	
IAMGOLD CORP	47,500	15.39	731,025.00	
INMET MINING CORPORATION	7,122	59.15	421,266.30	
IVANHOE MINES LTD	37,000	18.75	693,750.00	
KINROSS GOLD CORP	93,895	18.49	1,736,118.55	
PAN AMERICAN SILVER CORP	14,072	25.63	360,665.36	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	40,848	114.46	4,675,462.08	
SHERRITT INTERNATIONAL CORPORATION	44,500	8.33	370,685.00	
SILVER WHEATON CORPORATION	42,000	17.41	731,220.00	
SINO-FOREST CORPORATION-CL A	33,671	20.75	698,673.25	
TECK RESOURCES LIMITED-CL B	67,017	45.44	3,045,252.48	
YAMANA GOLD INC	102,170	10.48	1,070,741.60	
BOMBARDIER INC 'B'	198,659	5.50	1,092,624.50	
CAE INC	31,214	9.96	310,891.44	
FINNING INTERNATIONAL INC	24,250	18.20	441,350.00	
SNC-LAVALIN GROUP INC	20,581	51.22	1,054,158.82	
RITCHIE BROS. AUCTIONEERS	12,400	21.79	270,196.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	64,314	60.76	3,907,718.64	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	22,986	57.40	1,319,396.40	
MAGNA INTERNATIONAL INC-CL A	14,356	63.61	913,185.16	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	15,500	27.87	431,985.00	
TIM HORTONS INC	25,000	33.47	836,750.00	
GROUPE AEROPLAN INC	28,000	10.61	297,080.00	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	49,306	19.78	975,272.68	
THOMSON REUTERS CORP	49,978	36.29	1,813,701.62	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	10,758	55.90	601,372.20	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B	16,600	19.63	325,858.00	
EMPIRE CO LTD A	3,200	53.00	169,600.00	
LOBLAW COMPANIES LTD	14,433	37.93	547,443.69	
METRO INC -A	14,200	42.16	598,672.00	
SHOPPERS DRUG MART CORP	28,320	38.51	1,090,603.20	
WESTON (GEORGE) LTD	7,380	72.69	536,452.20	
SAPUTO INC	20,840	29.24	609,361.60	
VITERRA INC	53,000	9.35	495,550.00	
BIOVAIL CORP	20,693	16.70	345,573.10	
BANK OF MONTREAL	75,079	61.19	4,594,084.01	
BANK OF NOVA SCOTIA	140,051	50.69	7,099,185.19	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	52,009	73.32	3,813,299.88	



GENWORTH MI CANADA INC	6,000	27.94	167,640.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	22,461	61.08	1,371,917.88	
ROYAL BANK OF CANADA	192,032	59.57	11,439,346.24	
TORONTO-DOMINION BANK	117,103	74.42	8,714,805.26	
CI FINANCIAL CORP	23,200	21.48	498,336.00	
IGM FINANCIAL INC	15,601	43.36	676,459.36	
ONEX CORPORATION	12,923	29.16	376,834.68	
TMX GROUP INC	9,421	29.36	276,600.56	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,700	371.00	1,001,700.00	
GREAT-WEST LIFE CO INC	37,404	28.31	1,058,907.24	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANC	11,000	35.09	385,990.00	
INTACT FINANCIAL CORPORATION	16,500	44.58	735,570.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	240,845	20.00	4,816,900.00	
POWER CORP OF CANADA	48,260	29.76	1,436,217.60	
POWER FINANCIAL CORP	33,986	32.43	1,102,165.98	
SUN LIFE FINANCIAL INC	75,983	32.57	2,474,766.31	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	70,993	25.32	1,797,542.76	
BROOKFIELD PROPERTIES CORP	41,363	15.65	647,330.95	
CGI GROUP INC - CL A	35,587	15.05	535,584.35	
OPEN TEXT CORPORATION	7,500	47.70	357,750.00	
RESEARCH IN MOTION	69,631	70.75	4,926,393.25	
BCE INC	34,220	29.81	1,020,098.20	
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	65,000	34.16	2,220,400.00	
TELUS CORPORATION	4,400	37.69	165,836.00	
TELUS CORPORATION -NON VOTE	22,597	36.45	823,660.65	
CANADIAN UTILITIES LIMITED	10,900	48.27	526,143.00	
FORTIS INC	22,750	28.47	647,692.50	
TRANSALTA CORP	30,268	22.05	667,409.40	
カナダドル 小計	4,288,487		152,076,884.32	
( 邦貨換算額 )			(14,089,923,332)	( 単位 : 円 )
ユ-ロ				
COMPAGNIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE-VERITA	19,750	23.05	455,336.25	
ENI SPA	355,383	17.69	6,286,725.27	
FUGRO NV-CVA	9,145	51.33	469,412.85	
GALP ENERGIA SGPS S.A	21,800	13.54	295,281.00	
HELLENIC PETROLEUM SA	12,435	8.34	103,707.90	
NESTE OIL OYJ	16,385	13.60	222,836.00	
OMV AG	20,389	31.00	632,059.00	
REPSOL YPF SA	99,690	18.69	1,863,206.10	
SAIPEM	36,120	29.99	1,083,238.80	
SBM OFFSHORE NV	21,887	15.97	349,644.82	
TECHNIP S.A.	14,609	63.65	929,862.85	
TENARIS S.A.	62,969	16.53	1,040,877.57	
TOTAL SA	287,796	43.98	12,657,268.08	
ACERINOX SA	17,836	15.20	271,196.38	

AIR LIQUIDE	34,180	88.72	3,032,449.60
AKZO NOBEL	31,816	43.50	1,383,996.00
ARCELOR MITTAL	117,148	33.90	3,971,317.20
BASF SE	125,523	46.92	5,889,539.16
CIMPOR-CIMENTOS DE PORTUGAL	29,700	5.57	165,518.10
CRH PLC	96,280	18.98	1,827,394.40
ERAMET	750	284.60	213,450.00
HEIDELBERGCEMENT AG	18,600	43.50	809,100.00
IMERYS SA	4,465	46.30	206,729.50
ITALCEMENTI SPA	9,800	9.05	88,690.00
K+S AG	23,220	42.72	991,958.40
KONINKLIJKE DSM NV	20,081	34.00	682,754.00
LAFARGE SA	26,932	53.88	1,451,096.16
LINDE AG	20,491	87.70	1,797,060.70
OUTOKUMPU OYJ	17,429	16.89	294,375.81
RAUTARUUKKI OYJ	12,273	16.55	203,118.15
SALZGITTER AG	5,090	68.80	350,192.00
SOLVAY SA	8,305	78.36	650,779.80
STORA ENSO OYJ-R SHS	78,312	5.65	442,854.36
THYSSENKRUPP AG	46,558	26.37	1,227,967.25
TITAN CEMENT CO. S.A.	6,891	20.56	141,678.96
UMICORE	15,650	27.72	433,896.25
UPM-KYMMENE OYJ	70,976	10.03	711,889.28
VOESTALPINE AG	16,653	31.23	520,073.19
WACKER CHEMIE AG	2,150	110.30	237,145.00
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	19,635	35.85	704,012.92
ALSTOM RGPT	28,113	47.62	1,338,741.06
BOSKALIS WESTMINSTER NV	8,400	31.89	267,876.00
BOUYGUES	31,031	39.13	1,214,398.18
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	52,223	37.20	1,942,956.71
EIFPAGE SA	5,600	41.10	230,188.00
EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	56,680	14.77	837,447.00
FINMECCANICA SPA	53,589	10.44	559,469.16
FOMENTO DE CONSTRUC Y CONTRA	5,502	27.72	152,542.95
GAMESA CORP TECNOLOGICA SA	24,421	10.90	266,188.90
GEA GROUP AG	19,900	17.76	353,523.50
HOCHTIEF AG	5,437	63.50	345,249.50
KONE OYJ-B	21,800	31.60	688,880.00
LEGRAND SA	13,700	24.12	330,512.50
MAN SE	14,693	64.78	951,812.54
METSO OYJ	16,271	27.15	441,757.65
PHILIPS ELECTRONICS NV	132,645	24.67	3,273,015.37
PRYSMIAN SPA	14,400	15.49	223,056.00
SACYR VALLEHERMOSO SA	12,700	6.94	88,163.40
SAFRAN SA	25,677	19.52	501,343.42
SCHNEIDER ELECTRIC SA	32,087	88.13	2,827,827.31

SIEMENS AG-REG	112,391	74.78	8,404,598.98	
SOLARWORLD AG	12,784	11.08	141,710.64	
THALES SA	12,475	29.57	368,885.75	
VALLOUREC	7,610	153.05	1,164,710.50	
VINCI S.A.	59,763	44.61	2,666,027.43	
WARTSILA OYJ-B SHARES	11,871	38.20	453,472.20	
ZARDOYA OTIS SA	19,900	12.92	257,108.00	
BIC	3,400	56.75	192,950.00	
BUREAU VERITAS SA	7,300	40.19	293,387.00	
RANDSTAD HOLDING NV	14,398	37.92	545,972.16	
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	38,910	14.55	566,140.50	
AEROPORTS DE PARIS (ADP)	3,800	63.66	241,908.00	
AIR FRANCE-KLM	19,327	12.28	237,335.56	
ATLANTIA SPA	36,044	17.65	636,176.60	
BRISA	26,718	6.48	173,132.64	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	31,179	12.95	403,768.05	
DEUTSCHE POST AG-REG	117,848	12.78	1,506,097.44	
FERROVIAL SA	59,168	7.78	460,622.88	
FRAPORT AG	5,000	40.37	201,850.00	
GROUPE EUROTUNNEL SA	68,000	7.15	486,336.00	
IBERIA LINEAS AER DE ESPANA	63,493	2.64	167,748.50	
RYANAIR HOLDINGS PLC	1,656	4.00	6,632.28	
SOCIETE DES AUTOROUTES PARIS-RHIN-RHONE	3,000	55.26	165,780.00	
TNT NV	51,993	22.80	1,185,700.36	
VOPAK	4,500	60.56	272,520.00	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	46,066	35.12	1,617,837.92	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE(BMW)AG-PFD	7,041	25.87	182,185.87	
DAIMLER AG	124,423	35.41	4,405,818.43	
FIAT SPA	105,516	9.75	1,028,781.00	
MICHELIN (CGDE)-B	20,345	53.22	1,082,760.90	
NOKIAN RENKAAT OYJ	13,697	18.38	251,750.86	
PEUGEOT SA	19,755	21.85	431,745.52	
PIRELLI & C.	366,874	0.43	158,489.56	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PREF	12,565	45.35	569,822.75	
RENAULT SA	24,525	35.16	862,421.62	
VOLKSWAGEN AG	3,944	70.91	279,669.04	
VOLKSWAGEN AG PFD	23,105	68.20	1,575,761.00	
ADIDAS AG	26,824	41.18	1,104,612.32	
CHRISTIAN DIOR SA	8,720	81.00	706,320.00	
HERMES INTERNATIONAL	7,363	99.90	735,563.70	
LUXOTTICA GROUP SPA	15,130	20.49	310,013.70	
LVMH MOET HENNESSY LOUI V SA	33,438	88.75	2,967,622.50	
PUMA AG	626	237.40	148,612.40	
ACCOR SA	19,367	44.49	861,637.83	
AUTOGRILL SPA	12,200	9.38	114,436.00	
OPAP SA	31,406	16.88	530,133.28	

SODEXO	13,086	44.92	587,823.12	
TUI AG	20,000	8.41	168,200.00	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	13,600	26.56	361,284.00	
GESTEVISION TELECINCO SA	9,000	12.00	108,000.00	
JC DECAUX S.A.	7,000	21.27	148,890.00	
LAGARDERE S.C.A.	16,371	31.51	515,932.06	
M6-METROPOLE TELEVISION	8,300	19.13	158,779.00	
MEDIASET SPA	98,634	6.26	617,942.01	
PAGESJAUNES SA	19,000	8.64	164,198.00	
PUBLICIS GROUPE	15,800	31.23	493,513.00	
REED ELSEVIER NV	100,396	9.08	912,499.24	
SANOMA OYJ	10,500	15.40	161,700.00	
SES	38,796	18.52	718,501.92	
TELEVISION FRANCAISE (T.F.1)	16,976	13.59	230,788.72	
VIVENDI SA	167,977	19.88	3,339,382.76	
WOLTERS KLUWER-CVA	38,342	15.84	607,337.28	
INDITEX	30,833	49.43	1,524,229.35	
PPR	10,486	104.45	1,095,262.70	
CARREFOUR SA	86,516	37.56	3,249,540.96	
CASINO GUICHARD PERRACHON	7,640	64.91	495,912.40	
COLRUYT NV	2,089	186.40	389,389.60	
DELHAIZE GROUP	13,978	61.95	865,937.10	
JERONIMO MARTINS SGPS S.A.	32,500	7.66	249,242.50	
KESKO OYJ-B SHS	9,834	29.93	294,331.62	
KONINKLIJKE AHOLD NV	160,697	10.28	1,652,768.64	
METRO AG	15,829	45.46	719,665.48	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	97,694	38.56	3,767,080.64	
COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	25,429	20.29	515,954.41	
DANONE	74,560	46.07	3,434,979.20	
HEINEKEN HOLDING NV	15,339	32.52	498,824.28	
HEINEKEN NV	33,700	37.76	1,272,680.50	
KERRY GROUP PLC-A	18,598	23.55	437,982.90	
PARMALAT SPA	236,000	2.12	501,500.00	
PERNOD-RICARD SA	27,117	64.76	1,756,096.92	
SUEDZUCKER AG	8,500	16.31	138,677.50	
UNILEVER NV-CVA	221,720	22.99	5,097,342.80	
BEIERSDORF AG	11,140	43.91	489,213.10	
HENKEL AG & CO KGAA	18,400	34.75	639,400.00	
HENKEL AG & CO KGAA	24,378	40.73	992,915.94	
L'OREAL	32,410	81.18	2,631,043.80	
BIOMERIEUX	1,800	84.91	152,838.00	
CELESIO AG	11,604	24.49	284,239.98	
ESSILOR INTERNATIONAL	27,403	46.31	1,269,169.94	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	25,540	41.04	1,048,289.30	
FRESENIUS SE	3,200	55.31	176,992.00	
FRESENIUS SE-PFD	11,020	56.69	624,723.80	

