

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成25年7月11日

【発行者名】 三井住友アセットマネジメント株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 前田 良治

【本店の所在の場所】 東京都港区愛宕二丁目5番1号

【事務連絡者氏名】 三島 克哉

【電話番号】 03-5405-0228

**【届出の対象とした募集内国投資信託受益証 スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040
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2040

以下「当ファンド」といいます。

(2) 【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

* ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社である三井住友アセットマネジメント株式会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

当初元本は1口当たり1円です。委託会社の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

(3) 【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

(4) 【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。

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

「基準価額」とは、信託財産の純資産総額を計算日における受益権口数で除した価額をいいます（基準価額は、便宜上1万口単位で表示される場合があります。）。

基準価額は、組入有価証券の値動き等により日々変動します。

基準価額は、販売会社または委託会社にお問い合わせいただけるほか、原則として翌日付の日本経済新聞朝刊の証券欄「オープン基準価格」の紙面に、「DC2040」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

(5) 【申込手数料】

無手数料です。

(6) 【申込単位】

1円以上1円単位

(7) 【申込期間】

平成25年7月12日から平成26年7月10日まで

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

(8) 【申込取扱場所】

販売会社において申込みを取り扱います。

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

(9) 【払込期日】

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

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

(10) 【払込取扱場所】

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

(11) 【振替機関に関する事項】

当ファンドの振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】**イ 申込証拠金**

ありません。

ロ わが国以外の地域における募集

ありません。

ハ クーリング・オフ制度（金融商品取引法第37条の6）の適用

ありません。

ニ 振替受益権について

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

（参考：投資信託振替制度）

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1) 【ファンドの目的及び基本的性格】

イ 当ファンドは、国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）、国内債券パッシブ・マザーファンド、外国株式インデックス・マザーファンド、外国債券パッシブ・マザーファンドおよびマネーインカム・マザーファンドの受益証券への投資を通じて、日本を含む世界各国の株式、公社債および短期金融資産に分散投資を行うことにより、西暦2040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、対円での為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは対円での為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。 |

《商品分類表》

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

(注) 当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

《属性区分表》

| 投資対象資産 | 決算頻度 | 投資対象地域 | 投資形態 | 為替ヘッジ |
|--|--------------|---------------------|--------------|-------|
| 株 式 | 年 1 回 | グ ロー パ ル (日本を含む) | | |
| 一 般 株 | 年 2 回 | 日 本 | | |
| 大 型 株 | 年 4 回 | 北 米 | | |
| 中 小 型 株 | 年6回(隔月) | 欧 州 | ファミリーファンド | あ り |
| 債 券 | 年12回(毎月) | ア ジ ア | | |
| 一 般 債 | 日 々 | オ セ ア ニ ア | | |
| 公 債 | そ の 他 () | 中 南 米 | ファンド・オブ・ファンズ | な し |
| 社 債 | | ア フ リ カ | | |
| その他債券 クレジット属性 () | | 中近東(中東) | | |
| 不動産投信 | | エ マ ー ジ ン グ | | |
| その他資産 (投資信託(資産収合)株式、債券、 有価証券(資産収合)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。

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

商品分類、属性区分は、一般社団法人投資信託協会「商品分類に関する指針」に基づき記載しています。商品分類、属性区分の全体的な定義等は一般社団法人投資信託協会のホームページ(<http://www.toushin.or.jp/>)をご覧ください。

(2) 【ファンドの沿革】

平成20年3月31日 信託契約締結、設定、運用開始。

(3) 【ファンドの仕組み】

イ 当ファンドの関係法人とその役割

(イ) 委託会社 「三井住友アセットマネジメント株式会社」

証券投資信託契約に基づき、信託財産の運用指図、投資信託説明書(目論見書)および運

用報告書の作成等を行います。

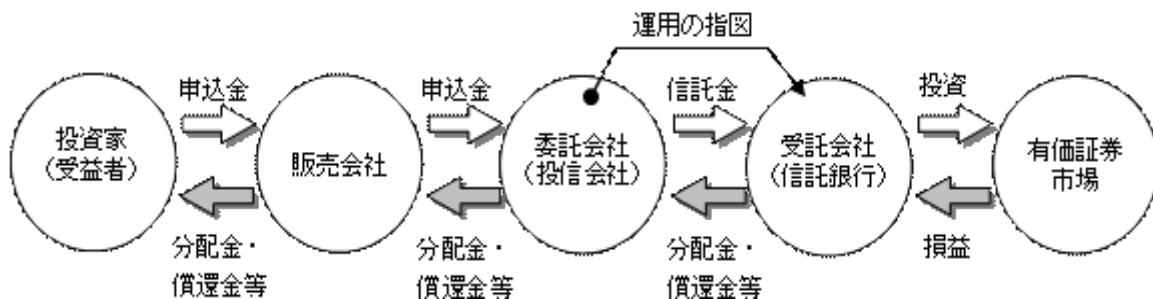
(ロ) 受託会社 「三井住友信託銀行株式会社」

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

(ハ) 販売会社

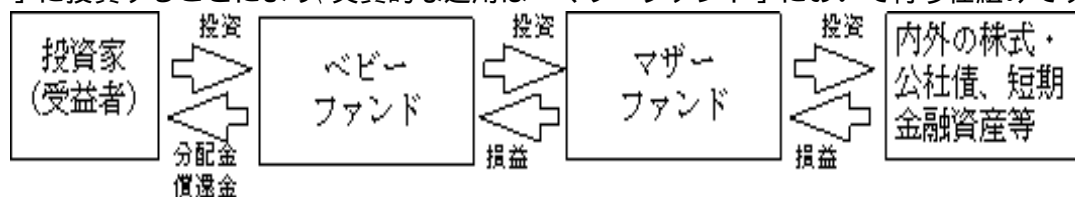
委託会社との間で締結される販売契約（名称の如何を問いません。）に基づき、当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書（目論見書）の提供、受益者からの一部解約実行請求の受付、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を行います。

運営の仕組み



当ファンドの運用は、「ファミリーファンド方式」で行われます。

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



ロ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

2,000百万円（平成25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

平成25年4月1日 トヨタアセットマネジメント株式会社と合併

(ハ) 大株主の状況

（平成25年5月31日現在）

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

イ 基本方針

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2040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、原則として対円での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。

ファンドの特色

1

日本を含む世界各国の株式、公社債および短期金融資産に分散投資を行います。

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

| | |
|--------|------------------------|
| 国内株式 | 国内株式インデックス・マザーファンド（B号） |
| 国内債券 | 国内債券バッシブ・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 | 外国債券バッシブ・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 |

ターゲットイヤー到達後は、主として国内債券バッシブ・マザーファンドおよびマネーインカム・マザーファンドで運用を行います。

ファミリーファンド方式

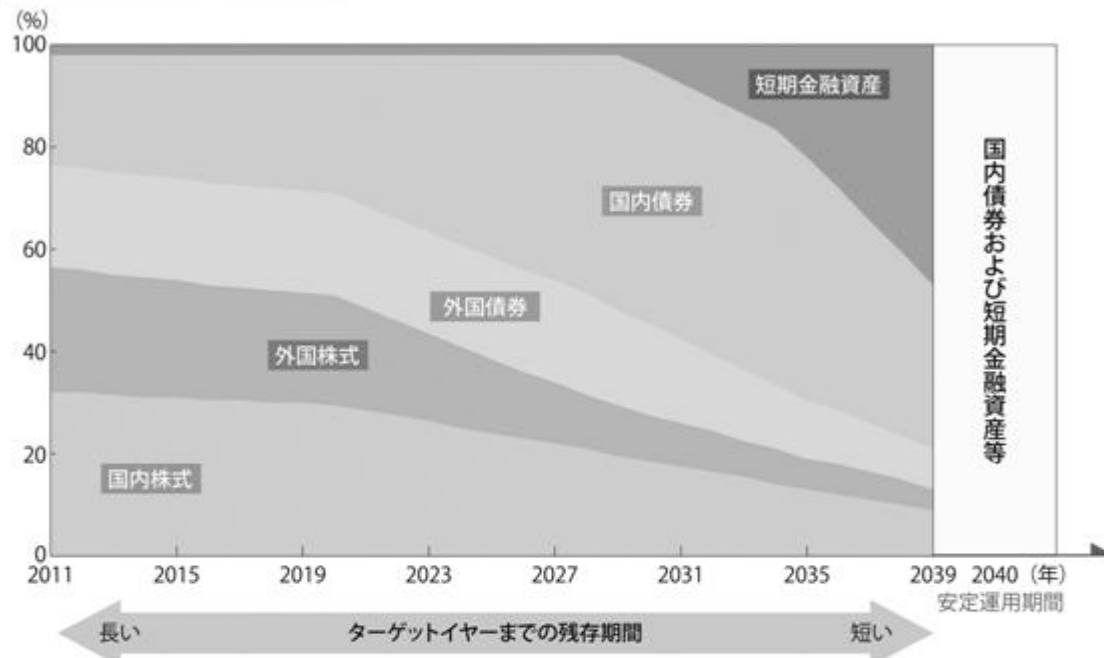


2

基本資産配分は、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ます。

基本資産配分は、原則として年1回決算時に変更します。

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。2039年の決算日以降2040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。

2013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 |
|-------|------|-------|------|--------|
| 31.5% | 23% | 23.5% | 20% | 2% |

3

実質外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。

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

各マザーファンドの運用プロセス

国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

国内債券バッシブ・マザーファンド

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

外国株式インデックス・マザーファンド

- 主として日本を除く世界各国の株式に投資し、MSCI－KOKUSAIインデックス（円ベース）と連動する投資成果を目指して運用を行います。
- 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－KOKUSAIインデックス（円ベース）との連動性を随時チェックし、必要に応じてマルチファクターモデルを使用してポートフォリオのリバランスを行います。

外国債券バッシブ・マザーファンド

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

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。

・ TOPIX（東証株価指数、配当込み）、NOMURA－BPI（総合）、MSCI－KOKUSAIインデックス、シティグループ世界国債インデックスは、それぞれ東京証券取引所、野村證券株式会社、MSCIインク、シティグループ・グローバル・マーケッツ・インクが公表している指数で各社の知的財産です。

・ 指数を公表する各社は当ファンドの運用と何ら関係ありません。

（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

ロ 投資対象とする有価証券

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

1. 株券または新株引受権証書
 2. 国債証券
 3. 地方債証券
 4. 特別の法律により法人の発行する債券
 5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
 6. 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
 7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
 8. 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
 9. 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
 10. コマーシャル・ペーパー
 11. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
 12. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
 13. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
 14. 投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
 15. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
 16. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）
 17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
 20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 21. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの
- なお、第1号の証券または証書、第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券および第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するもの、および第14号の証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、第13号の証券および第14号の証券（ただし、投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

ハ 投資対象とする金融商品

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

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

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

(3) 【運用体制】

イ 運用体制

当ファンドの運用は、次のプロセスに基づいて行われます。

(イ) 計画(Plan)

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

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

(ロ) 実行(Do)

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

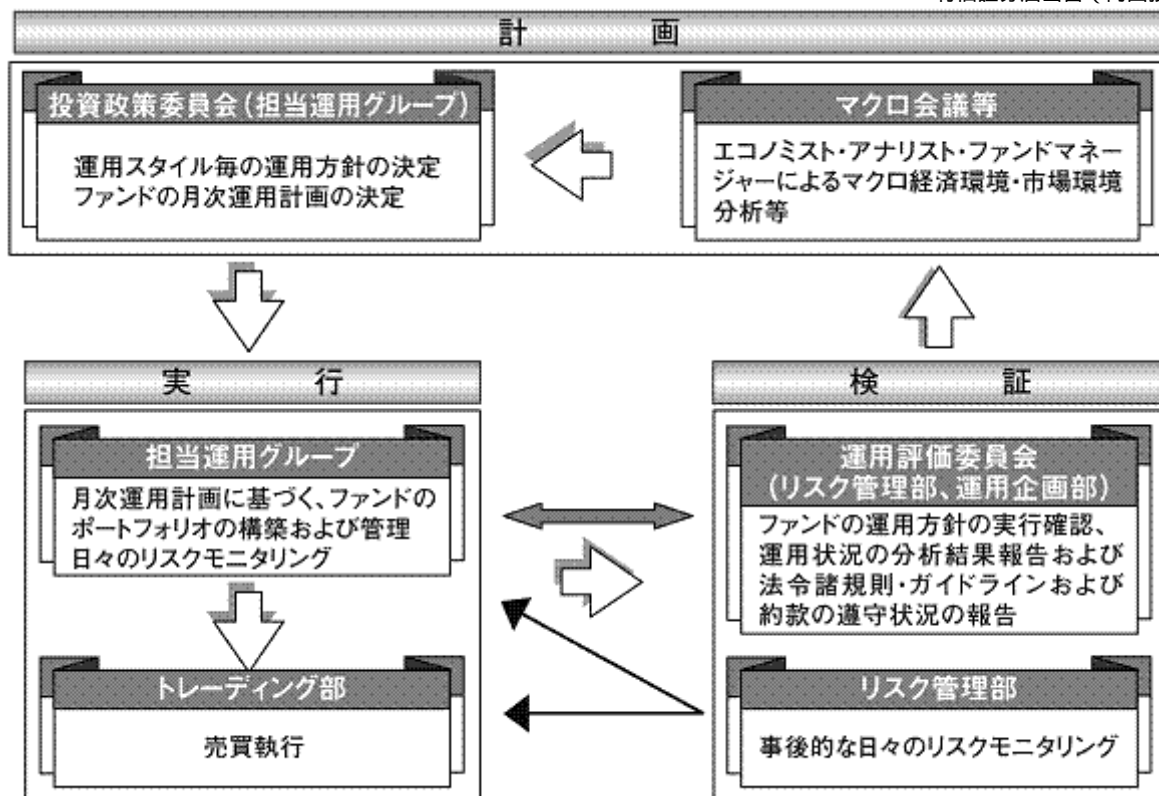
売買執行については、組織的に分離されたトレーディング部が、最良と思われる手法をもって売買を執行します。

(ハ) 検証(Check)

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

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

〔ファンドの運用体制〕



リスク管理部は8名程度、運用企画部は8名程度で構成されています。

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

□ 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。
- 収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合等には、委託会社の判断により収益分配を行わない場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- ハ 留保益の運用については、前記「（１）投資方針」に基づいて運用を行います。

（５）【投資制限】

ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- イ 株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%以下とします。
実質投資割合とは、当ファンドが保有するある種類の資産の評価額が当ファンドの純資産総額に占める比率（「組入比率」といいます。）と、当該同一種類の資産のマザーファンドにおける組入比率に当該マザーファンド受益証券の当ファンドにおける組入比率を乗じて得た率を合計したものをいいます（以下同じ。）。
- 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、株券の引渡した後は買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- (ロ) 信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けにかかる建玉の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- (ハ) 上記(ロ)において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売付けにかかる建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- (ニ) 信託財産の一部解約等の事由により、上記(ロ)の売付けにかかる建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

ハ 先物取引等の指図

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

ニ スワップ取引の指図

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

ホ 金利先渡取引および為替先渡取引の指図

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

かかるスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金にかかる決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

へ 有価証券の貸付けの指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。
1. 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 2. 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- (ロ) 上記(イ)各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は、速やかにその超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- (ハ) 委託会社は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

ト 有価証券の空売りの指図

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

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

ル 資金の借入れ

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

法令に基づく投資制限

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

(参考情報：マザーファンドの投資方針等)

(国内株式インデックス・マザーファンド(B号))

(1) 投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

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

(ロ) 株価指数先物取引等を含む株式の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。ただし、

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(八) 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。

(国内債券パッシブ・マザーファンド)

(1) 投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

(イ) NOMURA - B P I (総合)をベンチマークとし、ベンチマークと連動する投資成果を目指します。

(ロ) 公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。

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

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

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

(八) 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。

(二) 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ず。

(外国株式インデックス・マザーファンド)

(1) 投資方針等

イ 基本方針

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

□ 投資態度

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

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

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

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

□ 投資対象とする有価証券

前記「2 投資方針 (2) 投資対象 □ 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。

□ 法令に基づく投資制限

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

(外国債券パッシブ・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。

□ 投資態度

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

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

- (ハ) ベンチマークの月次の変化状況とポートフォリオのリスク量の状況を勘案しながらリバランスを行います。
- (ニ) 保有する外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
- (ホ) 公社債の組入比率は原則として高位を保ちます。
- (ヘ) 資金動向、市況動向等の急変により上記の運用が困難となった場合、暫定的に上記と異なる運用を行う場合があります。

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

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

ハ 投資対象とする金融商品

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

(3) 投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

- (イ) 株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- (ロ) 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ハ) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
- (ニ) 同一発行体の発行する債券への投資割合は、国債を除き、取得時において信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ホ) 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- (ヘ) 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (ト) 同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。

ロ 法令に基づく投資制限

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

(マネーインカム・マザーファンド)

(1) 投資方針等

イ 基本方針

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

ロ 投資態度

- (イ) 主として、円貨建の短期公社債および短期金融商品に投資し、安定した収益の確保を目指します。
- (ロ) 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(2) 投資対象

イ 投資対象とする資産の種類

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

ロ 投資対象とする有価証券

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

します。

八 投資対象とする金融商品

前記「2 投資方針（2）投資対象 八 投資対象とする金融商品」において記載したベビーファンドが投資対象とする金融商品に同じです。

（3）投資制限

イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限

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

ロ 法令に基づく投資制限

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

3【投資リスク】

イ ファンドのもつリスクの特性

当ファンドは、主に内外の株式、債券および短期金融資産を投資対象としています（マザーファンドを通じて間接的に投資する場合を含みます。）。当ファンドの基準価額は、組み入れた株式や債券等の値動き、当該発行者の経営・財務状況の変化、為替相場の変動等の影響により上下します。基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

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

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

（イ）株式市場リスク

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

（ロ）債券市場リスク

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

（ハ）為替変動リスク

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

（ニ）信用リスク

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

(ホ) カントリーリスク

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

(ヘ) 市場流動性リスク

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

(ト) 収益分配金に関する留意事項

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

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

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

(チ) ファミリーファンド方式にかかる留意点

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

ロ 投資リスクの管理体制

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

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

無手数料です。

(2) 【換金（解約）手数料】

解約手数料はありません。

(3) 【信託報酬等】

純資産総額に以下の率を乗じて得た金額が信託報酬として計算され、信託財産の費用として計上されます。

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

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32期 (ターゲットイヤー の決算日まで) | 年0.441% (0.42%) | 年0.1995% (0.19%) | 年0.21% (0.2%) | 年0.0315% (0.03%) |
| 第33期以降 (ターゲットイヤー の決算翌日以降) | 年0.2205% (0.21%) | 年0.084% (0.08%) | 年0.105% (0.1%) | 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%) 以内の率を乗じて得た金額が信託財産の費用として計上され、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日と各計算期末または信託終了のときに、信託財産中から支弁するものとします。監査費用は、将来、監査法人との契約等により変更となることがあります。
- 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等(それらにかかる消費税等相当額を含みます。)は、信託財産中から支弁するものとします。

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

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

(5) 【課税上の取扱い】

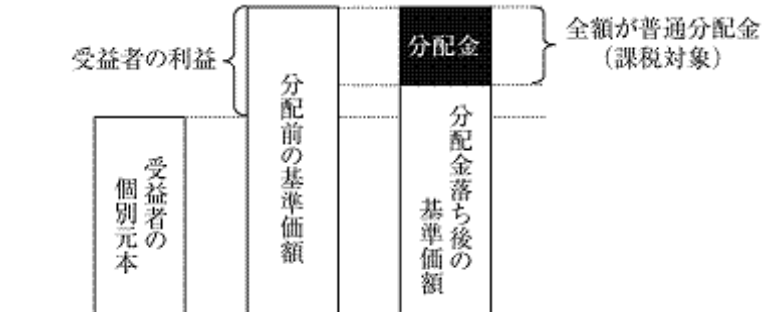
- イ 個別元本について
 - (イ) 追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等(申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。)が当該受益者の元本(個別元本)にあたります。
 - (ロ) 受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合については、各販売会社毎に個別元本の算出が行われます。また、同一販売会社であっても同一受益者の顧客口座が複数存在する場合や、「分配金受取りコース」と「分配金自動再投資コース」を併用するファンドの場合には、別々に個別元本の算出が行われることがあります。
 - (ハ) 受益者が元本払戻金(特別分配金)を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。(「元本払戻金(特別分配金)」については、下記の(収益分配金の課税について)を参照。)
- ロ 一部解約時および償還時の課税について

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

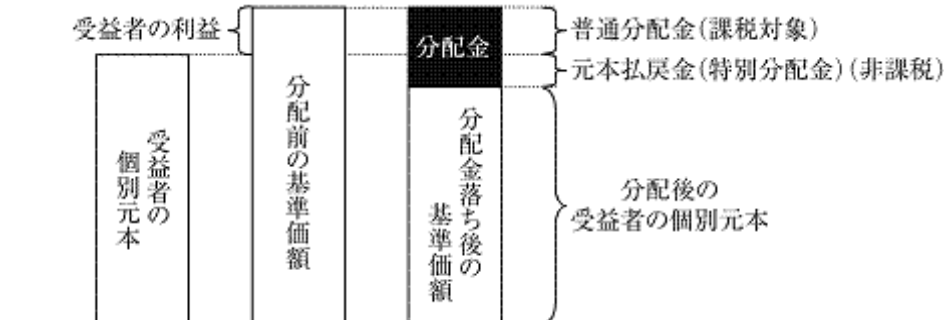
八 収益分配金の課税について

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

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



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



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

二 個人、法人別の課税の取扱いについて

(イ) 個人の受益者に対する課税

・収益分配時

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

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

・一部解約時および償還時

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

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

| 時期 | 税率 |
|---------------|----------------------------|
| 平成25年12月31日まで | 10.147%（所得税7.147%および地方税3%） |

| | |
|-------------|------------------------------|
| 平成26年1月1日以降 | 20.315% (所得税15.315%および地方税5%) |
|-------------|------------------------------|

(ロ) 法人の受益者に対する課税

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

| 時期 | 税率 |
|---------------|-----------------|
| 平成25年12月31日まで | 7.147% (所得税のみ) |
| 平成26年1月1日以降 | 15.315% (所得税のみ) |

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取り扱われます。

当ファンドは、少額投資非課税制度「NISA(ニーサ)」の適用対象です(平成26年1月1日以降)。

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。

少額投資非課税制度「NISA(ニーサ)」(以下「NISA」といいます。)をご利用の場合

NISAとは、平成26年1月1日より開始される非課税制度です。NISAをご利用の場合、毎年、年間100万円の範囲で新たに購入した公募株式投資信託等から生じる配当所得および譲渡所得が5年間非課税となります。ご利用になれるのは、満20歳以上の方で、販売会社で非課税口座を開設する等、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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25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25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 | 4,223,331 | 30.55 |
| 国内債券パッシブ・マザーファンド受益証券 | 日本 | 3,237,182 | 23.42 |
| 外国株式インデックス・マザーファンド受益証券 | 日本 | 3,325,878 | 24.06 |
| 外国債券パッシブ・マザーファンド受益証券 | 日本 | 2,771,027 | 20.05 |
| マネーインカム・マザーファンド受益証券 | 日本 | 265,444 | 1.92 |
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | | 1,134 | 0.01 |
| 合計(純資産総額) | | 13,823,996 | 100.00 |

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

(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25年5月31日現在

| 国/ 地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿単価 (円) | 帳簿価額 (円) | 評価額 単価 (円) | 評価額 (円) | 投資 比率 (%) |
|----------|---------------|----------------------------|-----------|-------------|-------------|------------------|------------|-----------------|
| 日本 | 親投資信託 受益証券 | 国内株式インデックス・マザーファンド (B号) | 2,676,552 | 1.5950 | 4,269,110 | 1.5779 | 4,223,331 | 30.55 |
| 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 | 1,675,590 | 1.8813 | 3,152,288 | 1.9849 | 3,325,878 | 24.06 |
| 日本 | 親投資信託 受益証券 | 国内債券パッシブ・マザーファンド | 2,841,877 | 1.1487 | 3,264,675 | 1.1391 | 3,237,182 | 23.42 |
| 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 | 1,840,236 | 1.4914 | 2,744,597 | 1.5058 | 2,771,027 | 20.05 |
| 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 | 262,686 | 1.0104 | 265,418 | 1.0105 | 265,444 | 1.92 |

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25年5月31日現在

| 種類 | 投資比率(%) |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 99.99 |
| 合計 | 99.99 |

【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) | 789,754 | 7,898 |
| (分配付) | 789,754 | 7,898 |
| 第2期(平成22年 4月13日) (分配落) | 921,372 | 9,072 |
| (分配付) | 921,372 | 9,072 |
| 第3期(平成23年 4月13日) (分配落) | 3,130,163 | 8,674 |
| (分配付) | 3,130,163 | 8,674 |
| 第4期(平成24年 4月13日) (分配落) | 20,230,023 | 8,618 |
| (分配付) | 20,230,023 | 8,618 |
| 第5期(平成25年 4月15日) (分配落) | 10,961,140 | 11,020 |
| (分配付) | 10,961,140 | 11,020 |
| 平成24年 5月末日 | 6,259,461 | 8,011 |
| 6月末日 | 6,667,662 | 8,238 |
| 7月末日 | 7,008,124 | 8,190 |
| 8月末日 | 7,036,014 | 8,241 |
| 9月末日 | 7,482,256 | 8,364 |
| 10月末日 | 7,734,982 | 8,452 |
| 11月末日 | 8,212,868 | 8,746 |

| | | |
|------------|------------|--------|
| 12月末日 | 8,867,496 | 9,279 |
| 平成25年 1月末日 | 9,680,566 | 9,903 |
| 2月末日 | 9,840,422 | 10,061 |
| 3月末日 | 10,369,163 | 10,425 |
| 4月末日 | 11,218,546 | 11,127 |
| 5月末日 | 13,823,996 | 11,188 |

【分配の推移】

| 計算期間 | 1万口当たり分配金（円） |
|------------------------------|--------------|
| 第1期（平成20年 3月31日～平成21年 4月13日） | 0 |
| 第2期（平成21年 4月14日～平成22年 4月13日） | 0 |
| 第3期（平成22年 4月14日～平成23年 4月13日） | 0 |
| 第4期（平成23年 4月14日～平成24年 4月13日） | 0 |
| 第5期（平成24年 4月14日～平成25年 4月15日） | 0 |

【収益率の推移】

| 計算期間 | 収益率（％） |
|------|--------|
| 第1期 | 21.0 |
| 第2期 | 14.9 |
| 第3期 | 4.4 |
| 第4期 | 0.6 |
| 第5期 | 27.9 |

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

（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 | 0 |
| 第2期 | 15,583 | 0 |
| 第3期 | 2,593,247 | 0 |
| 第4期 | 19,866,478 | 0 |
| 第5期 | 5,765,406 | 19,294,423 |

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

〔参考情報〕

〔国内株式インデックス・マザーファンド（B号）〕

（１）投資状況

平成25年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 | 306,098,693,920 | 97.48 |

| | | |
|---------------------|-----------------|--------|
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） | 7,898,378,381 | 2.52 |
| 合計（純資産総額） | 313,997,072,301 | 100.00 |

その他以下の取引を行っております。

| 種類 | 国 / 地域 | 買建 / 売建 | 投資比率 (%) |
|----------|--------|---------|----------|
| 株価指数先物取引 | 日本 | 買建 | 2.47 |
| | | 買建合計 | 2.47 |

（２）投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成25年5月31日現在

| 国 / 地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 数量 | 帳簿単価 (円) | 帳簿価額 (円) | 評価額単価 (円) | 評価額 (円) | 投資比率 (%) |
|--------|----|-------------------|------------|------------|------------|---------------|------------|----------------|----------|
| 日本 | 株式 | トヨタ自動車 | 輸送用機器 | 2,495,400 | 3,535.00 | 8,821,239,000 | 6,010.00 | 14,997,354,000 | 4.78 |
| 日本 | 株式 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 銀行業 | 14,517,700 | 377.00 | 5,473,172,900 | 595.00 | 8,638,031,500 | 2.75 |
| 日本 | 株式 | 本田技研工業 | 輸送用機器 | 1,637,700 | 2,732.00 | 4,474,196,400 | 3,830.00 | 6,272,391,000 | 2.00 |
| 日本 | 株式 | 三井住友フィナンシャルグループ | 銀行業 | 1,450,100 | 2,654.00 | 3,848,565,400 | 4,055.00 | 5,880,155,500 | 1.87 |
| 日本 | 株式 | みずほフィナンシャルグループ | 銀行業 | 24,787,000 | 132.00 | 3,271,884,000 | 195.00 | 4,833,465,000 | 1.54 |
| 日本 | 株式 | ソフトバンク | 情報・通信業 | 929,100 | 3,097.24 | 2,877,645,684 | 5,170.00 | 4,803,447,000 | 1.53 |
| 日本 | 株式 | キヤノン | 電気機器 | 1,206,400 | 2,883.00 | 3,478,051,200 | 3,530.00 | 4,258,592,000 | 1.36 |
| 日本 | 株式 | 日本たばこ産業 | 食料品 | 1,210,500 | 2,585.61 | 3,129,880,905 | 3,460.00 | 4,188,330,000 | 1.33 |
| 日本 | 株式 | 日本電信電話 | 情報・通信業 | 806,800 | 3,685.00 | 2,973,058,000 | 5,050.00 | 4,074,340,000 | 1.30 |
| 日本 | 株式 | 武田薬品工業 | 医薬品 | 762,200 | 3,770.00 | 2,873,494,000 | 4,500.00 | 3,429,900,000 | 1.09 |
| 日本 | 株式 | 三菱地所 | 不動産業 | 1,342,000 | 1,589.00 | 2,132,438,000 | 2,547.00 | 3,418,074,000 | 1.09 |
| 日本 | 株式 | 日立製作所 | 電気機器 | 4,660,000 | 476.56 | 2,220,769,600 | 700.00 | 3,262,000,000 | 1.04 |
| 日本 | 株式 | 野村ホールディングス | 証券・商品先物取引業 | 3,920,100 | 341.00 | 1,336,754,100 | 789.00 | 3,092,958,900 | 0.99 |
| 日本 | 株式 | ファナック | 電気機器 | 202,400 | 13,900.00 | 2,813,360,000 | 15,240.00 | 3,084,576,000 | 0.98 |
| 日本 | 株式 | セブン&アイ・ホールディングス | 小売業 | 802,100 | 2,402.00 | 1,926,644,200 | 3,505.00 | 2,811,360,500 | 0.90 |
| 日本 | 株式 | 日産自動車 | 輸送用機器 | 2,452,100 | 799.00 | 1,959,227,900 | 1,115.00 | 2,734,091,500 | 0.87 |
| 日本 | 株式 | 東日本旅客鉄道 | 陸運業 | 358,600 | 5,410.00 | 1,940,026,000 | 7,580.00 | 2,718,188,000 | 0.87 |
| 日本 | 株式 | 三菱商事 | 卸売業 | 1,494,700 | 1,561.00 | 2,333,226,700 | 1,786.00 | 2,669,534,200 | 0.85 |
| 日本 | 株式 | 三井不動産 | 不動産業 | 904,000 | 1,719.00 | 1,553,976,000 | 2,863.00 | 2,588,152,000 | 0.82 |
| 日本 | 株式 | ソニー | 電気機器 | 1,221,500 | 801.00 | 978,421,500 | 2,049.00 | 2,502,853,500 | 0.80 |
| 日本 | 株式 | KDDI | 情報・通信業 | 541,300 | 3,050.00 | 1,650,965,000 | 4,610.00 | 2,495,393,000 | 0.79 |
| 日本 | 株式 | 小松製作所 | 機械 | 949,000 | 1,847.00 | 1,752,803,000 | 2,611.00 | 2,477,839,000 | 0.79 |
| 日本 | 株式 | エヌ・ティ・ティ・ドコモ | 情報・通信業 | 15,775 | 118,900.00 | 1,875,647,500 | 149,800.00 | 2,363,095,000 | 0.75 |
| 日本 | 株式 | アステラス製薬 | 医薬品 | 451,600 | 4,170.00 | 1,883,172,000 | 5,230.00 | 2,361,868,000 | 0.75 |
| 日本 | 株式 | 信越化学工業 | 化学 | 364,600 | 4,850.00 | 1,768,310,000 | 6,470.00 | 2,358,962,000 | 0.75 |
| 日本 | 株式 | 新日鐵住金 | 鉄鋼 | 8,593,000 | 189.00 | 1,624,077,000 | 260.00 | 2,234,180,000 | 0.71 |
| 日本 | 株式 | 東京海上ホールディングス | 保険業 | 742,200 | 2,114.00 | 1,569,010,800 | 2,995.00 | 2,222,889,000 | 0.71 |
| 日本 | 株式 | ブリヂストン | ゴム製品 | 637,500 | 1,989.00 | 1,267,987,500 | 3,370.00 | 2,148,375,000 | 0.68 |
| 日本 | 株式 | 三井物産 | 卸売業 | 1,654,200 | 1,139.00 | 1,884,133,800 | 1,291.00 | 2,135,572,200 | 0.68 |
| 日本 | 株式 | 三菱重工業 | 機械 | 3,257,000 | 383.00 | 1,247,431,000 | 632.00 | 2,058,424,000 | 0.66 |

ロ 種類別・業種別の投資比率

平成25年5月31日現在

| 種類 | 業種 | 投資比率 (%) |
|--------|--------|----------|
| 株式（国内） | 水産・農林業 | 0.07 |
| | 鉱業 | 0.45 |

| | |
|------------|-------|
| 建設業 | 2.37 |
| 食料品 | 3.95 |
| 繊維製品 | 0.77 |
| パルプ・紙 | 0.24 |
| 化学 | 5.39 |
| 医薬品 | 4.40 |
| 石油・石炭製品 | 0.62 |
| ゴム製品 | 0.92 |
| ガラス・土石製品 | 0.91 |
| 鉄鋼 | 1.58 |
| 非鉄金属 | 0.97 |
| 金属製品 | 0.68 |
| 機械 | 5.24 |
| 電気機器 | 11.70 |
| 輸送用機器 | 11.89 |
| 精密機器 | 1.38 |
| その他製品 | 1.24 |
| 電気・ガス業 | 2.53 |
| 陸運業 | 3.81 |
| 海運業 | 0.33 |
| 空運業 | 0.62 |
| 倉庫・運輸関連業 | 0.22 |
| 情報・通信業 | 6.23 |
| 卸売業 | 4.52 |
| 小売業 | 4.13 |
| 銀行業 | 9.59 |
| 証券、商品先物取引業 | 1.90 |
| 保険業 | 2.30 |
| その他金融業 | 1.24 |
| 不動産業 | 3.32 |
| サービス業 | 1.97 |
| 合計 | 97.48 |