BAYER AG	113,323	49.91	5,656,517.54
ELAN CORPORATION PLC	75,566	5.88	444,328.08
GRIFOLS S.A.	15,200	11.19	170,088.00
IPSEN	3,300	36.66	120,994.50
MERCK KGAA	9,321	60.81	566,810.01
ORION OYJ	11,298	14.11	159,414.78
QIAGEN N.V.	30,400	17.38	528,504.00
SANOFI-AVENTIS	143,686	55.27	7,941,525.22
UCB SA	13,497	32.66	440,812.02
ALPHA BANK A.E.	65,321	6.94	453,327.74
ANGLO IRISH BANK CORPORATION PLC	96,000	0.00	96.00
BANCA CARIGE S.P.A	84,000	2.00	168,210.00
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	312,414	1.09	343,342.98
BANCA POPOLARE DI MILANO	59,060	4.69	276,991.40
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	489,284	11.18	5,472,641.54
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	313,402	0.84	263,884.48
BANCO DE SABADELL SA	118,244	4.25	503,246.46
BANCO DE VALENCIA SA	29,200	4.88	142,496.00
BANCO ESPIRITO SANTO,S.A(BES)	72,900	4.16	303,555.60
BANCO POPOLARE SPA	92,182	5.24	483,033.68
BANCO POPULAR ESPANOL	121,427	5.87	712,776.49
BANCO SANTANDER SA	1,120,641	10.69	11,979,652.29
BANK OF CYPRUS PUBLIC CO LTD	80,500	4.86	391,230.00
BANKINTER,S.A.	37,500	6.59	247,275.00
BNP PARIBAS	129,583	57.20	7,412,147.60
COMMERZBANK AG	99,543	6.37	634,487.08
CREDIT AGRICOLE SA	126,090	13.33	1,681,410.15
DEUTSCHE POSTBANK AG	12,150	23.98	291,417.75
DEXIA	72,498	4.42	320,441.16
EFG EUROBANK ERGASIAS	44,991	6.80	305,938.80
ERSTE GROUP BANK AG	26,513	33.68	892,957.84
INTESA SANPAOLO	1,051,490	2.79	2,936,285.82
INTESA SANPAOLO-RNC	134,503	2.27	305,994.32
KBC GROUPE SA	22,051	37.34	823,384.34
NATIONAL BANK OF GREECE S.A.	81,539	14.50	1,182,315.50
NATIXIS	118,000	4.09	483,564.00
PIRAEUS BANK S.A.	42,995	6.45	277,317.75
RAIFFEISEN INTERNATIONAL BANK-HOLDING AG	7,250	37.50	271,875.00
SOCIETE GENERALE	85,879	46.50	3,993,373.50
UNICREDIT SPA	2,228,241	2.26	5,046,965.86
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	77,894	10.04	782,055.76
CNP-CIE NATL A PORTEFEUILLE	3,800	39.94	151,791.00
CRITERIA CAIXACORP SA	117,507	3.80	447,114.13
DEUTSCHE BANK AG -REG	80,126	58.31	4,672,147.06
DEUTSCHE BOERSE AG	26,347	55.61	1,465,156.67
EURAZEO	4,000	52.53	210,120.00

EXOR SPA	10,997	13.40	147,359.80
FORTIS	305,000	2.66	812,825.00
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	11,295	67.29	760,040.55
ING GROEP NV-CVA	494,642	7.59	3,754,332.78
MARFIN INVESTMENT GROUP S.A	78,000	1.69	131,820.00
MEDIOBANCA SPA	65,868	7.99	526,285.32
POHJOLA BANK PLC	17,903	8.74	156,561.73
AEGON NV	214,788	5.35	1,149,115.80
ALLIANZ SE-REG	61,599	94.33	5,810,633.67
ASSICURAZIONI GENERALI	159,531	17.82	2,842,842.42
AXA SA	233,394	17.25	4,026,046.50
CNP ASSURANCES	5,471	70.42	385,267.82
FONDIARIA SAI S.P.A.	8,700	11.35	98,745.00
HANNOVER RUECKVERSICHERUNGS AG	8,600	37.49	322,414.00
MAPFRE SA	95,649	2.76	264,852.08
MEDIOLANUM SPA	29,000	4.39	127,455.00
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	26,894	122.15	3,285,102.10
SAMPO OYJ-A SHS	56,254	19.82	1,114,954.28
SCOR SE	23,458	18.82	441,596.85
VIENNA INSURANCE GROUP	4,600	39.45	181,470.00
IMMOEAST AG	60,000	4.44	266,400.00
ATOS ORIGIN	5,731	38.01	217,863.96
CAP GEMINI SA	19,604	36.68	719,172.74
DASSAULT SYSTEMES SA	9,253	45.95	425,175.35
INDRA SISTEMAS SA	11,528	15.91	183,468.12
SAP AG	117,120	36.04	4,221,004.80
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	15,000	12.16	182,400.00
ALCATEL-LUCENT	319,916	2.30	737,406.38
NEOPOST SA	4,418	61.06	269,763.08
NOKIA OYJ	511,367	11.18	5,717,083.06
BELGACOM SA	21,031	28.65	602,538.15
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	386,442	10.07	3,891,470.94
ELISA OYJ	17,422	15.55	270,912.10
FRANCE TELECOM SA	253,020	17.47	4,421,524.50
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	32,849	8.94	293,670.06
ILIAD SA	2,000	80.60	161,200.00
KONINKLIJKE KPN NV	227,375	11.86	2,696,667.50
MOBISTAR SA	4,264	45.66	194,694.24
PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	82,652	8.39	693,450.28
TELECOM ITALIA SPA	1,368,901	1.09	1,496,208.79
TELECOM ITALIA-RNC	820,811	0.86	705,897.46
TELEFONICA S.A.	576,572	18.01	10,386,944.58
TELEKOM AUSTRIA AG	43,226	10.58	457,331.08
A2A S.P.A.	165,000	1.39	230,835.00
ACCIONA S.A.	3,430	88.40	303,212.00
E.ON AG	259,682	28.52	7,406,130.64

EDP RENOVAVEIS SA	27,000	5.95	160,839.00	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	234,624	3.00	705,514.36	
ELECTRICITE DE FRANCE(EDF)	32,299	41.82	1,350,744.18	
ENAGAS	24,000	16.55	397,320.00	
ENEL SPA	895,547	4.18	3,745,625.32	
FORTUM OYJ	61,181	18.93	1,158,156.33	
GAS NATURAL SDG SA	32,246	13.87	447,413.25	
GDF SUEZ	168,705	28.95	4,884,009.75	
IBERDROLA RENOVABLES	117,000	3.24	379,080.00	
IBERDROLA SA	502,445	6.47	3,253,331.37	
OEST ELEKTRIZATSWIRTSCHAFTS AG-CL A	9,670	30.30	293,001.00	
PUBLIC POWER CORP	16,106	13.45	216,625.70	
RED ELECTRICA CORPORATION S.A.	14,400	40.29	580,248.00	
RWE AG	57,300	68.02	3,897,546.00	
RWE AG-NON VTG PFD	4,993	62.40	311,563.20	
SNAM RETE GAS	189,283	3.80	720,695.02	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	37,000	17.26	638,620.00	
TERNA SPA	179,846	3.19	574,607.97	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	54,730	26.21	1,434,746.95	
ASML HOLDING NV	58,682	26.39	1,548,911.39	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	150,000	5.02	754,200.00	
STMICROELECTRONICS NV	91,905	7.46	686,438.44	
ユーロ 小計	24,345,036		332,602,599.99	
(邦貨換算額)			(41,987,752,222)	(単位：円)
英ポンド				
AMEC PLC	47,335	8.33	394,300.55	
BG GROUP PLC	460,095	11.79	5,424,520.05	
BP PLC	2,558,318	6.41	16,401,376.69	
CAIRN ENERGY PLC	189,000	4.25	804,762.00	
ENQUEST PLC	28,000	1.08	30,240.00	
PETROFAC LIMITED	28,000	12.21	341,880.00	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	482,006	19.73	9,512,388.41	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	368,230	18.98	6,989,005.40	
TULLOW OIL PLC	121,500	13.21	1,605,015.00	
ANGLO AMERICAN PLC	179,391	29.48	5,288,446.68	
ANTOFAGASTA PLC	53,270	10.45	556,671.50	
BHP BILLITON PLC	300,097	22.70	6,813,702.38	
EURASIAN NATURAL RESOURCES CORPORATION	36,500	12.21	445,665.00	
FRESNILLO PLC	25,000	8.67	216,750.00	
JOHNSON MATTHEY PLC	29,301	17.56	514,525.56	
KAZAKHMYS PLC	28,000	15.77	441,560.00	
LONMIN PLC	20,936	21.13	442,377.68	
RANDGOLD RESOURCES LTD	12,702	53.55	680,192.10	
REXAM PLC	110,549	3.00	332,089.19	
RIO TINTO PLC	186,493	39.40	7,347,824.20	

VEDANTA RESOURCES PLC	18,600	29.15	542,190.00	
XSTRATA PLC	261,717	12.82	3,355,211.94	
BAE SYSTEMS PLC	480,735	3.70	1,782,565.38	
BALFOUR BEATTY PLC	86,839	3.03	263,122.17	
BUNZL PLC	46,008	7.58	348,740.64	
COBHAM PLC	161,074	2.74	442,309.20	
INVENSYS PLC	113,258	3.37	382,698.78	
ROLLS-ROYCE GROUP PLC	249,993	6.12	1,529,957.16	
SMITHS GROUP PLC	54,766	11.43	625,975.38	
TOMKINS PLC	117,922	2.43	287,493.83	
WOLSELEY PLC	37,232	15.60	580,819.20	
CAPITA GROUP PLC	87,199	7.99	697,156.00	
EXPERIAN PLC	141,394	6.31	892,196.14	
G4S PLC	176,927	2.67	473,102.79	
SERCO GROUP PLC	62,528	6.10	381,733.44	
BRITISH AIRWAYS PLC	78,550	2.42	190,640.85	
FIRSTGROUP PLC	63,315	3.65	231,289.69	
BURBERRY GROUP PLC	61,437	6.99	429,444.63	
CARNIVAL PLC	22,867	26.52	606,432.84	
COMPASS GROUP PLC	250,178	5.35	1,339,703.19	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	33,789	10.62	358,839.18	
THOMAS COOK GROUP PLC	116,000	2.67	310,300.00	
TUI TRAVEL PLC	80,000	3.03	243,120.00	
WHITBREAD PLC	22,856	15.26	348,782.56	
BRITISH SKY BROADCASTING PLC	157,055	6.12	961,961.87	
PEARSON PLC	112,953	9.98	1,127,270.94	
REED ELSEVIER PLC	162,148	5.26	852,898.48	
WPP PLC	173,667	6.88	1,194,828.96	
HOME RETAIL GROUP	126,094	2.94	370,968.54	
KINGFISHER PLC	315,840	2.32	734,328.00	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	220,199	3.75	827,507.84	
NEXT PLC	26,544	23.03	611,308.32	
SAINSBURY (J) PLC	160,638	3.46	556,771.30	
TESCO PLC	1,084,082	4.42	4,799,231.01	
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	290,792	2.96	860,744.32	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	50,400	9.83	495,684.00	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	272,426	22.57	6,150,016.95	
DIAGEO PLC	339,810	11.40	3,873,834.00	
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	139,170	20.10	2,797,317.00	
SABMILLER PLC	128,710	19.38	2,494,399.80	
UNILEVER PLC	174,197	19.61	3,416,003.17	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	83,063	35.93	2,984,453.59	
SMITH & NEPHEW PLC	122,783	6.78	832,468.74	
ASTRAZENECA PLC	196,821	29.34	5,774,728.14	
GLAXOSMITHKLINE PLC	708,543	12.69	8,994,953.38	
SHIRE PLC	75,000	14.43	1,082,250.00	



BARCLAYS PLC	1,559,827	3.64	5,687,909.15	
HSBC HOLDINGS PLC	2,372,703	6.94	16,476,049.63	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,189,754	0.64	3,348,948.25	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	2,312,954	0.44	1,038,516.34	
STANDARD CHARTERED PLC	275,343	17.72	4,879,077.96	
3I GROUP PLC	132,000	2.90	382,800.00	
ICAP PLC	70,916	3.94	280,047.28	
INVESTEC PLC	61,000	5.43	331,230.00	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	18,902	7.56	142,993.63	
MAN GROUP PLC	238,945	2.65	633,443.19	
SCHRODERS PLC	17,000	14.36	244,120.00	
ADMIRAL GROUP PLC	25,000	13.42	335,500.00	
AVIVA PLC	378,434	3.89	1,472,865.12	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	817,491	0.91	746,369.28	
OLD MUTUAL PLC	708,324	1.22	866,988.57	
PRUDENTIAL PLC	344,753	5.73	1,975,434.69	
RESOLUTION LTD	332,046	0.81	268,957.26	
RSA INSURANCE GROUP PLC	461,885	1.29	595,831.65	
STANDARD LIFE PLC	308,048	2.04	630,882.30	
AUTONOMY CORP PLC	30,000	18.40	552,000.00	
SAGE GROUP PLC (THE)	179,063	2.57	460,191.91	
BT GROUP PLC	1,047,669	1.23	1,289,680.53	
CABLE & WIRELESS WORLDWIDE	351,018	0.93	326,446.74	
INMARSAT PLC	60,000	7.54	452,700.00	
VODAFONE GROUP PLC	7,167,038	1.49	10,678,886.62	
CENTRICA PLC	696,335	3.02	2,108,502.38	
DRAX GROUP PLC	54,200	3.86	209,428.80	
INTERNATIONAL POWER PLC	206,253	3.33	688,472.51	
NATIONAL GRID PLC	337,617	6.56	2,216,455.60	
SCOTTISH & SOUTHERN ENERGY	124,308	11.19	1,391,006.52	
SEVERN TRENT PLC	33,494	12.33	412,981.02	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	95,391	5.70	544,205.65	
英bond 小計	39,218,553		194,689,968.31	
(邦貨換算額)			(27,790,046,076)	(単位：円)
スイスフラン				
GIVAUDAN-REG	1,028	980.00	1,007,440.00	
HOLCIM LTD-REG	34,097	80.80	2,755,037.60	
SYNGENTA AG	12,841	282.70	3,630,150.70	
ABB LTD	301,403	23.79	7,170,377.37	
GEBERIT AG-REG	5,370	190.30	1,021,911.00	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,000	93.50	93,500.00	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	8,250	94.65	780,862.50	
ADECCO SA-REG	16,734	62.45	1,045,038.30	
SGS SA	741	1,492.00	1,105,572.00	
KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	7,335	110.40	809,784.00	

CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-BR A	70,277	41.94	2,947,417.38	
THE SWATCH GROUP AG-B	4,219	334.30	1,410,411.70	
THE SWATCH GROUP AG-REG	6,100	62.05	378,505.00	
ARYATA AG	11,300	44.95	507,935.00	
LINDT & SPRUENGLI AG	116	2,477.00	287,332.00	
LINDT & SPRUENGLI AG-REG	14	28,330.00	396,620.00	
NESTLE SA-REGISTERED	472,800	53.30	25,200,240.00	
NOBEL BIOCARE HOLDING AG	15,645	29.10	455,269.50	
SONOVA HOLDING AG	6,442	134.00	863,228.00	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	970	266.75	258,747.50	
SYNTHES INC	8,150	129.90	1,058,685.00	
ACTELION LTD	14,216	48.94	695,731.04	
LONZA GROUP AG-REG	6,552	82.55	540,867.60	
NOVARTIS AG-REG SHS	287,583	56.70	16,305,956.10	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	95,710	173.50	16,605,685.00	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	153,460	54.30	8,332,878.00	
GAM HOLDING LTD	25,473	13.49	343,630.77	
JULIUS BAER GROUP LTD	27,073	38.60	1,045,017.80	
PARGESA HOLDING SA-BR	4,000	92.30	369,200.00	
UBS AG-REGISTERED	485,631	18.23	8,853,053.13	
BALOISE HOLDING AG	7,000	95.45	668,150.00	
SWISS LIFE HOLDING AG	4,070	145.00	590,150.00	
SWISS RE-REG	46,800	53.55	2,506,140.00	
ZURICH FINANCIAL SERVICES AG	20,148	260.40	5,246,539.20	
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	23,582	18.52	436,738.64	
SWISSCOM AG-REG	3,257	394.90	1,286,189.30	
BKW FMB ENERGIE AG	1,820	78.65	143,143.00	
スイスフラン 小計	2,191,207		117,153,134.13	
(邦貨換算額)			(10,279,015,988)	(単位：円)
スウェーデンクローナ				
ENQUEST PLC-W/I	37,190	12.15	451,858.50	
LUNDIN PETROLEUM AB	27,602	50.75	1,400,801.50	
HOLMEN AB-B SHARES	7,833	196.00	1,535,268.00	
SSAB AB-A SHARES	33,942	134.10	4,551,622.20	
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	79,262	103.10	8,171,912.20	
ALFA LAVAL AB	47,952	110.20	5,284,310.40	
ASSA ABLOY AB-B	42,466	147.40	6,259,488.40	
ATLAS COPCO AB-A SHS	91,032	115.40	10,505,092.80	
ATLAS COPCO AB-B SHS	53,196	104.30	5,548,342.80	
SANDVIK AB	135,054	95.65	12,917,915.10	
SCANIA AB-B SHS	46,532	117.50	5,467,510.00	
SKANSKA AB-B SHS	52,290	136.00	7,111,440.00	
SKF AB-B SHARES	54,348	131.60	7,152,196.80	
VOLVO AB-A SHS	60,266	76.70	4,622,402.20	
VOLVO AB-B SHS	145,700	77.65	11,313,605.00	

SECURITAS AB-B SHS	42,457	77.40	3,286,171.80	
ELECTROLUX AB-SER B	32,783	163.50	5,360,020.50	
HUSQVARNA AB-B SHS	57,983	53.00	3,073,099.00	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	69,572	490.00	34,090,280.00	
SWEDISH MATCH AB	34,571	173.60	6,001,525.60	
GETINGE AB-B SHS	28,138	174.00	4,896,012.00	
NORDEA BANK AB	438,129	73.80	32,333,920.20	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A	209,923	48.60	10,202,257.80	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	67,508	218.70	14,763,999.60	
SWEDBANK AB - A SHARES	83,060	77.35	6,424,691.00	
INVESTOR AB-B SHS	60,649	143.00	8,672,807.00	
KINNEVIK INVESTMENT AB-B	30,000	135.50	4,065,000.00	
RATOS AB-B SHS	14,000	249.50	3,493,000.00	
ERICSSON LM-B SHS	413,523	76.10	31,469,100.30	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	10,800	638.00	6,890,400.00	
TELE2 AB -B SHS	41,473	125.50	5,204,861.50	
TELIASONERA AB	301,271	49.42	14,888,812.82	
スウェーデンクローナ 小計	2,850,505		287,409,725.02	
(邦貨換算額)			(3,716,207,744)	(単位：円)
ノルウェークローネ				
SEADRILL LID	37,395	151.80	5,676,561.00	
STATOIL ASA	153,364	144.60	22,176,434.40	
NORSK HYDRO ASA	96,797	46.47	4,498,156.59	
YARA INTERNATIONAL ASA	25,705	242.30	6,228,321.50	
ORKLA ASA	107,350	52.10	5,592,935.00	
RENEWABLE ENERGY CORP AS	45,670	26.87	1,227,152.90	
DNB NOR ASA	119,019	69.00	8,212,311.00	
TELENOR ASA	114,792	82.30	9,447,381.60	
ノルウェークローネ 小計	700,092		63,059,253.99	
(邦貨換算額)			(995,075,027)	(単位：円)
デンマーククローネ				
NOVOZYMES A/S-B SHARES	6,223	631.50	3,929,824.50	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	27,562	330.60	9,111,997.20	
A P MOLLER - MAERSK A/S	182	43,390.00	7,896,980.00	
A P MOLLER-MAERSK A/S-A	71	41,910.00	2,975,610.00	
DSV A/S	29,480	103.10	3,039,388.00	
CARLSBERG AS-B	14,336	476.00	6,823,936.00	
COLOPLAST-B	2,952	613.00	1,809,576.00	
WILLIAM DEMANT HOLDING	2,900	383.60	1,112,440.00	
H LUNDBECK A/S	7,500	103.20	774,000.00	
NOVO NORDISK A/S-B	60,103	438.50	26,355,165.50	
DANSKE BANK A/S	63,398	140.10	8,882,059.80	
TOPDANMARK AS	1,934	720.00	1,392,480.00	
TRYGVESTA AS	3,368	375.50	1,264,684.00	

デンマーククローネ 小計	220,009		75,368,141.00	
(邦貨換算額)			(1,278,243,671)	(単位:円)
オーストラリアドル				
ARROW ENERGY LTD	75,000	5.19	389,250.00	
CALTEX AUSTRALIA LIMITED	18,000	12.33	221,940.00	
ENERGY RESOURCES OF AUSTRALIA LTD	9,500	19.69	187,055.00	
ORIGIN ENERGY LIMITED	120,981	16.99	2,055,467.19	
PALADIN ENERGY LIMITED	95,000	4.34	412,300.00	
SANTOS LTD	110,811	14.92	1,653,300.12	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	75,056	47.77	3,585,425.12	
WORLEY PARSONS LIMITED	22,100	26.85	593,385.00	
ALUMINA LTD	350,977	1.88	659,836.76	
AMCOR LIMITED	162,727	6.40	1,041,452.80	
BHP BILLITON LTD	456,730	44.45	20,301,648.50	
BLUESCOPE STEEL LTD	258,327	2.95	762,064.65	
BORAL LIMITED	83,596	5.80	484,856.80	
FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	168,000	5.25	882,000.00	
INCITEC PIVOT LTD	217,000	3.35	726,950.00	
JAMES HARDIE INDUSTRIES SE	55,003	7.34	403,722.02	
NEWCREST MINING LIMITED	66,278	34.93	2,315,090.54	
NUFARM LTD	24,275	7.86	190,801.50	
ONESTEEL LIMITED	174,695	4.10	716,249.50	
ORICA LIMITED	48,923	27.00	1,320,921.00	
OZ MINERALS LIMITED	431,524	1.24	535,089.76	
RIO TINTO LIMITED	59,681	80.66	4,813,869.46	
SIMS METAL MANAGEMENT LTD	22,195	23.25	516,033.75	
CSR LIMITED	207,940	1.73	359,736.20	
LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	20,905	37.94	793,135.70	
BRAMBLES LIMITED	194,532	7.26	1,412,302.32	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	130,138	2.96	385,208.48	
TOLL HOLDINGS LIMITED	91,620	7.47	684,401.40	
BILLABONG INTERNATIONAL LTD	24,611	11.62	285,979.82	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	48,007	4.60	220,832.20	
CROWN LTD	63,965	8.30	530,909.50	
TABCORP HOLDINGS LIMITED	83,545	7.02	586,485.90	
TATTS GROUP LTD	172,000	2.43	417,960.00	
FAIRFAX MEDIA LTD	301,729	1.80	543,112.20	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	79,432	3.64	289,132.48	
METCASH LTD	104,000	4.19	435,760.00	
WESFARMERS LIMITED	137,384	32.37	4,447,120.08	
WESFARMERS LIMITED-PPP	21,654	32.38	701,156.52	
WOOLWORTHS LIMITED	168,398	28.28	4,762,295.44	
COCA-COLA AMATIL LIMITED	76,917	11.51	885,314.67	
FOSTER'S GROUP LTD	258,619	5.43	1,404,301.17	
GOODMAN FIELDER LIMITED	158,000	1.46	230,680.00	

COCHLEAR LIMITED	7,803	75.35	587,956.05	
SONIC HEALTHCARE LTD	49,926	14.26	711,944.76	
CSL LIMITED	77,814	36.29	2,823,870.06	
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	342,792	25.36	8,693,205.12	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	46,000	10.07	463,220.00	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	208,868	58.40	12,197,891.20	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	287,711	27.65	7,955,209.15	
WESTPAC BANKING CORPORATION	400,377	27.84	11,146,495.68	
ASX LTD	23,410	34.12	798,749.20	
MACQUARIE GROUP LTD	45,932	49.45	2,271,337.40	
AMP LIMITED	280,161	6.42	1,798,633.62	
AXA ASIA PACIFIC HOLDINGS LTD	141,340	6.32	893,268.80	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	284,006	3.92	1,113,303.52	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	141,673	21.79	3,087,054.67	
SUNCORP-METWAY LIMITED	176,481	8.78	1,549,503.18	
COMPUTERSHARE LIMITED	61,429	12.56	771,548.24	
TELSTRA CORPORATION LIMITED	593,187	3.10	1,838,879.70	
AGL ENERGY LIMITED	70,969	15.20	1,078,728.80	
オーストラリアドル 小計	8,689,654		123,925,332.70	
(邦貨換算額)			(10,676,167,412)	(単位：円)
ニュージーランドドル				
FLETCHER BUILDING LTD	81,957	8.33	682,701.81	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	130,557	2.03	265,030.71	
SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP	82,890	3.29	272,708.10	
TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	256,909	2.20	565,199.80	
CONTACT ENERGY LIMITED	35,256	6.43	226,696.08	
ニュージーランドドル 小計	587,569		2,012,336.50	
(邦貨換算額)			(133,498,403)	(単位：円)
香港ドル				
MONGOLIA ENERGY CORPORATION LTD.	450,000	4.02	1,809,000.00	
HUTCHISON WHAMPOA LTD	294,000	56.80	16,699,200.00	
NWS HOLDINGS LTD	135,000	14.20	1,917,000.00	
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	165,000	16.66	2,748,900.00	
MTR CORPORATION	200,500	29.25	5,864,625.00	
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	31,000	60.85	1,886,350.00	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	96,000	24.30	2,332,800.00	
SANDS CHINA LTD	280,000	12.90	3,612,000.00	
SHANGRI-LA ASIA LTD.	188,000	15.34	2,883,920.00	
TELEVISION BROADCASTS LTD	40,000	38.30	1,532,000.00	
ESPRIT HOLDINGS LTD	154,927	62.75	9,721,669.25	
LI & FUNG LTD	311,600	39.00	12,152,400.00	
LIFESTYLE INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED	68,000	14.26	969,680.00	
BANK OF EAST ASIA	195,620	29.35	5,741,447.00	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	510,500	18.96	9,679,080.00	

HANG SENG BANK LTD	106,300	109.30	11,618,590.00	
WING HANG BANK LIMITED	22,000	79.60	1,751,200.00	
HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	141,700	139.00	19,696,300.00	
CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	188,000	104.70	19,683,600.00	
HANG LUNG GROUP LTD	116,000	42.20	4,895,200.00	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	287,000	31.60	9,069,200.00	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	149,000	54.70	8,150,300.00	
HOPEWELL HOLDINGS LTD	72,000	23.55	1,695,600.00	
HYSAN DEVELOPMENT CO	91,000	23.05	2,097,550.00	
KERRY PROPERTIES LTD	103,500	41.85	4,331,475.00	
NEW WORLD DEVELOPMENT	356,000	15.84	5,639,040.00	
SINO LAND CO	222,000	15.80	3,507,600.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	193,000	118.90	22,947,700.00	
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	106,500	96.55	10,282,575.00	
WHARF HOLDINGS LTD	185,000	46.35	8,574,750.00	
WHEELOK&COMPANY LTD	130,000	24.80	3,224,000.00	
FOXCONN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	298,000	8.58	2,556,840.00	
PCCW LIMITED	510,000	2.30	1,173,000.00	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	63,000	30.15	1,899,450.00	
CLP HOLDINGS LTD	276,600	56.95	15,752,370.00	
HONG KONG & CHINA GAS	527,969	21.00	11,087,349.00	
HONGKONG ELECTRIC HOLDINGS	191,500	46.15	8,837,725.00	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	25,500	74.90	1,909,950.00	
香港ドル 小計	7,481,716		259,931,435.25	
(邦貨換算額)			(3,113,978,594)	(単位：円)
シンガポールドル				
FRASER & NEAVE LTD	128,000	4.85	620,800.00	
KEPPEL CORP LTD	178,000	9.42	1,676,760.00	
NOBLE GROUP LTD	266,200	3.17	843,854.00	
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	140,820	4.19	590,035.80	
SEMBCORP MARINE LTD	125,400	4.26	534,204.00	
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG	201,000	3.28	659,280.00	
YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD	220,000	1.33	292,600.00	
COMFORTDELGRO CORP LTD	258,000	1.56	402,480.00	
NEPTUNE ORIENT LINES LTD	140,000	2.13	298,200.00	
SINGAPORE AIRLINES LTD	70,266	15.46	1,086,312.36	
GENTING SINGAPORE PLC	577,000	0.89	516,415.00	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	210,250	3.94	828,385.00	
CYCLE & CARRIAGE LTD	18,000	29.48	530,640.00	
OLAM INTERNATIONAL LTD	168,000	2.75	462,000.00	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	891,600	0.61	548,334.00	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	179,000	6.99	1,251,210.00	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	239,000	14.94	3,570,660.00	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	358,000	8.97	3,211,260.00	
UNITED OVERSEAS BANK LTD	167,000	19.94	3,329,980.00	