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

平成25年5月31日現在

| 種類 | 取引所等 | 名称 | 買建/ 売建 | 数量 | 簿価 (円) | 時価 (円) | 投資 比率 (%) |
|--------------|-------------|--------------|-----------|-----|---------------|---------------|-----------------|
| 株価指数 先物取引 | 東京証券 取引所 | 東証株価指数先 物 | 買建 | 686 | 8,411,877,150 | 7,768,950,000 | 2.47 |
| | | | 買建合計 | 686 | 8,411,877,150 | 7,768,950,000 | 2.47 |

(注) 主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

〔国内債券パッシブ・マザーファンド〕

(1) 投資状況

平成25年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 | 383,836,401,930 | 78.46 |
| 地方債証券 | 日本 | 27,635,456,136 | 5.65 |
| 特殊債券 | 日本 | 43,844,609,356 | 8.96 |
| 社債券 | 日本 | 27,350,541,000 | 5.59 |
| | アメリカ | 1,434,993,000 | 0.29 |
| | オランダ | 904,774,000 | 0.18 |
| | オーストラリア | 610,236,000 | 0.12 |
| | イギリス | 503,106,000 | 0.10 |
| | 小計 | 30,803,650,000 | 6.30 |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） | | 3,115,994,258 | 0.64 |
| 合計（純資産総額） | | 489,236,111,680 | 100.00 |

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成25年5月31日現在

| 国 / 地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿単価 (円) | 帳簿価額 (円) | 評価額 単価 (円) | 評価額 (円) | 利率 (%) | 償還期限 | 投資 比率 (%) |
|--------|------|--------------------|----------------|-------------|----------------|------------------|----------------|-----------|------------|-----------------|
| 日本 | 国債証券 | 第268回利付 国債(10年) | 14,845,000,000 | 102.48 | 15,214,492,050 | 102.43 | 15,207,069,550 | 1.500 | 2015/03/20 | 3.11 |
| 日本 | 国債証券 | 第265回利付 国債(10年) | 13,150,000,000 | 102.15 | 13,433,161,000 | 102.12 | 13,428,780,000 | 1.500 | 2014/12/20 | 2.74 |
| 日本 | 国債証券 | 第270回利付 国債(10年) | 12,167,000,000 | 102.41 | 12,460,711,380 | 102.37 | 12,455,844,580 | 1.300 | 2015/06/20 | 2.55 |
| 日本 | 国債証券 | 第285回利付 国債(10年) | 10,413,000,000 | 105.50 | 10,986,652,170 | 105.44 | 10,980,091,980 | 1.700 | 2017/03/20 | 2.24 |
| 日本 | 国債証券 | 第284回利付 国債(10年) | 10,007,000,000 | 105.23 | 10,530,366,100 | 105.15 | 10,522,360,500 | 1.700 | 2016/12/20 | 2.15 |
| 日本 | 国債証券 | 第272回利付 国債(10年) | 9,895,000,000 | 102.92 | 10,184,626,650 | 102.86 | 10,177,997,000 | 1.400 | 2015/09/20 | 2.08 |
| 日本 | 国債証券 | 第282回利付 国債(10年) | 9,470,000,000 | 104.95 | 9,939,049,100 | 104.89 | 9,933,461,800 | 1.700 | 2016/09/20 | 2.03 |
| 日本 | 国債証券 | 第289回利付 国債(10年) | 9,019,000,000 | 105.28 | 9,495,293,390 | 105.31 | 9,497,908,900 | 1.500 | 2017/12/20 | 1.94 |
| 日本 | 国債証券 | 第280回利付 国債(10年) | 8,697,000,000 | 105.26 | 9,154,984,020 | 105.17 | 9,147,069,750 | 1.900 | 2016/06/20 | 1.87 |
| 日本 | 国債証券 | 第288回利付 国債(10年) | 8,565,000,000 | 105.98 | 9,077,358,300 | 105.96 | 9,075,474,000 | 1.700 | 2017/09/20 | 1.86 |
| 日本 | 国債証券 | 第290回利付 国債(10年) | 8,477,000,000 | 104.99 | 8,900,157,530 | 104.99 | 8,900,595,690 | 1.400 | 2018/03/20 | 1.82 |
| 日本 | 国債証券 | 第274回利付 国債(10年) | 8,515,000,000 | 103.47 | 8,810,555,650 | 103.39 | 8,804,169,400 | 1.500 | 2015/12/20 | 1.80 |
| 日本 | 国債証券 | 第286回利付 国債(10年) | 8,200,000,000 | 106.14 | 8,703,480,000 | 106.12 | 8,701,840,000 | 1.800 | 2017/06/20 | 1.78 |
| 日本 | 国債証券 | 第277回利付 国債(10年) | 8,020,000,000 | 104.04 | 8,344,008,000 | 103.95 | 8,337,431,600 | 1.600 | 2016/03/20 | 1.70 |
| 日本 | 国債証券 | 第325回利付 国債(10年) | 6,350,000,000 | 99.95 | 6,347,206,000 | 99.69 | 6,330,823,000 | 0.800 | 2022/09/20 | 1.29 |
| 日本 | 国債証券 | 第310回利付 国債(10年) | 6,090,000,000 | 102.40 | 6,236,586,300 | 102.33 | 6,231,957,900 | 1.000 | 2020/09/20 | 1.27 |
| 日本 | 国債証券 | 第315回利付 国債(10年) | 5,830,000,000 | 103.61 | 6,040,498,000 | 103.45 | 6,031,309,900 | 1.200 | 2021/06/20 | 1.23 |
| 日本 | 国債証券 | 第313回利付 国債(10年) | 5,670,000,000 | 104.44 | 5,921,748,000 | 104.31 | 5,914,773,900 | 1.300 | 2021/03/20 | 1.21 |
| 日本 | 国債証券 | 第306回利付 国債(10年) | 5,550,000,000 | 105.50 | 5,855,694,000 | 105.39 | 5,849,256,000 | 1.400 | 2020/03/20 | 1.20 |
| 日本 | 国債証券 | 第305回利付 国債(10年) | 5,425,000,000 | 104.91 | 5,691,638,750 | 104.73 | 5,682,036,500 | 1.300 | 2019/12/20 | 1.16 |

| | | | | | | | | | | |
|----|------|----------------|---------------|--------|---------------|--------|---------------|-------|------------|------|
| 日本 | 国債証券 | 第328回利付国債(10年) | 5,800,000,000 | 97.74 | 5,669,349,500 | 97.60 | 5,661,206,000 | 0.600 | 2023/03/20 | 1.16 |
| 日本 | 国債証券 | 第312回利付国債(10年) | 5,320,000,000 | 103.77 | 5,520,936,400 | 103.65 | 5,514,552,400 | 1.200 | 2020/12/20 | 1.13 |
| 日本 | 国債証券 | 第303回利付国債(10年) | 4,645,000,000 | 105.57 | 4,903,737,000 | 105.42 | 4,897,177,050 | 1.400 | 2019/09/20 | 1.00 |
| 日本 | 国債証券 | 第324回利付国債(10年) | 4,900,000,000 | 100.04 | 4,902,058,000 | 99.78 | 4,889,661,000 | 0.800 | 2022/06/20 | 1.00 |
| 日本 | 国債証券 | 第327回利付国債(10年) | 4,550,000,000 | 99.86 | 4,543,903,000 | 99.60 | 4,531,891,000 | 0.800 | 2022/12/20 | 0.93 |
| 日本 | 国債証券 | 第320回利付国債(10年) | 4,280,000,000 | 101.88 | 4,360,806,400 | 101.68 | 4,351,946,800 | 1.000 | 2021/12/20 | 0.89 |
| 日本 | 国債証券 | 第296回利付国債(10年) | 3,363,000,000 | 105.85 | 3,560,038,170 | 105.75 | 3,556,675,170 | 1.500 | 2018/09/20 | 0.73 |
| 日本 | 国債証券 | 第322回利付国債(10年) | 3,390,000,000 | 100.94 | 3,422,103,300 | 100.73 | 3,415,018,200 | 0.900 | 2022/03/20 | 0.70 |
| 日本 | 国債証券 | 第297回利付国債(10年) | 3,043,000,000 | 105.44 | 3,208,539,200 | 105.33 | 3,205,465,770 | 1.400 | 2018/12/20 | 0.66 |
| 日本 | 国債証券 | 第308回利付国債(10年) | 3,050,000,000 | 104.70 | 3,193,350,000 | 104.62 | 3,191,032,000 | 1.300 | 2020/06/20 | 0.65 |

ロ 種類別の投資比率

平成25年5月31日現在

| 種類 | 投資比率(%) |
|-------|---------|
| 国債証券 | 78.46 |
| 地方債証券 | 5.65 |
| 特殊債券 | 8.96 |
| 社債券 | 6.30 |
| 合計 | 99.36 |

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

〔外国株式インデックス・マザーファンド〕

(1) 投資状況

平成25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 | 137,582,075,755 | 55.34 |
| | イギリス | 23,204,099,828 | 9.33 |
| | カナダ | 11,523,097,498 | 4.64 |
| | スイス | 11,042,157,118 | 4.44 |
| | フランス | 10,088,877,103 | 4.06 |
| | ドイツ | 9,623,109,889 | 3.87 |
| | オーストラリア | 8,241,254,979 | 3.32 |
| | スウェーデン | 3,528,553,055 | 1.42 |
| | オランダ | 3,306,235,785 | 1.33 |
| | スペイン | 3,205,737,186 | 1.29 |
| | 香港 | 2,877,258,442 | 1.16 |
| | イタリア | 2,282,516,353 | 0.92 |
| | アイルランド | 1,916,220,319 | 0.77 |

| | | | |
|---------------------|----------|-----------------|--------|
| | シンガポール | 1,762,874,143 | 0.71 |
| | ジャージー | 1,431,654,508 | 0.58 |
| | ベルギー | 1,291,829,832 | 0.52 |
| | デンマーク | 1,260,357,464 | 0.51 |
| | アンティル | 934,820,699 | 0.38 |
| | ノルウェー | 901,458,859 | 0.36 |
| | フィンランド | 868,134,092 | 0.35 |
| | バミューダ | 758,587,532 | 0.31 |
| | イスラエル | 561,072,322 | 0.23 |
| | ルクセンブルク | 410,017,677 | 0.16 |
| | オーストリア | 306,427,736 | 0.12 |
| | ケイマン諸島 | 265,647,818 | 0.11 |
| | ポルトガル | 192,379,653 | 0.08 |
| | ニュージーランド | 134,323,580 | 0.05 |
| | マン島 | 65,357,964 | 0.03 |
| | ガーンジー | 60,514,201 | 0.02 |
| | リベリア | 49,923,722 | 0.02 |
| | ギリシャ | 41,558,397 | 0.02 |
| | モーリシャス | 31,279,218 | 0.01 |
| | 小計 | 239,749,412,727 | 96.44 |
| 投資証券 | アメリカ | 3,697,053,240 | 1.49 |
| | オーストラリア | 877,112,720 | 0.35 |
| | フランス | 324,812,782 | 0.13 |
| | イギリス | 300,574,862 | 0.12 |
| | シンガポール | 137,783,295 | 0.06 |
| | 香港 | 130,597,344 | 0.05 |
| | カナダ | 63,098,470 | 0.03 |
| | オランダ | 28,836,789 | 0.01 |
| | 小計 | 5,559,869,502 | 2.24 |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） | | 3,287,498,856 | 1.32 |
| 合計（純資産総額） | | 248,596,781,085 | 100.00 |

その他以下の取引を行っております。

| 種類 | 国/地域 | 買建/ 売建 | 投資 比率 (%) |
|----------|------|-----------|-----------------|
| 株価指数先物取引 | アメリカ | 買建 | 0.86 |
| 株価指数先物取引 | ドイツ | 買建 | 0.28 |
| 株価指数先物取引 | イギリス | 買建 | 0.14 |
| | | 買建合計 | 1.28 |

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成25年5月31日現在

| 国/ 地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 数量 | 帳簿単価 (円) | 帳簿価額 (円) | 評価額 単価 (円) | 評価額 (円) | 投資 比率 (%) |
|----------|----|-----|----|----|-------------|-------------|------------------|------------|-----------------|
|----------|----|-----|----|----|-------------|-------------|------------------|------------|-----------------|

| | | | | | | | | | |
|------|----|----------------------------------|------------------------|-----------|-----------|---------------|-----------|---------------|------|
| アメリカ | 株式 | APPLE INC | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 87,568 | 59,573.77 | 5,216,756,084 | 45,691.87 | 4,001,146,215 | 1.61 |
| アメリカ | 株式 | EXXON MOBIL CORPORATION | エネルギー | 424,407 | 8,915.98 | 3,784,005,002 | 9,317.66 | 3,954,482,758 | 1.59 |
| アメリカ | 株式 | MICROSOFT CORP | ソフトウェア・サービス | 705,067 | 2,726.80 | 1,922,577,400 | 3,544.33 | 2,498,993,927 | 1.01 |
| アメリカ | 株式 | GENERAL ELECTRIC CO | 資本財 | 975,997 | 2,137.93 | 2,086,616,584 | 2,387.84 | 2,330,532,484 | 0.94 |
| アメリカ | 株式 | CHEVRON CORPORATION | エネルギー | 182,160 | 10,703.83 | 1,949,810,073 | 12,658.62 | 2,305,896,004 | 0.93 |
| 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 | 257,957 | 7,006.71 | 1,807,431,181 | 8,700.46 | 2,244,346,675 | 0.90 |
| アメリカ | 株式 | GOOGLE INC-CL A | ソフトウェア・サービス | 24,662 | 70,141.01 | 1,729,817,623 | 88,103.49 | 2,172,808,438 | 0.87 |
| アメリカ | 株式 | INTL BUSINESS MACHINES CORP | ソフトウェア・サービス | 99,911 | 19,379.00 | 1,936,175,808 | 21,183.04 | 2,116,419,189 | 0.85 |
| スイス | 株式 | NESTLE SA-REGISTERED | 食品・飲料・タバコ | 300,303 | 6,470.26 | 1,943,041,491 | 6,862.72 | 2,060,898,106 | 0.83 |
| アメリカ | 株式 | PROCTER & GAMBLE CO | 家庭用品・パーソナル用品 | 254,503 | 7,032.00 | 1,789,667,641 | 8,002.32 | 2,036,616,024 | 0.82 |
| アメリカ | 株式 | JPMORGAN CHASE & CO | 各種金融 | 353,788 | 4,170.63 | 1,475,522,242 | 5,627.63 | 1,990,988,528 | 0.80 |
| 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 | 685,310 | 2,514.32 | 1,723,090,695 | 2,858.33 | 1,958,845,558 | 0.79 |
| アメリカ | 株式 | WELLS FARGO & COMPANY | 銀行 | 465,435 | 3,355.12 | 1,561,594,373 | 4,173.67 | 1,942,574,423 | 0.78 |
| イギリス | 株式 | HSBC HOLDINGS PLC | 銀行 | 1,712,446 | 972.11 | 1,664,700,608 | 1,133.72 | 1,941,447,190 | 0.78 |
| アメリカ | 株式 | AT&T INC | 電気通信サービス | 528,955 | 3,433.03 | 1,815,922,297 | 3,591.88 | 1,899,948,174 | 0.76 |
| 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 | 65,392 | 19,325.95 | 1,263,762,783 | 25,711.36 | 1,681,317,776 | 0.68 |
| 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 | 214,095 | 6,114.93 | 1,309,177,115 | 7,366.56 | 1,577,143,984 | 0.63 |
| アメリカ | 株式 | COCA-COLA CO/THE | 食品・飲料・タバコ | 375,708 | 3,841.80 | 1,443,396,722 | 4,125.10 | 1,549,836,301 | 0.62 |
| アメリカ | 株式 | CITIGROUP INC | 各種金融 | 272,885 | 3,562.54 | 972,165,856 | 5,389.85 | 1,470,811,564 | 0.59 |
| アメリカ | 株式 | PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC. | 食品・飲料・タバコ | 155,482 | 9,139.58 | 1,421,041,639 | 9,351.05 | 1,453,920,826 | 0.58 |
| アメリカ | 株式 | BANK OF AMERICA CORP | 各種金融 | 1,002,930 | 994.59 | 997,513,576 | 1,399.31 | 1,403,419,405 | 0.56 |
| イギリス | 株式 | VODAFONE GROUP PLC | 電気通信サービス | 4,580,772 | 246.49 | 1,129,141,974 | 297.33 | 1,362,027,507 | 0.55 |
| アメリカ | 株式 | MERCK & CO. INC. | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 282,937 | 4,523.75 | 1,279,938,460 | 4,762.54 | 1,347,499,515 | 0.54 |
| アメリカ | 株式 | VERIZON COMMUNICATIONS INC | 電気通信サービス | 265,655 | 4,453.94 | 1,183,212,387 | 4,965.91 | 1,319,219,989 | 0.53 |
| イギリス | 株式 | BP PLC | エネルギー | 1,774,261 | 663.99 | 1,178,106,820 | 736.86 | 1,307,397,892 | 0.53 |
| アメリカ | 株式 | ORACLE CORPORATION | ソフトウェア・サービス | 358,765 | 3,221.57 | 1,155,786,991 | 3,474.52 | 1,246,536,598 | 0.50 |
| フランス | 株式 | SANOFI | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 110,946 | 9,167.26 | 1,017,070,961 | 11,087.27 | 1,230,089,278 | 0.49 |
| 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 | 494,059 | 1,923.43 | 950,288,791 | 2,465.75 | 1,218,229,240 | 0.49 |
| イギリス | 株式 | GLAXOSMITHKLINE PLC | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 457,133 | 2,081.35 | 951,454,043 | 2,652.91 | 1,212,734,169 | 0.49 |
| イギリス | 株式 | ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS | エネルギー | 347,888 | 3,215.23 | 1,118,540,699 | 3,428.60 | 1,192,770,640 | 0.48 |

□ 種類別・業種別の投資比率

平成25年5月31日現在

| 種類 | 業種 | 投資比率(%) |
|--------|-------|---------|
| 株式(外国) | 医薬品 | 0.07 |
| | エネルギー | 10.48 |
| | 素材 | 5.94 |

| | | |
|------------------------|---|-------|
| 資本財 | | 7.36 |
| 商業・専門サービス | | 0.99 |
| 運輸 | | 1.77 |
| 自動車・自動車部品 | | 1.52 |
| 耐久消費財・アパレル | | 1.53 |
| 消費者サービス | | 1.53 |
| メディア | | 2.89 |
| 小売 | | 3.10 |
| 食品・生活必需品小売り | | 2.27 |
| 食品・飲料・タバコ | | 6.69 |
| 家庭用品・パーソナル用品 | | 1.87 |
| ヘルスケア機器・サービス | | 2.81 |
| 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | | 8.61 |
| 銀行 | | 7.59 |
| 各種金融 | | 5.53 |
| 保険 | | 4.51 |
| 不動産 | | 0.66 |
| ソフトウェア・サービス | | 6.29 |
| テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | | 4.12 |
| 電気通信サービス | | 3.58 |
| 公益事業 | | 3.37 |
| 半導体・半導体製造装置 | | 1.36 |
| 投資証券 | - | 2.24 |
| 合計 | | 98.68 |

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

平成25年5月31日現在

| 種類 | 取引所等 | 名称 | 買建/ 売建 | 数量 | 簿価 (円) | 時価 (円) | 投資 比率 (%) |
|--------------|----------------------------|--------------|-----------|-----|---------------|---------------|-----------------|
| 株価指数 先物取引 | シカゴ商業取引所 | SP500 13/06 | 買建 | 51 | 2,138,050,313 | 2,133,218,412 | 0.86 |
| 株価指数 先物取引 | ユーレックス・ド イツ金融先物取引 所 | DJ EUR 13/06 | 買建 | 187 | 690,724,034 | 689,955,499 | 0.28 |
| 株価指数 先物取引 | ロンドン国際金融 先物オプション取 引所 | FTSE 13/06 | 買建 | 34 | 354,836,075 | 347,596,334 | 0.14 |
| | | | 買建合計 | 272 | 3,183,610,422 | 3,170,770,245 | 1.28 |

(注) 主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

〔外国債券パッシブ・マザーファンド〕

(1) 投資状況

平成25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 | 109,641,555,740 | 40.16 |
| | フランス | 26,488,268,504 | 9.70 |
| | イタリア | 25,651,803,820 | 9.40 |
| | ドイツ | 23,330,889,018 | 8.55 |
| | イギリス | 19,647,432,904 | 7.20 |
| | スペイン | 13,052,157,971 | 4.78 |
| | ベルギー | 7,266,529,177 | 2.66 |
| | オランダ | 7,227,297,705 | 2.65 |
| | カナダ | 7,113,370,467 | 2.61 |
| | オーストリア | 4,791,766,484 | 1.76 |
| | オーストラリア | 4,083,288,787 | 1.50 |
| | メキシコ | 2,823,225,651 | 1.03 |
| | デンマーク | 2,262,682,579 | 0.83 |
| | アイルランド | 2,248,517,467 | 0.82 |
| | ポーランド | 1,841,462,104 | 0.67 |
| | フィンランド | 1,773,970,475 | 0.65 |
| | スウェーデン | 1,676,371,928 | 0.61 |
| | マレーシア | 1,606,638,235 | 0.59 |
| | 南アフリカ | 1,531,170,302 | 0.56 |
| | スイス | 1,036,362,238 | 0.38 |
| シンガポール | 1,031,599,536 | 0.38 | |
| ノルウェー | 850,476,180 | 0.31 | |
| | 小計 | 266,976,837,272 | 97.80 |
| 現金・預金・その他の資産（負債控除後） | | 6,012,358,763 | 2.20 |
| 合計（純資産総額） | | 272,989,196,035 | 100.00 |

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ 主要投資銘柄（上位30銘柄）

平成25年5月31日現在

| 国 / 地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿単価 (円) | 帳簿価額 (円) | 評価額 単価 (円) | 評価額 (円) | 利率 (%) | 償還期限 | 投資 比率 (%) |
|--------|------|--------------------------|------------|-------------|---------------|------------------|---------------|-----------|------------|-----------------|
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 0.25 | 14,000,000 | 10,101.40 | 1,414,196,028 | 10,102.19 | 1,414,306,687 | 0.250 | 2015/07/15 | 0.52 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 0.25 | 14,000,000 | 10,097.44 | 1,413,642,693 | 10,095.07 | 1,413,310,703 | 0.250 | 2015/09/15 | 0.52 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 0.25 | 13,000,000 | 10,116.41 | 1,315,134,478 | 10,120.37 | 1,315,648,289 | 0.250 | 2015/01/15 | 0.48 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 0.25 | 13,000,000 | 10,105.35 | 1,313,695,825 | 10,109.30 | 1,314,209,636 | 0.250 | 2015/05/15 | 0.48 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 1.625 | 13,000,000 | 9,865.06 | 1,282,458,778 | 9,748.06 | 1,267,247,881 | 1.625 | 2022/11/15 | 0.46 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 0.375 | 12,000,000 | 10,125.11 | 1,215,013,706 | 10,096.65 | 1,211,598,887 | 0.375 | 2016/03/15 | 0.44 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 2.75 | 13,000,000 | 9,318.47 | 1,211,401,833 | 9,091.97 | 1,181,956,303 | 2.750 | 2042/11/15 | 0.43 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 3.625 | 10,000,000 | 11,909.89 | 1,190,989,780 | 11,559.02 | 1,155,902,458 | 3.625 | 2021/02/15 | 0.42 |
| フランス | 国債証券 | FRANCE O.A.T. 3 | 8,000,000 | 14,481.95 | 1,158,556,016 | 14,411.74 | 1,152,939,798 | 3.000 | 2022/04/25 | 0.42 |
| フランス | 国債証券 | FRANCE O.A.T. 4.25 | 7,400,000 | 15,773.17 | 1,167,215,231 | 15,559.79 | 1,151,425,161 | 4.250 | 2019/04/25 | 0.42 |

| | | | | | | | | | | |
|------|------|-----------------------|------------|-----------|---------------|-----------|---------------|-------|------------|------|
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 2.125 | 11,000,000 | 10,664.21 | 1,173,063,535 | 10,374.11 | 1,141,152,306 | 2.125 | 2021/08/15 | 0.42 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 1 | 11,000,000 | 10,228.66 | 1,125,153,218 | 10,200.20 | 1,122,022,962 | 1.000 | 2014/05/15 | 0.41 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 2.125 | 10,500,000 | 10,487.93 | 1,101,233,634 | 10,404.54 | 1,092,477,213 | 2.125 | 2014/11/30 | 0.40 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 1.875 | 10,000,000 | 10,696.62 | 1,069,662,312 | 10,558.29 | 1,055,829,114 | 1.875 | 2017/09/30 | 0.39 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 2.5 | 10,000,000 | 10,645.24 | 1,064,524,270 | 10,543.27 | 1,054,327,218 | 2.500 | 2015/04/30 | 0.39 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 2.25 | 10,000,000 | 10,543.27 | 1,054,327,218 | 10,454.73 | 1,045,473,968 | 2.250 | 2015/01/31 | 0.38 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 2.375 | 10,000,000 | 10,502.95 | 1,050,295,833 | 10,410.47 | 1,041,047,343 | 2.375 | 2014/09/30 | 0.38 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 3.625 | 9,000,000 | 11,842.10 | 1,065,789,648 | 11,561.39 | 1,040,525,634 | 3.625 | 2020/02/15 | 0.38 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 3.625 | 9,000,000 | 11,803.27 | 1,062,295,143 | 11,530.56 | 1,037,751,093 | 3.625 | 2019/08/15 | 0.38 |
| フランス | 国債証券 | FRANCE O.A.T. 3.25 | 7,000,000 | 14,821.48 | 1,037,503,829 | 14,758.40 | 1,033,088,448 | 3.250 | 2021/10/25 | 0.38 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 2.625 | 9,500,000 | 11,119.68 | 1,056,369,790 | 10,836.53 | 1,029,470,933 | 2.625 | 2020/11/15 | 0.38 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 3.375 | 9,000,000 | 11,653.09 | 1,048,778,128 | 11,399.34 | 1,025,941,490 | 3.375 | 2019/11/15 | 0.38 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 0.5 | 10,000,000 | 10,165.03 | 1,016,503,291 | 10,159.10 | 1,015,910,437 | 0.500 | 2014/10/15 | 0.37 |
| フランス | 国債証券 | FRANCE O.A.T. 3 | 7,200,000 | 14,264.87 | 1,027,071,072 | 14,052.42 | 1,011,774,268 | 3.000 | 2015/10/25 | 0.37 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 0.625 | 10,000,000 | 10,107.72 | 1,010,772,395 | 10,025.51 | 1,002,551,520 | 0.625 | 2017/08/31 | 0.37 |
| フランス | 国債証券 | FRANCE O.A.T. 5.5 | 5,500,000 | 18,333.20 | 1,008,326,154 | 18,004.62 | 990,254,232 | 5.500 | 2029/04/25 | 0.36 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 3.5 | 8,500,000 | 11,539.26 | 980,837,338 | 11,326.62 | 962,763,274 | 3.500 | 2018/02/15 | 0.35 |
| イタリア | 国債証券 | BTPS 6.5 | 5,960,000 | 15,241.38 | 908,386,248 | 16,072.72 | 957,934,588 | 6.500 | 2027/11/01 | 0.35 |
| フランス | 国債証券 | FRANCE O.A.T. 3.25 | 6,700,000 | 14,523.25 | 973,057,996 | 14,273.84 | 956,347,901 | 3.250 | 2016/04/25 | 0.35 |
| アメリカ | 国債証券 | US TREASURY N/B 2.5 | 9,000,000 | 10,634.17 | 957,075,852 | 10,528.25 | 947,542,799 | 2.500 | 2015/03/31 | 0.35 |

ロ 種類別の投資比率

平成25年5月31日現在

| 種類 | 投資比率（％） |
|------|---------|
| 国債証券 | 97.80 |
| 合計 | 97.80 |

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25年5月31日現在

| 資産の種類 | 国/地域 | 時価合計 (円) | 投資比率 (％) |
|-------|------|---------------|-------------|
| 国債証券 | 日本 | 1,314,919,350 | 98.46 |

| | | |
|---------------------|---------------|--------|
| 現金・預金・その他の資産(負債控除後) | 20,503,516 | 1.54 |
| 合計(純資産総額) | 1,335,422,866 | 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25年5月31日現在

| 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿単価(円) | 帳簿価額(円) | 評価額単価(円) | 評価額(円) | 利率(%) | 償還期限 | 投資比率(%) |
|------|------|----------------|-------------|---------|-------------|----------|-------------|-------|------------|---------|
| 日本 | 国債証券 | 第253回利付国債(10年) | 645,000,000 | 100.57 | 648,677,470 | 100.44 | 647,857,350 | 1.600 | 2013/09/20 | 48.51 |
| 日本 | 国債証券 | 第260回利付国債(10年) | 220,000,000 | 101.66 | 223,652,000 | 101.55 | 223,416,600 | 1.600 | 2014/06/20 | 16.73 |
| 日本 | 国債証券 | 第258回利付国債(10年) | 220,000,000 | 101.10 | 222,420,600 | 100.94 | 222,087,800 | 1.300 | 2014/03/20 | 16.63 |
| 日本 | 国債証券 | 第256回利付国債(10年) | 220,000,000 | 100.87 | 221,917,330 | 100.70 | 221,557,600 | 1.400 | 2013/12/20 | 16.59 |

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25年5月31日現在

| 種類 | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 国債証券 | 98.46 |
| 合計 | 98.46 |

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

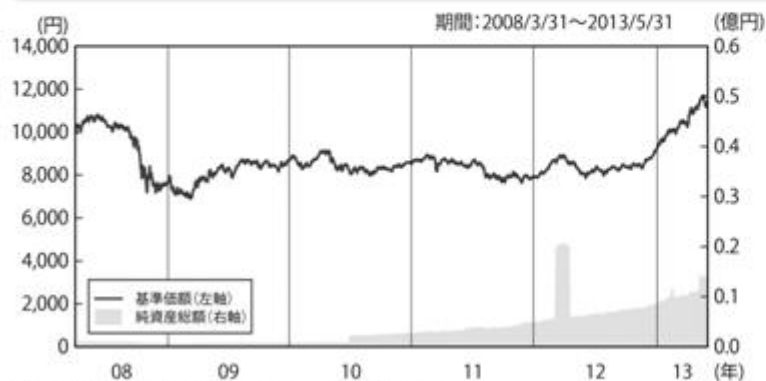
該当事項はありません。

〔参考情報〕

基準日2013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、1万口当たり、信託報酬控除後です。

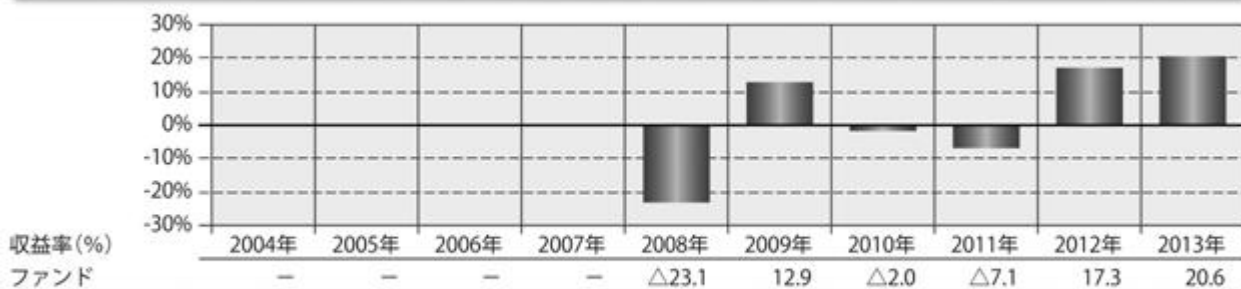
| | |
|-------|---------|
| 基準価額 | 11,188円 |
| 純資産総額 | 0.14億円 |

分配の推移

| 決算期 | 分配金 |
|---------|-----|
| 2013年4月 | 0円 |
| 2012年4月 | 0円 |
| 2011年4月 | 0円 |
| 2010年4月 | 0円 |
| 2009年4月 | 0円 |
| 設定来累計 | 0円 |

※分配金は1万口当たり、税引前です。

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。
2013年のファンドの収益率は、年初から2013年5月31日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 | http://www.smam-jp.com |

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

ヘ 申込取扱場所・払込取扱場所

販売会社において申込み・払込みを取り扱います。

ト 払込期日

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

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

2【換金（解約）手続等】

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

お買付けの販売会社にお申し出ください。

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

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

一部解約金は、解約請求受付日から起算して5営業日目からお支払いします。

一部解約価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額となります。

一部解約価額は、委託会社の営業日において日々算出されますので、委託会社（電話：0120-88-2976）にお問い合わせいただければ、いつでもお知らせします。

委託会社は、取引所等における取引の停止、決済機能の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止すること、および既に受け付けた一部解約の実行請求を取り消すことがあります。この場合、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして、上記に準じた取扱いとなります。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

イ 基準価額の算出方法

基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入れ有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます（基準価額は、便宜上1万口単位で表示される場合があります。）。

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

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、「DC2040」として掲載されます。

委託会社に対する照会は下記においてできます。

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

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

(2)【保管】

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

がって、受益証券の保管に関する該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

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

(4) 【計算期間】

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

(5) 【その他】

イ 信託の終了

(イ) 信託契約の解約

- a. 委託会社は、当ファンドの信託契約を解約することが受益者にとって有利であると認めるとき、残存口数が1億口を下回ることとなったとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、上記aの事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。
- c. 書面決議において、受益者（委託会社等を除きます。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、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場合もあるため、将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。
- b. 分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日の翌営業日に再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(ロ) 償還金

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

八 信託約款の変更等

- (イ) 委託会社は、当ファンドの信託約款を変更することが受益者の利益のため必要と認めるとき、監督官庁より変更の命令を受けたとき、その他やむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意の上、当ファンドの信託約款を変更すること、または当ファンドと他のファンドとの併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨および内容を監督官庁に届け出ます。
- (ロ) 委託会社は、上記(イ)の事項(変更についてはその内容が重大なものに限ります。以下、併合と合わせて「重大な信託約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な信託約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- (ハ) 上記(ロ)の書面決議において、受益者(委託会社等を除きます。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、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使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います(書面決議は、当ファンドのすべての受益者に対してその効力を生じます。)
- (ホ) 上記(ロ)から(ニ)までの取扱いは、委託会社が重大な信託約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- (ヘ) 上記にかかわらず、当ファンドと他のファンドとの併合の場合は、当ファンドにおいて併合の書面決議が可決された場合であっても、相手方となる他のファンドにおいて当該併合の書面決議が否決された場合は、併合を行うことはできません。

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。

ヘ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

ト 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

チ 運用にかかる報告書の開示方法

委託会社は毎決算後、投資信託及び投資法人に関する法律の規定に従い、期中の運用経過のほか、信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した「運用報告書」を作成します。運用報告書は、原則として、あらかじめ受益者が申し出た住所に販売会社から届けられます。

4【受益者の権利等】

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

受益者の有する主な権利は次の通りです。

イ 分配金請求権

受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。当ファンドは、現時点では、分配金自動再投資コースのみの取扱いしかありませんので、収益分配金は、原則として、税金を差し引いた後、毎計算期間終了日の翌営業日に再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

ロ 償還金請求権

受益者は、持分に応じて償還金を請求する権利を有します。償還金は、信託終了後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日から起算して5営業日目まで）から、販売会社において、原則として、償還日の振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として）に支払われます。償還金は、受益者がその支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、受益者はその権利を失い、当該金銭は、委託会社に帰属します。

ハ 一部解約実行請求権

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

ニ 書面決議における議決権および受益権の買取請求権

委託会社が、当ファンドの解約（監督官庁の命令による解約等の場合を除きます。）または、重大な信託約款の変更等を行おうとする場合において、受益者は、それぞれの書面決議手続きにおいて、受益権の口数に応じて議決権を有しこれを行行使することができます。書面決議の結果、当ファンドの解約または重大な信託約款の変更等が行われる場合は、書面決議において当該議案に反対した受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買い取るべき旨の請求ができます。

ホ 帳簿閲覧・謄写請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
2. 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第5期（平成24年4月14日から平成25年4月15日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

| | 第4期 (平成24年4月13日現在) | 第5期 (平成25年4月15日現在) |
|-----------------|-----------------------|-----------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 42,074 | 56,461 |
| 親投資信託受益証券 | 20,205,898 | 10,675,172 |
| 未収入金 | - | 250,000 |
| 流動資産合計 | 20,247,972 | 10,981,633 |
| 資産合計 | | |
| | 20,247,972 | 10,981,633 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払受託者報酬 | 1,275 | 1,462 |
| 未払委託者報酬 | 16,547 | 18,831 |
| その他未払費用 | 127 | 200 |
| 流動負債合計 | 17,949 | 20,493 |
| 負債合計 | | |
| | 17,949 | 20,493 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 23,475,308 | 9,946,291 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金() | 3,245,285 | 1,014,849 |
| 元本等合計 | 20,230,023 | 10,961,140 |
| 純資産合計 | | |
| | 20,230,023 | 10,961,140 |
| 負債純資産合計 | | |
| | 20,247,972 | 10,981,633 |

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第4期 | 第5期 |
|-------------------------|--------------------------------|--------------------------------|
| | 自 平成23年 4月14日 至 平成24年 4月13日 | 自 平成24年 4月14日 至 平成25年 4月15日 |
| 営業収益 | | |
| 有価証券売買等損益 | 13,140 | 2,299,274 |
| 営業収益合計 | 13,140 | 2,299,274 |
| 営業費用 | | |
| 受託者報酬 | 1,833 | 2,556 |
| 委託者報酬 | 23,936 | 33,144 |
| その他費用 | 158 | 307 |
| 営業費用合計 | 25,927 | 36,007 |
| 営業利益又は営業損失（ ） | 39,067 | 2,263,267 |
| 経常利益又は経常損失（ ） | 39,067 | 2,263,267 |
| 当期純利益又は当期純損失（ ） | 39,067 | 2,263,267 |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額 | - | 151,720 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ） | 478,667 | 3,245,285 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | - | 2,615,259 |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | - | 2,615,259 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 2,727,551 | 466,672 |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 2,727,551 | 466,672 |
| 分配金 | - | - |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 3,245,285 | 1,014,849 |

(3) 【注記表】
(重要な会計方針の注記)

| 項目 | 第5期 | |
|----------------------------|---|--|
| | 自 平成24年 4月14日 至 平成25年 4月15日 | |
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p> | |
| 2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>計算期間の取扱い 当計算期間は当期末が休日のため、平成24年 4月14日から平成25年 4月15日までとなっております。</p> | |

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | 第4期 | 第5期 |
|---------------|---|----------------------------------|
| | (平成24年 4月13日現在) | (平成25年 4月15日現在) |
| 1. 受益権総数 | 当計算期間の末日における受益権の総数 23,475,308口 | 当計算期間の末日における受益権の総数 9,946,291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 3,245,285円 | |
| 3. 1単位当たり純資産額 | 0.8618円 (1万口 = 8,618円) | 1.1020円 (1万口 = 11,020円) |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 項目 | 第4期 | 第5期 |
|----------|---|---|
| | 自 平成23年 4月14日 至 平成24年 4月13日 | 自 平成24年 4月14日 至 平成25年 4月15日 |
| 分配金の計算過程 | <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（162,395円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（1,303,156円）、および分配準備積立金（90,023円）より、分配対象収益は1,555,574円（1万口当たり662.64円）であります。分配を行っておりません。</p> | <p>計算期間末における費用控除後の配当等収益（185,677円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（1,849,718円）、収益調整金（607,630円）、および分配準備積立金（57,194円）より、分配対象収益は2,700,219円（1万口当たり2,714.79円）であります。分配を行っておりません。</p> |

(金融商品に関する注記)

・金融商品の状況に関する事項

| 項目 | <p style="text-align: center;">第5期 自 平成24年 4月14日 至 平成25年 4月15日</p> |
|----------------------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | <p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p> |
| 2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | <p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、親投資信託受益証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p> |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | <p>リスク管理の実効性を高め、またコンプライアンスの徹底を図るために運用部門から独立した組織を設置し、投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況にかかる、信託約款・社内ルール等において定める各種投資制限・リスク指標のモニタリングおよびファンドの運用パフォーマンスの測定・分析・評価についての確認等を行っています。投資リスクや法令・諸規則等の遵守状況等にかかる確認結果等については、運用評価、リスク管理およびコンプライアンスに関する委員会をそれぞれ設け、報告が義務づけられています。</p> <p>また、とりわけ、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクの管理体制については、各種リスクごとに管理項目、測定項目、上下限值、管理レベルおよび頻度等を定めて当該リスクの管理を実施しております。当該リスクを管理する部署では、原則として速やかに是正・修正等を行う必要がある状況の場合は、関連する運用グループに是正勧告あるいは報告が行われ、当該関連運用グループは、必要な対処の実施あるいは対処方針の決定を行います。その後、当該関連運用グループの対処の実施や対処方針の決定等に関し、必要に応じてリスク管理を行う部署が当該部署の担当役員、当該関連運用グループの担当役員およびリスク管理委員会へ報告を行う体制となっております。</p> <p>なお、他の運用会社が設定・運用を行うファンド（外部ファンド）を組入れる場合には、当該外部ファンドの運用会社にかかる経営の健全性、運用もしくはリスク管理の適切性も含め、外部ファンドの適格性等に関して、運用委託先を管理する部会にて、定期的に審議する体制となっております。加えて、外部ファンドの組入れは、原則として、運用実績の優位性、運用会社の信用力・運用体制・資産管理体制の状況を確認の上選定するものとし、また、定性・定量面における評価を継続的に実施し、投資対象としての適格性を判断しております。</p> |
| 4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって認める評価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引にかかる市場リスクを示すものではありません。</p> |

・金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | 第5期 (平成25年 4月15日現在) | |
|------------|--|--|
| | 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | (1) 有価証券（親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。 (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4期（自 平成23年4月14日 至 平成24年4月13日）

| 種類 | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|-----------|-------------------|
| 親投資信託受益証券 | 11,497円 |
| 合計 | 11,497円 |

第5期（自 平成24年4月14日 至 平成25年4月15日）

| 種類 | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|-----------|-------------------|
| 親投資信託受益証券 | 2,041,783円 |
| 合計 | 2,041,783円 |

(デリバティブ取引に関する注記)

第4期（平成24年4月13日現在）

該当事項はありません。

第5期（平成25年4月15日現在）

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第4期（自 平成23年4月14日 至 平成24年4月13日）

該当事項はありません。

第5期（自 平成24年4月14日 至 平成25年4月15日）

該当事項はありません。

(その他の注記)

| 項目 | 第4期 (平成24年 4月13日現在) | 第5期 (平成25年 4月15日現在) |
|-----------|------------------------|------------------------|
| | 期首元本額 | 3,608,830円 |
| 期中追加設定元本額 | 19,866,478円 | 5,765,406円 |
| 期中一部解約元本額 | 円 | 19,294,423円 |

(4) 【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

| 種類 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|---------------|----------------------------|-----------|------------|----|
| 親投資信託 受益証券 | 国内株式インデックス・マザー ファンド（B号） | 2,247,070 | 3,538,011 | |
| | 外国株式インデックス・マザー ファンド | 1,383,687 | 2,584,588 | |
| | 外国債券パッシブ・マザーファン ド | 1,406,052 | 2,092,767 | |
| | 国内債券パッシブ・マザーファン ド | 1,963,731 | 2,254,363 | |
| | マネーインカム・マザーファン ド | 203,309 | 205,443 | |
| | 親投資信託受益証券 小計 | 7,203,849 | 10,675,172 | |
| 合計 | | 7,203,849 | 10,675,172 | |

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

(参考情報)

[「国内株式インデックス・マザーファンド（B号）」の状況](#)

[「国内債券パッシブ・マザーファンド」の状況](#)

[「外国株式インデックス・マザーファンド」の状況](#)

[「外国債券パッシブ・マザーファンド」の状況](#)

[「マネーインカム・マザーファンド」の状況](#)

2 【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成25年5月31日現在

| | |
|----------------|--------------|
| 資産総額 | 13,857,404 円 |
| 負債総額 | 33,408 円 |
| 純資産総額（ - ） | 13,823,996 円 |
| 発行済口数 | 12,356,643 口 |
| 1口当たり純資産額（ / ） | 1.1188 円 |
| （1万口当たり純資産額 | 11,188 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てします。
- 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てします。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てします。
- 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てします。

ヘ 償還金

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

ト 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

イ 資本金の額および株式数

| | |
|--------------|--------------|
| | 平成25年5月31日現在 |
| 資本金の額 | 2,000百万円 |
| 会社が発行する株式の総数 | 60,000 株 |
| 発行済株式総数 | 17,640 株 |

ロ 最近5年間における資本金の額の増減 該当ありません。

ハ 会社の機構

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

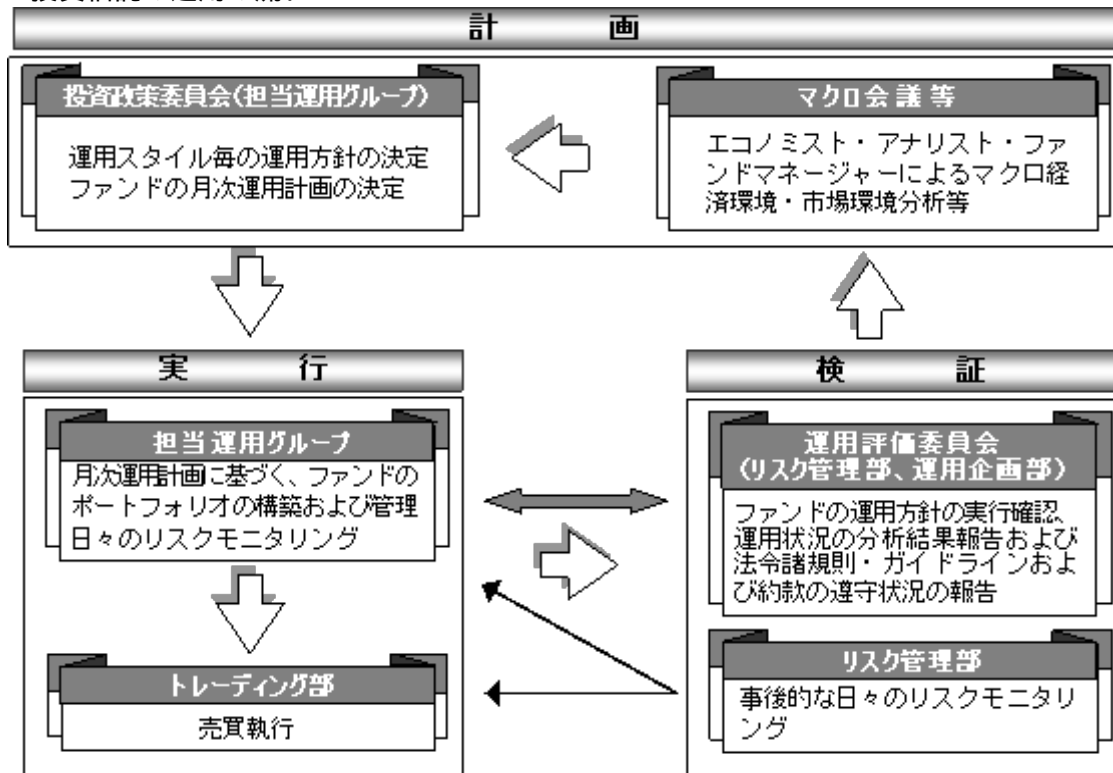
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役を若干名を選定します。

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

二 投資信託の運用の流れ



2【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用

(投資運用業)を行っています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行っています。

平成25年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25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 | 17 (5) | 71,159 (28,669) |
| | 追加型 | 352 (150) | 5,655,875 (3,482,132) |
| | 計 | 369 (155) | 5,727,034 (3,510,802) |
| 公社債投資信託 | 単位型 | 0 (0) | 0 (0) |
| | 追加型 | 4 (1) | 267,044 (184,500) |
| | 計 | 4 (1) | 267,044 (184,500) |
| 合計 | | 373 (156) | 5,994,079 (3,695,302) |

()内は、私募投資信託分であり、内書き表記しております。

3【委託会社等の経理状況】

- 1 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。)並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)に基づいて作成しております。
- 2 当社は、第28期(平成24年4月1日から平成25年3月31日まで)の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、有限責任 あずさ監査法人の監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

| | | 第 27 期 (平成24年3月31日) | 第 28 期 (平成25年3月31日) |
|----------|---|------------------------|------------------------|
| (資産の部) | | | |
| 流動資産 | | | |
| 現金及び預金 | 2 | 15,970,870 | 17,748,821 |
| 有価証券 | | 3,999,305 | 3,999,613 |
| 前払費用 | | 259,411 | 260,095 |
| 未収入金 | | 32,426 | 7,550 |
| 未収委託者報酬 | | 3,392,765 | 3,641,029 |
| 未収運用受託報酬 | | 305,910 | 439,648 |
| 未収投資助言報酬 | 2 | 452,618 | 470,228 |
| 未収収益 | | 14,092 | 12,379 |
| 繰延税金資産 | | 155,946 | 230,101 |

| | | | |
|------------|---|------------|------------|
| その他の流動資産 | | 9,011 | 15,233 |
| 流動資産計 | | 24,592,358 | 26,824,700 |
| 固定資産 | | | |
| 有形固定資産 | 1 | | |
| 建物 | | 130,525 | 138,920 |
| 器具備品 | | 201,264 | 153,518 |
| 有形固定資産合計 | | 331,789 | 292,438 |
| 無形固定資産 | 1 | | |
| ソフトウェア | | 241,251 | 487,128 |
| ソフトウェア仮勘定 | | 32,852 | 1,805 |
| 電話加入権 | | 126 | 115 |
| 商標権 | | 2,271 | 809 |
| 無形固定資産合計 | | 276,502 | 489,857 |
| 投資その他の資産 | | | |
| 投資有価証券 | | 6,720,330 | 6,914,557 |
| 関係会社株式 | | 234,921 | 234,311 |
| 長期差入保証金 | | 681,196 | 553,412 |
| 長期前払費用 | | 16,958 | 13,881 |
| 会員権 | | 9,480 | 9,480 |
| 繰延税金資産 | | 589,332 | 409,440 |
| 投資その他の資産合計 | | 8,252,219 | 8,135,083 |
| 固定資産計 | | 8,860,511 | 8,917,379 |
| 資産合計 | | 33,452,870 | 35,742,080 |

(単位：千円)

| | 第 27 期 (平成24年 3月31日) | 第 28 期 (平成25年 3月31日) |
|----------|-------------------------|-------------------------|
| (負債の部) | | |
| 流動負債 | | |
| 預り金 | 47,840 | 47,693 |
| 未払金 | | |
| 未払収益分配金 | 403 | 425 |
| 未払償還金 | 106,771 | 149,880 |
| 未払手数料 | 1,893,658 | 1,899,876 |
| その他未払金 | 86,141 | 127,465 |
| 未払費用 | 930,998 | 1,235,323 |
| 未払消費税等 | 35,683 | 93,482 |
| 未払法人税等 | 264,114 | 630,796 |
| 賞与引当金 | 279,981 | 253,750 |
| その他の流動負債 | 10 | - |
| 流動負債計 | 3,645,603 | 4,438,695 |
| 固定負債 | | |
| 退職給付引当金 | 1,489,315 | 1,605,470 |
| 固定負債計 | 1,489,315 | 1,605,470 |
| 負債合計 | 5,134,919 | 6,044,166 |

| (純資産の部) | | |
|--------------|------------|------------|
| 株主資本 | | |
| 資本金 | 2,000,000 | 2,000,000 |
| 資本剰余金 | | |
| 資本準備金 | 8,628,984 | 8,628,984 |
| 資本剰余金合計 | 8,628,984 | 8,628,984 |
| 利益剰余金 | | |
| 利益準備金 | 284,245 | 284,245 |
| その他利益剰余金 | | |
| 配当準備積立金 | 60,000 | 60,000 |
| 別途積立金 | 1,476,959 | 1,476,959 |
| 繰越利益剰余金 | 15,791,435 | 16,718,237 |
| 利益剰余金合計 | 17,612,639 | 18,539,441 |
| 株主資本計 | 28,241,623 | 29,168,425 |
| 評価・換算差額等 | | |
| その他有価証券評価差額金 | 76,327 | 529,488 |
| 評価・換算差額等計 | 76,327 | 529,488 |
| 純資産合計 | 28,317,951 | 29,697,914 |
| 負債・純資産合計 | 33,452,870 | 35,742,080 |

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

| | 第 27 期 (自 平成23年 4 月 1 日 至 平成24年 3 月31日) | 第 28 期 (自 平成24年 4 月 1 日 至 平成25年 3 月31日) |
|-----------------|---|---|
| 営業収益 | | |
| 委託者報酬 | 25,467,198 | 24,965,627 |
| 運用受託報酬 | 2,001,039 | 2,123,129 |
| 投資助言報酬 | 1,743,437 | 1,675,512 |
| 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 | 31,647 | 28,389 |
| サービス支援手数料 | 99,134 | 39,868 |
| その他 | 48,776 | 51,597 |
| 営業収益計 | 29,396,234 | 28,889,125 |
| 営業費用 | | |
| 支払手数料 | 13,259,090 | 12,702,099 |
| 広告宣伝費 | 475,028 | 323,773 |
| 公告費 | 4,092 | 5,176 |
| 調査費 | | |
| 調査費 | 503,839 | 628,953 |
| 委託調査費 | 2,285,064 | 2,491,384 |
| 営業雑経費 | | |
| 通信費 | 35,155 | 34,811 |

| | | | |
|-------------|---|------------|------------|
| 印刷費 | | 199,733 | 208,926 |
| 協会費 | | 28,233 | 27,115 |
| 諸会費 | | 12,025 | 13,918 |
| 情報機器関連費 | | 1,855,475 | 1,992,553 |
| 販売促進費 | | 28,021 | 14,507 |
| その他 | | 123,714 | 103,926 |
| 営業費用計 | | 18,809,475 | 18,547,147 |
| 一般管理費 | | | |
| 給料 | | | |
| 役員報酬 | | 154,738 | 145,461 |
| 給料・手当 | | 4,427,312 | 4,393,347 |
| 賞与 | | 937,970 | 767,474 |
| 賞与引当金繰入額 | | 279,981 | 253,750 |
| 交際費 | | 20,938 | 17,677 |
| 寄付金 | | 10,026 | 24 |
| 事務委託費 | | 245,311 | 252,472 |
| 旅費交通費 | | 230,691 | 184,318 |
| 租税公課 | | 80,136 | 83,374 |
| 不動産賃借料 | | 683,098 | 670,888 |
| 退職給付費用 | | 205,957 | 173,008 |
| 固定資産減価償却費 | | 170,410 | 189,990 |
| 諸経費 | | 268,760 | 260,890 |
| 一般管理費計 | | 7,715,334 | 7,392,682 |
| 営業利益 | | 2,871,423 | 2,949,295 |
| 営業外収益 | | | |
| 受取配当金 | | 29,042 | 36,741 |
| 有価証券利息 | | 3,731 | 3,643 |
| 受取利息 | 1 | 5,916 | 5,921 |
| 時効成立分配金・償還金 | | 3,563 | 961 |
| 原稿・講演料 | | 2,745 | 2,696 |
| 還付加算金 | | - | 78 |
| 雑収入 | | 5,096 | 4,508 |
| 営業外収益計 | | 50,095 | 54,551 |
| 営業外費用 | | | |
| 為替差損 | | 15,834 | 25,770 |
| 営業外費用計 | | 15,834 | 25,770 |
| 経常利益 | | 2,905,684 | 2,978,076 |
| 特別利益 | | | |
| 投資有価証券売却益 | | 13,806 | 52,516 |
| 受取和解金 | | 108,451 | - |
| 特別利益計 | | 122,258 | 52,516 |
| 特別損失 | | | |
| 固定資産除却損 | 2 | 12,873 | 2,409 |
| 投資有価証券償還損 | | 3,180 | 3,224 |
| 投資有価証券評価損 | | 301 | 18,303 |
| 投資有価証券売却損 | | 6,578 | 61,282 |
| 関係会社株式評価損 | | - | 610 |

| | | |
|--------------|-----------|-----------|
| ゴルフ会員権評価損 | 10,633 | - |
| 合併関連費用 | - | 70,655 |
| 事務所移転費用 | - | 13,795 |
| 特別損失計 | 33,566 | 170,280 |
| 税引前当期純利益 | 2,994,376 | 2,860,311 |
| 法人税、住民税及び事業税 | 1,195,768 | 1,223,890 |
| 法人税等調整額 | 136,130 | 119,459 |
| 法人税等合計 | 1,331,898 | 1,104,430 |
| 当期純利益 | 1,662,477 | 1,755,881 |

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

| | 第 27 期 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月 31日) | 第 28 期 (自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月 31日) |
|----------|---|---|
| 株主資本 | | |
| 資本金 | | |
| 当期首残高 | 2,000,000 | 2,000,000 |
| 当期末残高 | 2,000,000 | 2,000,000 |
| 資本剰余金 | | |
| 資本準備金 | | |
| 当期首残高 | 8,628,984 | 8,628,984 |
| 当期末残高 | 8,628,984 | 8,628,984 |
| 資本剰余金合計 | | |
| 当期首残高 | 8,628,984 | 8,628,984 |
| 当期末残高 | 8,628,984 | 8,628,984 |
| 利益剰余金 | | |
| 利益準備金 | | |
| 当期首残高 | 284,245 | 284,245 |
| 当期末残高 | 284,245 | 284,245 |
| その他利益剰余金 | | |
| 配当準備積立金 | | |
| 当期首残高 | 60,000 | 60,000 |
| 当期末残高 | 60,000 | 60,000 |
| 別途積立金 | | |
| 当期首残高 | 1,476,959 | 1,476,959 |
| 当期末残高 | 1,476,959 | 1,476,959 |
| 繰越利益剰余金 | | |
| 当期首残高 | 15,381,398 | 15,791,435 |
| 当期変動額 | | |
| 剰余金の配当 | 1,252,440 | 829,080 |
| 当期純利益 | 1,662,477 | 1,755,881 |
| 当期変動額合計 | 410,037 | 926,801 |
| 当期末残高 | 15,791,435 | 16,718,237 |
| 利益剰余金合計 | | |

| | | |
|-------------------------|------------|------------|
| 当期首残高 | 17,202,602 | 17,612,639 |
| 当期変動額 | | |
| 剰余金の配当 | 1,252,440 | 829,080 |
| 当期純利益 | 1,662,477 | 1,755,881 |
| 当期変動額合計 | 410,037 | 926,801 |
| 当期末残高 | 17,612,639 | 18,539,441 |
| 株主資本合計 | | |
| 当期首残高 | 27,831,586 | 28,241,623 |
| 当期変動額 | | |
| 剰余金の配当 | 1,252,440 | 829,080 |
| 当期純利益 | 1,662,477 | 1,755,881 |
| 当期変動額合計 | 410,037 | 926,801 |
| 当期末残高 | 28,241,623 | 29,168,425 |
| 評価・換算差額等 | | |
| その他有価証券評価差額金 | | |
| 当期首残高 | 110,498 | 76,327 |
| 当期変動額 | | |
| 株主資本以外の項目の当期変動額 (純額) | 34,170 | 453,160 |
| 当期変動額合計 | 34,170 | 453,160 |
| 当期末残高 | 76,327 | 529,488 |
| 評価・換算差額合計 | | |
| 当期首残高 | 110,498 | 76,327 |
| 当期変動額 | | |
| 株主資本以外の項目の当期変動額 (純額) | 34,170 | 453,160 |
| 当期変動額合計 | 34,170 | 453,160 |
| 当期末残高 | 76,327 | 529,488 |
| 純資産合計 | | |
| 当期首残高 | 27,942,085 | 28,317,951 |
| 当期変動額 | | |
| 剰余金の配当 | 1,252,440 | 829,080 |
| 当期純利益 | 1,662,477 | 1,755,881 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額 (純額) | 34,170 | 453,160 |
| 当期変動額合計 | 375,866 | 1,379,962 |
| 当期末残高 | 28,317,951 | 29,697,914 |

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 満期保有目的の債券

償却原価法

(2) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法

(3) その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

時価のないもの

移動平均法による原価法

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 3～50年

器具備品 3～20年

（会計上の見積りの変更と区別することが困難な会計方針の変更）

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

(2) 無形固定資産

定額法によっております。

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

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

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

過去勤務債務については、その発生時において一時に費用処理しております。

数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は税抜方式によっております。

5. 未適用の会計基準等

「退職給付に関する会計基準」（企業会計基準第26号 平成24年5月17日）及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第25号 平成24年5月17日）

(1) 概要

退職給付債務及び勤務費用の計算方法並びに開示の拡充の改正（退職給付見込額の期間帰属方法について、期間定額基準のほか給付算定式基準の適用が可能となったほか、割引率の算定方法の改正等）

(2) 適用予定日

平成25年4月1日以後開始する事業年度の期末から適用予定であります。ただし、退職給付債務及び勤務費用の計算方法の改正については、平成26年4月1日以後開始する事業年度の期首から適用予定であります。

(3)当該会計基準等の適用による影響

財務諸表作成時において財務諸表に与える影響は、現在評価中であります。

注 記 事 項

(貸借対照表関係)

| 第27期 (平成24年 3月31日) | 第28期 (平成25年 3月31日) |
|--|--|
| <p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建 物 210,710千円</p> <p>器具備品 624,552千円</p> <p>無形固定資産の減価償却累計額</p> <p>ソフトウェア 127,910千円</p> <p>電話加入権 107千円</p> <p>商標権 17,170千円</p> | <p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <p>建 物 223,463千円</p> <p>器具備品 698,449千円</p> <p>無形固定資産の減価償却累計額</p> <p>ソフトウェア 206,084千円</p> <p>電話加入権 118千円</p> <p>商標権 18,632千円</p> |
| <p>2 関係会社に対する債権債務</p> <p>現金及び預金 10,360,214千円</p> <p>未収投資助言報酬 283,244千円</p> <p>未払手数料 436,830千円</p> | <p>2 関係会社に対する債権債務</p> <p>現金及び預金 13,031,110千円</p> <p>未収投資助言報酬 289,597千円</p> <p>未払手数料 446,096千円</p> |
| <p>3 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座貸越契約を締結しております。</p> <p>当事業年度末における当座貸越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。</p> <p>当座貸越極度額の総額 10,000,000千円</p> <p>借入実行残高 - 千円</p> <p>差引額 10,000,000千円</p> | <p>3 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行1行と当座貸越契約を締結しております。</p> <p>当事業年度末における当座貸越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。</p> <p>当座貸越極度額の総額 10,000,000千円</p> <p>借入実行残高 - 千円</p> <p>差引額 10,000,000千円</p> |
| <p>4 当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York)Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成27年6月までの賃借料総額56,653千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45,184千円の支払保証を行っております。</p> |

(損益計算書関係)

| 第27期 (自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日) | 第28期 (自 平成24年 4月 1日 至 平成25年 3月31日) |
|--|---|
| <p>1 関係会社との取引に係るもの 受取利息 2,455千円</p> | <p>1 関係会社との取引に係るもの 受取利息 2,015千円</p> |
| <p>2 固定資産除却損は、器具備品12,873千円 あります。</p> | <p>2 固定資産除却損は、建物1,889千円、器具備品519千円 あります。</p> |

(株主資本等変動計算書関係)

第27期(自 平成23年 4月 1日 至 平成24年 3月31日)

1.発行済株式数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額等

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

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生が翌事業年度になるもの
平成24年6月25日開催の第27回定時株主総会において次の通り付議いたします。

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

第28期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

1. 発行済株式数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額等

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

(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25年6月24日開催の第28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25年6月24日 定時株主総会 | 普通株式 | 利益剰余金 | 864,360 | 49,000 | 平成25年 3月31日 | 平成25年 6月25日 |

(リース取引関係)

| 第27期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日) | 第28期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日) |
|---|---|
| 1. オペレーティング・リース取引 (借主側) 未経過リース料(解約不能のもの)(単位:千円) | 1. オペレーティング・リース取引 (借主側) 未経過リース料(解約不能のもの)(単位:千円) |
| 1年以内 672,641 | 1年以内 516,612 |
| 1年超 286,301 | 1年超 1,218,728 |
| 合計 958,942 | 合計 1,735,341 |

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2)金融商品の内容及びそのリスク

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

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

営業債務である未払手数料は、すべて1年以内の支払期日であります。

(3)金融商品に係るリスク管理体制

信用リスクの管理

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

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

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

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

市場リスクの管理

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

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

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2.金融商品の時価等に関する事項

第27期(自平成23年4月1日至平成24年3月31日)

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

(単位：千円)

| | 貸借対照表計上額 | 時価 | 差額 |
|-----------------|------------|------------|----|
| (1)現金及び預金 | 15,970,870 | 15,970,870 | - |
| (2)未収委託者報酬 | 3,392,765 | 3,392,765 | - |
| (3)未収運用受託報酬 | 305,910 | 305,910 | - |
| (4)未収投資助言報酬 | 452,618 | 452,618 | - |
| (5)有価証券及び投資有価証券 | | | |

| | | | |
|------------|------------|------------|-----|
| 満期保有目的の債券 | 3,999,305 | 3,999,200 | 105 |
| 其他有価証券 | 6,671,589 | 6,671,589 | - |
| (6)長期差入保証金 | 681,196 | 681,196 | - |
| 資産計 | 31,474,256 | 31,474,150 | 105 |
| (1)未払金 | | | |
| 未払手数料 | 1,893,658 | 1,893,658 | - |
| 負債計 | 1,893,658 | 1,893,658 | - |

(注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

資産

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

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

(5)有価証券及び投資有価証券

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

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

(6)長期差入保証金

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

負債

(1)未払金

未払手数料

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

(注2)時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

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

其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)其他有価証券」には含めておりません。

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

(注3)金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：千円)

| 区分 | 1年以内 | 1年超5年以内 | 5年超10年以内 | 10年超 |
|--------|------------|---------|----------|------|
| 現金及び預金 | 15,970,870 | - | - | - |

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

第28期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

平成25年3月31日における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれていません(注2)参照)。

(単位：千円)

| | 貸借対照表計上額 | 時価 | 差額 |
|-----------------|------------|------------|-----|
| (1)現金及び預金 | 17,748,821 | 17,748,821 | - |
| (2)未収委託者報酬 | 3,641,029 | 3,641,029 | - |
| (3)未収運用受託報酬 | 439,648 | 439,648 | - |
| (4)未収投資助言報酬 | 470,228 | 470,228 | - |
| (5)有価証券及び投資有価証券 | | | |
| 満期保有目的の債券 | 3,999,613 | 3,999,200 | 413 |
| その他有価証券 | 6,881,219 | 6,881,219 | - |
| (6)長期差入保証金 | 553,412 | 553,412 | - |
| 資産計 | 33,733,972 | 33,733,559 | 413 |
| (1)未払金 | | | |
| 未払手数料 | 1,899,876 | 1,899,876 | - |
| 負債計 | 1,899,876 | 1,899,876 | - |

(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 | 33,040 |
| 合計 | 33,338 |
| 子会社株式 | |
| 非上場株式 | 234,311 |
| 合計 | 234,311 |