SINGAPORE EXCHANGE LTD	116,000	7.96	923,360.00	
CAPITALAND LTD	356,000	4.09	1,456,040.00	
CAPITAMALLS ASIA LTD	190,000	2.29	435,100.00	
CITY DEVELOPMENTS LTD	70,000	11.48	803,600.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,100,015	3.18	3,498,047.70	
STARHUB LIMITED	80,000	2.33	186,400.00	
シンガポールドル 小計	6,447,551		28,555,957.86	
(邦貨換算額)			(1,907,252,425)	(単位：円)
合計	140,569,908		256,497,951,064	単位：円
(外貨建有価証券邦貨換算額合計)			(256,497,951,064)	(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、571銘柄、信託財産純資産総額に対する比率53.5%、合計に対する比率54.8%です。  
カナダドル表示の株式については、90銘柄、信託財産純資産総額に対する比率5.4%、合計に対する比率5.5%です。  
ユーロ表示の株式については、266銘柄、信託財産純資産総額に対する比率16.0%、合計に対する比率16.4%です。  
英ポンド表示の株式については、98銘柄、信託財産純資産総額に対する比率10.6%、合計に対する比率10.8%です。  
スイスフラン表示の株式については、37銘柄、信託財産純資産総額に対する比率3.9%、合計に対する比率4.0%です。  
スウェーデンクローナ表示の株式については、32銘柄、信託財産純資産総額に対する比率1.4%、合計に対する比率1.4%です。  
ノルウェークローネ表示の株式については、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。  
デンマーククローネ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0.5%、合計に対する比率0.5%です。  
オーストラリアドル表示の株式については、60銘柄、信託財産純資産総額に対する比率4.1%、合計に対する比率4.2%です。  
ニュージーランドドル表示の株式については、5銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.1%、合計に対する比率0.1%です。  
香港ドル表示の株式については、38銘柄、信託財産純資産総額に対する比率1.2%、合計に対する比率1.2%です。  
シンガポールドル表示の株式については、25銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.7%、合計に対する比率0.7%です。

## (b)株式以外の有価証券

種類	銘柄	口数	評価額	備考
投資証券	米ドル			
	AMB PROPERTY CORP	19,450	540,321.00	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	75,000	1,292,250.00	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,257	1,028,664.66	
	BOSTON PROPERTIES INC	18,859	1,460,629.55	
	DUKE REALTY CORP	30,373	406,390.74	
	EQUITY RESIDENTIAL	37,706	1,582,520.82	
	FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	7,904	589,085.12	
	HCP,INC.	39,557	1,301,425.30	
	HEALTH CARE REIT INC	16,200	733,860.00	

	HOST HOTELS AND RESORTS INC	84,951	1,272,565.98	
	KIMCO REALTY CORPORATION	52,532	848,917.12	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	15,247	517,788.12	
	PLUM CREEK TIMBER COMPANY	22,407	897,848.49	
	PROLOGIS	58,852	818,042.80	
	PUBLIC STORAGE	17,529	1,646,498.97	
	RAYONIER INC	10,900	509,575.00	
	REGENCY CENTERS CORP	11,100	420,024.00	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	38,642	3,285,729.26	
	VENTAS INC	22,179	1,035,981.09	
	VORNADO REALTY TRUST	22,091	1,728,399.84	
	米ドル 小計	612,736	21,916,517.86	
	(邦貨換算額)		(2,038,236,160)	(単位：円)
	カナダドル			
	ARC ENERGY TRUST UNITS	18,000	383,400.00	
	CANADIAN OIL SANDS TRUST	33,059	1,065,160.98	
	ENERPLUS RESOURCES FUND	23,490	561,880.80	
	PENN WEST ENERGY TRUST	56,867	1,201,599.71	
	PROVIDENT ENERGY TRUST-UNITS	34,000	268,940.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	14,500	265,350.00	
	YELLOW PAGES INCOME FUND	31,500	200,970.00	
	カナダドル 小計	211,416	3,947,301.49	
	(邦貨換算額)		(365,717,483)	(単位：円)
	ユーロ			
	CORIO NV	7,578	378,180.09	
	FONCIERE DES REGIONS	3,200	258,720.00	
	GECINA SA	2,430	203,755.50	
	ICADE	2,670	215,816.10	
	KLEPIERRE	12,132	360,805.68	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	12,111	1,848,138.60	
	ユーロ 小計	40,121	3,265,415.97	
	(邦貨換算額)		(412,226,112)	(単位：円)
	英ポンド			
	BRITISH LAND CO PLC	117,505	565,199.05	
	HAMMERSON PLC	95,497	376,640.16	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	100,627	682,251.06	
	LIBERTY INTERNATIONAL PLC	65,855	341,458.17	
	SEGRO PLC	98,434	314,890.36	
	英ポンド 小計	477,918	2,280,438.80	
	(邦貨換算額)		(325,509,834)	(単位：円)
	オーストラリアドル			
	ASCIANO GROUP	362,000	675,130.00	



	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	236,612	442,464.44	
	DEXUS PROPERTY GROUP	694,804	583,635.36	
	GOODMAN GROUP	850,000	578,000.00	
	GPT GROUP	1,227,473	711,934.34	
	INTOLL GROUP	316,311	352,686.76	
	LEND LEASE GROUP	58,172	500,860.92	
	MAP GROUP	107,000	337,050.00	
	MIRVAC GROUP	380,710	544,415.30	
	STOCKLAND	323,614	1,297,692.14	
	TRANSURBAN GROUP	162,123	834,933.45	
	WESTFIELD GROUP	286,593	3,484,970.88	
	オーストラリアドル 小計	5,005,412	10,343,773.59	
	(邦貨換算額)		(891,116,094)	(単位：円)
	香港ドル			
	LINK REIT	293,500	5,605,850.00	
	香港ドル 小計	293,500	5,605,850.00	
	(邦貨換算額)		(67,158,083)	(単位：円)
	シンガポールドル			
	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	218,000	427,280.00	
	CAPITAMALL TRUST	328,000	593,680.00	
	シンガポールドル 小計	546,000	1,020,960.00	
	(邦貨換算額)		(68,189,918)	(単位：円)
	合計		4,168,153,684	単位：円
	(外貨建有価証券邦貨換算額合計)		(4,168,153,684)	(単位：円)

(注)

- 合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券にかかるもので、内書きであります。
- 米ドル表示の投資証券については、20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48.9%です。  
カナダドル表示の投資証券については、7銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.1%、合計に対する比率8.8%です。  
ユーロ表示の投資証券については、6銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.2%、合計に対する比率9.9%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7.8%です。  
オーストラリアドル表示の投資証券については、12銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.3%、合計に対する比率21.4%です。  
香港ドル表示の投資証券については、1銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.0%、合計に対する比率1.6%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1.6%です。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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



「外国債券パッシブ・マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

対象年月日	(平成21年4月13日現在)	(平成22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	1,494,876,901	1,143,244,171
コール・ローン	3,616,698,083	1,087,322,711
国債証券	180,362,126,568	259,505,207,724
派生商品評価勘定	10,326,374	1,158,363
未収利息	2,541,676,027	3,596,242,584
前払費用	288,409,382	202,744,883
流動資産合計	188,314,113,335	265,535,920,436
資産合計	188,314,113,335	265,535,920,436
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	13,392,678	-
未払金	2,810,894,436	-
未払解約金	1,060,280	1,583,741
流動負債合計	2,825,347,394	1,583,741
負債合計	2,825,347,394	1,583,741
純資産の部		
元本等		
1 元本		
元本	151,497,648,151	218,330,196,293
元本合計	151,497,648,151	218,330,196,293
2 剰余金		
剰余金	33,991,117,790	47,204,140,402
剰余金合計	33,991,117,790	47,204,140,402
元本等合計	185,488,765,941	265,534,336,695
純資産合計	185,488,765,941	265,534,336,695
負債・純資産合計	188,314,113,335	265,535,920,436

(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21年4月13日ならびに平成22年4月13日現在における同マザーファンドの状況です。

## (2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	自平成20年3月31日 至平成21年4月13日	自平成21年4月14日 至平成22年4月13日
1. 有価証券の評価基準及び 評価方法	国債証券（売買目的有価証券） 個別法に基づき、時価で評価して おります。時価評価にあたっては、 金融商品取引業者、銀行等の提 示する価額（ただし、売気配相場 は使用しない）、価格情報会社の 提供する価額または業界団体が公 表する売買参考統計値等で評価し ております。	国債証券（売買目的有価証券） 同左
2. デリバティブの評価基準 及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時 価で評価しております。時価評価 にあたっては、原則として、わが 国における計算期間末日の対顧 客先物売買相場の仲値によって おります。	為替予約取引 同左
3. その他財務諸表作成のため の基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する 規則」第60条および第61条に 基づいて処理しております。	外貨建資産等の会計処理 同左

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成21年4月13日現在)	(平成22年4月13日現在)
1. 受益権総数	平成21年4月13日現在における 受益権の総数 151,497,648,151口	平成22年4月13日現在における 受益権の総数 218,330,196,293口
2. 1単位当たり純資産額	1.2244円 (1万口 = 12,244円)	1.2162円 (1万口 = 12,162円)

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

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

・金融商品の状況に関する事項

項目	自平成21年4月14日 至平成22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。
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。 なお、当計算期間末の保有については、附属明細表に記載しております。</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ため、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。 なお、当計算期間末における残高については、「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</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理ならびにコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。リスクを管理する部署では、各種リスクごとに定められた頻度で、測定項目が上下限值（リミットあるいは注意レベル）内に収まっているかどうかのモニタリングを行っております。上下限値を越えていることが発見された場合は、原則として速やかに修正を行うよう、リスク管理を行う部署から関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われます。また、是正勧告あるいは報告を受けた関連運用グループでは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、リスク管理を行う部署は、上下限値に抵触した事実ならびにその後の対処結果、あるいは関連運用グループの対処方針の決定に関し、必要に応じて、リスク管理を行う部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員、およびリスク管理委員会へ報告する体制となっております。</p>

4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された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については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。
----------------------------	--

・金融商品の時価等に関する事項

項目	自平成21年4月14日 至平成22年4月13日
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券(国債証券) 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コールローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

## （デリバティブ取引に関する注記）

## ．取引の状況に関する事項

項目	自平成20年3月31日 至平成21年4月13日
1．取引の内容	<p>当ファンドの行うことのできるデリバティブ取引は、次の通りです。</p> <p>a．わが国の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。</p> <p>b．わが国の取引所における通貨にかかる先物取引および通貨にかかるオプション取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引。</p> <p>c．わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。</p> <p>異なった通貨、異なった受取金利、または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（「スワップ取引」）。</p> <p>金利先渡取引および為替先渡取引。</p> <p>外国為替の売買の予約取引。</p>
2．取引に対する取組方針	<p>デリバティブ取引につきましては信託約款等に従っており、その制限を遵守しております。</p>
3．取引の利用目的	<p>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。</p>
4．取引に係るリスクの内容	<p>デリバティブ取引に伴いファンドに影響を与える主なリスクとしてマーケットリスクがあげられます。マーケットリスクについては、ポジションや時価、予想損失額の把握が重要だと考えております。</p>
5．取引に係るリスクの管理体制	<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、リスク管理ならびにコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p>
6．取引の時価等に関する事項についての補足説明	<p>該当事項はありません。</p>

## ・取引の時価等に関する事項

## デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

## 通貨関連

(平成21年4月13日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場外取引	為替予約取引				
	売建				
	米ドル	500,191,000	-	501,750,000	1,559,000
	ユーロ	479,304,000	-	474,732,000	4,572,000
	英ポンド	176,376,000	-	176,136,000	240,000
	買建				
	米ドル	907,230,105	-	910,284,936	3,054,831
	カナダドル	88,338,810	-	88,938,988	600,178
	ユーロ	1,513,202,759	-	1,503,675,937	9,526,822
	英ポンド	330,843,506	-	330,396,015	447,491
	売建 合計	1,155,871,000	-	1,152,618,000	3,253,000
	買建 合計	2,839,615,180	-	2,833,295,876	6,319,304

(平成22年4月13日現在)

## 1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

## 通貨関連

(単位：円)

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

(注) 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法について

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

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

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

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの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売買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電信売買相場の仲値で評価しています。

## 2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。



## （関連当事者との取引に関する注記）

（自 平成20年 3月31日 至 平成21年 4月13日）

該当事項はありません。

（自 平成21年 4月14日 至 平成22年 4月13日）

該当事項はありません。

## （その他の注記）

（平成21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	111,795,928,812円
同期中における追加設定元本額	52,002,033,881円
同期中における一部解約元本額	12,300,314,542円
平成21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	866,485,152円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	82,557,642円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	262,991,608円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	113,765,061円
スミセイ・DCバランスファンド（機動的資産配分型）	2,030,928円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	147,665円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	137,243円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	130,101円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	127,491円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	121,885円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	101,777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＞	4,984,299,610円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型＜適格機関投資家限定＞	11,648,080,707円
SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	38,546,560,264円
SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	12,192,238,544円
SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	25,160,342,234円
SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	80,874,418円
SMAM・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	173,316,548円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	47,621,477円
SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	1,360,620,059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＞	156,719,301円
SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	1,749,532,102円
SMAM・インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞	2,655,496,228円
SMAM・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	6,784,211,837円
SMAM・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	15,016,165,635円
SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	1,235,687,906円
三井住友・外国債券パッシブファンドVA＜適格機関投資家限定＞	2,597,281,566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）	994,467,103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）	3,804,983,386円
SMAM・グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	369,303,957円
SMAM・バランスファンドVA20＜適格機関投資家専用＞	6,156,154,325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）	14,455,094,391円
合計	151,497,648,151円