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

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

(注3) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：千円)

| 区分 | 1年以内 | 1年超5年以内 | 5年超10年以内 | 10年超 |
|-------------------|------------|---------|----------|------|
| 現金及び預金 | 17,748,821 | - | - | - |
| 未収委託者報酬 | 3,641,029 | - | - | - |
| 未収運用受託報酬 | 439,648 | - | - | - |
| 未収投資助言報酬 | 470,228 | - | - | - |
| 有価証券及び投資有価証券 | | | | |
| 満期保有目的の債券 | 4,000,000 | - | - | - |
| その他有価証券のうち満期があるもの | - | - | - | - |
| 長期差入保証金 | 27,733 | 525,679 | - | - |
| 合計 | 26,327,460 | 525,679 | - | - |

(有価証券関係)

第27期(平成24年3月31日)

1. 満期保有目的の債券

(単位：千円)

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

2. 子会社株式及び関連会社株式

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

3. その他有価証券

(単位：千円)

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

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

4. 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：千円)

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

第28期(平成25年3月31日)

1. 満期保有目的の債券

(単位：千円)

| 区分 | 貸借対照表計上額 | 時価 | 差額 |
|-------------------------------|-----------|-----------|-----|
| (1) 貸借対照表日の時価が貸借対照表計上額を超えるもの | - | - | - |
| 小計 | - | - | - |
| (2) 貸借対照表日の時価が貸借対照表計上額を超えないもの | 3,999,613 | 3,999,200 | 413 |
| 小計 | 3,999,613 | 3,999,200 | 413 |
| 合計 | 3,999,613 | 3,999,200 | 413 |

2. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（貸借対照表計上額 関係会社株式234,311千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。また、上記「貸借対照表計上額」は、減損処理後の帳簿価額です。当事業年度における減損処理額は、610千円です。

3. その他有価証券

(単位：千円)

| 区分 | 貸借対照表計上額 | 取得原価 | 差額 |
|-----------------------------------|-----------|-----------|---------|
| (1) 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等 | 6,212,805 | 5,419,133 | 793,672 |
| 小計 | 6,212,805 | 5,419,133 | 793,672 |
| (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 | 668,413 | 670,000 | 1,586 |
| 小計 | 668,413 | 670,000 | 1,586 |

| | | | |
|----|-----------|-----------|---------|
| 合計 | 6,881,219 | 6,089,133 | 792,086 |
|----|-----------|-----------|---------|

(注)非上場株式等(貸借対照表計上額 33,338千円)については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。また、上記「貸借対照表計上額」は、減損処理後の帳簿価額です。当事業年度における減損処理額は、18,303千円です。

4. 当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：千円)

| | | |
|-----------|---------|---------|
| 売却額 | 売却益の合計額 | 売却損の合計額 |
| 1,042,233 | 52,516 | 61,282 |

(デリバティブ取引関係)

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

(退職給付関係)

| 第27期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日) | 第28期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日) | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|--|--|-----------|---------|-----------|--|--------|-----------|---------|-----------|---------|---|------|---------|------|--------|----------------|--------|-----|--------|--------|---------|
| <p>1. 採用している退職給付制度の概要 当社は、確定給付型の制度として、退職一時金制度を設けております。</p> | <p>1. 採用している退職給付制度の概要 当社は、確定給付型の制度として、退職一時金制度を設けております。</p> | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| <p>2. 退職給付債務の額 (単位：千円)</p> <table> <tr> <td>退職給付債務</td> <td>1,489,315</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td>1,489,315</td> </tr> </table> | 退職給付債務 | 1,489,315 | 退職給付引当金 | 1,489,315 | <p>2. 退職給付債務の額 (単位：千円)</p> <table> <tr> <td>退職給付債務</td> <td>1,605,470</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td>1,605,470</td> </tr> </table> | 退職給付債務 | 1,605,470 | 退職給付引当金 | 1,605,470 | | | | | | | | | | | | |
| 退職給付債務 | 1,489,315 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 退職給付引当金 | 1,489,315 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 退職給付債務 | 1,605,470 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 退職給付引当金 | 1,605,470 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| <p>3. 退職給付費用の額 (単位：千円)</p> <table> <tr> <td>勤務費用</td> <td>167,222</td> </tr> <tr> <td>利息費用</td> <td>19,662</td> </tr> <tr> <td>数理計算上の差異の費用処理額</td> <td>5,053</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td>14,018</td> </tr> <tr> <td>退職給付費用</td> <td>205,957</td> </tr> </table> <p>(注)その他は、その他の関係会社からの出向者の年金掛金負担分と退職給付引当額相当額負担分になります。</p> | 勤務費用 | 167,222 | 利息費用 | 19,662 | 数理計算上の差異の費用処理額 | 5,053 | その他 | 14,018 | 退職給付費用 | 205,957 | <p>3. 退職給付費用の額 (単位：千円)</p> <table> <tr> <td>勤務費用</td> <td>171,214</td> </tr> <tr> <td>利息費用</td> <td>22,339</td> </tr> <tr> <td>数理計算上の差異の費用処理額</td> <td>36,910</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td>16,364</td> </tr> <tr> <td>退職給付費用</td> <td>173,008</td> </tr> </table> <p>(注)その他は、その他の関係会社からの出向者の年金掛金負担分と退職給付引当額相当額負担分になります。</p> | 勤務費用 | 171,214 | 利息費用 | 22,339 | 数理計算上の差異の費用処理額 | 36,910 | その他 | 16,364 | 退職給付費用 | 173,008 |
| 勤務費用 | 167,222 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 利息費用 | 19,662 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 数理計算上の差異の費用処理額 | 5,053 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| その他 | 14,018 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 退職給付費用 | 205,957 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 勤務費用 | 171,214 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 利息費用 | 22,339 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 数理計算上の差異の費用処理額 | 36,910 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| その他 | 16,364 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 退職給付費用 | 173,008 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| <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> | <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> | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |

(税効果会計関係)

| 第27期 (平成24年 3月31日) | 第28期 (平成25年 3月31日) | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|---|-----------------------|------|-------|---------|-----------|--------|--------------------|--------|---------|-------|--------|-------|---------|---------|---------------|-----|----------|---------|-------------------|---------|---|--|---------|---------|----------|--------|-----------|--------|-------------|---------|-----|-------|---------|---------|--------|---------|----------|---------|--------|--|--------------|--------|----------|--------|-----------|---------|---|--------|--|-------|--------|---------|--------|-------|--------|--------|-------|-----|--------|-----|--------|---------|---------|--------|---|----------|---------|-----------|---------|--------|--|---------|---------|----------|--------|-----------|--------|-------------|---------|-----|-------|---------|---------|--------|---------|----------|---------|--------|--|--------------|---------|----------|---------|-----------|---------|
| <p>1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳</p> <p style="text-align: right;">(単位：千円)</p> <p>(1) 流動の部</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <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;">106,421</td></tr> <tr><td>未払社会保険料</td><td style="text-align: right;">12,691</td></tr> <tr><td>未払事業税</td><td style="text-align: right;">27,381</td></tr> <tr><td>未払事業所税</td><td style="text-align: right;">5,808</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;">3,644</td></tr> <tr><td>繰延税金資産計</td><td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">155,946</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; border-top: 1px solid black;">155,946</td></tr> <tr><td>繰延税金資産の純額</td><td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">155,946</td></tr> </table> <p>(2) 固定の部</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <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;">530,792</td></tr> <tr><td>ソフトウェア償却</td><td style="text-align: right;">95,129</td></tr> <tr><td>投資有価証券評価損</td><td style="text-align: right;">61,204</td></tr> <tr><td>特定外国子会社留保金額</td><td style="text-align: right;">222,604</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;">7,328</td></tr> <tr><td>繰延税金資産計</td><td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">917,059</td></tr> <tr><td>評価性引当額</td><td style="text-align: right;">290,326</td></tr> <tr><td>繰延税金資産合計</td><td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">626,732</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;">37,399</td></tr> <tr><td>繰延税金負債合計</td><td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">37,399</td></tr> <tr><td>繰延税金資産の純額</td><td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">589,332</td></tr> </table> | 繰延税金資産 | | 賞与引当金 | 106,421 | 未払社会保険料 | 12,691 | 未払事業税 | 27,381 | 未払事業所税 | 5,808 | その他 | 3,644 | 繰延税金資産計 | 155,946 | 評価性引当額 | - | 繰延税金資産合計 | 155,946 | 繰延税金資産の純額 | 155,946 | 繰延税金資産 | | 退職給付引当金 | 530,792 | ソフトウェア償却 | 95,129 | 投資有価証券評価損 | 61,204 | 特定外国子会社留保金額 | 222,604 | その他 | 7,328 | 繰延税金資産計 | 917,059 | 評価性引当額 | 290,326 | 繰延税金資産合計 | 626,732 | 繰延税金負債 | | その他有価証券評価差額金 | 37,399 | 繰延税金負債合計 | 37,399 | 繰延税金資産の純額 | 589,332 | <p>1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳</p> <p style="text-align: right;">(単位：千円)</p> <p>(1) 流動の部</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <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;">96,450</td></tr> <tr><td>未払社会保険料</td><td style="text-align: right;">12,409</td></tr> <tr><td>未払事業税</td><td style="text-align: right;">56,165</td></tr> <tr><td>未払事業所税</td><td style="text-align: right;">5,778</td></tr> <tr><td>調査費</td><td style="text-align: right;">48,698</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;">10,598</td></tr> <tr><td>繰延税金資産計</td><td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">230,101</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; border-top: 1px solid black;">230,101</td></tr> <tr><td>繰延税金資産の純額</td><td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">230,101</td></tr> </table> <p>(2) 固定の部</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <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;">572,189</td></tr> <tr><td>ソフトウェア償却</td><td style="text-align: right;">75,827</td></tr> <tr><td>投資有価証券評価損</td><td style="text-align: right;">51,622</td></tr> <tr><td>特定外国子会社留保金額</td><td style="text-align: right;">226,275</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;">6,428</td></tr> <tr><td>繰延税金資産計</td><td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">932,342</td></tr> <tr><td>評価性引当額</td><td style="text-align: right;">260,304</td></tr> <tr><td>繰延税金資産合計</td><td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">672,038</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;">262,597</td></tr> <tr><td>繰延税金負債合計</td><td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">262,597</td></tr> <tr><td>繰延税金資産の純額</td><td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">409,440</td></tr> </table> | 繰延税金資産 | | 賞与引当金 | 96,450 | 未払社会保険料 | 12,409 | 未払事業税 | 56,165 | 未払事業所税 | 5,778 | 調査費 | 48,698 | その他 | 10,598 | 繰延税金資産計 | 230,101 | 評価性引当額 | - | 繰延税金資産合計 | 230,101 | 繰延税金資産の純額 | 230,101 | 繰延税金資産 | | 退職給付引当金 | 572,189 | ソフトウェア償却 | 75,827 | 投資有価証券評価損 | 51,622 | 特定外国子会社留保金額 | 226,275 | その他 | 6,428 | 繰延税金資産計 | 932,342 | 評価性引当額 | 260,304 | 繰延税金資産合計 | 672,038 | 繰延税金負債 | | その他有価証券評価差額金 | 262,597 | 繰延税金負債合計 | 262,597 | 繰延税金資産の純額 | 409,440 |
| 繰延税金資産 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 賞与引当金 | 106,421 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 未払社会保険料 | 12,691 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 未払事業税 | 27,381 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 未払事業所税 | 5,808 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| その他 | 3,644 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 繰延税金資産計 | 155,946 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 評価性引当額 | - | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 繰延税金資産合計 | 155,946 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 繰延税金資産の純額 | 155,946 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 繰延税金資産 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 退職給付引当金 | 530,792 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| ソフトウェア償却 | 95,129 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 投資有価証券評価損 | 61,204 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 特定外国子会社留保金額 | 222,604 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| その他 | 7,328 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 繰延税金資産計 | 917,059 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 評価性引当額 | 290,326 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 繰延税金資産合計 | 626,732 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 繰延税金負債 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| その他有価証券評価差額金 | 37,399 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 繰延税金負債合計 | 37,399 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 繰延税金資産の純額 | 589,332 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 繰延税金資産 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 賞与引当金 | 96,450 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 未払社会保険料 | 12,409 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 未払事業税 | 56,165 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 未払事業所税 | 5,778 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 調査費 | 48,698 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| その他 | 10,598 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 繰延税金資産計 | 230,101 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 評価性引当額 | - | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 繰延税金資産合計 | 230,101 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 繰延税金資産の純額 | 230,101 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 繰延税金資産 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 退職給付引当金 | 572,189 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| ソフトウェア償却 | 75,827 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 投資有価証券評価損 | 51,622 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 特定外国子会社留保金額 | 226,275 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| その他 | 6,428 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 繰延税金資産計 | 932,342 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 評価性引当額 | 260,304 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 繰延税金資産合計 | 672,038 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 繰延税金負債 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| その他有価証券評価差額金 | 262,597 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 繰延税金負債合計 | 262,597 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 繰延税金資産の純額 | 409,440 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| <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 style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr><td>法定実効税率</td><td style="text-align: right;">40.6</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;">1.0</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;">0.3</td></tr> <tr><td>住民税均等割等</td><td style="text-align: right;">0.2</td></tr> <tr><td>外国税額控除</td><td style="text-align: right;">0.5</td></tr> <tr><td>税率変更による</td><td></td></tr> <tr><td>期末繰延税金資産の減額修正</td><td style="text-align: right;">4.5</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;">0.2</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; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">44.4</td></tr> </table> | 法定実効税率 | 40.6 | (調整) | | 評価性引当額の増減 | 1.0 | 交際費等永久に損金に算入されない項目 | 0.3 | 住民税均等割等 | 0.2 | 外国税額控除 | 0.5 | 税率変更による | | 期末繰延税金資産の減額修正 | 4.5 | その他 | 0.2 | 税効果会計適用後の法人税等の負担率 | 44.4 | <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>法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、記載を省略しております。</p> | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 法定実効税率 | 40.6 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| (調整) | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 評価性引当額の増減 | 1.0 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 交際費等永久に損金に算入されない項目 | 0.3 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 住民税均等割等 | 0.2 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 外国税額控除 | 0.5 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 税率変更による | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 期末繰延税金資産の減額修正 | 4.5 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| その他 | 0.2 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 税効果会計適用後の法人税等の負担率 | 44.4 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |

3. 法定実効税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の修正

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

平成24年4月1日から平成27年3月31日
38.0%

平成27年4月1日以降 35.6%

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

-

(資産除去債務関係)

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

第27期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

1. セグメント情報

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

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

2. 関連情報

(1) 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

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

(2) 地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

第28期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

1.セグメント情報

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

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

2.関連情報

(1)製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

| | 委託者報酬 | 運用受託報酬 | 投資助言報酬 | その他 | 合計 |
|-----------|------------|-----------|-----------|---------|------------|
| 外部顧客への売上高 | 24,965,627 | 2,123,129 | 1,675,512 | 124,856 | 28,889,125 |

(2)地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

(3)主要な顧客ごとの情報

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

(関連当事者情報)

第27期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

1.親会社及び主要株主(会社等の場合に限る。)等

(単位：千円)

| 種類 | 会社等の名称又は氏名 | 所在地 | 資本金、出資金又は基金 | 事業の内容又は職業 | 議決権等の所有(被所有)割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額 | 科目 | 期末残高 |
|----------|------------|-----------|---------------|-----------|------------------|------------------|---------|-----------|----------|---------|
| その他の関係会社 | 住友生命保険(相) | 大阪府大阪市中央区 | 220,000,000 | 生命保険業 | (被所有)% 直接 40 | 当社の主要顧客 | 投資助言報酬 | 1,082,284 | 未収投資助言報酬 | 283,244 |
| その他の関係会社 | (株)三井住友銀行 | 東京都千代田区 | 1,770,996,505 | 銀行業 | (被所有)% 直接27.5 | 投信の販売委託 役員の兼任 | 委託販売手数料 | 4,294,733 | 未払手数料 | 345,061 |

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2. その他の関係会社の子会社等

| 種類 | 会社等の名称又は氏名 | 所在地 | 資本金、出資金又は基金 | 事業の内容又は職業 | 議決権等の所有(被所有)割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額 | 科目 | 期末残高 |
|--------------|-----------------|---------|-------------|-----------|----------------|-----------|---------|-----------|-------|---------|
| その他の関係会社の子会社 | S M B C 日興証券(株) | 東京都千代田区 | 10,000,000 | 証券業 | - % | 投信の販売委託 | 委託販売手数料 | 1,765,986 | 未払手数料 | 264,970 |

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

第28期(自 平成24年4月1日 至 平成25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 | (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 40 | 投信の販売委託 役員の兼任 | 委託販売手数料 | 4,030,024 | 未払手数料 | 345,107 |
| その他の関係会社 | 住友生命保険(相) | 大阪府大阪市中央区 | 270,000,000 | 生命保険業 | (被所有)% 直接27.5 | 当社の主要顧客 | 投資助言報酬 | 1,063,467 | 未収投資助言報酬 | 289,597 |

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2. その他の関係会社の子会社等

(単位:千円)

| 種類 | 会社等の名称又は氏名 | 所在地 | 資本金、出資金又は基金 | 事業の内容又は職業 | 議決権等の所有(被所有)割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額 | 科目 | 期末残高 |
|--------------|-----------------|---------|-------------|-----------|----------------|-----------|---------|-----------|-------|---------|
| その他の関係会社の子会社 | S M B C 日興証券(株) | 東京都千代田区 | 10,000,000 | 証券業 | - % | 投信の販売委託 | 委託販売手数料 | 1,620,156 | 未払手数料 | 195,174 |

(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27期 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日) | | 第28期 (自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日) | |
|--|---------------|--|---------------|
| 1株当たり純資産額 | 1,605,326円06銭 | 1株当たり純資産額 | 1,683,555円22銭 |
| 1株当たり当期純利益 | 94,244円73銭 | 1株当たり当期純利益 | 99,539円78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) | | (1株当たり純資産額の算定上の基礎) | |

| | |
|--------------------------------------|--------------------------------------|
| 貸借対照表の純資産の部の 合計額 28,317,951千円 | 貸借対照表の純資産の部の 合計額 29,697,914千円 |
| 普通株式に係る純資産額 28,317,951千円 | 普通株式に係る純資産額 29,697,914千円 |
| 普通株式の発行済株式数 17,640株 | 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) | (1株当たり当期純利益の算定上の基礎) |
| 損益計算書上の当期純利益 1,662,477千円 | 損益計算書上の当期純利益 1,755,881千円 |
| 普通株式に係る当期純利益 1,662,477千円 | 普通株式に係る当期純利益 1,755,881千円 |
| 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 | 普通株式の期中平均株式数 17,640株 |

(重要な後発事象)

第27期(自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日)

該当事項はありません。

第28期(自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日)

1. トヨタアセットマネジメント株式会社との経営統合

当社は、平成24年9月28日に、トヨタアセットマネジメント株式会社、トヨタファイナンシャルサービス株式会社、あいおいニッセイ同和損害保険株式会社、三井住友海上火災保険株式会社と、平成25年4月1日を効力発生日としてトヨタアセットマネジメント株式会社と経営統合する旨の合意をし、平成25年1月17日の合併契約書の締結を経て、平成25年4月1日に合併が成立致しました。

(1) 目的

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

(2) 合併する相手会社の概要

| | |
|-------|-------------------|
| 名称 | トヨタアセットマネジメント株式会社 |
| 事業の内容 | 投資運用業等 |
| 資本金 | 600,000千円 |
| 純資産 | 1,167,378千円 |
| 総資産 | 1,862,260千円 |
| 営業損失 | 26,248千円 |
| 当期純損失 | 214,380千円 |

(3) 合併の方法、合併後の会社名

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

(4) 合併比率、合併交付金の額、合併により発行する株式の種類及び数

当社は、トヨタアセットマネジメント株式会社の発行済株式の全てを所有していたため、合併に際しては新株の発行及び金銭等の交付はありません。

2. 被取得企業の取得原価及びその内訳

| | |
|------------|-----------|
| 取得の対価 | 760,008千円 |
| 取得に直接要した費用 | 2,145千円 |

取得原価 762,153千円

3. 発生したのれんの金額及び発生原因

(1) 負ののれん

186,047千円

(2) 発生原因

受け入れた資産及び引き受けた負債の純額が、被取得企業の取得の対価算定時の企業評価に基づく投資額を上回ったことによります。

4. 企業結合日に受け入れた資産及び引き受けた負債の額並びにその主な内訳

流動資産 1,604,153千円

固定資産 258,107千円

資産合計 1,862,260千円

流動負債 619,705千円

固定負債 75,176千円

負債合計 694,881千円

(参考情報) トヨタアセットマネジメント株式会社の財務諸表

1. 当社の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表の記載金額は、千円未満の端数を四捨五入して表示しております。
2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明に準じて、第24期事業年度（平成24年4月1日から平成25年3月31日まで）の財務諸表について、あらた監査法人により監査を受けております。
3. 当社は平成25年4月1日付で三井住友アセットマネジメント株式会社を存続会社として合併しております。なお、財務諸表中に記載されている「当社」は、合併前のトヨタアセットマネジメント株式会社を指しております。

独立監査人の監査報告書

平成25年5月22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

あらた監査法人

指定社員 公認会計士
業務執行社員

荒川



当監査法人は、貴社の委嘱に基づき、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に準じて、トヨタアセットマネジメント株式会社（平成25年4月1日三井住友アセットマネジメント株式会社と合併）の平成24年4月1日から平成25年3月31日までの第24期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、トヨタアセットマネジメント株式会社（平成25年4月1日三井住友アセットマネジメント株式会社と合併）の平成25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。

強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、トヨタアセットマネジメント株式会社と三井住友アセットマネジメント株式会社は平成25年4月1日付で合併している。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以上

(1) 貸借対照表

(単位：千円)

| | 前事業年度 (平成24年3月31日) | 当事業年度 (平成25年3月31日) |
|------|-----------------------|-----------------------|
| 資産の部 | | |

| | | |
|------------|--------------|-----------|
| 流動資産 | | |
| 現金及び預金 | 501,562 | 994,987 |
| 有価証券 | 643,270 | - |
| 前払費用 | 21,817 | 23,419 |
| 未収委託者報酬 | 372,005 | 437,440 |
| 未収運用受託報酬 | 92,258 | 110,402 |
| 未収還付法人税等 | - | 5,415 |
| 繰延税金資産 | 19,857 | 22,654 |
| その他 | - | 9,836 |
| 流動資産合計 | 1,650,770 | 1,604,153 |
| 固定資産 | | |
| 有形固定資産 | | |
| 建物 | *1 17,684 *1 | 697 |
| 器具備品 | *1 8,726 *1 | 3,264 |
| 有形固定資産合計 | 26,411 | 3,961 |
| 無形固定資産 | | |
| ソフトウェア | 7,672 | 12,075 |
| その他 | 1,207 | 38 |
| 無形固定資産合計 | 8,879 | 12,113 |
| 投資その他の資産 | | |
| 投資有価証券 | 40,477 | 42,695 |
| 長期差入保証金 | 70,406 | 52,610 |
| 長期預け金 | 574 | - |
| 繰延税金資産 | 35,810 | 146,728 |
| 投資その他の資産合計 | 147,266 | 242,033 |
| 固定資産合計 | 182,555 | 258,108 |
| 資産合計 | 1,833,325 | 1,862,261 |

(単位:千円)

| | 前事業年度 (平成24年3月31日) | 当事業年度 (平成25年3月31日) |
|---------|-----------------------|-----------------------|
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 預り金 | 8,489 | 7,801 |
| 未払代行手数料 | 202,085 | 237,521 |
| 未払金 | 606 | 201,189 |
| 未払費用 | 93,163 | 121,583 |
| 未払法人税等 | 6,403 | - |
| 未払消費税等 | 9,154 | 4,755 |
| 賞与引当金 | 27,000 | 46,857 |
| 流動負債合計 | 346,901 | 619,705 |
| 固定負債 | | |
| 退職給付引当金 | 100,461 | 75,177 |
| 固定負債合計 | 100,461 | 75,177 |

| | | |
|--------------|-----------|-----------|
| 負債合計 | 447,362 | 694,882 |
| 純資産の部 | | |
| 株主資本 | | |
| 資本金 | 600,000 | 600,000 |
| 利益剰余金 | | |
| 利益準備金 | 29,284 | 29,788 |
| その他利益剰余金 | | |
| 別途積立金 | 109,000 | 109,000 |
| 繰越利益剰余金 | 647,689 | 427,764 |
| 利益剰余金合計 | 785,973 | 566,552 |
| 株主資本合計 | 1,385,973 | 1,166,552 |
| 評価・換算差額等 | | |
| その他有価証券評価差額金 | 10 | 827 |
| 評価・換算差額等合計 | 10 | 827 |
| 純資産合計 | 1,385,963 | 1,167,379 |
| 負債・純資産合計 | 1,833,325 | 1,862,261 |

(2) 損益計算書

(単位：千円)

| | 前事業年度 (自平成23年 4月 1日 至平成24年 3月31日) | 当事業年度 (自平成24年 4月 1日 至平成25年 3月31日) |
|----------|---|---|
| 営業収益 | | |
| 委託者報酬 | 1,177,306 | 1,203,017 |
| 運用受託報酬 | 273,573 | 306,131 |
| 投資助言報酬 | *1 529,665 | *1 430,339 |
| 営業収益合計 | 1,980,544 | 1,939,488 |
| 営業費用 | | |
| 支払手数料 | 550,329 | 572,174 |
| 広告宣伝費 | 6,366 | 100 |
| 調査費 | 147,633 | 138,401 |
| 委託調査費 | 114,623 | 123,589 |
| 委託計算費 | 42,128 | 41,985 |
| 営業雑経費 | | |
| 通信費 | 5,816 | 5,390 |
| 印刷費 | 21,775 | 21,494 |
| 協会費 | 4,239 | 4,591 |
| 諸会費 | 874 | 763 |
| その他営業雑経費 | 3,651 | 3,738 |
| 営業費用合計 | 897,433 | 912,225 |

一般管理費

給料

| | | | | |
|-----------------------|----|-----------|----|-----------|
| 役員報酬 | | 83,127 | | 73,927 |
| 給料・手当 | *1 | 488,251 | *1 | 475,070 |
| 賞与 | *1 | 99,845 | *1 | 100,723 |
| 賞与引当金繰入 | | 27,000 | | 46,857 |
| 福利厚生費 | | 93,480 | | 90,095 |
| 交際費 | | 6,181 | | 10,415 |
| 旅費交通費 | | 16,469 | | 23,984 |
| 租税公課 | | 9,114 | | 7,490 |
| 不動産賃借料 | | 89,783 | | 76,034 |
| 退職給付費用 | *1 | 32,884 | *1 | 37,467 |
| 固定資産減価償却費 | | 13,584 | | 11,128 |
| 業務委託費 | | 49,845 | | 58,172 |
| 諸経費 | | 40,787 | | 42,151 |
| 一般管理費合計 | | 1,050,351 | | 1,053,511 |
| 営業利益又は営業損失() | | 32,760 | | 26,248 |
| 営業外収益 | | | | |
| 受取利息 | | 36 | | 52 |
| 有価証券利息 | | 547 | | 392 |
| 受取配当金 | | 529 | | 988 |
| その他営業外収益 | | 1,203 | | 1,050 |
| 営業外収益合計 | | 2,315 | | 2,481 |
| 営業外費用 | | | | |
| 雑損失 | | 336 | | 1,115 |
| 営業外費用合計 | | 336 | | 1,115 |
| 経常利益又は経常損失() | | 34,739 | | 24,882 |
| 特別利益 | | | | |
| 投資有価証券売却益 | | 71 | | - |
| 特別利益合計 | | 71 | | - |
| 特別損失 | | | | |
| 役員退職慰労金 | | 7,750 | | 40,700 |
| 固定資産除売却損 | *2 | 1,020 | *2 | 881 |
| 合併関連費用 | | - | *3 | 261,274 |
| 特別損失合計 | | 8,770 | | 302,855 |
| 税引前当期純利益又は税引前当期純損失() | | 26,040 | | 327,736 |
| 法人税、住民税及び事業税 | | 15,259 | | 823 |
| 法人税等調整額 | | 5,146 | | 114,178 |
| 法人税等合計 | | 20,405 | | 113,355 |
| 当期純利益又は当期純損失() | | 5,635 | | 214,381 |

(3) 株主資本等変動計算書

(単位：千円)

| | 前事業年度 (自平成23年 4月 1日 至平成24年 3月31日) | 当事業年度 (自平成24年 4月 1日 至平成25年 3月31日) |
|---------------------|---|---|
| 株主資本 | | |
| 資本金 | | |
| 当期首残高 | 600,000 | 600,000 |
| 当期変動額 | | |
| 当期変動額合計 | - | - |
| 当期末残高 | 600,000 | 600,000 |
| 利益剰余金 | | |
| 利益準備金 | | |
| 当期首残高 | 27,760 | 29,284 |
| 当期変動額 | | |
| 利益準備金の積立 | 1,524 | 504 |
| 当期変動額合計 | 1,524 | 504 |
| 当期末残高 | 29,284 | 29,788 |
| その他利益剰余金 | | |
| 別途積立金 | | |
| 当期首残高 | 109,000 | 109,000 |
| 当期変動額 | | |
| 当期変動額合計 | - | - |
| 当期末残高 | 109,000 | 109,000 |
| 繰越利益剰余金 | | |
| 当期首残高 | 658,818 | 647,689 |
| 当期変動額 | | |
| 利益準備金の積立 | 1,524 | 504 |
| 剰余金の配当 | 15,240 | 5,040 |
| 当期純利益又は当期純損失 () | 5,635 | 214,381 |
| 当期変動額合計 | 11,129 | 219,925 |
| 当期末残高 | 647,689 | 427,764 |
| 利益剰余金合計 | | |
| 当期首残高 | 795,578 | 785,973 |
| 当期変動額 | | |
| 利益準備金の積立 | - | - |
| 剰余金の配当 | 15,240 | 5,040 |
| 当期純利益又は当期純損失() | 5,635 | 214,381 |
| 当期変動額合計 | 9,605 | 219,421 |
| 当期末残高 | 785,973 | 566,552 |
| 株主資本合計 | | |
| 当期首残高 | 1,395,578 | 1,385,973 |
| 当期変動額 | | |
| 剰余金の配当 | 15,240 | 5,040 |
| 当期純利益又は当期純損失() | 5,635 | 214,381 |
| 当期変動額合計 | 9,605 | 219,421 |

| | | |
|---------------------|-----------|-----------|
| 当期末残高 | 1,385,973 | 1,166,552 |
| 評価・換算差額等 | | |
| その他有価証券評価差額金 | | |
| 当期首残高 | 111 | 10 |
| 当期変動額 | | |
| 株主資本以外の項目の当期変動額(純額) | 121 | 837 |
| 当期変動額合計 | 121 | 837 |
| 当期末残高 | 10 | 827 |
| 評価・換算差額等合計 | | |
| 当期首残高 | 111 | 10 |
| 当期変動額 | | |
| 株主資本以外の項目の当期変動額(純額) | 121 | 837 |
| 当期変動額合計 | 121 | 837 |
| 当期末残高 | 10 | 827 |
| 純資産合計 | | |
| 当期首残高 | 1,395,689 | 1,385,963 |
| 当期変動額 | | |
| 剰余金の配当 | 15,240 | 5,040 |
| 当期純利益又は当期純損失() | 5,635 | 214,381 |
| 株主資本以外の項目の当期変動額(純額) | 121 | 837 |
| 当期変動額合計 | 9,726 | 218,584 |
| 当期末残高 | 1,385,963 | 1,167,379 |

重要な会計方針

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

その他有価証券

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

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

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

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

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

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

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

(2) 退職給付引当金

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

の全額を計上しております。

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

消費税等の会計処理

消費税等の会計処理は、税抜方式によっております。

会計方針の変更

減価償却方法の変更

当社は法人税法の改正に伴い、当事業年度より、平成24年4月1日以後に取得した有形固定資産について、改正後の法人税法に基づく減価償却方法に変更しております。

なお、この変更による当事業年度の損益に与える影響は軽微であります。

注記事項

（貸借対照表関係）

| 前事業年度 (平成24年3月31日) | 当事業年度 (平成25年3月31日) |
|-----------------------|-----------------------|
| *1 有形固定資産の減価償却累計額 | *1 有形固定資産の減価償却累計額 |
| 建物 63,978千円 | 建物 1,071千円 |
| 器具備品 57,853千円 | 器具備品 22,826千円 |
| 計 121,831千円 | 計 23,897千円 |

（損益計算書関係）

| 前事業年度 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日) | 当事業年度 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日) |
|--------------------------------------|--|
| *1 関係会社との取引額 | *1 関係会社との取引額 |
| 投資助言報酬 529,665千円 | 投資助言報酬 430,339千円 |
| 給料・手当 107,355千円 | 給料・手当 77,490千円 |
| 賞与 31,907千円 | 賞与 18,286千円 |
| 退職給付費用 4,200千円 | 退職給付費用 4,857千円 |
| *2 固定資産除売却損は、器具備品1,020千円です。 | *2 固定資産除売却損は、建物881千円です。 |
| | *3 合併関連費用は三井住友アセットマネジメント株式会社との合併にかかる費用であり、以下の通りです。 |
| | 希望退職関連費用 205,102千円 |
| | 固定資産除売却損 21,460千円 |
| | 原状回復費用 17,365千円 |
| | IT関連費用 8,026千円 |
| | その他 9,321千円 |

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

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

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの
該当事項はありません。

(リース取引関係)

該当事項はありません。

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

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

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

前事業年度(平成24年3月31日)

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

(単位：千円)

| | 貸借対照表計上額 | 時価 | 差額 |
|-------------|-----------|-----------|-------|
| (1)現金及び預金 | 501,562 | 501,562 | |
| (2)有価証券 | 643,270 | 643,270 | |
| (3)未収委託者報酬 | 372,005 | 372,005 | |
| (4)未収運用受託報酬 | 92,258 | 92,258 | |
| (5)投資有価証券 | 40,477 | 40,477 | |
| (6)長期差入保証金 | 70,406 | 69,389 | 1,016 |
| 資産計 | 1,719,978 | 1,718,962 | 1,016 |
| (1)未払代行手数料 | 202,085 | 202,085 | |
| (2)未払費用 | 93,163 | 93,163 | |
| 負債計 | 295,248 | 295,248 | |

(注1)金融商品の時価の算定方法

資産

(1)現金及び預金

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

(2)有価証券及び(5)投資有価証券

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

(3)未収委託者報酬及び(4)未収運用受託報酬

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

(6)長期差入保証金

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

負債

(1)未払代行手数料及び(2)未払費用

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

(注2)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

(注3)金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：千円)

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

当事業年度(平成25年3月31日)

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

(単位：千円)

| | 貸借対照表計上額 | 時価 | 差額 |
|-------------|-----------|-----------|-----|
| (1)現金及び預金 | 994,987 | 994,987 | |
| (2)未収委託者報酬 | 437,440 | 437,440 | |
| (3)未収運用受託報酬 | 110,402 | 110,402 | |
| (4)投資有価証券 | 42,695 | 42,695 | |
| (5)長期差入保証金 | 52,610 | 52,135 | 475 |
| 資産計 | 1,638,134 | 1,637,659 | 475 |
| (1)未払代行手数料 | 237,521 | 237,521 | |
| (2)未払金 | 201,189 | 201,189 | |
| (3)未払費用 | 121,583 | 121,583 | |
| 負債計 | 560,293 | 560,293 | |

(注1)金融商品の時価の算定方法

資産

(1)現金及び預金

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

(2)未収委託者報酬及び(3)未収運用受託報酬

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

(4)投資有価証券

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

(5)長期差入保証金

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

負債

(1)未払代行手数料、(2)未払金及び(3)未払費用

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

(注2)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

(注3)金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：千円)

| | 1年以内 | 1年超5年以内 | 5年超10年以内 | 10年超 |
|----------|-----------|---------|----------|------|
| 現金及び預金 | 994,987 | - | - | - |
| 未収委託者報酬 | 437,440 | - | - | - |
| 未収運用受託報酬 | 110,402 | - | - | - |
| 長期差入保証金 | 50,935 | 1,675 | - | - |
| 合計 | 1,593,764 | 1,675 | - | - |

(有価証券関係)

その他有価証券

前事業年度(平成24年3月31日)

(単位：千円)

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

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

当事業年度(平成25年3月31日)

(単位：千円)

| | 種類 | 貸借対照表計上額 | 取得原価 | 差額 |
|---------------------|------|----------|--------|-------|
| 貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの | 投資信託 | 42,695 | 41,410 | 1,285 |
| 合計 | | 42,695 | 41,410 | 1,285 |

その他有価証券の当事業年度中の売却額は643,584千円であり、売却損益は生じておりません。

(デリバティブ取引関係)

該当事項はありません。

(退職給付関係)

| 前事業年度 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日) | 当事業年度 (自平成24年4月1日 至平成25年3月31日) |
|--|--|
| 1. 採用している退職給付制度の概要 当社は確定給付型の制度として、退職一時金制度を採用しております。 | 1. 採用している退職給付制度の概要 同左 |
| 2. 退職給付債務に関する事項 (1)退職給付債務 100,461千円 (2)退職給付引当金 100,461千円 | 2. 退職給付債務に関する事項 (1)退職給付債務 75,177千円 (2)退職給付引当金 75,177千円 |

| | |
|---|---|
| <p>3. 退職給付費用に関する事項</p> <p>(1) 勤務費用(注) 32,884千円</p> <p>(2) 退職給付費用 32,884千円</p> <p>(注) 確定拠出年金への掛金支払額を含んでおります。</p> | <p>3. 退職給付費用に関する事項</p> <p>(1) 勤務費用(注) 37,467千円</p> <p>(2) 退職給付費用 37,467千円</p> <p>(注) 確定拠出年金への掛金支払額を含んでおります。</p> |
|---|---|

(税効果会計関係)

| 前事業年度 (平成24年3月31日) | 当事業年度 (平成25年3月31日) | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|---|-----------------------|-------|--------------------|-------|--------|------|----------|--------|----------------------|-------|------------|--------|-------------------|-------|---|-----|----------|--------|--------|-------|-----------|--------|---|--------|--|-------|----|----------|--------|------|-------|------------|--------|--------|-------|-----------|---------|-----|-----|----------|---------|--------|-----|----------|---------|--------|--|-------------------------|-----|----------|-----|-----------|---------|
| <p>1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳</p> <p style="text-align: right;">(単位：千円)</p> <table style="width: 100%;"> <tr><td>繰延税金資産</td><td></td></tr> <tr><td> 未払事業税</td><td style="text-align: right;">1,023</td></tr> <tr><td> 少額固定資産</td><td style="text-align: right;">71</td></tr> <tr><td> 賞与引当金超過額</td><td style="text-align: right;">10,263</td></tr> <tr><td> 未払費用</td><td style="text-align: right;">8,270</td></tr> <tr><td> 退職給付引当金超過額</td><td style="text-align: right;">35,804</td></tr> <tr><td> 資産除去債務</td><td style="text-align: right;">1,476</td></tr> <tr><td> その他</td><td style="text-align: right;">235</td></tr> <tr><td>繰延税金資産小計</td><td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">57,142</td></tr> <tr><td>評価性引当額</td><td style="text-align: right;">1,475</td></tr> <tr><td>繰延税金資産の純額</td><td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">55,667</td></tr> </table> | 繰延税金資産 | | 未払事業税 | 1,023 | 少額固定資産 | 71 | 賞与引当金超過額 | 10,263 | 未払費用 | 8,270 | 退職給付引当金超過額 | 35,804 | 資産除去債務 | 1,476 | その他 | 235 | 繰延税金資産小計 | 57,142 | 評価性引当額 | 1,475 | 繰延税金資産の純額 | 55,667 | <p>1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳</p> <p style="text-align: right;">(単位：千円)</p> <table style="width: 100%;"> <tr><td>繰延税金資産</td><td></td></tr> <tr><td> 未払事業税</td><td style="text-align: right;">66</td></tr> <tr><td> 賞与引当金超過額</td><td style="text-align: right;">17,810</td></tr> <tr><td> 未払費用</td><td style="text-align: right;">4,581</td></tr> <tr><td> 退職給付引当金超過額</td><td style="text-align: right;">26,793</td></tr> <tr><td> 資産除去債務</td><td style="text-align: right;">7,665</td></tr> <tr><td> 税務上の繰越欠損金</td><td style="text-align: right;">112,728</td></tr> <tr><td> その他</td><td style="text-align: right;">613</td></tr> <tr><td>繰延税金資産小計</td><td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">170,256</td></tr> <tr><td>評価性引当額</td><td style="text-align: right;">417</td></tr> <tr><td>繰延税金資産合計</td><td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">169,839</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; border-top: 1px solid black;">457</td></tr> <tr><td>繰延税金負債合計</td><td style="text-align: right;">457</td></tr> <tr><td>繰延税金資産の純額</td><td style="text-align: right; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">169,382</td></tr> </table> | 繰延税金資産 | | 未払事業税 | 66 | 賞与引当金超過額 | 17,810 | 未払費用 | 4,581 | 退職給付引当金超過額 | 26,793 | 資産除去債務 | 7,665 | 税務上の繰越欠損金 | 112,728 | その他 | 613 | 繰延税金資産小計 | 170,256 | 評価性引当額 | 417 | 繰延税金資産合計 | 169,839 | 繰延税金負債 | | その他有価証券評価差額金 | 457 | 繰延税金負債合計 | 457 | 繰延税金資産の純額 | 169,382 |
| 繰延税金資産 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 未払事業税 | 1,023 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 少額固定資産 | 71 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 賞与引当金超過額 | 10,263 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 未払費用 | 8,270 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 退職給付引当金超過額 | 35,804 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 資産除去債務 | 1,476 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| その他 | 235 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 繰延税金資産小計 | 57,142 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 評価性引当額 | 1,475 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 繰延税金資産の純額 | 55,667 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 繰延税金資産 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 未払事業税 | 66 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 賞与引当金超過額 | 17,810 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 未払費用 | 4,581 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 退職給付引当金超過額 | 26,793 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 資産除去債務 | 7,665 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 税務上の繰越欠損金 | 112,728 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| その他 | 613 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 繰延税金資産小計 | 170,256 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 評価性引当額 | 417 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 繰延税金資産合計 | 169,839 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 繰延税金負債 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| その他有価証券評価差額金 | 457 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 繰延税金負債合計 | 457 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 繰延税金資産の純額 | 169,382 | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| <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> <table style="width: 100%;"> <tr><td>法定実効税率 (調整)</td><td style="text-align: right;">40.7%</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;">10.6%</td></tr> <tr><td>住民税均等割</td><td style="text-align: right;">3.2%</td></tr> <tr><td>評価性引当額</td><td style="text-align: right;">0.2%</td></tr> <tr><td>税率変更による期末繰延税金資産の減額修正</td><td style="text-align: right;">24.9%</td></tr> <tr><td>その他</td><td style="text-align: right;">0.7%</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; border-top: 1px solid black; border-bottom: 3px double black;">78.4%</td></tr> </table> | 法定実効税率 (調整) | 40.7% | 交際費等永久に損金に算入されない項目 | 10.6% | 住民税均等割 | 3.2% | 評価性引当額 | 0.2% | 税率変更による期末繰延税金資産の減額修正 | 24.9% | その他 | 0.7% | 税効果会計適用後の法人税等の負担率 | 78.4% | <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>税引前当期純損失であるため、記載を省略しております。</p> | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 法定実効税率 (調整) | 40.7% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 交際費等永久に損金に算入されない項目 | 10.6% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 住民税均等割 | 3.2% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 評価性引当額 | 0.2% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 税率変更による期末繰延税金資産の減額修正 | 24.9% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| その他 | 0.7% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| 税効果会計適用後の法人税等の負担率 | 78.4% | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | | |

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産の金額の修正

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

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

（セグメント情報等）

〔セグメント情報〕

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

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

前事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

〔関連情報〕

製品及びサービスごとの情報

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

地域ごとの情報

（1）営業収益

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

（2）有形固定資産

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

主要な顧客ごとの情報

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

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

〔関連情報〕

製品及びサービスごとの情報

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

地域ごとの情報

（1）営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

主要な顧客ごとの情報

| 顧客の名称又は氏名 | 営業収益（千円） | 関連するセグメント名 |
|--------------------|----------|------------|
| あいおいニッセイ同和損害保険株式会社 | 430,339 | - |

(関連当事者情報)

前事業年度（自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

1. 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主(会社等の場合に限る。)等

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

(1) 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておりません。

(2) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

該当事項はありません。

当事業年度（自 平成24年4月1日 至 平成25年3月31日）

1. 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主(会社等の場合に限る。)等

| 種類 | 会社等の名称 | 所在地 | 資本金 | 事業の内容 | 議決権等の所有(被所有)割合 | 関連当事者との関係 | 取引の内容 | 取引金額(千円) | 科目 | 期末残高(千円) |
|----------|--------------------|--------|------------|-------|----------------|------------------|------------|----------|----|----------|
| その他の関係会社 | あいおいニッセイ同和損害保険株式会社 | 東京都渋谷区 | 100,005百万円 | 損害保険業 | (被所有)直接50% | 投資顧問契約 役員の兼任等 | 投資助言報酬(注1) | 430,339 | | |
| | | | | | | | 出向者人件費(注2) | 82,689 | | |

(1) 上記金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておりません。

(2) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

| 前事業年度 (自 平成23年4月 1日 至 平成24年3月31日) | 当事業年度 (自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日) |
|--|---|
| 1株当たり純資産額 115,496.94円 1株当たり当期純利益 469.62円 なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。 | 1株当たり純資産額 97,281.58円 1株当たり当期純損失 17,865.08円 なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、1株当たり当期純損失であり、また潜在株式が存在しないため記載しておりません。 |
| 1株当たり当期純利益の算定上の基礎 損益計算書上の当期純利益 5,635千円 普通株式に係る当期純利益 5,635千円 普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。 | 1株当たり当期純損失の算定上の基礎 損益計算書上の当期純損失 214,381千円 普通株式に係る当期純損失 214,381千円 普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。 |
| 普通株式の期中平均株式数 12,000株 | 普通株式の期中平均株式数 12,000株 |

（重要な後発事象）

当事業年度（自 平成24年4月 1日 至 平成25年3月31日）

三井住友アセットマネジメント株式会社との経営統合

当社は、平成24年9月28日に、三井住友アセットマネジメント株式会社、トヨタファイナンシャルサービス株式会社、あいおいニッセイ同和損害保険株式会社、三井住友海上火災保険株式会社と、平成25年4月1日を効力発生日として三井住友アセットマネジメント株式会社と経営統合する旨の合意をし、平成25年1月17日の合併契約書の締結を経て、平成25年4月1日に合併が成立致しました。

合併の目的

当社と三井住友アセットマネジメント株式会社との経営統合により、地域性や商品性などの相互補完関係を活かすことで、国内における事業基盤の飛躍的な拡大と運用・商品開発力の強化、更に、経営におけるシナジー発揮などを通じ、お客様サービスのより一層の向上が行えるとの判断に至り、合併致しました。

合併する相手会社の概要（平成24年3月期）

| | |
|-------|--------------------|
| 名称 | 三井住友アセットマネジメント株式会社 |
| 事業の内容 | 投資運用業等 |
| 資本金 | 2,000,000千円 |
| 純資産 | 28,317,951千円 |
| 総資産 | 33,452,870千円 |
| 営業利益 | 2,871,423千円 |
| 当期純利益 | 1,662,477千円 |

合併の方法、合併後の会社名

当該合併は、三井住友アセットマネジメント株式会社が当社の全株式を取得した後に行い、三井住友アセットマネジメント株式会社を存続会社とする吸収合併方式であり、当社は解散致しました。合併後の名称は、三井住友アセットマネジメント株式会社であります。

合併比率、合併交付金の額、合併により発行する株式の種類及び数

三井住友アセットマネジメント株式会社は、当社の発行済株式の全てを所有していたため、合併に際しては新株の発行及び金銭等の交付はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

イ 自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を

行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)

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

5【その他】

イ 定款の変更、その他の重要事項

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

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

イ 受託会社

- (イ) 名称 三井住友信託銀行株式会社
- (ロ) 資本金の額 342,037百万円（平成25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25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 639,000百万円（平成25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4,851株（持株比率27.5%）保有しています。

第3【その他】

1. 目論見書の表紙にロゴ・マーク、図案およびキャッチコピーを採用すること、ファンドの形態、申込みにかかる事項、委託会社の金融商品取引業者登録番号、当該目論見書の使用開始日などを記載することがあります。
2. 目論見書は、目論見書の別称として「投資信託説明書」と称して使用することがあります。
3. 目論見書に当ファンドの信託約款を掲載すること、および投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨を記載することがあります。
4. 目論見書は、電子媒体等として使用されるほか、インターネット等に掲載されることがあります。
5. 有価証券届出書の表紙記載情報を抜粋して、目論見書に記載することがあります。
6. 目論見書の冒頭または巻末に届出書記載内容に関連する用語集を掲載することがあります。
7. 評価機関等から当ファンドに対する評価を取得し、使用することがあります。

（参考情報）

スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040は、「国内株式インデックス・マザーファンド（B号）」、「国内債券パッシブ・マザーファンド」、「外国株式インデックス・マザーファンド」、「外国債券パッシブ・マザーファンド」および「マネーインカム・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同マザーファンドの受益証券です。

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外です。

「国内株式インデックス・マザーファンド（B号）」の状況

（1）貸借対照表

| | （単位：円） | |
|----------------|------------------------|------------------------|
| | （平成24年 4月13日現在） | （平成25年 4月15日現在） |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 1,235,879,662 | 4,866,808,642 |
| 株式 | 285,252,885,760 | 334,404,904,740 |
| 派生商品評価勘定 | 271,850 | 251,260,350 |
| 未収入金 | | 5,965,318,523 |
| 未収配当金 | 3,349,948,146 | 2,943,676,923 |
| 未収利息 | 1,692 | 4,000 |
| 前払金 | 253,805,000 | |
| 差入委託証拠金 | 22,475,000 | |
| 流動資産合計 | 290,115,267,110 | 348,431,973,178 |
| 資産合計 | 290,115,267,110 | 348,431,973,178 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 254,158,750 | 13,686,300 |
| 前受金 | | 237,615,000 |
| 未払金 | | 85,640,000 |
| 未払解約金 | 12,211,243 | 4,099,859,418 |
| 流動負債合計 | 266,369,993 | 4,436,800,718 |
| 負債合計 | 266,369,993 | 4,436,800,718 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 261,559,293,680 | 218,473,743,709 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金（ ） | 28,289,603,437 | 125,521,428,751 |
| 元本等合計 | 289,848,897,117 | 343,995,172,460 |
| 純資産合計 | 289,848,897,117 | 343,995,172,460 |
| 負債純資産合計 | 290,115,267,110 | 348,431,973,178 |

（2）注記表

（重要な会計方針の注記）

| 項目 | 自 平成24年 4月14日 至 平成25年 4月15日 |
|----------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p> |
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | <p>先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。</p> |
| 3. 収益及び費用の計上基準 | <p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p> |

（貸借対照表に関する注記）

| 項目 | （平成24年 4月13日現在） | （平成25年 4月15日現在） | | | | | | | | |
|---------------|--|--|----|----|----------------|--|------|----|----|----------------|
| 1. 担保資産 | <p>代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>担保資産</th> <th>金額</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>株式</td> <td>5,985,000,000円</td> </tr> </tbody> </table> | 担保資産 | 金額 | 株式 | 5,985,000,000円 | <p>代用として、担保に供している資産は次の通りであります。</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>担保資産</th> <th>金額</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>株式</td> <td>9,972,000,000円</td> </tr> </tbody> </table> | 担保資産 | 金額 | 株式 | 9,972,000,000円 |
| 担保資産 | 金額 | | | | | | | | | |
| 株式 | 5,985,000,000円 | | | | | | | | | |
| 担保資産 | 金額 | | | | | | | | | |
| 株式 | 9,972,000,000円 | | | | | | | | | |
| 2. 受益権総数 | <p>平成24年 4月13日における受益権の総数</p> <p style="text-align: right;">261,559,293,680口</p> | <p>平成25年 4月15日における受益権の総数</p> <p style="text-align: right;">218,473,743,709口</p> | | | | | | | | |
| 3. 1単位当たり純資産額 | <p style="text-align: right;">1.1082円</p> <p style="text-align: center;">（1万口 = 11,082円）</p> | <p style="text-align: right;">1.5745円</p> <p style="text-align: center;">（1万口 = 15,745円）</p> | | | | | | | | |

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 自 平成24年 4月14日 至 平成25年 4月15日 |
|------------------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | <p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p> |
| 2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | <p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式を組み入れております。</p> |

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

・ 金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | (平成25年 4月15日現在) |
|---------------------------|---|
| <p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> | <p>金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。</p> |
| <p>2. 時価の算定方法</p> | <p>(1) 有価証券（株式） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> |

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

（デリバティブ取引に関する注記）

（平成24年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 | | | | |
| | 東証株価指数先物 | 4,852,986,900 | | 4,599,100,000 | 253,886,900 |
| | 小計 | 4,852,986,900 | | 4,599,100,000 | 253,886,900 |
| 合計 | | 4,852,986,900 | | 4,599,100,000 | 253,886,900 |

（注）1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については以下のように評価しております。

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

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

2．株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引

該当事項はありません。

（平成25年4月15日現在）

1．ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引
株式関連

（単位：円）

| 区分 | 種類 | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
|------|----------------|---------------|-------|---------------|-------------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 買建 | | | | |
| | 東証株価指数先物 | 5,817,985,950 | | 6,055,560,000 | 237,574,050 |
| | 小計 | 5,817,985,950 | | 6,055,560,000 | 237,574,050 |
| 合計 | | 5,817,985,950 | | 6,055,560,000 | 237,574,050 |

（注）1．時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については以下のように評価しております。

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

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

2．株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

（自 平成23年4月14日 至 平成24年4月13日）
該当事項はありません。

（自 平成24年4月14日 至 平成25年4月15日）
該当事項はありません。

（その他の注記）

（平成24年 4月13日現在）

| | |
|---------------------------------|------------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 272,894,945,293円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 32,882,435,835円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 44,218,087,448円 |
| 平成24年 4月13日現在の元本の内訳 | |
| 三井住友・日本株式インデックス年金ファンド | 8,778,276,405円 |
| 三井住友・DC年金バランス30（債券重点型） | 442,880,130円 |
| 三井住友・DC年金バランス50（標準型） | 2,206,635,657円 |
| 三井住友・DC年金バランス70（株式重点型） | 1,482,859,041円 |
| スミセイ・DCバランスファンド（機動的資産配分型） | 44,485,704円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020 | 4,840,491円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025 | 5,800,204円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030 | 5,321,194円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035 | 6,383,960円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040 | 5,705,797円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045 | 4,010,171円 |
| 国内株式指数ファンド（TOPIX） | 692,778,051円 |
| 三井住友・DC日本株式インデックスファンドS | 17,787,504円 |
| SMAM・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用） | 61,690,647,654円 |
| バランスファンドVA（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞ | 690,838,041円 |
| SMAM・バランスファンドVA安定成長型＜適格機関投資家限定＞ | 48,247,841,514円 |
| SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞ | 16,192,302,112円 |
| SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞ | 7,224,906,684円 |
| SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞ | 25,130,221,112円 |
| SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞ | 173,737,468円 |
| SMAM・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞ | 540,652,567円 |
| 世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞ | 87,658,147円 |
| SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞ | 2,438,875,534円 |
| SMAM・バランスファンドVL国際分散型＜適格機関投資家限定＞ | 124,197,132円 |
| SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞ | 975,558,607円 |
| SMAM・インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞ | 3,075,556,252円 |
| SMAM・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞ | 4,759,687,195円 |
| SMAM・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞ | 10,269,367,005円 |
| SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞ | 1,265,979,855円 |
| 三井住友・5資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用） | 10,332,030,577円 |
| SMAM・グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞ | 211,195,545円 |
| SMAM・バランスファンドVA20＜適格機関投資家専用＞ | 2,773,261,851円 |
| 三井住友・7資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用） | 43,577,792,287円 |

| | |
|--|------------------|
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A < 適格機関投資家専用 > | 298,692,609円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A < 適格機関投資家専用 > | 154,092,418円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A < 適格機関投資家専用 > | 54,819,085円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 L < 適格機関投資家専用 > | 788,848,847円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L < 適格機関投資家専用 > | 1,391,109,898円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T < 適格機関投資家専用 > | 525,789,689円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A 2 < 適格機関投資家専用 > | 349,290,702円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 > | 154,589,617円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 > | 31,614,573円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 0 L 2 < 適格機関投資家専用 > | 327,447,982円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 > | 3,319,404,539円 |
| S M A M ・ 国内株式インデックスファンド・V A (適格機関投資家専用) | 533,590,331円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T 2 < 適格機関投資家専用 > | 120,821,931円 |
| S M A M ・ F G 新興国重視型バランス20V A < 適格機関投資家限定 > | 21,808,802円 |
| S M A M ・ F G グローバルバランス25V A < 適格機関投資家限定 > | 7,301,209円 |
| 合 計 | 261,559,293,680円 |

(平成25年 4月15日現在)

| | |
|--|------------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 261,559,293,680円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 19,450,205,043円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 62,535,755,014円 |
| 平成25年 4月15日現在の元本の内訳 | |
| 三井住友・日本株式インデックス年金ファンド | 9,395,369,543円 |
| 三井住友・D C 年金バランス30(債券重点型) | 439,830,701円 |
| 三井住友・D C 年金バランス50(標準型) | 2,196,133,972円 |
| 三井住友・D C 年金バランス70(株式重点型) | 1,581,714,779円 |
| スミセイ・D C バランスファンド(機動的資産配分型) | 50,243,775円 |
| スミセイ・D C ターゲットイヤーファンド2020 | 4,677,850円 |
| スミセイ・D C ターゲットイヤーファンド2025 | 7,131,766円 |
| スミセイ・D C ターゲットイヤーファンド2030 | 6,521,050円 |
| スミセイ・D C ターゲットイヤーファンド2035 | 8,245,972円 |
| スミセイ・D C ターゲットイヤーファンド2040 | 2,247,070円 |
| スミセイ・D C ターゲットイヤーファンド2045 | 6,132,450円 |
| 国内株式指数ファンド(T O P I X) | 815,698,313円 |
| 三井住友・D C 日本株式インデックスファンドS | 60,561,325円 |
| S M A M ・ 国内株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用) | 53,641,830,876円 |
| バランスファンドV A(安定運用型)< 適格機関投資家限定 > | 495,260,697円 |
| S M A M ・ バランスファンドV A 安定成長型< 適格機関投資家限定 > | 39,163,593,748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 > | 14,012,277,193円 |

| | |
|--|------------------|
| SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用> | 6,211,076,658円 |
| SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用> | 22,261,022,144円 |
| SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定> | 147,878,973円 |
| SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定> | 486,175,498円 |
| 世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定> | 79,151,251円 |
| SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用> | 2,308,953,878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> | 116,337,434円 |
| SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用> | 831,105,331円 |
| SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用> | 2,609,122,861円 |
| SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用> | 4,287,957,017円 |
| SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用> | 8,346,537,808円 |
| SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定> | 971,930,332円 |
| 三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用) | 8,383,629,961円 |
| SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定> | 169,121,652円 |
| SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用> | 1,920,681,961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) | 30,864,789,824円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A <適格機関投資家専用> | 255,323,770円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA35A <適格機関投資家専用> | 130,948,467円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA50A <適格機関投資家専用> | 50,584,016円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20L <適格機関投資家専用> | 626,050,231円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA25L <適格機関投資家専用> | 1,141,918,263円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20T <適格機関投資家専用> | 454,086,872円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A2 <適格機関投資家専用> | 297,439,527円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA35A2 <適格機関投資家専用> | 131,882,045円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA50A2 <適格機関投資家専用> | 27,405,906円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA30L2 <適格機関投資家専用> | 249,695,255円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA25L2 <適格機関投資家専用> | 2,672,222,900円 |
| SMAM・国内株式インデックスファンド・VA (適格機関投資家専用) | 434,958,924円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20T2 <適格機関投資家専用> | 108,563,873円 |
| SMAM・FG新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定> | 2,629,303円 |
| SMAM・FGグローバルバランス25VA<適格機関投資家限定> | 5,348,326円 |
| SMAM・グローバル・マルチアセット・グロース・ファンド (安定成長型)<適格機関投資家限定> | 1,742,368円 |
| 合計 | 218,473,743,709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 | 83,000 | 212.00 | 17,596,000 | |
| 日本水産 | 276,700 | 188.00 | 52,019,600 | |
| マルハニチロホールディングス | 460,000 | 190.00 | 87,400,000 | |
| サカタのタネ | 35,400 | 1,255.00 | 44,427,000 | |
| ホクト | 24,000 | 1,772.00 | 42,528,000 | |
| 住石ホールディングス | 94,800 | 126.00 | 11,944,800 | |
| 日鉄鉱業 | 57,000 | 484.00 | 27,588,000 | |
| 三井松島産業 | 171,000 | 178.00 | 30,438,000 | |
| 国際石油開発帝石 | 2,899 | 497,500.00 | 1,442,252,500 | |
| 日本海洋掘削 | 6,500 | 5,200.00 | 33,800,000 | |
| 関東天然瓦斯開発 | 20,000 | 660.00 | 13,200,000 | |
| 石油資源開発 | 33,700 | 3,765.00 | 126,880,500 | |
| ショーボンドホールディングス | 20,900 | 3,485.00 | 72,836,500 | |
| ミライト・ホールディングス | 68,400 | 931.00 | 63,680,400 | |
| ダイセキ環境ソリューション | 22 | 161,800.00 | 3,559,600 | |
| 安藤・間 | 135,000 | 225.00 | 30,375,000 | |
| 東急建設 | 92,220 | 228.00 | 21,026,160 | |
| コムシスホールディングス | 115,700 | 1,131.00 | 130,856,700 | |
| ミサワホーム | 28,900 | 1,633.00 | 47,193,700 | |
| 高松コンストラクショングループ | 17,800 | 1,428.00 | 25,418,400 | |
| 東建コーポレーション | 9,090 | 6,500.00 | 59,085,000 | |
| ヤマウラ | 16,000 | 326.00 | 5,216,000 | |
| 大成建設 | 1,207,000 | 284.00 | 342,788,000 | |
| 大林組 | 715,000 | 562.00 | 401,830,000 | |
| 清水建設 | 724,000 | 343.00 | 248,332,000 | |
| 長谷工コーポレーション | 1,503,500 | 108.00 | 162,378,000 | |
| 松井建設 | 31,000 | 352.00 | 10,912,000 | |
| 鹿島建設 | 1,046,000 | 282.00 | 294,972,000 | |
| 不動テトラ | 171,000 | 189.00 | 32,319,000 | |
| 鉄建建設 | 169,000 | 130.00 | 21,970,000 | |
| 太平工業 | 46,000 | 339.00 | 15,594,000 | |
| 西松建設 | 299,000 | 168.00 | 50,232,000 | |
| 三井住友建設 | 350,900 | 86.00 | 30,177,400 | |
| 大豊建設 | 87,000 | 109.00 | 9,483,000 | |
| 前田建設工業 | 151,000 | 403.00 | 60,853,000 | |
| 佐田建設 | 106,000 | 81.00 | 8,586,000 | |
| ナカノフドー建設 | 29,000 | 247.00 | 7,163,000 | |
| 奥村組 | 212,000 | 380.00 | 80,560,000 | |
| 大和小田急建設 | 16,500 | 216.00 | 3,564,000 | |
| 東鉄工業 | 31,100 | 1,510.00 | 46,961,000 | |
| イチケン | 41,000 | 174.00 | 7,134,000 | |
| 戸田建設 | 274,000 | 234.00 | 64,116,000 | |
| 熊谷組 | 201,000 | 101.00 | 20,301,000 | |
| 青木あすなろ建設 | 15,500 | 508.00 | 7,874,000 | |
| 北野建設 | 60,000 | 210.00 | 12,600,000 | |
| 植木組 | 36,000 | 196.00 | 7,056,000 | |
| 三井ホーム | 28,000 | 508.00 | 14,224,000 | |

| | | | | |
|-----------|---------|----------|---------------|--|
| 矢作建設工業 | 33,500 | 425.00 | 14,237,500 | |
| ピーエス三菱 | 21,500 | 463.00 | 9,954,500 | |
| 大東建託 | 90,900 | 8,710.00 | 791,739,000 | |
| 新日本建設 | 35,600 | 293.00 | 10,430,800 | |
| N I P P O | 54,000 | 1,228.00 | 66,312,000 | |
| 東亜道路工業 | 46,000 | 480.00 | 22,080,000 | |
| 前田道路 | 67,000 | 1,326.00 | 88,842,000 | |
| 日本道路 | 67,000 | 480.00 | 32,160,000 | |
| 東亜建設工業 | 212,000 | 149.00 | 31,588,000 | |
| 若築建設 | 158,000 | 111.00 | 17,538,000 | |
| 東洋建設 | 79,800 | 289.00 | 23,062,200 | |
| 五洋建設 | 287,000 | 237.00 | 68,019,000 | |
| 大林道路 | 31,000 | 426.00 | 13,206,000 | |
| 福田組 | 41,000 | 382.00 | 15,662,000 | |
| 住友林業 | 162,000 | 1,072.00 | 173,664,000 | |
| 日本基礎技術 | 36,900 | 328.00 | 12,103,200 | |
| 日成ビルド工業 | 89,000 | 204.00 | 18,156,000 | |
| エス・バイ・エル | 128,000 | 177.00 | 22,656,000 | |
| 巴コーポレーション | 39,100 | 363.00 | 14,193,300 | |
| パナホーム | 87,000 | 657.00 | 57,159,000 | |
| 大和ハウス工業 | 593,000 | 1,990.00 | 1,180,070,000 | |
| ライト工業 | 55,500 | 480.00 | 26,640,000 | |
| 積水ハウス | 716,000 | 1,387.00 | 993,092,000 | |
| 日特建設 | 22,700 | 361.00 | 8,194,700 | |
| 北陸電気工事 | 13,000 | 375.00 | 4,875,000 | |
| ユアテック | 39,000 | 301.00 | 11,739,000 | |
| 西部電気工業 | 9,000 | 412.00 | 3,708,000 | |
| 四電工 | 19,000 | 327.00 | 6,213,000 | |
| 中電工 | 30,200 | 981.00 | 29,626,200 | |
| 関電工 | 107,000 | 423.00 | 45,261,000 | |
| きんでん | 157,000 | 657.00 | 103,149,000 | |
| 東京エネシス | 29,000 | 477.00 | 13,833,000 | |
| トーエネック | 33,000 | 455.00 | 15,015,000 | |
| 住友電設 | 17,700 | 1,296.00 | 22,939,200 | |
| 日本電設工業 | 42,000 | 979.00 | 41,118,000 | |
| 協和エクシオ | 84,600 | 1,025.00 | 86,715,000 | |
| 新日本空調 | 16,500 | 572.00 | 9,438,000 | |
| N D S | 32,000 | 300.00 | 9,600,000 | |
| 九電工 | 35,000 | 425.00 | 14,875,000 | |
| 三機工業 | 49,000 | 529.00 | 25,921,000 | |
| 日揮 | 240,000 | 2,587.00 | 620,880,000 | |
| 中外炉工業 | 85,000 | 252.00 | 21,420,000 | |
| ヤマト | 25,000 | 368.00 | 9,200,000 | |
| 太平電業 | 34,000 | 571.00 | 19,414,000 | |
| 高砂熱学工業 | 63,100 | 734.00 | 46,315,400 | |
| 三晃金属工業 | 37,000 | 224.00 | 8,288,000 | |
| 朝日工業社 | 30,000 | 317.00 | 9,510,000 | |
| 大気社 | 34,400 | 2,116.00 | 72,790,400 | |