(平成22年4月13日現在)

本有価証券報告書における開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	151,497,648,151円
同期中における追加設定元本額	69,521,995,410円
同期中における一部解約元本額	2,689,447,268円
平成22年4月13日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	1,545,582,372円
三井住友・DC年金バランス30(債券重点型)	125,548,246円
三井住友・DC年金バランス50(標準型)	402,983,239円
三井住友・DC年金バランス70(株式重点型)	189,923,691円
スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型)	6,813,547円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	2,408,710円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	268,526円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	2,005,469円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	273,794円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	148,874円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	433,348円
SMAM・年金外国債券パッシブファンド<適格機関投資家限定>	5,314,027,567円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定>	11,648,080,707円
SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用>	40,356,560,721円
SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用>	13,522,977,374円
SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用>	28,388,134,178円
SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定>	85,063,627円
SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定>	184,534,055円
世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定>	52,430,229円
SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用>	1,493,369,206円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定>	182,579,547円
SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用>	2,608,619,428円
SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用>	3,826,214,969円
SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用>	7,314,529,946円
SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用>	18,834,160,186円
SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定>	1,289,878,560円
三井住友・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定>	8,588,365,960円
三井住友・外国債券インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,527,455,644円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	10,399,713,387円
SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	447,114,953円
SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用>	11,857,402,694円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	44,140,833,782円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A<適格機関投資家専用>	297,019,628円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A<適格機関投資家専用>	89,446,385円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A<適格機関投資家専用>	24,483,112円
SMAM・アセットバランスファンドVA20L<適格機関投資家専用>	438,898,912円
SMAM・アセットバランスファンドVA25L<適格機関投資家専用>	1,574,737,694円
SMAM・アセットバランスファンドVA20T<適格機関投資家専用>	399,449,669円
SMAM・アセットバランスファンドVA20A2<適格機関投資家専用>	86,775,824円
SMAM・アセットバランスファンドVA35A2<適格機関投資家専用>	22,664,879円
SMAM・アセットバランスファンドVA50A2<適格機関投資家専用>	3,703,780円

SMAM・アセットバランスファンドVA25L2&lt;適格機関投資家専用&gt;

1,054,579,874円

合計

218,330,196,293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 0.75% 11/11/30	12,000,000.00	11,980,312.56	
	US T 0.875% 11/02/28	10,000,000.00	10,040,234.40	
	US T 0.875% 11/03/31	10,000,000.00	10,039,062.50	
	US T 0.875% 11/04/30	10,000,000.00	10,038,671.90	
	US T 0.875% 11/05/31	9,000,000.00	9,035,859.42	
	US T 0.875% 12/01/31	12,000,000.00	11,981,250.00	
	US T 1% 11/07/31	11,000,000.00	11,054,140.68	
	US T 1% 11/08/31	8,000,000.00	8,034,375.04	
	US T 1% 11/09/30	9,000,000.00	9,033,750.00	
	US T 1% 11/10/31	11,000,000.00	11,034,375.00	
	US T 1.00% 2011/12/31	10,000,000.00	10,013,281.30	
	US T 1.125% 11/06/30	10,000,000.00	10,069,921.90	
	US T 1.125% 11/12/15	7,000,000.00	7,028,437.50	
	US T 1.125% 12/01/15	7,000,000.00	7,022,968.75	
	US T 1.125% 12/12/15	9,000,000.00	8,919,843.75	
	US T 1.375% 12/03/15	7,000,000.00	7,048,125.00	
	US T 1.375% 12/04/15	8,000,000.00	8,048,750.00	
	US T 1.375% 12/05/15	8,500,000.00	8,545,156.25	
	US T 1.375% 12/09/15	7,000,000.00	7,011,484.41	
	US T 1.375% 12/10/15	8,000,000.00	8,004,375.04	
	US T 1.375% 12/11/15	10,000,000.00	9,991,406.30	
	US T 1.375% 12/2/15	8,000,000.00	8,058,125.04	
	US T 1.375% 13/02/15	10,000,000.00	9,948,437.50	
	US T 1.375% 13/03/15	8,000,000.00	7,946,250.00	
	US T 1.375% 2013/01/15	10,000,000.00	9,963,281.30	
	US T 1.5% 12/07/15	9,000,000.00	9,063,984.42	
	US T 1.5% 13/12/31	7,000,000.00	6,872,031.25	
	US T 1.75% 11/11/15	6,000,000.00	6,088,125.00	
	US T 1.75% 12/08/15	10,000,000.00	10,115,625.00	
	US T 1.75% 14/01/31	6,500,000.00	6,424,843.75	
	US T 1.75% 14/03/31	8,000,000.00	7,879,375.04	
	US T 1.875% 12/06/15	8,000,000.00	8,125,000.00	
	US T 1.875% 14/02/28	6,000,000.00	5,948,906.28	
	US T 1.875% 14/04/30	8,000,000.00	7,903,750.00	
	US T 11.25% 15/02/15	2,000,000.00	2,796,875.00	
	US T 2% 13/11/30	7,000,000.00	7,006,562.50	
	US T 2.125% 14/11/30	10,500,000.00	10,347,421.87	

	US T 2.25% 14/05/31	9,000,000.00	9,009,140.67	
	US T 2.25% 15/01/31	8,000,000.00	7,899,375.04	
	US T 2.375% 14/08/31	8,000,000.00	8,008,750.00	
	US T 2.375% 14/09/30	10,000,000.00	9,991,406.30	
	US T 2.375% 14/10/31	8,000,000.00	7,979,375.04	
	US T 2.375% 15/02/28	6,000,000.00	5,948,437.50	
	US T 2.375% 16/03/31	5,500,000.00	5,312,656.25	
	US T 2.5% 13/03/31	4,500,000.00	4,620,234.37	
	US T 2.5% 15/03/31	9,000,000.00	8,959,921.92	
	US T 2.625% 14/06/30	9,000,000.00	9,128,671.92	
	US T 2.625% 14/07/31	10,000,000.00	10,127,343.80	
	US T 2.625% 16/02/29	5,000,000.00	4,903,906.25	
	US T 2.625% 16/04/30	5,000,000.00	4,889,843.75	
	US T 2.625% 2014/12/31	8,000,000.00	8,045,625.04	
	US T 2.75% 13/02/28	3,700,000.00	3,826,031.25	
	US T 2.75% 13/10/31	5,500,000.00	5,659,843.75	
	US T 2.75% 16/11/30	7,000,000.00	6,800,937.50	
	US T 2.75% 19/02/15	15,000,000.00	13,928,906.25	
	US T 2.875% 13/01/31	4,000,000.00	4,149,687.52	
	US T 3% 16/08/31	7,000,000.00	6,944,218.75	
	US T 3% 16/09/30	7,000,000.00	6,932,187.50	
	US T 3% 17/02/28	5,000,000.00	4,914,843.75	
	US T 3.125% 13/04/30	4,500,000.00	4,698,632.83	
	US T 3.125% 13/08/31	5,500,000.00	5,735,468.75	
	US T 3.125% 13/09/30	6,500,000.00	6,772,187.50	
	US T 3.125% 16/10/31	6,000,000.00	5,977,500.00	
	US T 3.125% 17/01/31	7,000,000.00	6,940,937.50	
	US T 3.125% 19/05/15	16,000,000.00	15,237,500.00	
	US T 3.25% 16/05/31	4,000,000.00	4,043,750.00	
	US T 3.25% 16/06/30	6,000,000.00	6,061,875.00	
	US T 3.25% 16/07/31	5,000,000.00	5,043,750.00	
	US T 3.25% 17/03/31	5,000,000.00	4,984,375.00	
	US T 3.25% 2016/12/31	8,000,000.00	8,001,250.00	
	US T 3.375% 12/11/30	3,000,000.00	3,155,156.25	
	US T 3.375% 13/06/30	5,000,000.00	5,257,031.25	
	US T 3.375% 13/07/31	5,500,000.00	5,788,750.00	
	US T 3.375% 19/11/15	15,000,000.00	14,463,281.25	
	US T 3.5% 13/05/31	5,000,000.00	5,278,125.00	
	US T 3.5% 18/02/15	8,500,000.00	8,521,250.00	
	US T 3.5% 39/02/15	6,000,000.00	4,873,125.00	
	US T 3.625 12/12/31	3,500,000.00	3,702,070.33	
	US T 3.625% 13/05/15	3,650,000.00	3,866,148.43	
	US T 3.625% 19/08/15	16,000,000.00	15,792,500.00	
	US T 3.625% 20/02/15	8,000,000.00	7,855,000.00	
	US T 3.75% 18/11/15	13,000,000.00	13,101,562.50	
	US T 3.875% 12/10/31	3,000,000.00	3,190,312.50	

	US T 3.875% 13/02/15	3,800,000.00	4,048,187.50	
	US T 3.875% 18/05/15	6,000,000.00	6,150,000.00	
	US T 4% 12/11/15	5,000,000.00	5,339,062.50	
	US T 4% 14/02/15	6,500,000.00	6,978,359.37	
	US T 4% 18/08/15	8,000,000.00	8,237,500.00	
	US T 4% 2015/02/15	7,700,000.00	8,225,765.62	
	US T 4.125 15/05/15	7,200,000.00	7,725,375.00	
	US T 4.125% 12/08/31	2,500,000.00	2,669,335.95	
	US T 4.25% 12/09/30	3,000,000.00	3,214,921.89	
	US T 4.25% 13/08/15	7,000,000.00	7,566,562.50	
	US T 4.25% 13/11/15	6,900,000.00	7,468,171.87	
	US T 4.25% 14/08/15	5,400,000.00	5,843,812.50	
	US T 4.25% 14/11/15	6,100,000.00	6,598,484.37	
	US T 4.25% 15/08/15	7,600,000.00	8,187,812.50	
	US T 4.25% 17/11/15	5,000,000.00	5,284,375.00	
	US T 4.25% 39/05/15	9,000,000.00	8,368,593.75	
	US T 4.375% 12/08/15	3,700,000.00	3,968,828.12	
	US T 4.375% 38/02/15	4,200,000.00	4,007,718.75	
	US T 4.375% 39/11/15	9,000,000.00	8,537,343.75	
	US T 4.5 11/09/30	4,000,000.00	4,220,625.00	
	US T 4.5 15/11/15	5,800,000.00	6,322,906.25	
	US T 4.5% 11/02/28	3,800,000.00	3,937,156.25	
	US T 4.5% 11/11/30	3,800,000.00	4,026,218.75	
	US T 4.5% 12/03/31	3,500,000.00	3,735,976.58	
	US T 4.5% 12/04/30	3,000,000.00	3,209,765.64	
	US T 4.5% 160215	5,400,000.00	5,868,281.25	
	US T 4.5% 17/05/15	5,000,000.00	5,392,187.50	
	US T 4.5% 36/02/15	5,500,000.00	5,387,421.87	
	US T 4.5% 38/05/15	4,500,000.00	4,379,062.50	
	US T 4.5% 39/08/15	9,000,000.00	8,718,750.00	
	US T 4.625% 11/08/31	3,600,000.00	3,797,437.50	
	US T 4.625% 11/10/31	2,800,000.00	2,967,125.00	
	US T 4.625% 11/12/31	3,500,000.00	3,723,398.45	
	US T 4.625% 12/02/29	2,500,000.00	2,670,703.12	
	US T 4.625% 12/07/31	3,000,000.00	3,232,265.64	
	US T 4.625% 16/11/15	5,200,000.00	5,663,937.50	
	US T 4.625% 17/02/15	5,000,000.00	5,441,406.25	
	US T 4.625% 40/02/15	6,000,000.00	5,927,812.50	
	US T 4.75% 11/03/31	4,000,000.00	4,164,843.76	
	US T 4.75% 12/01/31	3,000,000.00	3,205,546.89	
	US T 4.75% 12/05/31	3,500,000.00	3,769,335.95	
	US T 4.75% 14/05/15	6,400,000.00	7,059,000.00	
	US T 4.75% 17/08/15	5,000,000.00	5,460,937.50	
	US T 4.75% 37/02/15	4,000,000.00	4,066,875.00	
	US T 4.875% 11/04/30	4,000,000.00	4,184,687.52	
	US T 4.875% 11/05/31	4,000,000.00	4,198,125.00	