| | | | | |
|-------------------|-----------|----------|---------------|--|
| ダイダシ | 31,000 | 517.00 | 16,027,000 | |
| 日比谷総合設備 | 27,200 | 964.00 | 26,220,800 | |
| 東芝プラントシステム | 40,000 | 1,254.00 | 50,160,000 | |
| 東洋エンジニアリング | 125,000 | 433.00 | 54,125,000 | |
| 千代田化工建設 | 173,000 | 950.00 | 164,350,000 | |
| 新興プランテック | 50,600 | 700.00 | 35,420,000 | |
| 日本製粉 | 133,000 | 443.00 | 58,919,000 | |
| 日清製粉グループ本社 | 214,500 | 1,236.00 | 265,122,000 | |
| 日東富士製粉 | 19,000 | 318.00 | 6,042,000 | |
| 昭和産業 | 81,000 | 314.00 | 25,434,000 | |
| 鳥越製粉 | 18,800 | 635.00 | 11,938,000 | |
| 協同飼料 | 110,000 | 114.00 | 12,540,000 | |
| 中部飼料 | 22,800 | 576.00 | 13,132,800 | |
| 日本配合飼料 | 90,000 | 120.00 | 10,800,000 | |
| 東洋精糖 | 65,000 | 102.00 | 6,630,000 | |
| 日本甜菜製糖 | 119,000 | 181.00 | 21,539,000 | |
| 三井製糖 | 99,000 | 295.00 | 29,205,000 | |
| 森永製菓 | 218,000 | 201.00 | 43,818,000 | |
| 中村屋 | 59,000 | 435.00 | 25,665,000 | |
| 江崎グリコ | 86,000 | 1,158.00 | 99,588,000 | |
| 名糖産業 | 14,200 | 996.00 | 14,143,200 | |
| 不二家 | 155,000 | 203.00 | 31,465,000 | |
| 山崎製パン | 174,000 | 1,226.00 | 213,324,000 | |
| モロゾフ | 40,000 | 305.00 | 12,200,000 | |
| 亀田製菓 | 13,500 | 2,547.00 | 34,384,500 | |
| カルビー | 21,900 | 9,030.00 | 197,757,000 | |
| 森永乳業 | 194,000 | 288.00 | 55,872,000 | |
| ヤクルト本社 | 140,500 | 4,425.00 | 621,712,500 | |
| 明治ホールディングス | 70,300 | 4,260.00 | 299,478,000 | |
| 雪印メグミルク | 45,900 | 1,500.00 | 68,850,000 | |
| プリマハム | 145,000 | 242.00 | 35,090,000 | |
| 日本ハム | 183,000 | 1,430.00 | 261,690,000 | |
| 伊藤ハム | 136,000 | 427.00 | 58,072,000 | |
| 林兼産業 | 120,000 | 87.00 | 10,440,000 | |
| 丸大食品 | 97,000 | 312.00 | 30,264,000 | |
| 米久 | 13,400 | 842.00 | 11,282,800 | |
| S F o o d s | 15,500 | 901.00 | 13,965,500 | |
| サッポロホールディングス | 398,000 | 407.00 | 161,986,000 | |
| アサヒグループホールディングス | 481,400 | 2,342.00 | 1,127,438,800 | |
| キリンホールディングス | 1,023,000 | 1,673.00 | 1,711,479,000 | |
| 宝ホールディングス | 191,000 | 771.00 | 147,261,000 | |
| オエノンホールディングス | 70,000 | 269.00 | 18,830,000 | |
| 養命酒製造 | 21,000 | 819.00 | 17,199,000 | |
| 三国コカ・コーラボトリング | 20,100 | 987.00 | 19,838,700 | |
| コカ・コーラウエスト | 80,100 | 1,659.00 | 132,885,900 | |
| コカ・コーラ セントラル ジャパン | 31,200 | 1,272.00 | 39,686,400 | |
| ダイドードリンコ | 11,900 | 4,260.00 | 50,694,000 | |
| 伊藤園 | 64,400 | 2,496.00 | 160,742,400 | |

| | | | | |
|--------------|-----------|----------|---------------|--|
| キーコーヒー | 17,000 | 1,516.00 | 25,772,000 | |
| 日清オイリオグループ | 92,000 | 336.00 | 30,912,000 | |
| 不二製油 | 58,500 | 1,466.00 | 85,761,000 | |
| J-オイルミルズ | 101,000 | 298.00 | 30,098,000 | |
| キッコーマン | 197,000 | 1,786.00 | 351,842,000 | |
| 味の素 | 630,000 | 1,334.00 | 840,420,000 | |
| キューピー | 119,000 | 1,387.00 | 165,053,000 | |
| ハウス食品 | 80,400 | 1,702.00 | 136,840,800 | |
| カゴメ | 85,100 | 1,799.00 | 153,094,900 | |
| 焼津水産化学工業 | 10,900 | 861.00 | 9,384,900 | |
| アリアケジャパン | 22,400 | 2,114.00 | 47,353,600 | |
| ニチレイ | 258,000 | 571.00 | 147,318,000 | |
| 東洋水産 | 111,000 | 3,070.00 | 340,770,000 | |
| 日清食品ホールディングス | 92,300 | 4,590.00 | 423,657,000 | |
| 永谷園 | 20,000 | 888.00 | 17,760,000 | |
| フジッコ | 20,000 | 1,126.00 | 22,520,000 | |
| ロック・フィールド | 11,400 | 2,015.00 | 22,971,000 | |
| 日本たばこ産業 | 1,327,800 | 3,470.00 | 4,607,466,000 | |
| ケンコーマヨネーズ | 9,100 | 868.00 | 7,898,800 | |
| わらべや日洋 | 16,500 | 1,493.00 | 24,634,500 | |
| なとり | 10,100 | 942.00 | 9,514,200 | |
| ミヨシ油脂 | 98,000 | 152.00 | 14,896,000 | |
| 片倉工業 | 27,100 | 1,399.00 | 37,912,900 | |
| グンゼ | 154,000 | 257.00 | 39,578,000 | |
| 東洋紡 | 946,000 | 166.00 | 157,036,000 | |
| ユニチカ | 631,000 | 58.00 | 36,598,000 | |
| 富士紡ホールディングス | 110,000 | 270.00 | 29,700,000 | |
| 日清紡ホールディングス | 143,000 | 660.00 | 94,380,000 | |
| 倉敷紡績 | 216,000 | 183.00 | 39,528,000 | |
| シキボウ | 158,000 | 149.00 | 23,542,000 | |
| 日本毛織 | 68,000 | 712.00 | 48,416,000 | |
| トーア紡コーポレーション | 138,000 | 72.00 | 9,936,000 | |
| ダイドーリミテッド | 28,300 | 663.00 | 18,762,900 | |
| 帝国繊維 | 23,000 | 896.00 | 20,608,000 | |
| 帝人 | 852,000 | 225.00 | 191,700,000 | |
| 東レ | 1,727,000 | 672.00 | 1,160,544,000 | |
| サカイオーベックス | 80,000 | 148.00 | 11,840,000 | |
| 住江織物 | 69,000 | 264.00 | 18,216,000 | |
| 日本フェルト | 5,800 | 442.00 | 2,563,600 | |
| イチカワ | 23,000 | 180.00 | 4,140,000 | |
| 日本バイリーン | 33,000 | 500.00 | 16,500,000 | |
| 日東製網 | 32,000 | 154.00 | 4,928,000 | |
| 芦森工業 | 68,000 | 142.00 | 9,656,000 | |
| アツギ | 186,000 | 112.00 | 20,832,000 | |
| ダイニック | 52,000 | 181.00 | 9,412,000 | |
| セーレン | 59,700 | 623.00 | 37,193,100 | |
| 小松精練 | 35,000 | 470.00 | 16,450,000 | |
| ワコールホールディングス | 128,000 | 1,047.00 | 134,016,000 | |

| | | | | |
|---------------|-----------|----------|---------------|--|
| ホギメディカル | 14,000 | 5,500.00 | 77,000,000 | |
| レナウン | 71,000 | 154.00 | 10,934,000 | |
| クラウドピア | 2,300 | 1,360.00 | 3,128,000 | |
| T S Iホールディングス | 115,900 | 690.00 | 79,971,000 | |
| 三陽商会 | 111,000 | 289.00 | 32,079,000 | |
| オンワードホールディングス | 150,000 | 846.00 | 126,900,000 | |
| ルック | 46,000 | 397.00 | 18,262,000 | |
| ゴールドウイン | 51,000 | 586.00 | 29,886,000 | |
| デサント | 56,000 | 635.00 | 35,560,000 | |
| ヤマトインターナショナル | 6,100 | 428.00 | 2,610,800 | |
| 特種東海製紙 | 131,000 | 211.00 | 27,641,000 | |
| 王子ホールディングス | 983,000 | 337.00 | 331,271,000 | |
| 日本製紙 | 107,300 | 1,258.00 | 134,983,400 | |
| 三菱製紙 | 326,000 | 90.00 | 29,340,000 | |
| 北越紀州製紙 | 141,000 | 421.00 | 59,361,000 | |
| 中越パルプ工業 | 88,000 | 148.00 | 13,024,000 | |
| 巴川製紙所 | 40,000 | 175.00 | 7,000,000 | |
| 大王製紙 | 95,000 | 565.00 | 53,675,000 | |
| レンゴー | 178,000 | 466.00 | 82,948,000 | |
| トーモク | 66,000 | 317.00 | 20,922,000 | |
| ザ・パックス | 15,300 | 1,913.00 | 29,268,900 | |
| クラレ | 379,600 | 1,423.00 | 540,170,800 | |
| 旭化成 | 1,390,000 | 650.00 | 903,500,000 | |
| 共和レザー | 13,100 | 320.00 | 4,192,000 | |
| コープケミカル | 58,000 | 124.00 | 7,192,000 | |
| 昭和電工 | 1,400,000 | 154.00 | 215,600,000 | |
| 住友化学 | 1,538,000 | 289.00 | 444,482,000 | |
| 日本化成 | 67,000 | 150.00 | 10,050,000 | |
| 住友精化 | 44,000 | 350.00 | 15,400,000 | |
| 日産化学工業 | 154,100 | 1,103.00 | 169,972,300 | |
| クレハ | 161,000 | 335.00 | 53,935,000 | |
| テイカ | 45,000 | 290.00 | 13,050,000 | |
| 石原産業 | 448,000 | 83.00 | 37,184,000 | |
| 片倉チッカリン | 19,000 | 262.00 | 4,978,000 | |
| 日本曹達 | 135,000 | 412.00 | 55,620,000 | |
| 東ソー | 602,000 | 261.00 | 157,122,000 | |
| トクヤマ | 339,000 | 235.00 | 79,665,000 | |
| セントラル硝子 | 201,000 | 315.00 | 63,315,000 | |
| 東亜合成 | 257,000 | 408.00 | 104,856,000 | |
| ダイソー | 89,000 | 281.00 | 25,009,000 | |
| 関東電化工業 | 69,000 | 230.00 | 15,870,000 | |
| 電気化学工業 | 444,000 | 341.00 | 151,404,000 | |
| 信越化学工業 | 400,000 | 6,280.00 | 2,512,000,000 | |
| 日本カーバイド工業 | 71,000 | 616.00 | 43,736,000 | |
| 堺化学工業 | 83,000 | 295.00 | 24,485,000 | |
| エア・ウォーター | 183,000 | 1,440.00 | 263,520,000 | |
| 大陽日酸 | 297,000 | 637.00 | 189,189,000 | |
| 日本化学工業 | 99,000 | 120.00 | 11,880,000 | |

| | | | |
|----------------|-----------|----------|---------------|
| 日本パーカライジング | 54,000 | 1,800.00 | 97,200,000 |
| 高圧ガス工業 | 32,000 | 536.00 | 17,152,000 |
| チタン工業 | 40,000 | 230.00 | 9,200,000 |
| 四国化成工業 | 32,000 | 632.00 | 20,224,000 |
| 戸田工業 | 45,000 | 312.00 | 14,040,000 |
| ステラ ケミファ | 12,100 | 1,773.00 | 21,453,300 |
| 保土谷化学工業 | 63,000 | 205.00 | 12,915,000 |
| 日本触媒 | 163,000 | 856.00 | 139,528,000 |
| 大日精化工業 | 75,000 | 440.00 | 33,000,000 |
| カネカ | 271,000 | 541.00 | 146,611,000 |
| 三菱瓦斯化学 | 355,000 | 668.00 | 237,140,000 |
| 三井化学 | 954,000 | 203.00 | 193,662,000 |
| J S R | 205,600 | 2,121.00 | 436,077,600 |
| 東京応化工業 | 43,500 | 1,986.00 | 86,391,000 |
| 三菱ケミカルホールディングス | 1,392,500 | 449.00 | 625,232,500 |
| 日本合成化学工業 | 49,000 | 866.00 | 42,434,000 |
| ダイセル | 266,000 | 780.00 | 207,480,000 |
| 住友ベークライト | 180,000 | 371.00 | 66,780,000 |
| 積水化学工業 | 457,000 | 1,098.00 | 501,786,000 |
| 日本ゼオン | 194,000 | 948.00 | 183,912,000 |
| アイカ工業 | 61,100 | 1,775.00 | 108,452,500 |
| 宇部興産 | 1,078,000 | 187.00 | 201,586,000 |
| 積水樹脂 | 31,000 | 1,345.00 | 41,695,000 |
| タキロン | 54,000 | 359.00 | 19,386,000 |
| 旭有機材工業 | 76,000 | 213.00 | 16,188,000 |
| 日立化成 | 96,100 | 1,447.00 | 139,056,700 |
| ニチバン | 13,000 | 409.00 | 5,317,000 |
| リケンテクノス | 30,000 | 266.00 | 7,980,000 |
| 大倉工業 | 57,000 | 437.00 | 24,909,000 |
| 積水化成成品工業 | 62,000 | 248.00 | 15,376,000 |
| 群栄化学工業 | 60,000 | 228.00 | 13,680,000 |
| タイガースポリマー | 13,500 | 379.00 | 5,116,500 |
| 日本カーリット | 17,100 | 545.00 | 9,319,500 |
| 日本化薬 | 155,000 | 1,359.00 | 210,645,000 |
| 日本精化 | 15,900 | 667.00 | 10,605,300 |
| A D E K A | 94,700 | 792.00 | 75,002,400 |
| 日油 | 167,000 | 487.00 | 81,329,000 |
| ハリマ化成グループ | 21,200 | 479.00 | 10,154,800 |
| 花王 | 591,700 | 3,335.00 | 1,973,319,500 |
| 第一工業製薬 | 43,000 | 248.00 | 10,664,000 |
| 三洋化成工業 | 65,000 | 513.00 | 33,345,000 |
| 大日本塗料 | 145,000 | 174.00 | 25,230,000 |
| 日本ペイント | 193,000 | 1,008.00 | 194,544,000 |
| 関西ペイント | 252,000 | 1,179.00 | 297,108,000 |
| 中国塗料 | 72,000 | 476.00 | 34,272,000 |
| 日本特殊塗料 | 19,400 | 404.00 | 7,837,600 |
| 藤倉化成 | 26,900 | 388.00 | 10,437,200 |
| 太陽ホールディングス | 18,300 | 2,884.00 | 52,777,200 |

| | | | | |
|--------------------|---------|------------|---------------|--|
| D I C | 800,000 | 205.00 | 164,000,000 | |
| サカタインクス | 42,000 | 630.00 | 26,460,000 | |
| 東洋インキ S C ホールディングス | 198,000 | 438.00 | 86,724,000 | |
| 富士フイルムホールディングス | 477,600 | 2,039.00 | 973,826,400 | |
| 資生堂 | 399,600 | 1,492.00 | 596,203,200 | |
| ライオン | 245,000 | 544.00 | 133,280,000 | |
| 高砂香料工業 | 74,000 | 516.00 | 38,184,000 | |
| マンダム | 23,800 | 3,540.00 | 84,252,000 | |
| ミルボン | 10,400 | 3,625.00 | 37,700,000 | |
| ファンケル | 51,200 | 1,040.00 | 53,248,000 | |
| コーセー | 39,200 | 2,560.00 | 100,352,000 | |
| ドクターシーラボ | 164 | 280,700.00 | 46,034,800 | |
| ポーラ・オルビスホールディングス | 26,000 | 3,230.00 | 83,980,000 | |
| ノエビアホールディングス | 12,300 | 1,596.00 | 19,630,800 | |
| エステー | 12,800 | 1,003.00 | 12,838,400 | |
| コニシ | 16,300 | 1,679.00 | 27,367,700 | |
| 長谷川香料 | 27,900 | 1,453.00 | 40,538,700 | |
| 小林製薬 | 33,400 | 5,200.00 | 173,680,000 | |
| 荒川化学工業 | 16,400 | 796.00 | 13,054,400 | |
| メック | 22,800 | 530.00 | 12,084,000 | |
| 日本高純度化学 | 67 | 227,200.00 | 15,222,400 | |
| J C U | 3,900 | 4,870.00 | 18,993,000 | |
| アース製薬 | 13,500 | 3,350.00 | 45,225,000 | |
| イハラケミカル工業 | 39,000 | 581.00 | 22,659,000 | |
| 北興化学工業 | 28,000 | 302.00 | 8,456,000 | |
| 大成ラミック | 5,000 | 2,418.00 | 12,090,000 | |
| クミアイ化学工業 | 49,000 | 585.00 | 28,665,000 | |
| 日本農薬 | 56,000 | 704.00 | 39,424,000 | |
| アキレス | 173,000 | 137.00 | 23,701,000 | |
| 有沢製作所 | 45,900 | 369.00 | 16,937,100 | |
| 日東電工 | 184,200 | 6,540.00 | 1,204,668,000 | |
| レック | 8,400 | 1,288.00 | 10,819,200 | |
| きもと | 24,500 | 781.00 | 19,134,500 | |
| 藤森工業 | 19,500 | 2,594.00 | 50,583,000 | |
| 前澤化成工業 | 14,500 | 1,049.00 | 15,210,500 | |
| J S P | 14,400 | 1,410.00 | 20,304,000 | |
| エフピコ | 10,800 | 6,250.00 | 67,500,000 | |
| 天馬 | 17,300 | 1,193.00 | 20,638,900 | |
| 信越ポリマー | 47,100 | 356.00 | 16,767,600 | |
| 東リ | 66,000 | 215.00 | 14,190,000 | |
| ニフコ | 50,300 | 2,215.00 | 111,414,500 | |
| 日本バルカー工業 | 91,000 | 243.00 | 22,113,000 | |
| ユニ・チャーム | 123,200 | 6,110.00 | 752,752,000 | |
| 協和発酵キリン | 265,000 | 1,142.00 | 302,630,000 | |
| 武田薬品工業 | 835,900 | 5,100.00 | 4,263,090,000 | |
| アステラス製薬 | 495,400 | 5,480.00 | 2,714,792,000 | |
| 大日本住友製薬 | 159,300 | 1,670.00 | 266,031,000 | |
| 塩野義製薬 | 326,500 | 2,035.00 | 664,427,500 | |

| | | | |
|-----------------|-----------|-----------|---------------|
| 田辺三菱製薬 | 183,700 | 1,495.00 | 274,631,500 |
| わかもと製薬 | 35,000 | 330.00 | 11,550,000 |
| あすか製薬 | 30,000 | 691.00 | 20,730,000 |
| 日本新薬 | 47,000 | 1,362.00 | 64,014,000 |
| 中外製薬 | 257,400 | 2,415.00 | 621,621,000 |
| 科研製薬 | 87,000 | 1,639.00 | 142,593,000 |
| エーザイ | 274,500 | 4,355.00 | 1,195,447,500 |
| ロート製薬 | 96,000 | 1,322.00 | 126,912,000 |
| 小野薬品工業 | 108,600 | 6,150.00 | 667,890,000 |
| 久光製薬 | 68,900 | 5,460.00 | 376,194,000 |
| 有機合成薬品工業 | 24,000 | 295.00 | 7,080,000 |
| 持田製薬 | 84,000 | 1,273.00 | 106,932,000 |
| 参天製薬 | 76,600 | 4,485.00 | 343,551,000 |
| 扶桑薬品工業 | 80,000 | 410.00 | 32,800,000 |
| 日本ケミファ | 38,000 | 613.00 | 23,294,000 |
| ツムラ | 61,700 | 3,065.00 | 189,110,500 |
| 日医工 | 33,900 | 2,153.00 | 72,986,700 |
| キッセイ薬品工業 | 40,900 | 2,023.00 | 82,740,700 |
| 生化学工業 | 40,100 | 1,008.00 | 40,420,800 |
| 栄研化学 | 17,700 | 1,474.00 | 26,089,800 |
| 日水製薬 | 5,300 | 1,050.00 | 5,565,000 |
| 鳥居薬品 | 12,600 | 2,282.00 | 28,753,200 |
| 東和薬品 | 11,600 | 4,635.00 | 53,766,000 |
| 沢井製薬 | 14,900 | 11,790.00 | 175,671,000 |
| ゼリア新薬工業 | 32,000 | 1,488.00 | 47,616,000 |
| 第一三共 | 703,100 | 1,830.00 | 1,286,673,000 |
| キョーリン製薬ホールディングス | 59,500 | 2,436.00 | 144,942,000 |
| 大幸薬品 | 12,200 | 1,745.00 | 21,289,000 |
| ダイト | 9,300 | 1,337.00 | 12,434,100 |
| 大塚ホールディングス | 443,500 | 3,575.00 | 1,585,512,500 |
| 大正製薬ホールディングス | 53,300 | 7,110.00 | 378,963,000 |
| 日本コークス工業 | 202,000 | 119.00 | 24,038,000 |
| 昭和シェル石油 | 201,500 | 754.00 | 151,931,000 |
| コスモ石油 | 619,000 | 210.00 | 129,990,000 |
| ニチレキ | 29,000 | 685.00 | 19,865,000 |
| 東燃ゼネラル石油 | 331,000 | 939.00 | 310,809,000 |
| ユシロ化学工業 | 14,600 | 930.00 | 13,578,000 |
| AOCホールディングス | 58,300 | 351.00 | 20,463,300 |
| MORESCO | 5,700 | 998.00 | 5,688,600 |
| 出光興産 | 25,900 | 8,140.00 | 210,826,000 |
| JXホールディングス | 2,481,500 | 522.00 | 1,295,343,000 |
| 横浜ゴム | 249,000 | 1,188.00 | 295,812,000 |
| 東洋ゴム工業 | 189,000 | 445.00 | 84,105,000 |
| ブリヂストン | 698,900 | 3,690.00 | 2,578,941,000 |
| 住友ゴム工業 | 173,500 | 1,721.00 | 298,593,500 |
| 藤倉ゴム工業 | 17,900 | 272.00 | 4,868,800 |
| オカモト | 73,000 | 315.00 | 22,995,000 |
| フコク | 9,100 | 884.00 | 8,044,400 |

| | | | |
|--------------------|-----------|----------|---------------|
| ニッタ | 22,900 | 1,978.00 | 45,296,200 |
| 東海ゴム工業 | 41,800 | 1,068.00 | 44,642,400 |
| 三ツ星ベルト | 57,000 | 512.00 | 29,184,000 |
| バンドー化学 | 76,000 | 297.00 | 22,572,000 |
| 日東紡績 | 166,000 | 340.00 | 56,440,000 |
| 旭硝子 | 1,098,000 | 689.00 | 756,522,000 |
| 日本板硝子 | 1,027,000 | 113.00 | 116,051,000 |
| 石塚硝子 | 26,000 | 155.00 | 4,030,000 |
| 日本山村硝子 | 85,000 | 186.00 | 15,810,000 |
| 日本電気硝子 | 400,000 | 462.00 | 184,800,000 |
| オハラ | 11,500 | 642.00 | 7,383,000 |
| 住友大阪セメント | 399,000 | 267.00 | 106,533,000 |
| 太平洋セメント | 1,236,000 | 235.00 | 290,460,000 |
| デイ・シイ | 29,900 | 319.00 | 9,538,100 |
| 日本ヒューム | 19,000 | 613.00 | 11,647,000 |
| 日本コンクリート工業 | 45,000 | 307.00 | 13,815,000 |
| 東海カーボン | 201,000 | 326.00 | 65,526,000 |
| 日本カーボン | 121,000 | 220.00 | 26,620,000 |
| 東洋炭素 | 12,300 | 2,128.00 | 26,174,400 |
| ノリタケカンパニーリミテド | 99,000 | 238.00 | 23,562,000 |
| TOTO | 342,000 | 881.00 | 301,302,000 |
| 日本碍子 | 292,000 | 1,056.00 | 308,352,000 |
| 日本特殊陶業 | 192,000 | 1,513.00 | 290,496,000 |
| MARUWA | 4,800 | 2,898.00 | 13,910,400 |
| 品川リフラクトリーズ | 51,000 | 213.00 | 10,863,000 |
| 黒崎播磨 | 57,000 | 221.00 | 12,597,000 |
| 東京窯業 | 29,000 | 191.00 | 5,539,000 |
| ニッカトー | 7,700 | 433.00 | 3,334,100 |
| フジインコーポレーテッド | 20,500 | 1,363.00 | 27,941,500 |
| エーアンドエーマテリアル | 65,000 | 92.00 | 5,980,000 |
| ニチアス | 99,000 | 557.00 | 55,143,000 |
| ニチハ | 26,100 | 1,397.00 | 36,461,700 |
| 新日鐵住金 | 9,446,000 | 252.00 | 2,380,392,000 |
| 神戸製鋼所 | 3,095,000 | 118.00 | 365,210,000 |
| 合同製鐵 | 132,000 | 147.00 | 19,404,000 |
| ジェイ エフ イー ホールディングス | 571,200 | 1,952.00 | 1,114,982,400 |
| 日新製鋼ホールディングス | 97,700 | 765.00 | 74,740,500 |
| 東京製鐵 | 128,800 | 396.00 | 51,004,800 |
| 共英製鋼 | 21,700 | 1,725.00 | 37,432,500 |
| 大和工業 | 45,900 | 2,899.00 | 133,064,100 |
| 東京鐵鋼 | 49,000 | 362.00 | 17,738,000 |
| 大阪製鐵 | 12,400 | 1,728.00 | 21,427,200 |
| 淀川製鋼所 | 148,000 | 350.00 | 51,800,000 |
| 東洋鋼鈹 | 51,000 | 304.00 | 15,504,000 |
| 住友鋼管 | 17,500 | 753.00 | 13,177,500 |
| 丸一鋼管 | 73,100 | 2,283.00 | 166,887,300 |
| モリ工業 | 37,000 | 288.00 | 10,656,000 |
| 大同特殊鋼 | 344,000 | 537.00 | 184,728,000 |

| | | | |
|------------------|-----------|----------|-------------|
| 日本高周波鋼業 | 118,000 | 93.00 | 10,974,000 |
| 山陽特殊製鋼 | 114,000 | 341.00 | 38,874,000 |
| 愛知製鋼 | 112,000 | 381.00 | 42,672,000 |
| 日立金属 | 156,000 | 920.00 | 143,520,000 |
| 日本金属 | 76,000 | 123.00 | 9,348,000 |
| 大太平洋金属 | 148,000 | 492.00 | 72,816,000 |
| 日本電工 | 92,000 | 312.00 | 28,704,000 |
| 栗本鐵工所 | 104,000 | 303.00 | 31,512,000 |
| 日本鑄鉄管 | 33,000 | 243.00 | 8,019,000 |
| 三菱製鋼 | 137,000 | 198.00 | 27,126,000 |
| 日亜鋼業 | 33,000 | 296.00 | 9,768,000 |
| 日本精線 | 16,000 | 362.00 | 5,792,000 |
| シンニッタン | 20,900 | 394.00 | 8,234,600 |
| 新家工業 | 55,000 | 139.00 | 7,645,000 |
| 大紀アルミニウム工業所 | 42,000 | 212.00 | 8,904,000 |
| 日本軽金属ホールディングス | 474,400 | 113.00 | 53,607,200 |
| 三井金属鉱業 | 571,000 | 225.00 | 128,475,000 |
| 東邦亜鉛 | 123,000 | 358.00 | 44,034,000 |
| 三菱マテリアル | 1,301,000 | 273.00 | 355,173,000 |
| 住友金属鉱山 | 577,000 | 1,303.00 | 751,831,000 |
| DOWAホールディングス | 246,000 | 716.00 | 176,136,000 |
| 古河機械金属 | 386,000 | 117.00 | 45,162,000 |
| 大阪チタニウムテクノロジーズ | 22,700 | 1,850.00 | 41,995,000 |
| 東邦チタニウム | 39,200 | 770.00 | 30,184,000 |
| 住友軽金属工業 | 550,000 | 98.00 | 53,900,000 |
| 古河スカイ | 73,000 | 288.00 | 21,024,000 |
| 古河電気工業 | 699,000 | 235.00 | 164,265,000 |
| 住友電気工業 | 784,900 | 1,257.00 | 986,619,300 |
| フジクラ | 355,000 | 329.00 | 116,795,000 |
| 昭和電線ホールディングス | 297,000 | 93.00 | 27,621,000 |
| タツタ電線 | 45,500 | 607.00 | 27,618,500 |
| 日立電線 | 201,000 | 155.00 | 31,155,000 |
| 沖電線 | 42,000 | 136.00 | 5,712,000 |
| 平河ヒューテック | 4,100 | 897.00 | 3,677,700 |
| リョービ | 127,000 | 222.00 | 28,194,000 |
| アサヒホールディングス | 33,800 | 2,060.00 | 69,628,000 |
| 稲葉製作所 | 9,100 | 1,345.00 | 12,239,500 |
| 宮地エンジニアリンググループ | 95,000 | 161.00 | 15,295,000 |
| トーカロ | 15,100 | 1,391.00 | 21,004,100 |
| アルファC o | 6,100 | 1,053.00 | 6,423,300 |
| SUMCO | 120,300 | 1,030.00 | 123,909,000 |
| 川田テクノロジーズ | 6,100 | 2,258.00 | 13,773,800 |
| 東洋製罐グループホールディングス | 157,400 | 1,274.00 | 200,527,600 |
| ホッカンホールディングス | 46,000 | 303.00 | 13,938,000 |
| コロナ | 10,000 | 1,081.00 | 10,810,000 |
| 横河ブリッジホールディングス | 43,000 | 845.00 | 36,335,000 |
| 日本橋梁 | 51,700 | 175.00 | 9,047,500 |
| 駒井ハルテック | 57,000 | 238.00 | 13,566,000 |

| | | | | |
|-------------|---------|-----------|---------------|--|
| 高田機工 | 29,000 | 209.00 | 6,061,000 | |
| 三和ホールディングス | 208,000 | 540.00 | 112,320,000 | |
| 文化シャッター | 59,000 | 520.00 | 30,680,000 | |
| 三協立山 | 29,300 | 2,131.00 | 62,438,300 | |
| LIxilグループ | 311,000 | 2,028.00 | 630,708,000 | |
| 日本フィルコン | 22,800 | 406.00 | 9,256,800 | |
| ノーリツ | 43,200 | 1,921.00 | 82,987,200 | |
| 長府製作所 | 18,800 | 2,344.00 | 44,067,200 | |
| リンナイ | 35,700 | 7,230.00 | 258,111,000 | |
| ダイニチ工業 | 13,400 | 789.00 | 10,572,600 | |
| 日東精工 | 37,000 | 335.00 | 12,395,000 | |
| 三洋工業 | 41,000 | 203.00 | 8,323,000 | |
| 岡部 | 44,700 | 858.00 | 38,352,600 | |
| 東プレ | 43,800 | 937.00 | 41,040,600 | |
| 高周波熱錬 | 30,500 | 716.00 | 21,838,000 | |
| 東京製綱 | 180,000 | 120.00 | 21,600,000 | |
| パイオラックス | 9,300 | 2,478.00 | 23,045,400 | |
| 日本発條 | 162,900 | 1,013.00 | 165,017,700 | |
| 中央発條 | 29,000 | 330.00 | 9,570,000 | |
| 三益半導体工業 | 21,600 | 966.00 | 20,865,600 | |
| アタカ大機 | 18,000 | 378.00 | 6,804,000 | |
| 日本製鋼所 | 348,000 | 490.00 | 170,520,000 | |
| 三浦工業 | 31,100 | 2,449.00 | 76,163,900 | |
| タクマ | 80,000 | 528.00 | 42,240,000 | |
| ツガミ | 65,000 | 505.00 | 32,825,000 | |
| オークマ | 147,000 | 739.00 | 108,633,000 | |
| 東芝機械 | 112,000 | 532.00 | 59,584,000 | |
| アマダ | 341,000 | 705.00 | 240,405,000 | |
| アイダエンジニアリング | 55,100 | 784.00 | 43,198,400 | |
| 牧野フライス製作所 | 105,000 | 601.00 | 63,105,000 | |
| オーエスジー | 92,800 | 1,407.00 | 130,569,600 | |
| ダイジェット工業 | 41,000 | 160.00 | 6,560,000 | |
| 旭ダイヤモンド工業 | 54,700 | 901.00 | 49,284,700 | |
| 森精機製作所 | 119,000 | 1,137.00 | 135,303,000 | |
| ディスコ | 25,000 | 5,780.00 | 144,500,000 | |
| 日東工器 | 9,400 | 1,839.00 | 17,286,600 | |
| 豊和工業 | 147,000 | 128.00 | 18,816,000 | |
| 大阪機工 | 101,000 | 170.00 | 17,170,000 | |
| 島精機製作所 | 29,800 | 2,037.00 | 60,702,600 | |
| 日阪製作所 | 29,000 | 877.00 | 25,433,000 | |
| やまびこ | 9,200 | 2,620.00 | 24,104,000 | |
| ベガサスミシン製造 | 28,500 | 317.00 | 9,034,500 | |
| ナブテスコ | 111,300 | 2,064.00 | 229,723,200 | |
| 三井海洋開発 | 19,400 | 2,512.00 | 48,732,800 | |
| レオン自動機 | 22,000 | 221.00 | 4,862,000 | |
| S M C | 66,500 | 19,920.00 | 1,324,680,000 | |
| 新川 | 20,500 | 606.00 | 12,423,000 | |
| ホソカワミクロン | 39,000 | 797.00 | 31,083,000 | |

| | | | |
|--------------|-----------|----------|---------------|
| ユニオンツール | 11,900 | 2,214.00 | 26,346,600 |
| オイレス工業 | 22,600 | 1,847.00 | 41,742,200 |
| サトーホールディングス | 23,800 | 1,797.00 | 42,768,600 |
| 日本エアージェット | 9,000 | 580.00 | 5,220,000 |
| 日精樹脂工業 | 18,800 | 750.00 | 14,100,000 |
| ワイエイシイ | 13,300 | 533.00 | 7,088,900 |
| 小松製作所 | 1,040,900 | 2,433.00 | 2,532,509,700 |
| 住友重機械工業 | 613,000 | 404.00 | 247,652,000 |
| 日立建機 | 113,300 | 2,194.00 | 248,580,200 |
| 日工 | 33,000 | 350.00 | 11,550,000 |
| 巴工業 | 8,700 | 2,086.00 | 18,148,200 |
| 井関農機 | 218,000 | 340.00 | 74,120,000 |
| TOWA | 25,200 | 551.00 | 13,885,200 |
| 丸山製作所 | 59,000 | 309.00 | 18,231,000 |
| 北川鉄工所 | 112,000 | 158.00 | 17,696,000 |
| クボタ | 1,193,000 | 1,439.00 | 1,716,727,000 |
| 荏原実業 | 4,300 | 1,305.00 | 5,611,500 |
| 三菱化工機 | 81,000 | 199.00 | 16,119,000 |
| 月島機械 | 35,000 | 919.00 | 32,165,000 |
| 帝国電機製作所 | 8,000 | 1,883.00 | 15,064,000 |
| 新東工業 | 46,000 | 860.00 | 39,560,000 |
| 澁谷工業 | 14,000 | 888.00 | 12,432,000 |
| アイチ コーポレーション | 41,300 | 447.00 | 18,461,100 |
| 小森コーポレーション | 56,200 | 1,131.00 | 63,562,200 |
| 鶴見製作所 | 17,000 | 849.00 | 14,433,000 |
| 住友精密工業 | 43,000 | 409.00 | 17,587,000 |
| 酒井重工業 | 55,000 | 292.00 | 16,060,000 |
| 荏原製作所 | 456,000 | 400.00 | 182,400,000 |
| 石井鐵工所 | 42,000 | 315.00 | 13,230,000 |
| 西島製作所 | 28,300 | 777.00 | 21,989,100 |
| ダイキン工業 | 291,300 | 3,830.00 | 1,115,679,000 |
| オルガノ | 33,000 | 547.00 | 18,051,000 |
| トーヨーカネツ | 130,000 | 324.00 | 42,120,000 |
| 栗田工業 | 121,900 | 2,028.00 | 247,213,200 |
| 椿本チエイン | 113,000 | 518.00 | 58,534,000 |
| 大同工業 | 49,000 | 156.00 | 7,644,000 |
| 日本コンベヤ | 99,000 | 83.00 | 8,217,000 |
| 木村化工機 | 29,700 | 377.00 | 11,196,900 |
| アネスト岩田 | 33,000 | 407.00 | 13,431,000 |
| ダイフク | 99,500 | 805.00 | 80,097,500 |
| 加藤製作所 | 60,000 | 324.00 | 19,440,000 |
| 油研工業 | 51,000 | 224.00 | 11,424,000 |
| タダノ | 105,000 | 1,110.00 | 116,550,000 |
| フジテック | 63,000 | 950.00 | 59,850,000 |
| C K D | 61,600 | 649.00 | 39,978,400 |
| キトー | 15,100 | 1,016.00 | 15,341,600 |
| 平和 | 44,400 | 1,825.00 | 81,030,000 |
| 理想科学工業 | 14,400 | 1,878.00 | 27,043,200 |

| | | | | |
|---------------|-----------|----------|---------------|--|
| SANKYO | 64,300 | 4,450.00 | 286,135,000 | |
| 日本金銭機械 | 20,700 | 1,050.00 | 21,735,000 | |
| マースエンジニアリング | 12,600 | 1,921.00 | 24,204,600 | |
| 福島工業 | 6,500 | 2,541.00 | 16,516,500 | |
| ダイコク電機 | 9,700 | 2,267.00 | 21,989,900 | |
| アマノ | 59,400 | 893.00 | 53,044,200 | |
| サンデン | 125,000 | 390.00 | 48,750,000 | |
| 蛇の目ミシン工業 | 246,000 | 81.00 | 19,926,000 | |
| マックス | 29,000 | 1,178.00 | 34,162,000 | |
| グローリー | 62,500 | 2,225.00 | 139,062,500 | |
| 大和冷機工業 | 34,000 | 562.00 | 19,108,000 | |
| セガサミーホールディングス | 229,200 | 2,070.00 | 474,444,000 | |
| 日本ピストンリング | 89,000 | 184.00 | 16,376,000 | |
| リケン | 74,000 | 385.00 | 28,490,000 | |
| T P R | 24,600 | 1,544.00 | 37,982,400 | |
| ホシザキ電機 | 44,400 | 3,035.00 | 134,754,000 | |
| 大豊工業 | 16,300 | 1,318.00 | 21,483,400 | |
| 日本精工 | 470,000 | 741.00 | 348,270,000 | |
| N T N | 468,000 | 242.00 | 113,256,000 | |
| ジェイテクト | 224,200 | 867.00 | 194,381,400 | |
| 不二越 | 203,000 | 432.00 | 87,696,000 | |
| 日本トムソン | 76,000 | 462.00 | 35,112,000 | |
| T H K | 142,600 | 2,049.00 | 292,187,400 | |
| ユーシン精機 | 11,200 | 1,831.00 | 20,507,200 | |
| 前澤給装工業 | 6,800 | 1,259.00 | 8,561,200 | |
| イーグル工業 | 28,000 | 870.00 | 24,360,000 | |
| 日本ピラー工業 | 24,000 | 784.00 | 18,816,000 | |
| キッツ | 88,900 | 534.00 | 47,472,600 | |
| 日立工機 | 51,200 | 805.00 | 41,216,000 | |
| マキタ | 129,700 | 4,935.00 | 640,069,500 | |
| 日立造船 | 847,000 | 160.00 | 135,520,000 | |
| 三菱重工業 | 3,576,000 | 667.00 | 2,385,192,000 | |
| I H I | 1,454,000 | 337.00 | 489,998,000 | |
| イビデン | 131,500 | 1,512.00 | 198,828,000 | |
| コニカミノルタ | 563,500 | 702.00 | 395,577,000 | |
| ブラザー工業 | 275,100 | 1,090.00 | 299,859,000 | |
| ミネベア | 297,000 | 301.00 | 89,397,000 | |
| 日立製作所 | 5,111,000 | 612.00 | 3,127,932,000 | |
| 東芝 | 4,205,000 | 536.00 | 2,253,880,000 | |
| 三菱電機 | 2,129,000 | 897.00 | 1,909,713,000 | |
| 富士電機 | 644,000 | 311.00 | 200,284,000 | |
| 東洋電機製造 | 48,000 | 342.00 | 16,416,000 | |
| 安川電機 | 235,000 | 1,057.00 | 248,395,000 | |
| シンフォニアテクノロジー | 139,000 | 166.00 | 23,074,000 | |
| 明電舎 | 206,000 | 278.00 | 57,268,000 | |
| オリジン電気 | 41,000 | 378.00 | 15,498,000 | |
| デンヨー | 19,500 | 1,304.00 | 25,428,000 | |
| 東芝テック | 133,000 | 629.00 | 83,657,000 | |

| | | | | |
|-------------------|-----------|------------|---------------|--|
| 芝浦メカトロニクス | 50,000 | 210.00 | 10,500,000 | |
| マブチモーター | 29,300 | 5,200.00 | 152,360,000 | |
| 日本電産 | 115,600 | 5,640.00 | 651,984,000 | |
| 東光高岳ホールディングス | 8,300 | 1,337.00 | 11,097,100 | |
| ダイヘン | 121,000 | 263.00 | 31,823,000 | |
| ヤーマン | 3,100 | 1,943.00 | 6,023,300 | |
| JVCケンウッド | 137,200 | 257.00 | 35,260,400 | |
| 第一精工 | 8,700 | 1,419.00 | 12,345,300 | |
| 日新電機 | 49,000 | 432.00 | 21,168,000 | |
| 大崎電気工業 | 33,000 | 475.00 | 15,675,000 | |
| オムロン | 225,400 | 2,697.00 | 607,903,800 | |
| 日東工業 | 32,400 | 1,341.00 | 43,448,400 | |
| I D E C | 27,100 | 863.00 | 23,387,300 | |
| ジーエス・ユアサ コーポレーション | 417,000 | 389.00 | 162,213,000 | |
| サクサホールディングス | 65,000 | 182.00 | 11,830,000 | |
| メルコホールディングス | 13,700 | 1,588.00 | 21,755,600 | |
| 日本電気 | 2,766,000 | 267.00 | 738,522,000 | |
| 富士通 | 2,056,000 | 431.00 | 886,136,000 | |
| 沖電気工業 | 800,000 | 136.00 | 108,800,000 | |
| 岩崎通信機 | 119,000 | 101.00 | 12,019,000 | |
| 電気興業 | 62,000 | 425.00 | 26,350,000 | |
| サンケン電気 | 116,000 | 397.00 | 46,052,000 | |
| ナカヨ通信機 | 24,000 | 289.00 | 6,936,000 | |
| アイホン | 12,700 | 1,592.00 | 20,218,400 | |
| ルネサスエレクトロニクス | 65,100 | 283.00 | 18,423,300 | |
| セイコーエプソン | 147,900 | 1,024.00 | 151,449,600 | |
| ワコム | 401 | 413,500.00 | 165,813,500 | |
| アルバック | 38,400 | 745.00 | 28,608,000 | |
| アクセル | 11,800 | 2,085.00 | 24,603,000 | |
| E I Z O | 16,900 | 1,684.00 | 28,459,600 | |
| 日本信号 | 55,000 | 725.00 | 39,875,000 | |
| 京三製作所 | 44,000 | 329.00 | 14,476,000 | |
| 能美防災 | 24,000 | 736.00 | 17,664,000 | |
| ホーチキ | 17,000 | 458.00 | 7,786,000 | |
| 日本無線 | 51,000 | 309.00 | 15,759,000 | |
| パナソニック | 2,438,400 | 710.00 | 1,731,264,000 | |
| シャープ | 876,000 | 370.00 | 324,120,000 | |
| アンリツ | 113,800 | 1,485.00 | 168,993,000 | |
| 富士通ゼネラル | 52,000 | 815.00 | 42,380,000 | |
| 日立国際電気 | 51,000 | 997.00 | 50,847,000 | |
| ソニー | 1,340,000 | 1,658.00 | 2,221,720,000 | |
| T D K | 120,700 | 3,210.00 | 387,447,000 | |
| 帝国通信工業 | 60,000 | 192.00 | 11,520,000 | |
| ミツミ電機 | 86,100 | 531.00 | 45,719,100 | |
| タムラ製作所 | 84,000 | 197.00 | 16,548,000 | |
| アルプス電気 | 160,100 | 749.00 | 119,914,900 | |
| パイオニア | 271,900 | 219.00 | 59,546,100 | |
| 日本電波工業 | 20,600 | 955.00 | 19,673,000 | |

| | | | | |
|---------------------|---------|-----------|---------------|--|
| 日本トリム | 2,950 | 3,455.00 | 10,192,250 | |
| ローランド ディー . ジー . | 10,200 | 1,381.00 | 14,086,200 | |
| フォスター電機 | 24,000 | 1,307.00 | 31,368,000 | |
| S M K | 71,000 | 299.00 | 21,229,000 | |
| ヨコオ | 18,600 | 571.00 | 10,620,600 | |
| 東光 | 119,000 | 288.00 | 34,272,000 | |
| ホシデン | 59,800 | 551.00 | 32,949,800 | |
| ヒロセ電機 | 36,900 | 13,730.00 | 506,637,000 | |
| 日本航空電子工業 | 51,000 | 738.00 | 37,638,000 | |
| T O A | 24,000 | 732.00 | 17,568,000 | |
| ユニデン | 75,000 | 230.00 | 17,250,000 | |
| アルパイン | 41,200 | 1,017.00 | 41,900,400 | |
| スミダコーポレーション | 17,800 | 502.00 | 8,935,600 | |
| アイコム | 10,800 | 2,472.00 | 26,697,600 | |
| 船井電機 | 23,000 | 1,220.00 | 28,060,000 | |
| 横河電機 | 215,700 | 910.00 | 196,287,000 | |
| 新電元工業 | 75,000 | 392.00 | 29,400,000 | |
| アズビル | 58,000 | 1,960.00 | 113,680,000 | |
| 日本光電工業 | 42,700 | 3,510.00 | 149,877,000 | |
| チノー | 41,000 | 219.00 | 8,979,000 | |
| 共和電業 | 29,000 | 311.00 | 9,019,000 | |
| 日本電子材料 | 8,800 | 396.00 | 3,484,800 | |
| 堀場製作所 | 42,700 | 3,055.00 | 130,448,500 | |
| アドバンテスト | 148,000 | 1,342.00 | 198,616,000 | |
| 小野測器 | 31,000 | 462.00 | 14,322,000 | |
| エスペック | 24,100 | 737.00 | 17,761,700 | |
| パナソニック デバイス S U N X | 19,200 | 415.00 | 7,968,000 | |
| キーエンス | 52,200 | 30,650.00 | 1,599,930,000 | |
| 日置電機 | 9,500 | 1,539.00 | 14,620,500 | |
| シスメックス | 75,200 | 6,390.00 | 480,528,000 | |
| メガチップス | 19,200 | 1,463.00 | 28,089,600 | |
| O B A R A G R O U P | 16,700 | 1,757.00 | 29,341,900 | |
| 日本電産コパル電子 | 21,400 | 444.00 | 9,501,600 | |
| ミヤチテクノス | 13,000 | 865.00 | 11,245,000 | |
| コーセル | 30,100 | 1,153.00 | 34,705,300 | |
| 日立メディコ | 17,000 | 1,612.00 | 27,404,000 | |
| オプテックス | 14,200 | 1,283.00 | 18,218,600 | |
| 千代田インテグレ | 9,100 | 1,420.00 | 12,922,000 | |
| スタンレー電気 | 165,100 | 1,841.00 | 303,949,100 | |
| 岩崎電気 | 94,000 | 211.00 | 19,834,000 | |
| ウシオ電機 | 128,800 | 933.00 | 120,170,400 | |
| 岡谷電機産業 | 7,000 | 337.00 | 2,359,000 | |
| ヘリオス テクノ ホールディング | 27,600 | 213.00 | 5,878,800 | |
| 日本セラミック | 15,300 | 1,543.00 | 23,607,900 | |
| 日本デジタル研究所 | 17,100 | 1,166.00 | 19,938,600 | |
| 古河電池 | 20,000 | 547.00 | 10,940,000 | |
| 双信電機 | 14,800 | 349.00 | 5,165,200 | |
| 山一電機 | 32,800 | 173.00 | 5,674,400 | |

| | | | | |
|-------------------|-----------|-----------|----------------|--------------------------------|
| 図研 | 13,100 | 678.00 | 8,881,800 | |
| 日本電子 | 85,000 | 427.00 | 36,295,000 | |
| カシオ計算機 | 206,100 | 781.00 | 160,964,100 | |
| ファナック | 221,900 | 15,170.00 | 3,366,223,000 | |
| 日本シイエムケイ | 53,600 | 323.00 | 17,312,800 | |
| エンプラス | 9,700 | 5,130.00 | 49,761,000 | |
| ローム | 112,700 | 3,510.00 | 395,577,000 | |
| 浜松ホトニクス | 82,400 | 3,850.00 | 317,240,000 | |
| 三井ハイテック | 33,600 | 717.00 | 24,091,200 | |
| 新光電気工業 | 73,700 | 883.00 | 65,077,100 | |
| 京セラ | 176,800 | 8,930.00 | 1,578,824,000 | |
| 太陽誘電 | 105,500 | 1,316.00 | 138,838,000 | |
| 村田製作所 | 223,300 | 7,910.00 | 1,766,303,000 | |
| ユーシン | 32,100 | 705.00 | 22,630,500 | |
| 双葉電子工業 | 39,200 | 1,107.00 | 43,394,400 | |
| 北陸電気工業 | 106,000 | 120.00 | 12,720,000 | |
| ニチコン | 68,500 | 805.00 | 55,142,500 | |
| 日本ケミコン | 133,000 | 284.00 | 37,772,000 | |
| K O A | 24,900 | 939.00 | 23,381,100 | |
| 市光工業 | 63,000 | 141.00 | 8,883,000 | |
| 小糸製作所 | 106,000 | 1,794.00 | 190,164,000 | |
| ミツバ | 41,000 | 1,046.00 | 42,886,000 | |
| スター精密 | 36,500 | 982.00 | 35,843,000 | |
| 大日本スクリーン製造 | 226,000 | 433.00 | 97,858,000 | |
| キャノン電子 | 17,400 | 1,973.00 | 34,330,200 | |
| キャノン | 1,323,200 | 3,675.00 | 4,862,760,000 | |
| リコー | 642,000 | 1,168.00 | 749,856,000 | |
| M U T O Hホールディングス | 42,000 | 254.00 | 10,668,000 | |
| 東京エレクトロン | 179,600 | 4,260.00 | 765,096,000 | |
| トヨタ紡織 | 74,300 | 1,373.00 | 102,013,900 | |
| 鬼怒川ゴム工業 | 41,000 | 492.00 | 20,172,000 | |
| ユニプレス | 38,000 | 2,170.00 | 82,460,000 | |
| 豊田自動織機 | 191,000 | 3,850.00 | 735,350,000 | |
| モリタホールディングス | 38,000 | 840.00 | 31,920,000 | |
| 三櫻工業 | 26,000 | 660.00 | 17,160,000 | |
| デンソー | 525,000 | 4,310.00 | 2,262,750,000 | |
| 東海理化電機製作所 | 50,500 | 1,760.00 | 88,880,000 | |
| 三井造船 | 836,000 | 180.00 | 150,480,000 | |
| 佐世保重工業 | 162,000 | 118.00 | 19,116,000 | |
| 川崎重工業 | 1,661,000 | 333.00 | 553,113,000 | |
| 日本車輛製造 | 78,000 | 428.00 | 33,384,000 | |
| ニチュ三菱フォークリフト | 37,000 | 398.00 | 14,726,000 | |
| 近畿車輛 | 44,000 | 303.00 | 13,332,000 | |
| 日産自動車 | 2,690,700 | 1,011.00 | 2,720,297,700 | |
| いすゞ自動車 | 1,237,000 | 626.00 | 774,362,000 | |
| トヨタ自動車 | 2,737,500 | 5,540.00 | 15,165,750,000 | 代用有価証券で 1,800,000株 担 保差入 |
| 日野自動車 | 266,000 | 1,290.00 | 343,140,000 | |

| | | | |
|------------|-----------|------------|---------------|
| 三菱自動車工業 | 5,215,000 | 103.00 | 537,145,000 |
| エフテック | 9,100 | 1,428.00 | 12,994,800 |
| 武蔵精密工業 | 22,600 | 2,173.00 | 49,109,800 |
| 日産車体 | 69,000 | 1,260.00 | 86,940,000 |
| 新明和工業 | 86,000 | 741.00 | 63,726,000 |
| 極東開発工業 | 39,200 | 986.00 | 38,651,200 |
| 日信工業 | 42,900 | 1,866.00 | 80,051,400 |
| トピー工業 | 162,000 | 215.00 | 34,830,000 |
| ティラド | 80,000 | 264.00 | 21,120,000 |
| 曙ブレーキ工業 | 102,500 | 438.00 | 44,895,000 |
| タチエス | 29,000 | 1,639.00 | 47,531,000 |
| NOK | 103,900 | 1,473.00 | 153,044,700 |
| フタバ産業 | 64,900 | 443.00 | 28,750,700 |
| カヤバ工業 | 163,000 | 460.00 | 74,980,000 |
| シロキ工業 | 51,000 | 223.00 | 11,373,000 |
| 大同メタル工業 | 31,000 | 738.00 | 22,878,000 |
| プレス工業 | 91,000 | 462.00 | 42,042,000 |
| カルソニックカンセイ | 145,000 | 440.00 | 63,800,000 |
| 太平洋工業 | 43,000 | 570.00 | 24,510,000 |
| ケーヒン | 44,700 | 1,463.00 | 65,396,100 |
| 河西工業 | 31,000 | 455.00 | 14,105,000 |
| アイシン精機 | 193,900 | 3,730.00 | 723,247,000 |
| 富士機工 | 31,000 | 334.00 | 10,354,000 |
| マツダ | 3,385,000 | 304.00 | 1,029,040,000 |
| ダイハツ工業 | 226,000 | 1,956.00 | 442,056,000 |
| 今仙電機製作所 | 16,900 | 1,145.00 | 19,350,500 |
| 本田技研工業 | 1,797,600 | 3,885.00 | 6,983,676,000 |
| スズキ | 445,700 | 2,315.00 | 1,031,795,500 |
| 富士重工業 | 672,000 | 1,673.00 | 1,124,256,000 |
| ヤマハ発動機 | 325,800 | 1,316.00 | 428,752,800 |
| ショーワ | 50,500 | 1,069.00 | 53,984,500 |
| T B K | 23,000 | 549.00 | 12,627,000 |
| エクセディ | 28,900 | 2,223.00 | 64,244,700 |
| 豊田合成 | 60,200 | 2,420.00 | 145,684,000 |
| 愛三工業 | 20,800 | 871.00 | 18,116,800 |
| ヨロズ | 15,700 | 1,619.00 | 25,418,300 |
| エフ・シー・シー | 33,400 | 2,318.00 | 77,421,200 |
| シマノ | 86,000 | 8,600.00 | 739,600,000 |
| タカタ | 38,400 | 1,740.00 | 66,816,000 |
| テイ・エス テック | 45,200 | 2,814.00 | 127,192,800 |
| 日本電産トーソク | 12,600 | 622.00 | 7,837,200 |
| テルモ | 163,300 | 4,195.00 | 685,043,500 |
| 日機装 | 75,000 | 1,273.00 | 95,475,000 |
| 島津製作所 | 256,000 | 688.00 | 176,128,000 |
| J M S | 32,000 | 351.00 | 11,232,000 |
| 長野計器 | 17,600 | 739.00 | 13,006,400 |
| バイ・テクノロジー | 47 | 288,900.00 | 13,578,300 |
| 東京計器 | 78,000 | 204.00 | 15,912,000 |

| | | | |
|-------------------|---------|------------|-------------|
| 愛知時計電機 | 26,000 | 266.00 | 6,916,000 |
| 東京精密 | 38,900 | 1,940.00 | 75,466,000 |
| マニー | 6,200 | 3,320.00 | 20,584,000 |
| ニコン | 398,200 | 2,182.00 | 868,872,400 |
| トプコン | 46,000 | 949.00 | 43,654,000 |
| オリンパス | 250,900 | 2,283.00 | 572,804,700 |
| 理研計器 | 14,500 | 665.00 | 9,642,500 |
| タムロン | 17,100 | 2,010.00 | 34,371,000 |
| HOYA | 517,500 | 1,925.00 | 996,187,500 |
| ノーリツ鋼機 | 22,000 | 520.00 | 11,440,000 |
| エー・アンド・デイ | 20,200 | 523.00 | 10,564,600 |
| 日本電産コパル | 17,800 | 627.00 | 11,160,600 |
| シチズンホールディングス | 240,800 | 547.00 | 131,717,600 |
| リズム時計工業 | 106,000 | 164.00 | 17,384,000 |
| 大研医器 | 3,300 | 3,130.00 | 10,329,000 |
| 松風 | 11,400 | 952.00 | 10,852,800 |
| セイコーホールディングス | 136,000 | 540.00 | 73,440,000 |
| ニプロ | 114,500 | 827.00 | 94,691,500 |
| パラマウントベッドホールディングス | 18,300 | 3,635.00 | 66,520,500 |
| 永大産業 | 27,000 | 395.00 | 10,665,000 |
| ダンロップスポーツ | 9,600 | 1,081.00 | 10,377,600 |
| バンダイナムコホールディングス | 221,600 | 1,686.00 | 373,617,600 |
| 共立印刷 | 38,300 | 250.00 | 9,575,000 |
| フランスベッドホールディングス | 142,000 | 209.00 | 29,678,000 |
| パイロットコーポレーション | 192 | 311,500.00 | 59,808,000 |
| トッパン・フォームズ | 37,400 | 842.00 | 31,490,800 |
| フジシールインターナショナル | 25,200 | 2,530.00 | 63,756,000 |
| タカラトミー | 70,200 | 479.00 | 33,625,800 |
| 廣済堂 | 22,100 | 422.00 | 9,326,200 |
| アーク | 82,900 | 284.00 | 23,543,600 |
| タカノ | 4,500 | 468.00 | 2,106,000 |
| プロネクサス | 28,100 | 752.00 | 21,131,200 |
| ホクシン | 28,900 | 196.00 | 5,664,400 |
| ウッドワン | 40,000 | 318.00 | 12,720,000 |
| 大建工業 | 91,000 | 263.00 | 23,933,000 |
| 凸版印刷 | 596,000 | 695.00 | 414,220,000 |
| 大日本印刷 | 647,000 | 935.00 | 604,945,000 |
| 図書印刷 | 44,000 | 337.00 | 14,828,000 |
| 共同印刷 | 67,000 | 383.00 | 25,661,000 |
| 日本写真印刷 | 31,300 | 1,649.00 | 51,613,700 |
| 光村印刷 | 16,000 | 276.00 | 4,416,000 |
| 宝印刷 | 8,400 | 773.00 | 6,493,200 |
| アシックス | 200,300 | 1,815.00 | 363,544,500 |
| ツツミ | 10,900 | 2,863.00 | 31,206,700 |
| ローランド | 24,200 | 829.00 | 20,061,800 |
| 小松ウオール工業 | 9,100 | 2,030.00 | 18,473,000 |
| ヤマハ | 158,200 | 967.00 | 152,979,400 |
| 河合楽器製作所 | 89,000 | 177.00 | 15,753,000 |

| | | | | |
|------------|-----------|-----------|---------------|--|
| クリナップ | 24,900 | 630.00 | 15,687,000 | |
| ピジョン | 16,400 | 7,530.00 | 123,492,000 | |
| 兼松日産農林 | 39,000 | 177.00 | 6,903,000 | |
| キングジム | 18,500 | 752.00 | 13,912,000 | |
| リンテック | 45,800 | 1,698.00 | 77,768,400 | |
| イトーキ | 46,400 | 619.00 | 28,721,600 | |
| 任天堂 | 121,700 | 11,470.00 | 1,395,899,000 | |
| 三菱鉛筆 | 16,400 | 1,801.00 | 29,536,400 | |
| タカラスタンダード | 92,000 | 768.00 | 70,656,000 | |
| コクヨ | 100,500 | 720.00 | 72,360,000 | |
| ナカバヤシ | 48,000 | 207.00 | 9,936,000 | |
| グローブライド | 113,000 | 119.00 | 13,447,000 | |
| 岡村製作所 | 84,000 | 751.00 | 63,084,000 | |
| 美津濃 | 99,000 | 411.00 | 40,689,000 | |
| アデランス | 26,800 | 1,707.00 | 45,747,600 | |
| 東京電力 | 1,565,000 | 461.00 | 721,465,000 | |
| 中部電力 | 657,900 | 1,422.00 | 935,533,800 | |
| 関西電力 | 877,300 | 1,369.00 | 1,201,023,700 | |
| 中国電力 | 298,100 | 1,524.00 | 454,304,400 | |
| 北陸電力 | 213,200 | 1,469.00 | 313,190,800 | |
| 東北電力 | 539,000 | 1,056.00 | 569,184,000 | |
| 四国電力 | 196,100 | 1,920.00 | 376,512,000 | |
| 九州電力 | 476,400 | 1,545.00 | 736,038,000 | |
| 北海道電力 | 204,700 | 1,457.00 | 298,247,900 | |
| 沖縄電力 | 13,600 | 3,860.00 | 52,496,000 | |
| 電源開発 | 134,100 | 2,758.00 | 369,847,800 | |
| 東京瓦斯 | 2,572,000 | 539.00 | 1,386,308,000 | |
| 大阪瓦斯 | 2,081,000 | 425.00 | 884,425,000 | |
| 東邦瓦斯 | 547,000 | 628.00 | 343,516,000 | |
| 北海道瓦斯 | 56,000 | 257.00 | 14,392,000 | |
| 西部瓦斯 | 254,000 | 230.00 | 58,420,000 | |
| 静岡瓦斯 | 61,000 | 728.00 | 44,408,000 | |
| 東武鉄道 | 1,209,000 | 558.00 | 674,622,000 | |
| 相鉄ホールディングス | 338,000 | 390.00 | 131,820,000 | |
| 東京急行電鉄 | 1,251,000 | 798.00 | 998,298,000 | |
| 京浜急行電鉄 | 548,000 | 1,083.00 | 593,484,000 | |
| 小田急電鉄 | 680,000 | 1,206.00 | 820,080,000 | |
| 京王電鉄 | 596,000 | 808.00 | 481,568,000 | |
| 京成電鉄 | 320,000 | 1,004.00 | 321,280,000 | |
| 富士急行 | 62,000 | 915.00 | 56,730,000 | |
| 新京成電鉄 | 24,000 | 399.00 | 9,576,000 | |
| 東日本旅客鉄道 | 393,100 | 8,700.00 | 3,419,970,000 | |
| 西日本旅客鉄道 | 183,600 | 4,665.00 | 856,494,000 | |
| 東海旅客鉄道 | 177,200 | 11,770.00 | 2,085,644,000 | |
| 西日本鉄道 | 272,000 | 405.00 | 110,160,000 | |
| ハマキョウレックス | 6,700 | 3,400.00 | 22,780,000 | |
| サカイ引越センター | 3,500 | 2,348.00 | 8,218,000 | |
| 近畿日本鉄道 | 1,925,000 | 484.00 | 931,700,000 | |

| | | | |
|----------------|-----------|----------|-------------|
| 阪急阪神ホールディングス | 1,342,000 | 630.00 | 845,460,000 |
| 南海電気鉄道 | 444,000 | 396.00 | 175,824,000 |
| 京阪電気鉄道 | 474,000 | 425.00 | 201,450,000 |
| 名糖運輸 | 8,000 | 641.00 | 5,128,000 |
| 名古屋鉄道 | 748,000 | 308.00 | 230,384,000 |
| 日本通運 | 844,000 | 506.00 | 427,064,000 |
| ヤマトホールディングス | 402,300 | 1,878.00 | 755,519,400 |
| 山九 | 265,000 | 407.00 | 107,855,000 |
| 丸運 | 14,300 | 232.00 | 3,317,600 |
| 丸全昭和運輸 | 69,000 | 345.00 | 23,805,000 |
| センコー | 90,000 | 494.00 | 44,460,000 |
| トナミホールディングス | 54,000 | 212.00 | 11,448,000 |
| 日本梱包運輸倉庫 | 69,900 | 1,539.00 | 107,576,100 |
| 日本石油輸送 | 27,000 | 235.00 | 6,345,000 |
| 福山通運 | 124,000 | 535.00 | 66,340,000 |
| セイノーホールディングス | 164,000 | 851.00 | 139,564,000 |
| 神奈川中央交通 | 27,000 | 597.00 | 16,119,000 |
| 日立物流 | 38,000 | 1,504.00 | 57,152,000 |
| 日本郵船 | 1,702,000 | 248.00 | 422,096,000 |
| 商船三井 | 1,051,000 | 347.00 | 364,697,000 |
| 川崎汽船 | 960,000 | 217.00 | 208,320,000 |
| N S ユナイテッド海運 | 104,000 | 179.00 | 18,616,000 |
| 乾汽船 | 35,100 | 437.00 | 15,338,700 |
| 飯野海運 | 94,300 | 761.00 | 71,762,300 |
| 共栄タンカー | 30,000 | 287.00 | 8,610,000 |
| 日本航空 | 180,600 | 4,170.00 | 753,102,000 |
| A N A ホールディングス | 4,165,000 | 197.00 | 820,505,000 |
| パスコ | 26,000 | 360.00 | 9,360,000 |
| 日新 | 77,000 | 274.00 | 21,098,000 |
| 三菱倉庫 | 151,000 | 1,748.00 | 263,948,000 |
| 三井倉庫 | 104,000 | 607.00 | 63,128,000 |
| 住友倉庫 | 143,000 | 688.00 | 98,384,000 |
| 澁澤倉庫 | 61,000 | 557.00 | 33,977,000 |
| 東陽倉庫 | 42,000 | 289.00 | 12,138,000 |
| 日本トランスシティ | 52,000 | 375.00 | 19,500,000 |
| ケイヒン | 53,000 | 204.00 | 10,812,000 |
| 安田倉庫 | 18,700 | 1,154.00 | 21,579,800 |
| 東洋埠頭 | 76,000 | 208.00 | 15,808,000 |
| 宇徳 | 25,700 | 331.00 | 8,506,700 |
| 上組 | 236,000 | 907.00 | 214,052,000 |
| サンリツ | 8,900 | 613.00 | 5,455,700 |
| 郵船ロジスティクス | 19,500 | 1,042.00 | 20,319,000 |
| 近鉄エクスプレス | 19,300 | 3,600.00 | 69,480,000 |
| 東海運 | 21,300 | 275.00 | 5,857,500 |
| N E C ネットズエスアイ | 20,800 | 1,972.00 | 41,017,600 |
| システナ | 25,000 | 831.00 | 20,775,000 |
| 新日鉄住金ソリューションズ | 14,500 | 1,911.00 | 27,709,500 |
| コア | 9,000 | 738.00 | 6,642,000 |