	US T 4.875% 11/07/31	4,000,000.00	4,219,687.52	
	US T 4.875% 12/02/15	5,820,000.00	6,238,312.50	
	US T 4.875% 12/06/30	3,500,000.00	3,784,101.58	
	US T 4.875% 16/08/15	4,900,000.00	5,423,687.50	
	US T 5% 11/08/15	5,900,000.00	6,242,015.62	
	US T 5% 37/05/15	4,000,000.00	4,225,000.00	
	US T 5.125% 11/06/30	4,300,000.00	4,538,179.70	
	US T 5.125% 16/05/15	5,700,000.00	6,388,453.12	
	US T 5.25% 28/11/15	3,000,000.00	3,270,937.50	
	US T 5.25% 29/02/15	2,000,000.00	2,179,062.50	
	US T 5.375% 31/02/15	4,020,000.00	4,458,431.25	
	US T 5.5% 28/08/15	2,000,000.00	2,242,812.50	
	US T 6% 26/02/15	3,000,000.00	3,539,062.50	
	US T 6.125% 27/11/15	4,000,000.00	4,796,406.24	
	US T 6.125% 29/08/15	2,420,000.00	2,917,234.37	
	US T 6.25% 23/08/15	4,500,000.00	5,405,625.00	
	US T 6.25% 30/05/15	4,000,000.00	4,905,000.00	
	US T 6.375% 27/08/15	2,000,000.00	2,458,125.00	
	US T 6.5% 26/11/15	2,000,000.00	2,482,500.00	
	US T 6.625% 27/02/15	2,000,000.00	2,514,375.00	
	US T 6.75% 26/08/15	2,000,000.00	2,539,375.00	
	US T 6.875% 25/08/15	2,000,000.00	2,554,375.00	
	US T 7.125% 23/02/15	3,400,000.00	4,376,968.75	
	US T 7.25% 16/05/15	4,000,000.00	4,956,250.00	
	US T 7.25% 22/08/15	2,500,000.00	3,247,656.25	
	US T 7.5% 16/11/15	3,400,000.00	4,287,187.50	
	US T 7.5% 24/11/15	2,000,000.00	2,684,687.50	
	US T 7.625% 22/11/15	1,000,000.00	1,337,656.25	
	US T 7.625% 25/02/15	2,000,000.00	2,716,250.00	
	US T 7.875% 21/02/15	2,000,000.00	2,686,875.00	
	US T 8% 21/11/15	5,800,000.00	7,897,968.75	
	US T 8.125% 19/08/15	3,300,000.00	4,437,984.37	
	US T 8.125% 21/05/15	2,000,000.00	2,735,937.50	
	US T 8.125% 21/08/15	2,000,000.00	2,740,937.50	
	US T 8.75% 17/05/15	3,000,000.00	4,049,062.50	
	US T 8.75% 20/08/15	3,000,000.00	4,235,156.25	
	US T 8.75% 2020/05/15	1,000,000.00	1,407,812.50	
	US T 8.875% 17/08/15	2,000,000.00	2,727,500.00	
	US T 8.875% 190215	2,100,000.00	2,929,500.00	
	US T 9.0% 18/11/15	1,000,000.00	1,401,093.75	
	US T 9.125% 18/05/15	1,000,000.00	1,399,218.75	
	US T-BOND 8.5% 20/02/15	2,000,000.00	2,763,437.50	
	米ドル 小計	1,003,310,000.00	1,040,281,158.99	
	(邦貨換算額)		(96,746,147,786)	(単位:円)
	カナダドル			



	CAN 1% 11/09/01	3,500,000.00	3,476,970.00	
	CAN 1.25% 11/06/01	3,000,000.00	3,000,090.00	
	CAN 1.5% 2012/03/01	1,000,000.00	993,550.00	
	CAN 2% 12/09/01	3,000,000.00	2,989,830.00	
	CAN 2% 14/12/01	4,000,000.00	3,834,640.00	
	CAN 2.5% 2015/06/01	1,000,000.00	973,500.00	
	CAN 2.75% 10/12/01	3,000,000.00	3,038,730.00	
	CAN 3% 14/06/01	4,500,000.00	4,525,335.00	
	CAN 3.5% 13/06/01	4,500,000.00	4,632,930.00	
	CAN 3.5% 20/06/01	1,000,000.00	980,570.00	
	CAN 3.75% 11/09/01	2,000,000.00	2,061,840.00	
	CAN 3.75% 12/06/01	2,000,000.00	2,072,940.00	
	CAN 3.75% 19/06/01	5,000,000.00	5,025,000.00	
	CAN 4% 16/06/01	3,000,000.00	3,122,700.00	
	CAN 4% 17/06/01	3,000,000.00	3,109,020.00	
	CAN 4% 41/06/01	3,000,000.00	2,988,930.00	
	CAN 4.25% 18/06/01	2,500,000.00	2,619,750.00	
	CAN 4.5% 15/06/01	3,000,000.00	3,206,790.00	
	CAN 5% 14/06/01	2,500,000.00	2,709,550.00	
	CAN 5% 37/06/01	4,000,000.00	4,612,000.00	
	CAN 5.25% 12/06/01	2,620,000.00	2,798,343.40	
	CAN 5.25% 13/06/01	2,000,000.00	2,164,560.00	
	CAN 5.75% 29/06/01	2,800,000.00	3,415,944.00	
	CAN 5.75% 33/06/01	3,000,000.00	3,730,950.00	
	CAN 6% 11/06/01	1,600,000.00	1,685,664.00	
	CAN 8% 23/06/01	980,000.00	1,389,894.80	
	CAN 8% 27/06/01	2,000,000.00	2,971,280.00	
	CAN 9% 25/06/01	1,480,000.00	2,317,413.60	
	CANADA-GOV'T 1.25 111201	1,000,000.00	993,130.00	
	カナダドル 小計	75,980,000.00	81,441,844.80	
	(邦貨換算額)		(7,545,586,920)	(単位:円)
	ユーロ			
	BGB 2% 12/3/28	1,500,000.00	1,521,750.00	
	BGB 3.25% 16/09/28	3,500,000.00	3,590,650.00	
	BGB 3.5% 15/03/28	1,500,000.00	1,576,050.00	
	BGB 3.75% 15/09/28	3,300,000.00	3,503,610.00	
	BGB 3.75% 20/09/28	1,000,000.00	1,015,700.00	
	BGB 4% 13/03/28	2,800,000.00	2,998,240.00	
	BGB 4% 14/03/28	3,200,000.00	3,443,200.00	
	BGB 4% 17/03/28	2,500,000.00	2,662,250.00	
	BGB 4% 18/03/28	2,500,000.00	2,643,500.00	
	BGB 4% 19/03/28	3,000,000.00	3,146,400.00	
	BGB 4% 2022/03/28	2,000,000.00	2,060,200.00	
	BGB 4.25% 13/09/28	3,000,000.00	3,252,000.00	
	BGB 4.25% 14/09/28	3,500,000.00	3,802,050.00	

	BGB 5% 11/09/28	3,200,000.00	3,388,480.00	
	BGB 5% 12/09/28	3,700,000.00	4,027,080.00	
	BGB 5% 35/03/28	4,000,000.00	4,454,400.00	
	BGB 5.5% 17/09/28	2,740,000.00	3,184,702.00	
	BGB 5.5% 28/03/28	3,000,000.00	3,553,800.00	
	BGB 8% 12/12/24	1,600,000.00	1,873,600.00	
	BGB 8% 15/03/28	2,000,000.00	2,516,000.00	
	BTNS 1.5% 11/09/12	5,000,000.00	5,050,000.00	
	BTNS 2.5% 14/01/12	5,500,000.00	5,619,075.00	
	BTNS 2.5% 15/01/15	2,000,000.00	2,010,300.00	
	BTNS 3% 14/07/12	3,500,000.00	3,628,450.00	
	BTNS 3.5% 11/07/12	6,200,000.00	6,413,280.00	
	BTNS 3.75% 12/01/12	5,000,000.00	5,242,500.00	
	BTNS 3.75% 13/01/12	5,000,000.00	5,307,000.00	
	BTNS 4.5% 12/07/12	4,500,000.00	4,817,475.00	
	BTNS 4.5% 13/07/12	3,500,000.00	3,816,750.00	
	BTPS 2.5% 12/07/01	4,000,000.00	4,086,800.00	
	BTPS 3% 12/03/01	4,500,000.00	4,631,130.00	
	BTPS 3% 15/04/15	1,000,000.00	1,016,200.00	
	BTPS 3.5% 14/06/01	4,000,000.00	4,178,000.00	
	BTPS 3.75% 11/09/15	4,500,000.00	4,661,505.00	
	BTPS 3.75% 13/12/15	5,000,000.00	5,276,000.00	
	BTPS 3.75% 15/08/01	7,200,000.00	7,567,200.00	
	BTPS 3.75% 16/08/01	7,000,000.00	7,325,500.00	
	BTPS 3.75% 21/08/01	6,300,000.00	6,215,580.00	
	BTPS 4% 12/04/15	4,500,000.00	4,724,550.00	
	BTPS 4% 17/02/01	6,000,000.00	6,343,800.00	
	BTPS 4% 37/02/01	6,500,000.00	5,853,250.00	
	BTPS 4.25 12/10/15	5,500,000.00	5,849,800.00	
	BTPS 4.25 13/08/01	7,310,000.00	7,836,320.00	
	BTPS 4.25 19/02/01	6,400,000.00	6,707,200.00	
	BTPS 4.25% 11/09/01	4,500,000.00	4,689,135.00	
	BTPS 4.25% 13/04/15	4,500,000.00	4,806,900.00	
	BTPS 4.25% 14/08/01	6,900,000.00	7,420,260.00	
	BTPS 4.25% 15/02/01	6,000,000.00	6,454,200.00	
	BTPS 4.25% 19/09/01	6,000,000.00	6,245,400.00	
	BTPS 4.25% 20/03/01	4,000,000.00	4,136,000.00	
	BTPS 4.5% 18/02/01	6,000,000.00	6,461,400.00	
	BTPS 4.5% 18/08/01	5,000,000.00	5,360,500.00	
	BTPS 4.5% 19/03/01	6,500,000.00	6,924,450.00	
	BTPS 4.5% 20/02/01	5,500,000.00	5,806,900.00	
	BTPS 4.75% 13/02/01	5,300,000.00	5,729,830.00	
	BTPS 4.75% 23/08/01	4,500,000.00	4,749,750.00	
	BTPS 5% 12/02/01	5,900,000.00	6,283,500.00	
	BTPS 5% 25/03/01	3,000,000.00	3,206,700.00	
	BTPS 5% 34/08/01	4,970,000.00	5,190,668.00	

	BTPS 5% 39/08/01	5,000,000.00	5,220,500.00	
	BTPS 5% 40/09/01	2,000,000.00	2,077,800.00	
	BTPS 5.25 17/08/01	5,000,000.00	5,672,000.00	
	BTPS 5.25% 11/08/01	5,500,000.00	5,794,580.00	
	BTPS 5.25% 29/11/01	7,200,000.00	7,790,400.00	
	BTPS 5.75% 33/02/01	4,700,000.00	5,391,370.00	
	BTPS 6% 31/05/01	7,900,000.00	9,306,990.00	
	BTPS 6.5% 27/11/01	6,960,000.00	8,613,696.00	
	BTPS 7.25% 26/11/01	2,000,000.00	2,655,600.00	
	BTPS 9.00% 23/11/01	3,000,000.00	4,464,600.00	
	BUNDESSCHATZ 1.25 111216	3,000,000.00	3,016,590.00	
	BUNDESSCHATZ 1.25% 110916	4,000,000.00	4,025,600.00	
	BUNDESSCHATZ 1.5% 110610	4,000,000.00	4,037,200.00	
	DBR 3.25% 15/07/04	5,500,000.00	5,753,825.00	
	DBR 3.25% 20/01/04	2,000,000.00	2,012,000.00	
	DBR 3.5% 160104	6,700,000.00	7,072,185.00	
	DBR 3.5% 19/07/04	7,000,000.00	7,205,800.00	
	DBR 3.75% 13/07/04	5,800,000.00	6,199,620.00	
	DBR 3.75% 15/01/04	6,000,000.00	6,425,400.00	
	DBR 3.75% 17/01/04	6,000,000.00	6,391,200.00	
	DBR 3.75% 19/01/04	6,000,000.00	6,303,600.00	
	DBR 4% 18/01/04	5,000,000.00	5,365,000.00	
	DBR 4% 37/01/04	6,200,000.00	6,294,860.00	
	DBR 4.00% 16/07/04	5,900,000.00	6,378,490.00	
	DBR 4.25% 14/01/04	6,700,000.00	7,300,320.00	
	DBR 4.25% 14/07/04	6,500,000.00	7,086,950.00	
	DBR 4.25% 17/07/04	5,000,000.00	5,464,000.00	
	DBR 4.25% 18/07/04	6,200,000.00	6,764,820.00	
	DBR 4.25% 39/07/04	3,500,000.00	3,699,500.00	
	DBR 4.5% 13/01/04	6,700,000.00	7,261,795.00	
	DBR 4.75% 28/07/04	3,000,000.00	3,380,700.00	
	DBR 4.75% 34/07/04	6,100,000.00	6,883,850.00	
	DBR 4.75% 40/07/04	3,000,000.00	3,433,500.00	
	DBR 5% 11/07/04	5,900,000.00	6,207,095.00	
	DBR 5% 12/01/04	7,000,000.00	7,484,050.00	
	DBR 5% 12/07/04	7,220,000.00	7,830,812.00	
	DBR 5.5% 31/01/04	4,300,000.00	5,257,610.00	
	DBR 5.625% 28/01/04	3,980,000.00	4,894,206.00	
	DBR 6% 16/06/20	890,000.00	1,059,278.00	
	DBR 6.25% 24/01/04	2,700,000.00	3,483,000.00	
	DBR 6.25% 300104	2,200,000.00	2,914,780.00	
	DBR 6.5% 27/07/04	3,000,000.00	4,024,200.00	
	FINNISH GO 3.875% 170915	2,000,000.00	2,109,000.00	
	FRANCE 3.75% 17/04/25	5,000,000.00	5,262,000.00	
	FRANCE 3.75% 19/10/25	5,000,000.00	5,145,000.00	
	FRANCE O.A.T.3.5% 150425	5,600,000.00	5,887,840.00	

	FRANCE O.A.T.3.5% 200425	2,000,000.00	2,004,200.00	
	FRANCE O.A.T.4% 600425	1,000,000.00	981,500.00	
	FRANCE O.A.T.5% 12/04/25	6,200,000.00	6,684,840.00	
	FRANCE OAT4% 141025	5,000,000.00	5,381,000.00	
	FRTR 3.0% 15/10/25	7,000,000.00	7,168,000.00	
	FRTR 3.25% 16/04/25	5,700,000.00	5,881,260.00	
	FRTR 3.75% 21/04/25	5,200,000.00	5,284,240.00	
	FRTR 4% 13/04/25	5,700,000.00	6,114,390.00	
	FRTR 4% 13/10/25	5,060,000.00	5,443,042.00	
	FRTR 4% 14/04/25	5,300,000.00	5,704,920.00	
	FRTR 4% 18/04/25	6,000,000.00	6,367,200.00	
	FRTR 4% 38/10/25	6,500,000.00	6,429,800.00	
	FRTR 4% 55/04/25	4,170,000.00	4,054,491.00	
	FRTR 4.25% 17/10/25	4,500,000.00	4,867,200.00	
	FRTR 4.25% 18/10/25	5,000,000.00	5,386,500.00	
	FRTR 4.25% 19/04/25	6,900,000.00	7,409,910.00	
	FRTR 4.25% 23/10/25	5,000,000.00	5,255,000.00	
	FRTR 4.5% 41/04/25	2,000,000.00	2,142,800.00	
	FRTR 4.75% 12/10/25	4,800,000.00	5,210,880.00	
	FRTR 4.75% 35/04/25	4,600,000.00	5,103,240.00	
	FRTR 5% 11/10/25	4,000,000.00	4,250,400.00	
	FRTR 5% 16/10/25	6,200,000.00	7,002,900.00	
	FRTR 5.5% 29/04/25	5,000,000.00	5,993,000.00	
	FRTR 5.75% 32/10/25	4,700,000.00	5,881,580.00	
	FRTR 6.00% 25/10/25	3,500,000.00	4,368,700.00	
	FRTR 6.5% 11/04/25	3,000,000.00	3,175,200.00	
	FRTR 8.5% 12/12/26	1,000,000.00	1,187,600.00	
	FRTR 8.5% 19/10/25	2,550,000.00	3,624,315.00	
	FRTR 8.5% 23/04/25	3,200,000.00	4,789,760.00	
	GGB 3.6% 16/07/20	2,000,000.00	1,724,000.00	
	GGB 3.7% 15/07/20	3,000,000.00	2,670,000.00	
	GGB 4% 13/08/20	2,000,000.00	1,880,000.00	
	GGB 4.3% 12/03/20	3,000,000.00	2,935,500.00	
	GGB 4.3% 17/07/20	3,000,000.00	2,623,800.00	
	GGB 4.5% 14/05/20	2,000,000.00	1,912,600.00	
	GGB 4.5% 37/09/20	2,050,000.00	1,484,200.00	
	GGB 4.6% 13/05/20	2,000,000.00	1,918,000.00	
	GGB 4.7% 24/03/20	2,200,000.00	1,878,800.00	
	GGB 5.25% 12/05/18	2,800,000.00	2,754,360.00	
	GGB 5.3% 26/03/20	1,000,000.00	863,000.00	
	GGB 5.5% 14/08/20	3,500,000.00	3,395,000.00	
	GGB 5.9% 22/10/22	2,730,000.00	2,657,655.00	
	GGB 6.5% 14/01/11	1,300,000.00	1,316,900.00	
	GGB 6.5% 19/10/22	2,540,000.00	2,483,612.00	
	HELLENIC REP 3.9% 110820	1,500,000.00	1,465,500.00	
	HELLENIC REP 4.1% 120820	2,500,000.00	2,395,500.00	

	HELLENIC REP 4.6% 180720	2,000,000.00	1,741,600.00	
	HELLENIC REP 4.6% 400920	2,000,000.00	1,494,000.00	
	HELLENIC REP 5.35% 110518	1,600,000.00	1,609,600.00	
	HELLENIC REP 6% 190719	4,500,000.00	4,432,500.00	
	IRISH 3.9% 12/03/05	1,000,000.00	1,037,000.00	
	IRISH 4% 11/11/11	1,000,000.00	1,038,000.00	
	IRISH 4% 14/01/15	2,500,000.00	2,598,750.00	
	IRISH 4.4% 19/06/18	1,500,000.00	1,504,500.00	
	IRISH 4.5% 18/10/18	2,000,000.00	2,043,000.00	
	IRISH 4.5% 20/04/18	2,490,000.00	2,464,104.00	
	IRISH 4.6% 16/04/18	1,800,000.00	1,897,200.00	
	IRISH 5% 13/04/18	2,000,000.00	2,150,200.00	
	IRISH 5% 2020/10/18	1,000,000.00	1,030,000.00	
	IRISH 5.4% 25/03/13	2,000,000.00	2,049,600.00	
	IRISH 5.9% 19/10/18	2,000,000.00	2,209,000.00	
	ITALY 5.75% 16/07/25	1,000,000.00	1,146,000.00	
	NETHERLANDS 2.5% 120115	3,000,000.00	3,080,700.00	
	NETHERLANDS 2.75 150115	2,000,000.00	2,041,800.00	
	NETHERLANDS 3.25% 150715	3,100,000.00	3,228,650.00	
	NETHERLANDS 3.5% 200715	2,000,000.00	2,013,600.00	
	NETHERLANDS 3.75% 140715	3,400,000.00	3,634,940.00	
	NETHERLANDS 3.75% 230115	2,000,000.00	2,028,800.00	
	NETHERLANDS 4% 16/07/15	3,300,000.00	3,544,530.00	
	NETHERLANDS 4% 18/07/15	3,500,000.00	3,721,200.00	
	NETHERLANDS 4% 19/07/15	2,500,000.00	2,644,750.00	
	NETHERLANDS 4.25% 130715	4,400,000.00	4,767,400.00	
	NETHERLANDS 4.5% 170715	3,600,000.00	3,962,880.00	
	NETHERLANDS 5% 12/07/15	4,000,000.00	4,339,600.00	
	NETHERLANDS 5.5% 280115	3,000,000.00	3,626,700.00	
	NETHERLANDS 7.5% 230115	1,000,000.00	1,402,100.00	
	NETHERLANDS G1.75%130115	1,000,000.00	1,009,700.00	
	NETHERLANDS GOVT4%370115	3,000,000.00	3,000,300.00	
	NETHERLANDS GOVT5%110715	4,000,000.00	4,212,000.00	
	OBL 2.25% 14/04/11	5,000,000.00	5,088,500.00	
	OBL 2.5% 14/10/10	4,000,000.00	4,069,200.00	
	OBL 2.5% 15/02/27	2,000,000.00	2,027,500.00	
	OBL 3.5% 11/04/08	5,500,000.00	5,652,790.00	
	OBL 3.5% 11/10/14	4,500,000.00	4,683,600.00	
	OBL 3.5% 13/04/12	4,500,000.00	4,775,850.00	
	OBL 4% 12/04/13	4,000,000.00	4,235,400.00	
	OBL 4% 13/10/11	4,000,000.00	4,318,200.00	
	OBL 4.25% 12/10/12	4,000,000.00	4,299,000.00	
	PGB 3.2% 11/04/15	2,000,000.00	2,034,400.00	
	PGB 3.35% 15/10/15	2,000,000.00	1,981,200.00	
	PGB 3.6% 14/10/15	1,000,000.00	1,015,050.00	
	PGB 3.85% 21/04/15	2,000,000.00	1,911,200.00	

	PGB 4.10% 37/04/15	2,000,000.00	1,720,800.00	
	PGB 4.2% 16/10/15	1,000,000.00	1,022,500.00	
	PGB 4.35% 17/10/16	1,400,000.00	1,450,400.00	
	PGB 4.375% 14/06/16	2,000,000.00	2,103,200.00	
	PGB 4.45% 18/06/15	2,000,000.00	2,040,800.00	
	PGB 4.75% 19/06/14	2,000,000.00	2,074,000.00	
	PGB 4.95% 23/10/25	1,000,000.00	1,025,100.00	
	PGB 5% 12/06/15	1,500,000.00	1,600,350.00	
	PGB 5.15% 11/06/15	1,000,000.00	1,043,500.00	
	PGB 5.45% 13/09/23	2,000,000.00	2,187,000.00	
	RAGB 3.4% 14/10/20	3,000,000.00	3,130,500.00	
	RAGB 3.5% 15/07/15	2,200,000.00	2,295,700.00	
	RAGB 3.5% 21/09/15	3,000,000.00	2,943,000.00	
	RAGB 3.8% 13/10/20	3,000,000.00	3,195,000.00	
	RAGB 3.9% 20/07/15	2,500,000.00	2,566,250.00	
	RAGB 4% 16/09/15	3,000,000.00	3,192,000.00	
	RAGB 4.15% 37/03/15	2,000,000.00	2,003,000.00	
	RAGB 4.3% 14/07/15	2,400,000.00	2,595,600.00	
	RAGB 4.3% 17/09/15	1,500,000.00	1,612,500.00	
	RAGB 4.35% 19/03/15	2,200,000.00	2,358,400.00	
	RAGB 4.65% 18/01/15	3,000,000.00	3,295,500.00	
	RAGB 4.85% 26/03/15	1,000,000.00	1,096,000.00	
	RAGB 5% 12/07/15	3,000,000.00	3,244,500.00	
	RAGB 6.25% 27/07/15	2,000,000.00	2,535,600.00	
	RFGB 3.125% 14/09/15	1,500,000.00	1,568,550.00	
	RFGB 4% 25/07/04	1,000,000.00	1,015,600.00	
	RFGB 4.25% 12/09/15	2,000,000.00	2,141,000.00	
	RFGB 4.25% 15/07/04	1,300,000.00	1,410,435.00	
	RFGB 4.375% 19/07/04	1,000,000.00	1,081,500.00	
	RFGB 5.375% 13/07/04	1,500,000.00	1,673,550.00	
	SPGB 2.3% 2013/04/30	2,500,000.00	2,511,250.00	
	SPGB 2.75% 12/04/30	3,500,000.00	3,588,900.00	
	SPGB 3.15% 16/01/31	3,800,000.00	3,811,780.00	
	SPGB 3.3% 14/10/31	3,000,000.00	3,081,300.00	
	SPGB 3.8% 17/01/31	4,000,000.00	4,096,000.00	
	SPGB 3.9% 12/10/31	4,500,000.00	4,754,250.00	
	SPGB 4% 20/04/30	2,000,000.00	2,024,200.00	
	SPGB 4.1% 11/04/30	3,500,000.00	3,608,185.00	
	SPGB 4.1% 18/07/30	4,000,000.00	4,111,200.00	
	SPGB 4.2% 13/07/30	3,500,000.00	3,708,950.00	
	SPGB 4.2% 37/01/31	3,250,000.00	3,007,875.00	
	SPGB 4.25% 14/01/31	3,500,000.00	3,746,050.00	
	SPGB 4.3% 19/10/31	3,000,000.00	3,108,300.00	
	SPGB 4.4% 15/01/31	3,800,000.00	4,066,000.00	
	SPGB 4.6% 19/07/30	3,500,000.00	3,718,750.00	
	SPGB 4.65% 25/07/30	1,000,000.00	1,033,100.00	

	SPGB 4.7% 41/07/30	1,000,000.00	992,300.00	
	SPGB 4.75% 14/07/30	3,500,000.00	3,813,600.00	
	SPGB 4.8% 24/01/31	3,300,000.00	3,499,650.00	
	SPGB 4.9% 40/07/30	4,000,000.00	4,151,200.00	
	SPGB 5% 12/07/30	3,100,000.00	3,327,850.00	
	SPGB 5.35% 11/10/31	3,600,000.00	3,830,760.00	
	SPGB 5.4% 11/07/30	4,500,000.00	4,748,850.00	
	SPGB 5.5% 17/07/30	4,280,000.00	4,865,932.00	
	SPGB 5.75% 32/07/30	3,700,000.00	4,245,750.00	
	SPGB 6% 29/01/31	4,900,000.00	5,810,420.00	
	SPGB 6.15% 13/01/31	3,600,000.00	4,020,120.00	
	ユーロ 小計	919,290,000.00	978,967,378.00	
	(邦貨換算額)		(123,584,841,798)	(単位：円)
	英ポンド			
	UKT 2.25% 14/03/07	7,000,000.00	6,977,600.00	
	UKT 2.75% 15/01/22	2,000,000.00	1,997,660.00	
	UKT 3.25% 11/12/07	4,400,000.00	4,563,900.00	
	UKT 3.75% 19/09/07	5,000,000.00	4,888,400.00	
	UKT 4% 16/09/07	4,800,000.00	4,996,944.00	
	UKT 4% 22/03/07	2,000,000.00	1,940,760.00	
	UKT 4% 60/01/22	1,000,000.00	900,770.00	
	UKT 4.25% 27/12/07	2,800,000.00	2,694,440.00	
	UKT 4.25% 32/06/07	3,800,000.00	3,628,620.00	
	UKT 4.25% 36/03/07	4,800,000.00	4,538,976.00	
	UKT 4.25% 39/09/07	2,000,000.00	1,882,600.00	
	UKT 4.25% 46/12/07	3,900,000.00	3,704,766.00	
	UKT 4.25% 49/12/07	3,500,000.00	3,315,550.00	
	UKT 4.25% 55/12/07	5,000,000.00	4,749,250.00	
	UKT 4.5% 13/03/07	5,700,000.00	6,130,920.00	
	UKT 4.5% 19/03/07	5,200,000.00	5,408,936.00	
	UKT 4.5% 34/09/07	2,000,000.00	1,962,000.00	
	UKT 4.5% 42/12/07	5,000,000.00	4,938,450.00	
	UKT 4.75% 15/09/07	3,400,000.00	3,704,436.00	
	UKT 4.75% 20/03/07	2,200,000.00	2,311,518.00	
	UKT 4.75% 30/12/07	3,800,000.00	3,879,648.00	
	UKT 4.75% 38/12/07	4,500,000.00	4,611,330.00	
	UKT 5% 12/03/07	7,560,000.00	8,102,354.40	
	UKT 5% 14/09/07	3,500,000.00	3,855,600.00	
	UKT 5% 18/03/07	3,500,000.00	3,803,940.00	
	UKT 5% 25/03/07	4,400,000.00	4,628,932.00	
	UKT 5.25% 12/06/07	5,500,000.00	5,948,800.00	
	UKT 6.0% 281207	3,000,000.00	3,552,660.00	
	UKT 8% 13/09/27	2,500,000.00	2,998,525.00	
	UKT 8% 15/12/07	1,900,000.00	2,391,530.00	
	UKT 8% 21/06/07	2,620,000.00	3,501,027.40	

	UKT 8.75% 17/08/25	2,300,000.00	3,070,707.00	
	UKT 9% 11/07/12	1,600,000.00	1,762,080.00	
	英債券 小計	122,180,000.00	127,343,629.80	
	(邦貨換算額)		(18,177,029,717)	(単位:円)
	スイスフラン			
	SWITZERLAND 2.5% 160312	2,000,000.00	2,132,400.00	
	SWITZERLAND 2.75% 120610	2,500,000.00	2,618,750.00	
	SWITZERLAND 3% 180108	1,000,000.00	1,094,900.00	
	SWITZERLAND 3% 19/05/12	2,000,000.00	2,190,000.00	
	SWITZERLAND 4% 11/06/10	2,000,000.00	2,085,800.00	
	SWITZERLAND 4% 13/02/11	2,000,000.00	2,182,200.00	
	SWITZERLAND 4% 280408	900,000.00	1,107,450.00	
	SWITZERLAND 4% 230211	1,000,000.00	1,196,500.00	
	SWITZERLAND 4.25% 140106	800,000.00	895,840.00	
	SWITZERLAND 4.25% 170605	2,000,000.00	2,349,400.00	
	スイスフラン 小計	16,200,000.00	17,853,240.00	
	(邦貨換算額)		(1,566,443,277)	(単位:円)
	スウェーデンクローナ			
	SGB 3% 16/07/12	17,000,000.00	17,263,500.00	
	SGB 3.5% 39/03/30	10,000,000.00	9,495,100.00	
	SGB 3.75% 17/08/12	13,200,000.00	13,918,080.00	
	SGB 4.25% 19/03/12	20,000,000.00	21,696,200.00	
	SGB 4.5% 15/08/12	13,000,000.00	14,259,700.00	
	SGB 5% 20/12/01	15,000,000.00	17,328,000.00	
	SGB 5.5% 12/10/08	16,000,000.00	17,518,400.00	
	SGB 6.75% 14/05/05	19,100,000.00	22,440,590.00	
	スウェーデンクローナ 小計	123,300,000.00	133,919,570.00	
	(邦貨換算額)		(1,731,580,040)	(単位:円)
	ノルウェークローネ			
	NORWAY GOV 4.25% 170519	10,000,000.00	10,447,000.00	
	NORWAY GOV 4.5% 19/05/22	6,000,000.00	6,322,800.00	
	NORWAY GOV 5% 150515	10,000,000.00	10,872,000.00	
	NORWAY GOV 6% 110516	13,000,000.00	13,520,000.00	
	NORWAY GOV 6.5% 130515	16,000,000.00	17,785,600.00	
	ノルウェークローネ 小計	55,000,000.00	58,947,400.00	
	(邦貨換算額)		(930,189,972)	(単位:円)
	デンマーククローネ			
	DGB 4% 12/11/15	10,000,000.00	10,598,000.00	
	DGB 4% 15/11/15	16,000,000.00	17,105,600.00	
	DGB 4% 17/11/15	15,000,000.00	15,885,000.00	
	DGB 4% 19/11/15	15,000,000.00	15,687,750.00	
	DGB 4.5% 39/11/15	22,000,000.00	24,096,600.00	



	DGB 5% 13/11/15	20,820,000.00	22,976,952.00	
	DGB 6% 11/11/15	18,000,000.00	19,333,800.00	
	DGB 7% 24/11/10	5,080,000.00	6,926,580.00	
	デンマーククローネ 小計	121,900,000.00	132,610,282.00	
	(邦貨換算額)		(2,249,070,382)	(単位：円)
	ポーランドズロチ			
	POLGB 0% 11/07/25	5,000,000.00	4,740,000.00	
	POLGB 0% 12/01/25	5,000,000.00	4,631,500.00	
	POLGB 4.25% 11/05/24	8,000,000.00	8,014,400.00	
	POLGB 4.75% 12/04/25	7,000,000.00	7,021,000.00	
	POLGB 5.00% 13/10/24	6,500,000.00	6,554,600.00	
	POLGB 5.25% 13/04/25	5,000,000.00	5,050,000.00	
	POLGB 5.25% 17/10/25	8,000,000.00	7,944,000.00	
	POLGB 5.5% 19/10/25	6,000,000.00	5,952,000.00	
	POLGB 5.5% 2015/04/25	5,000,000.00	5,050,500.00	
	POLGB 5.75% 14/04/25	8,000,000.00	8,204,000.00	
	POLGB 5.75% 22/09/23	5,200,000.00	5,210,400.00	
	POLGB 6.25% 15/10/24	7,500,000.00	7,878,750.00	
	ポーランドズロチ 小計	76,200,000.00	76,251,150.00	
	(邦貨換算額)		(2,499,512,697)	(単位：円)
	オーストラリアドル			
	ACGB 4.5% 20/04/15	2,000,000.00	1,807,400.00	
	ACGB 5.25% 10/08/15	1,800,000.00	1,805,029.20	
	ACGB 5.25% 19/03/15	3,000,000.00	2,889,219.00	
	ACGB 5.75% 11/06/15	2,000,000.00	2,027,828.00	
	ACGB 5.75% 12/04/15	3,000,000.00	3,049,200.00	
	ACGB 5.75% 21/05/15	2,000,000.00	1,979,400.00	
	ACGB 6% 17/02/15	3,300,000.00	3,352,387.50	
	ACGB 6.25% 14/06/15	3,000,000.00	3,087,165.00	
	ACGB 6.25% 15/04/15	2,000,000.00	2,060,918.00	
	ACGB 6.5% 13/05/15	3,540,000.00	3,659,959.98	
	オーストラリアドル 小計	25,640,000.00	25,718,506.68	
	(邦貨換算額)		(2,215,649,350)	(単位：円)
	シンガポールドル			
	SIGB 2.25% 13/07/01	1,000,000.00	1,046,153.00	
	SIGB 3.125% 11/02/01	1,000,000.00	1,022,294.00	
	SIGB 3.125% 22/09/01	1,000,000.00	989,534.00	
	SIGB 3.25% 20/09/01	1,000,000.00	1,019,260.00	
	SIGB 3.5% 12/07/01	1,000,000.00	1,064,080.00	
	SIGB 3.5% 27/03/01	1,000,000.00	1,008,554.00	
	SIGB 3.625 140701	2,500,000.00	2,751,800.00	
	SIGB 3.625% 11/07/01	2,000,000.00	2,078,456.00	
	SIGB 3.75% 160901	1,000,000.00	1,092,286.00	

	SIGB 4% 18/09/01	1,200,000.00	1,314,798.00	
	シンガポールドル 小計	12,700,000.00	13,387,215.00	
	(邦貨換算額)		(894,132,089)	(単位：円)
	マレーシアリングット			
	MALAYSIAN 2.509 12/08/27	6,000,000.00	5,926,914.00	
	MALAYSIAN 3.502 27/05/31	4,000,000.00	3,531,384.00	
	MALAYSIAN 3.702 13/02/25	8,000,000.00	8,105,440.00	
	MALAYSIAN 3.718 12/06/15	8,000,000.00	8,124,064.00	
	MALAYSIAN 3.756 11/04/28	5,000,000.00	5,059,735.00	
	MALAYSIAN 3.814% 17/02/15	2,000,000.00	1,988,186.00	
	MALAYSIAN 4.24 18/02/07	5,000,000.00	5,082,675.00	
	MALAYSIAN 4.262 16/09/15	3,000,000.00	3,069,477.00	
	MALAYSIAN 5.094 14/04/30	6,000,000.00	6,361,128.00	
	マレーシアリングット 小計	47,000,000.00	47,249,003.00	
	(邦貨換算額)		(1,365,023,696)	(単位：円)
	合計		259,505,207,724	単位：円
	(外貨建有価証券邦貨換算額合計)		(259,505,207,724)	(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、171銘柄、信託財産純資産総額に対する比率36.4%、合計に対する比率37.3%です。  
カナダドル表示の債券については、29銘柄、信託財産純資産総額に対する比率2.8%、合計に対する比率2.9%です。  
ユーロ表示の債券については、254銘柄、信託財産純資産総額に対する比率46.5%、合計に対する比率47.6%です。  
英ポンド表示の債券については、33銘柄、信託財産純資産総額に対する比率6.8%、合計に対する比率7.0%です。  
スイスフラン表示の債券については、10銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.6%、合計に対する比率0.6%です。  
スウェーデンクローナ表示の債券については、8銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.7%、合計に対する比率0.7%です。  
ノルウェークローネ表示の債券については、5銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.4%、合計に対する比率0.4%です。  
デンマーククローネ表示の債券については、8銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.8%、合計に対する比率0.9%です。  
ポーランドズロチ表示の債券については、12銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.9%、合計に対する比率1.0%です。  
オーストラリアドル表示の債券については、10銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.8%、合計に対する比率0.9%です。  
シンガポールドル表示の債券については、10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。  
マレーシアリングット表示の債券については、9銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.5%、合計に対する比率0.5%です。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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



## 「マネーインカム・マザーファンド」の状況

## (1) 貸借対照表

期 別	第 1 期 (平成21年4月13日現在)	第 2 期 (平成22年4月13日現在)
科 目	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,040,036	7,836,318
国債証券	20,936,100	166,173,620
未収入金	-	3,009,630
未収利息	50,972	470,775
前払費用	33,288	254,317
流動資産合計	22,060,396	177,744,660
資産合計	22,060,396	177,744,660
負債の部		
流動負債		
未払解約金	35,000	4,000,000
流動負債合計	35,000	4,000,000
負債合計	35,000	4,000,000
純資産の部		
元本等		
1 元本		
元本	21,902,962	172,477,387
元本合計	21,902,962	172,477,387
2 剰余金		
期末剰余金	122,434	1,267,273
剰余金合計	122,434	1,267,273
元本等合計	22,025,396	173,744,660
純資産合計	22,025,396	173,744,660
負債・純資産合計	22,060,396	177,744,660

(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21年4月13日ならびに平成22年4月13日現在における同マザーファンドの状況です。

## (2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	第1期 自平成20年3月31日 至平成21年4月13日	第2期 自平成21年4月14日 至平成22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、売気配は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。	国債証券（売買目的有価証券） 同左
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間の取扱い 当計算期間は、設定日の平成20年3月31日から平成21年4月13日までとなっております。	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第1期 (平成21年4月13日現在)	第2期 (平成22年4月13日現在)
1. 受益権総数	当該計算期間の末日における受益権の総数 21,902,962口	当該計算期間の末日における受益権の総数 172,477,387口
2. 1単位当たり純資産額	1.0056円 (1万口 = 10,056円)	1.0073円 (1万口 = 10,073円)

（金融商品に関する注記）

（追加情報）

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

・金融商品の状況に関する事項

項目	第2期 自平成21年4月14日 至平成22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。
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。 なお、当計算期間末の保有については、附属明細表に記載しております。</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ため、ならびに価格変動リスクの回避を目的としております。 なお、当計算期間末における残高については、「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</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p>
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理ならびにコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。リスクを管理する部署では、各種リスクごとに定められた頻度で、測定項目が上下限值（リミットあるいは注意レベル）内に収まっているかどうかのモニタリングを行っております。上下限値を越えていることが発見された場合は、原則として速やかに修正を行うよう、リスク管理を行う部署から関連する運用グループには是正勧告あるいは報告が行われます。また、是正勧告あるいは報告を受けた関連運用グループでは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。なお、リスク管理を行う部署は、上下限値に抵触した事実ならびにその後の対処結果、あるいは関連運用グループの対処方針の決定に関し、必要に応じて、リスク管理を行う部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員、およびリスク管理委員会へ報告する体制となっております。</p>

4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された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については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。
----------------------------	--

・金融商品の時価等に関する事項

項目	第2期
	自平成21年4月14日 至平成22年4月13日
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券(国債証券) 「重要な会計方針に係る事項に関する注記」に記載しております。 (2) 派生商品評価勘定(デリバティブ取引) デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。 (3) コールローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。

(デリバティブ取引に関する注記)

・取引の状況に関する事項

項目	第1期
	自平成20年3月31日 至平成21年4月13日
1. 取引の内容	当ファンドの行うことのできるデリバティブ取引は、次の通りです。 a. わが国の取引所における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引および有価証券オプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。 b. わが国の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引。 異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(「スワップ取引」)。 金利先渡取引。
2. 取引に対する取組方針	デリバティブ取引につきましては信託約款等に従っており、その制限を遵守しております。
3. 取引の利用目的	信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため。
4. 取引に係るリスクの内容	デリバティブ取引に伴いファンドに影響を与える主なリスクとしてマーケットリスクがあげられます。マーケットリスクについては、ポジションや時価、予想損失額の把握が重要だと考えております。
5. 取引に係るリスクの管理体制	リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についてのチェックを行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかるチェックの結果については、運用評価、リスク管理ならびにコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。
6. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	該当事項はありません。

・取引の時価等に関する事項  
デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

第1期（平成21年4月13日現在）

第1期末現在、デリバティブ取引は行っておりません。

第2期（平成22年4月13日現在）

第2期末現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第1期（自平成20年3月31日 至平成21年4月13日）

該当事項はありません。

第2期（自平成21年4月14日 至平成22年4月13日）

該当事項はありません。

（その他の注記）

第1期 (平成21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	20,170,000円
同期中における追加設定元本額	1,839,827円
同期中における一部解約元本額	106,865円
期末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）	822,236円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	17,508円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	16,012円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	16,012円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	15,015円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	15,015円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	16,801円
三井住友・ロシア株式オープン	999,001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＞	19,985,362円
合計	21,902,962円



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

**(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221回利付国債（10年）	81,000,000	81,260,820	
	第223回利付国債（10年）	28,000,000	28,190,680	
	第225回利付国債（10年）	28,000,000	28,339,080	
	第227回利付国債（10年）	28,000,000	28,383,040	
	国債証券 小計	165,000,000	166,173,620	
	合 計		166,173,620	

## 独立監査人の監査報告書

平成22年6月16日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているスミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035の平成21年4月14日から平成22年4月13日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035の平成22年4月13日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

- 
- (注) 1. 上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. 財務諸表の範囲には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21年6月11日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

あずさ監査法人

指 定 社 員  
業務執行社員 公認会計士 鈴木 敏 夫 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているスミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035の平成20年3月31日から平成21年4月13日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035の平成21年4月13日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

---

(注) 1. 上記は、当社が、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. 前期の財務諸表の範囲にはXBR Lデータ自体は含まれていません。

[委託会社の監査報告書（前期）へ](#)

## 独立監査人の監査報告書

平成22年 6月18日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

あずさ監査法人

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

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

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

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

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

以 上

---

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

## 独立監査人の監査報告書

平成21年 6 月26日

三井住友アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

あずさ監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友アセットマネジメント株式会社の平成20年4月1日から平成21年3月31日までの第24期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友アセットマネジメント株式会社の平成21年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

---

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