| | | | | |
|-----------------------|---------|------------|-------------|--|
| ITホールディングス | 72,200 | 1,329.00 | 95,953,800 | |
| ネオス | 46 | 62,100.00 | 2,856,600 | |
| グリー | 111,900 | 1,172.00 | 131,146,800 | |
| コーエーテックホールディングス | 44,700 | 800.00 | 35,760,000 | |
| 三菱総合研究所 | 8,700 | 2,111.00 | 18,365,700 | |
| ボルテージ | 5,400 | 1,009.00 | 5,448,600 | |
| ネクソン | 177,200 | 1,038.00 | 183,933,600 | |
| ドワンゴ | 120 | 359,500.00 | 43,140,000 | |
| マクロミル | 16,800 | 1,202.00 | 20,193,600 | |
| ティーガイア | 26,200 | 995.00 | 26,069,000 | |
| GMOペイメントゲートウェイ | 8,300 | 2,306.00 | 19,139,800 | |
| ザッパラス | 163 | 101,700.00 | 16,577,100 | |
| インターネットイニシアティブ | 25,100 | 3,660.00 | 91,866,000 | |
| SRAホールディングス | 7,900 | 1,062.00 | 8,389,800 | |
| 朝日ネット | 19,000 | 486.00 | 9,234,000 | |
| パナソニック インフォメーションシステムズ | 3,300 | 2,287.00 | 7,547,100 | |
| フェイス | 847 | 10,950.00 | 9,274,650 | |
| 野村総合研究所 | 119,600 | 2,733.00 | 326,866,800 | |
| インテージ | 7,200 | 2,387.00 | 17,186,400 | |
| シンプレクス・ホールディングス | 491 | 43,050.00 | 21,137,550 | |
| クレスコ | 7,100 | 800.00 | 5,680,000 | |
| フジ・メディア・ホールディングス | 2,043 | 175,200.00 | 357,933,600 | |
| オービック | 7,300 | 24,190.00 | 176,587,000 | |
| TDCソフトウェアエンジニアリング | 5,600 | 818.00 | 4,580,800 | |
| ヤフー | 15,492 | 47,000.00 | 728,124,000 | |
| トレンドマイクロ | 85,000 | 2,605.00 | 221,425,000 | |
| 日本オラクル | 42,700 | 4,215.00 | 179,980,500 | |
| アルファシステムズ | 8,600 | 1,452.00 | 12,487,200 | |
| フューチャーアーキテクト | 270 | 45,300.00 | 12,231,000 | |
| シーエーシー | 10,100 | 842.00 | 8,504,200 | |
| オービックビジネスコンサルタント | 6,950 | 5,740.00 | 39,893,000 | |
| 伊藤忠テクノソリューションズ | 25,300 | 4,480.00 | 113,344,000 | |
| アイティフォー | 31,300 | 399.00 | 12,488,700 | |
| 大塚商会 | 19,000 | 9,980.00 | 189,620,000 | |
| サイボウズ | 433 | 25,400.00 | 10,998,200 | |
| 電通国際情報サービス | 16,100 | 1,058.00 | 17,033,800 | |
| ウェザーニューズ | 6,800 | 2,332.00 | 15,857,600 | |
| CIJ | 25,100 | 400.00 | 10,040,000 | |
| WOWOW | 64 | 240,100.00 | 15,366,400 | |
| ネットワンシステムズ | 81,600 | 829.00 | 67,646,400 | |
| アルゴグラフィックス | 6,600 | 1,416.00 | 9,345,600 | |
| エイベックス・グループ・ホールディングス | 41,100 | 2,734.00 | 112,367,400 | |
| 日本ユニシス | 59,900 | 799.00 | 47,860,100 | |
| 兼松エレクトロニクス | 7,700 | 1,195.00 | 9,201,500 | |
| 東京放送ホールディングス | 113,900 | 1,512.00 | 172,216,800 | |
| 日本テレビホールディングス | 191,700 | 1,536.00 | 294,451,200 | |
| テレビ朝日 | 53,000 | 1,875.00 | 99,375,000 | |

| | | | | |
|----------------------|-----------|------------|---------------|--|
| スカパーJ S A Tホールディングス | 1,828 | 46,750.00 | 85,459,000 | |
| テレビ東京ホールディングス | 13,400 | 1,152.00 | 15,436,800 | |
| アイ・ティー・シーネットワーク | 18,800 | 821.00 | 15,434,800 | |
| N E C モバイリング | 7,700 | 6,060.00 | 46,662,000 | |
| 日本電信電話 | 884,700 | 4,710.00 | 4,166,937,000 | |
| K D D I | 593,500 | 4,055.00 | 2,406,642,500 | |
| 光通信 | 21,600 | 5,220.00 | 112,752,000 | |
| エヌ・ティ・ティ・ドコモ | 17,302 | 155,300.00 | 2,687,000,600 | |
| G M O インターネット | 72,100 | 997.00 | 71,883,700 | |
| 学研ホールディングス | 75,000 | 279.00 | 20,925,000 | |
| ゼンリン | 30,500 | 1,228.00 | 37,454,000 | |
| 昭文社 | 6,500 | 591.00 | 3,841,500 | |
| 角川グループホールディングス | 18,300 | 2,636.00 | 48,238,800 | |
| インプレスホールディングス | 36,100 | 131.00 | 4,729,100 | |
| アイネット | 13,400 | 683.00 | 9,152,200 | |
| 松竹 | 139,000 | 1,010.00 | 140,390,000 | |
| 東宝 | 149,000 | 2,150.00 | 320,350,000 | |
| 東映 | 89,000 | 658.00 | 58,562,000 | |
| A O I P r o . | 12,500 | 668.00 | 8,350,000 | |
| エヌ・ティ・ティ・データ | 1,303 | 301,000.00 | 392,203,000 | |
| D T S | 21,900 | 1,461.00 | 31,995,900 | |
| スクウェア・エニックス・ホールディングス | 80,300 | 1,074.00 | 86,242,200 | |
| シーイーシー | 15,400 | 675.00 | 10,395,000 | |
| カブコン | 41,500 | 1,517.00 | 62,955,500 | |
| ジャステック | 13,000 | 661.00 | 8,593,000 | |
| S C S K | 51,500 | 1,828.00 | 94,142,000 | |
| アイネス | 30,900 | 758.00 | 23,422,200 | |
| T K C | 16,800 | 1,782.00 | 29,937,600 | |
| 富士ソフト | 29,500 | 2,371.00 | 69,944,500 | |
| N S D | 42,700 | 1,061.00 | 45,304,700 | |
| コナミ | 97,300 | 1,841.00 | 179,129,300 | |
| J B C C ホールディングス | 18,900 | 877.00 | 16,575,300 | |
| ソフトバンク | 1,012,300 | 4,685.00 | 4,742,625,500 | |
| 高千穂交易 | 6,300 | 913.00 | 5,751,900 | |
| 伊藤忠食品 | 3,100 | 3,670.00 | 11,377,000 | |
| エレマテック | 10,100 | 1,301.00 | 13,140,100 | |
| J A L U X | 6,300 | 929.00 | 5,852,700 | |
| あらた | 54,000 | 389.00 | 21,006,000 | |
| トーメンデバイス | 1,600 | 1,869.00 | 2,990,400 | |
| 双日 | 1,324,600 | 151.00 | 200,014,600 | |
| アルフレッサ ホールディングス | 54,500 | 5,430.00 | 295,935,000 | |
| 横浜冷凍 | 49,200 | 855.00 | 42,066,000 | |
| アルコニックス | 7,400 | 1,826.00 | 13,512,400 | |
| あい ホールディングス | 38,900 | 931.00 | 36,215,900 | |
| ダイワボウホールディングス | 204,000 | 195.00 | 39,780,000 | |
| バイタルケーエスケー・ホールディングス | 40,500 | 894.00 | 36,207,000 | |
| U K C ホールディングス | 13,900 | 2,176.00 | 30,246,400 | |

| | | | |
|-------------------|-----------|----------|---------------|
| TOKAIホールディングス | 94,500 | 310.00 | 29,295,000 |
| ミタチ産業 | 8,800 | 512.00 | 4,505,600 |
| シップヘルスケアホールディングス | 30,500 | 3,455.00 | 105,377,500 |
| 協栄産業 | 34,000 | 170.00 | 5,780,000 |
| 小野建 | 17,200 | 931.00 | 16,013,200 |
| 佐鳥電機 | 15,000 | 503.00 | 7,545,000 |
| 伯東 | 9,600 | 959.00 | 9,206,400 |
| コンドーテック | 21,200 | 615.00 | 13,038,000 |
| ナガイレーベン | 27,200 | 1,675.00 | 45,560,000 |
| 三菱食品 | 23,300 | 3,060.00 | 71,298,000 |
| 松田産業 | 15,400 | 1,305.00 | 20,097,000 |
| メディパルホールディングス | 211,100 | 1,499.00 | 316,438,900 |
| アドヴァン | 14,300 | 1,095.00 | 15,658,500 |
| S P K | 3,900 | 1,719.00 | 6,704,100 |
| アズワン | 13,700 | 2,176.00 | 29,811,200 |
| スズデン | 2,400 | 469.00 | 1,125,600 |
| 尾家産業 | 8,100 | 826.00 | 6,690,600 |
| シモジマ | 13,100 | 998.00 | 13,073,800 |
| ドウシシャ | 22,100 | 1,512.00 | 33,415,200 |
| 高速 | 13,500 | 864.00 | 11,664,000 |
| 黒田電気 | 29,500 | 1,173.00 | 34,603,500 |
| 丸文 | 18,800 | 439.00 | 8,253,200 |
| ハピネット | 15,000 | 792.00 | 11,880,000 |
| トーメンエレクトロニクス | 11,400 | 1,167.00 | 13,303,800 |
| エクセル | 7,100 | 925.00 | 6,567,500 |
| マルカキカイ | 8,800 | 1,210.00 | 10,648,000 |
| ガリバーインターナショナル | 7,440 | 5,670.00 | 42,184,800 |
| 日本エム・ディ・エム | 29,400 | 282.00 | 8,290,800 |
| 進和 | 14,400 | 1,175.00 | 16,920,000 |
| ダイトエレクトロン | 16,700 | 401.00 | 6,696,700 |
| シークス | 15,400 | 1,430.00 | 22,022,000 |
| 田中商事 | 11,000 | 504.00 | 5,544,000 |
| オーハシテクニカ | 14,300 | 881.00 | 12,598,300 |
| マクニカ | 10,900 | 1,849.00 | 20,154,100 |
| 白銅 | 7,700 | 812.00 | 6,252,400 |
| 伊藤忠商事 | 1,679,100 | 1,197.00 | 2,009,882,700 |
| 丸紅 | 1,724,000 | 696.00 | 1,199,904,000 |
| 高島 | 52,000 | 277.00 | 14,404,000 |
| F & A アクアホールディングス | 17,100 | 1,571.00 | 26,864,100 |
| 長瀬産業 | 115,400 | 1,161.00 | 133,979,400 |
| 蝶理 | 14,700 | 1,047.00 | 15,390,900 |
| 豊田通商 | 233,500 | 2,416.00 | 564,136,000 |
| 三共生興 | 39,300 | 355.00 | 13,951,500 |
| 兼松 | 467,000 | 127.00 | 59,309,000 |
| ツカモトコーポレーション | 55,000 | 174.00 | 9,570,000 |
| 三井物産 | 1,815,000 | 1,367.00 | 2,481,105,000 |
| 日本紙パルプ商事 | 101,000 | 303.00 | 30,603,000 |
| 日立ハイテクノロジーズ | 64,800 | 2,079.00 | 134,719,200 |

| | | | | |
|-------------------|-----------|----------|---------------|--|
| カメイ | 25,600 | 966.00 | 24,729,600 | |
| 東都水産 | 55,000 | 138.00 | 7,590,000 | |
| スターゼン | 60,000 | 256.00 | 15,360,000 | |
| 山善 | 80,500 | 610.00 | 49,105,000 | |
| 椿本興業 | 28,000 | 265.00 | 7,420,000 | |
| 住友商事 | 1,241,600 | 1,210.00 | 1,502,336,000 | |
| 内田洋行 | 56,000 | 283.00 | 15,848,000 | |
| 三菱商事 | 1,640,300 | 1,786.00 | 2,929,575,800 | |
| 第一実業 | 49,000 | 486.00 | 23,814,000 | |
| キャノンマーケティングジャパン | 71,600 | 1,479.00 | 105,896,400 | |
| 西華産業 | 76,000 | 253.00 | 19,228,000 | |
| 佐藤商事 | 17,900 | 586.00 | 10,489,400 | |
| 菱洋エレクトロ | 20,200 | 839.00 | 16,947,800 | |
| 東京産業 | 25,500 | 307.00 | 7,828,500 | |
| ユアサ商事 | 223,000 | 197.00 | 43,931,000 | |
| 神鋼商事 | 52,000 | 182.00 | 9,464,000 | |
| 阪和興業 | 211,000 | 349.00 | 73,639,000 | |
| カナデン | 20,000 | 602.00 | 12,040,000 | |
| 菱電商事 | 28,000 | 626.00 | 17,528,000 | |
| フルサト工業 | 12,300 | 1,005.00 | 12,361,500 | |
| 岩谷産業 | 236,000 | 424.00 | 100,064,000 | |
| すてきナイスグループ | 91,000 | 274.00 | 24,934,000 | |
| 昭光通商 | 93,000 | 144.00 | 13,392,000 | |
| ニチモウ | 44,000 | 201.00 | 8,844,000 | |
| 極東貿易 | 36,000 | 242.00 | 8,712,000 | |
| イワキ | 33,000 | 207.00 | 6,831,000 | |
| 三愛石油 | 45,000 | 456.00 | 20,520,000 | |
| 稲畑産業 | 50,300 | 694.00 | 34,908,200 | |
| G S Iクレオス | 76,000 | 140.00 | 10,640,000 | |
| 明和産業 | 24,000 | 411.00 | 9,864,000 | |
| 東邦ホールディングス | 68,700 | 2,193.00 | 150,659,100 | |
| サンゲツ | 35,700 | 2,652.00 | 94,676,400 | |
| ミツウロコグループホールディングス | 36,500 | 505.00 | 18,432,500 | |
| シナネン | 37,000 | 405.00 | 14,985,000 | |
| 伊藤忠エネクス | 39,600 | 503.00 | 19,918,800 | |
| サンリオ | 53,500 | 4,760.00 | 254,660,000 | |
| サンワテクノス | 12,500 | 853.00 | 10,662,500 | |
| リョーサン | 34,500 | 1,717.00 | 59,236,500 | |
| 新光商事 | 21,900 | 925.00 | 20,257,500 | |
| トーホー | 27,000 | 333.00 | 8,991,000 | |
| 三信電気 | 31,600 | 612.00 | 19,339,200 | |
| 東陽テクニカ | 30,000 | 1,389.00 | 41,670,000 | |
| モスフードサービス | 23,200 | 1,902.00 | 44,126,400 | |
| 加賀電子 | 20,900 | 783.00 | 16,364,700 | |
| ソーダニッカ | 17,000 | 404.00 | 6,868,000 | |
| 立花エレテック | 12,800 | 910.00 | 11,648,000 | |
| P a l t a c | 26,400 | 1,226.00 | 32,366,400 | |
| 太平洋興発 | 106,000 | 119.00 | 12,614,000 | |

| | | | |
|------------------|---------|------------|-------------|
| ヤマタネ | 111,000 | 196.00 | 21,756,000 |
| 丸紅建材リース | 38,000 | 215.00 | 8,170,000 |
| 日鐵商事 | 49,000 | 295.00 | 14,455,000 |
| トラスコ中山 | 23,100 | 1,906.00 | 44,028,600 |
| オートバックスセブン | 78,100 | 1,442.00 | 112,620,200 |
| 加藤産業 | 27,800 | 2,027.00 | 56,350,600 |
| イノテック | 23,700 | 408.00 | 9,669,600 |
| イエローハット | 20,100 | 1,483.00 | 29,808,300 |
| 富士エレクトロニクス | 10,900 | 1,235.00 | 13,461,500 |
| J Kホールディングス | 21,800 | 619.00 | 13,494,200 |
| 日伝 | 7,800 | 2,374.00 | 18,517,200 |
| 北沢産業 | 32,000 | 188.00 | 6,016,000 |
| 杉本商事 | 8,800 | 813.00 | 7,154,400 |
| 因幡電機産業 | 23,700 | 2,787.00 | 66,051,900 |
| 住金物産 | 109,000 | 312.00 | 34,008,000 |
| ミスミグループ本社 | 78,700 | 2,815.00 | 221,540,500 |
| タキヒヨー | 37,000 | 418.00 | 15,466,000 |
| スズケン | 80,900 | 3,750.00 | 303,375,000 |
| ジェコス | 18,800 | 790.00 | 14,852,000 |
| ローソン | 79,800 | 7,220.00 | 576,156,000 |
| サンエー | 7,400 | 4,685.00 | 34,669,000 |
| キリン堂 | 10,100 | 687.00 | 6,938,700 |
| カワチ薬品 | 15,300 | 2,157.00 | 33,002,100 |
| エービーシー・マート | 25,800 | 3,710.00 | 95,718,000 |
| ハードオフコーポレーション | 10,200 | 635.00 | 6,477,000 |
| アスクル | 16,500 | 1,536.00 | 25,344,000 |
| ゲオホールディングス | 355 | 115,100.00 | 40,860,500 |
| ポイント | 19,330 | 4,185.00 | 80,896,050 |
| シー・ヴィ・エス・バイエリア | 48,000 | 107.00 | 5,136,000 |
| くらコーポレーション | 13,000 | 1,737.00 | 22,581,000 |
| キャンドゥ | 129 | 151,200.00 | 19,504,800 |
| パル | 12,300 | 3,065.00 | 37,699,500 |
| エディオン | 93,800 | 427.00 | 40,052,600 |
| サーラコーポレーション | 20,200 | 513.00 | 10,362,600 |
| あみやき亭 | 43 | 285,700.00 | 12,285,100 |
| ひらまつ | 26,700 | 670.00 | 17,889,000 |
| ゲンキー | 2,900 | 2,279.00 | 6,609,100 |
| 大黒天物産 | 4,200 | 2,622.00 | 11,012,400 |
| ハニーズ | 16,550 | 1,211.00 | 20,042,050 |
| アルペン | 15,400 | 1,799.00 | 27,704,600 |
| ビックカメラ | 722 | 41,900.00 | 30,251,800 |
| D C Mホールディングス | 102,600 | 897.00 | 92,032,200 |
| MonotaRO | 14,800 | 4,650.00 | 68,820,000 |
| J・フロントリテイリング | 499,000 | 804.00 | 401,196,000 |
| ドトール・日レスホールディングス | 35,900 | 1,389.00 | 49,865,100 |
| マツモトキヨシホールディングス | 35,600 | 2,641.00 | 94,019,600 |
| スタートトゥデイ | 44,500 | 1,427.00 | 63,501,500 |
| 物語コーポレーション | 3,100 | 3,140.00 | 9,734,000 |

| | | | |
|-------------------|---------|-----------|---------------|
| ココカラファイン | 22,000 | 3,605.00 | 79,310,000 |
| 三越伊勢丹ホールディングス | 418,200 | 1,507.00 | 630,227,400 |
| ウエルシアホールディングス | 7,300 | 5,380.00 | 39,274,000 |
| クリエイトSDホールディングス | 8,500 | 3,970.00 | 33,745,000 |
| ブックオフコーポレーション | 12,400 | 688.00 | 8,531,200 |
| あさひ | 11,600 | 1,459.00 | 16,924,400 |
| 日本調剤 | 3,910 | 2,275.00 | 8,895,250 |
| コスモス薬品 | 10,600 | 10,680.00 | 113,208,000 |
| セブン&アイ・ホールディングス | 879,800 | 3,605.00 | 3,171,679,000 |
| ツルハホールディングス | 20,200 | 9,350.00 | 188,870,000 |
| サンマルクホールディングス | 6,900 | 4,695.00 | 32,395,500 |
| フェリシモ | 6,000 | 1,129.00 | 6,774,000 |
| トリドール | 21,500 | 1,086.00 | 23,349,000 |
| クスリのアオキ | 3,200 | 6,780.00 | 21,696,000 |
| メディカルシステムネットワーク | 17,800 | 454.00 | 8,081,200 |
| 総合メディカル | 5,900 | 3,615.00 | 21,328,500 |
| はるやま商事 | 10,800 | 589.00 | 6,361,200 |
| カッパ・クリエイトホールディングス | 14,800 | 1,848.00 | 27,350,400 |
| ライトオン | 16,500 | 859.00 | 14,173,500 |
| 良品計画 | 22,700 | 8,660.00 | 196,582,000 |
| 三城ホールディングス | 31,900 | 531.00 | 16,938,900 |
| コナカ | 26,500 | 1,135.00 | 30,077,500 |
| イオン北海道 | 4,400 | 488.00 | 2,147,200 |
| コジマ | 37,300 | 325.00 | 12,122,500 |
| コーナン商事 | 26,500 | 1,175.00 | 31,137,500 |
| エコス | 5,100 | 589.00 | 3,003,900 |
| ワタミ | 24,500 | 1,721.00 | 42,164,500 |
| ドン・キホーテ | 61,700 | 4,900.00 | 302,330,000 |
| メガネトップ | 38,300 | 1,398.00 | 53,543,400 |
| 西松屋チェーン | 42,200 | 843.00 | 35,574,600 |
| ゼンショーホールディングス | 78,700 | 1,231.00 | 96,879,700 |
| 幸楽苑 | 14,000 | 1,221.00 | 17,094,000 |
| サイゼリヤ | 28,600 | 1,250.00 | 35,750,000 |
| ユナイテッドアローズ | 22,800 | 3,360.00 | 76,608,000 |
| ハイデイ日高 | 11,000 | 1,956.00 | 21,516,000 |
| 京都きもの友禅 | 14,700 | 1,049.00 | 15,420,300 |
| コロワイド | 71,000 | 940.00 | 66,740,000 |
| 壱番屋 | 7,900 | 3,970.00 | 31,363,000 |
| スギホールディングス | 34,100 | 3,435.00 | 117,133,500 |
| スクロール | 38,000 | 303.00 | 11,514,000 |
| ファミリーマート | 65,300 | 4,035.00 | 263,485,500 |
| 木曽路 | 24,200 | 1,904.00 | 46,076,800 |
| 千趣会 | 37,800 | 796.00 | 30,088,800 |
| タカキュー | 23,000 | 464.00 | 10,672,000 |
| ケーヨー | 34,000 | 485.00 | 16,490,000 |
| 上新電機 | 44,000 | 881.00 | 38,764,000 |
| 日本瓦斯 | 31,200 | 1,183.00 | 36,909,600 |
| ベスト電器 | 78,600 | 227.00 | 17,842,200 |

| | | | |
|------------------|---------|------------|---------------|
| マルエツ | 48,000 | 319.00 | 15,312,000 |
| ロイヤルホールディングス | 32,400 | 1,312.00 | 42,508,800 |
| 東天紅 | 27,000 | 210.00 | 5,670,000 |
| いなげや | 16,100 | 1,010.00 | 16,261,000 |
| 島忠 | 47,300 | 2,435.00 | 115,175,500 |
| チヨダ | 25,100 | 2,839.00 | 71,258,900 |
| ライフコーポレーション | 14,700 | 1,411.00 | 20,741,700 |
| カスミ | 30,600 | 651.00 | 19,920,600 |
| リンガーハット | 20,400 | 1,253.00 | 25,561,200 |
| テナアライド | 26,500 | 292.00 | 7,738,000 |
| A O K Iホールディングス | 19,000 | 2,674.00 | 50,806,000 |
| オークワ | 33,000 | 1,056.00 | 34,848,000 |
| コメリ | 32,500 | 2,776.00 | 90,220,000 |
| 青山商事 | 58,800 | 2,736.00 | 160,876,800 |
| しまむら | 24,400 | 12,030.00 | 293,532,000 |
| C F Sコーポレーション | 19,300 | 386.00 | 7,449,800 |
| 高島屋 | 286,000 | 1,084.00 | 310,024,000 |
| 松屋 | 42,500 | 1,676.00 | 71,230,000 |
| エイチ・ツー・オー リテイリング | 140,000 | 1,043.00 | 146,020,000 |
| ニッセンホールディングス | 46,800 | 351.00 | 16,426,800 |
| パルコ | 42,900 | 1,026.00 | 44,015,400 |
| 丸井グループ | 276,300 | 1,079.00 | 298,127,700 |
| 原信ナルスホールディングス | 11,000 | 1,792.00 | 19,712,000 |
| 井筒屋 | 75,000 | 103.00 | 7,725,000 |
| ダイエー | 130,000 | 325.00 | 42,250,000 |
| イズミヤ | 75,000 | 496.00 | 37,200,000 |
| イオン | 739,500 | 1,377.00 | 1,018,291,500 |
| ユニーグループ・ホールディングス | 203,800 | 652.00 | 132,877,600 |
| イズミ | 53,100 | 2,532.00 | 134,449,200 |
| 東武ストア | 26,000 | 269.00 | 6,994,000 |
| 平和堂 | 41,900 | 1,567.00 | 65,657,300 |
| フジ | 22,200 | 1,799.00 | 39,937,800 |
| ヤオコー | 9,900 | 4,155.00 | 41,134,500 |
| ゼビオ | 29,400 | 2,141.00 | 62,945,400 |
| ケーズホールディングス | 53,600 | 3,200.00 | 171,520,000 |
| O l y m p i c | 16,500 | 707.00 | 11,665,500 |
| 日産東京販売ホールディングス | 40,000 | 331.00 | 13,240,000 |
| アインファーマシーズ | 13,300 | 4,740.00 | 63,042,000 |
| 元気寿司 | 8,100 | 1,186.00 | 9,606,600 |
| ヤマダ電機 | 95,810 | 4,795.00 | 459,408,950 |
| アークランドサカモト | 14,300 | 1,845.00 | 26,383,500 |
| ニトリホールディングス | 42,200 | 7,170.00 | 302,574,000 |
| グルメ杵屋 | 18,000 | 663.00 | 11,934,000 |
| 愛眼 | 25,300 | 321.00 | 8,121,300 |
| 吉野家ホールディングス | 548 | 110,200.00 | 60,389,600 |
| 松屋フーズ | 7,600 | 1,608.00 | 12,220,800 |
| サガミチェーン | 28,000 | 780.00 | 21,840,000 |
| プレナス | 21,300 | 1,586.00 | 33,781,800 |

| | | | | |
|-------------------|------------|-----------|----------------|--|
| ミニストップ | 13,300 | 1,639.00 | 21,798,700 | |
| アークス | 35,400 | 1,785.00 | 63,189,000 | |
| パロー | 45,400 | 1,739.00 | 78,950,600 | |
| ベルク | 7,800 | 1,615.00 | 12,597,000 | |
| 大庄 | 8,400 | 1,224.00 | 10,281,600 | |
| ファーストリテイリング | 42,200 | 33,350.00 | 1,407,370,000 | |
| サンドラッグ | 40,100 | 4,120.00 | 165,212,000 | |
| 東京デリカ | 8,600 | 1,538.00 | 13,226,800 | |
| ヤマザワ | 4,900 | 1,505.00 | 7,374,500 | |
| やまや | 5,000 | 1,523.00 | 7,615,000 | |
| ペルーナ | 27,050 | 925.00 | 25,021,250 | |
| 島根銀行 | 5,000 | 1,304.00 | 6,520,000 | |
| 新生銀行 | 1,830,000 | 262.00 | 479,460,000 | |
| あおぞら銀行 | 777,000 | 290.00 | 225,330,000 | |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 15,924,000 | 663.00 | 10,557,612,000 | |
| りそなホールディングス | 2,169,800 | 518.00 | 1,123,956,400 | |
| 三井住友トラスト・ホールディングス | 4,401,000 | 502.00 | 2,209,302,000 | |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 1,590,600 | 4,510.00 | 7,173,606,000 | |
| 第四銀行 | 267,000 | 383.00 | 102,261,000 | |
| 北越銀行 | 211,000 | 237.00 | 50,007,000 | |
| 西日本シティ銀行 | 740,000 | 298.00 | 220,520,000 | |
| 千葉銀行 | 812,000 | 751.00 | 609,812,000 | |
| 横浜銀行 | 1,341,000 | 586.00 | 785,826,000 | |
| 常陽銀行 | 788,000 | 568.00 | 447,584,000 | |
| 群馬銀行 | 470,000 | 587.00 | 275,890,000 | |
| 武蔵野銀行 | 34,100 | 4,050.00 | 138,105,000 | |
| 千葉興業銀行 | 43,900 | 904.00 | 39,685,600 | |
| 筑波銀行 | 91,400 | 492.00 | 44,968,800 | |
| 東京都民銀行 | 42,200 | 1,335.00 | 56,337,000 | |
| 七十七銀行 | 332,000 | 541.00 | 179,612,000 | |
| 青森銀行 | 159,000 | 290.00 | 46,110,000 | |
| 秋田銀行 | 140,000 | 271.00 | 37,940,000 | |
| 山形銀行 | 127,000 | 481.00 | 61,087,000 | |
| 岩手銀行 | 15,900 | 4,045.00 | 64,315,500 | |
| 東邦銀行 | 178,000 | 301.00 | 53,578,000 | |
| 東北銀行 | 125,000 | 165.00 | 20,625,000 | |
| みちのく銀行 | 103,000 | 227.00 | 23,381,000 | |
| ふくおかフィナンシャルグループ | 854,000 | 499.00 | 426,146,000 | |
| 静岡銀行 | 615,000 | 1,146.00 | 704,790,000 | |
| 十六銀行 | 261,000 | 398.00 | 103,878,000 | |
| スルガ銀行 | 207,000 | 1,569.00 | 324,783,000 | |
| 八十二銀行 | 380,000 | 619.00 | 235,220,000 | |
| 山梨中央銀行 | 128,000 | 448.00 | 57,344,000 | |
| 大垣共立銀行 | 275,000 | 356.00 | 97,900,000 | |
| 福井銀行 | 192,000 | 208.00 | 39,936,000 | |
| 北國銀行 | 240,000 | 412.00 | 98,880,000 | |
| 清水銀行 | 7,500 | 2,943.00 | 22,072,500 | |
| 滋賀銀行 | 194,000 | 679.00 | 131,726,000 | |

| | | | | |
|-----------------|------------|----------|---------------|--|
| 南都銀行 | 211,000 | 448.00 | 94,528,000 | |
| 百五銀行 | 186,000 | 485.00 | 90,210,000 | |
| 京都銀行 | 375,000 | 1,030.00 | 386,250,000 | |
| 三重銀行 | 85,000 | 232.00 | 19,720,000 | |
| ほくほくフィナンシャルグループ | 1,483,000 | 221.00 | 327,743,000 | |
| 広島銀行 | 622,000 | 507.00 | 315,354,000 | |
| 山陰合同銀行 | 120,000 | 818.00 | 98,160,000 | |
| 中国銀行 | 160,000 | 1,668.00 | 266,880,000 | |
| 鳥取銀行 | 74,000 | 211.00 | 15,614,000 | |
| 伊予銀行 | 224,000 | 988.00 | 221,312,000 | |
| 百十四銀行 | 227,000 | 392.00 | 88,984,000 | |
| 四国銀行 | 155,000 | 288.00 | 44,640,000 | |
| 阿波銀行 | 166,000 | 587.00 | 97,442,000 | |
| 鹿児島銀行 | 146,000 | 700.00 | 102,200,000 | |
| 大分銀行 | 127,000 | 385.00 | 48,895,000 | |
| 宮崎銀行 | 143,000 | 285.00 | 40,755,000 | |
| 肥後銀行 | 170,000 | 628.00 | 106,760,000 | |
| 佐賀銀行 | 125,000 | 247.00 | 30,875,000 | |
| 十八銀行 | 131,000 | 250.00 | 32,750,000 | |
| 沖縄銀行 | 15,900 | 4,860.00 | 77,274,000 | |
| 琉球銀行 | 43,600 | 1,448.00 | 63,132,800 | |
| 八千代銀行 | 11,300 | 3,820.00 | 43,166,000 | |
| セブン銀行 | 721,500 | 313.00 | 225,829,500 | |
| みずほフィナンシャルグループ | 27,158,200 | 212.00 | 5,757,538,400 | |
| 紀陽ホールディングス | 828,000 | 154.00 | 127,512,000 | |
| 山口フィナンシャルグループ | 209,000 | 967.00 | 202,103,000 | |
| 長野銀行 | 78,000 | 188.00 | 14,664,000 | |
| 名古屋銀行 | 191,000 | 448.00 | 85,568,000 | |
| 北洋銀行 | 325,500 | 313.00 | 101,881,500 | |
| 愛知銀行 | 7,800 | 5,680.00 | 44,304,000 | |
| 第三銀行 | 123,000 | 175.00 | 21,525,000 | |
| 中京銀行 | 88,000 | 203.00 | 17,864,000 | |
| 東日本銀行 | 94,000 | 256.00 | 24,064,000 | |
| 大光銀行 | 83,000 | 275.00 | 22,825,000 | |
| 愛媛銀行 | 122,000 | 249.00 | 30,378,000 | |
| トマト銀行 | 94,000 | 182.00 | 17,108,000 | |
| みなと銀行 | 198,000 | 184.00 | 36,432,000 | |
| 京葉銀行 | 171,000 | 562.00 | 96,102,000 | |
| 関西アーバン銀行 | 312,000 | 130.00 | 40,560,000 | |
| 栃木銀行 | 108,000 | 407.00 | 43,956,000 | |
| 北日本銀行 | 6,900 | 2,519.00 | 17,381,100 | |
| 東和銀行 | 243,000 | 115.00 | 27,945,000 | |
| 福島銀行 | 293,000 | 88.00 | 25,784,000 | |
| 大東銀行 | 163,000 | 95.00 | 15,485,000 | |
| トモニホールディングス | 164,600 | 397.00 | 65,346,200 | |
| フィデアホールディングス | 127,500 | 237.00 | 30,217,500 | |
| 池田泉州ホールディングス | 178,700 | 525.00 | 93,817,500 | |
| SBIホールディングス | 271,400 | 996.00 | 270,314,400 | |

| | | | |
|-------------------------------|-----------|------------|---------------|
| ジャフコ | 29,500 | 4,165.00 | 122,867,500 |
| 大和証券グループ本社 | 2,084,000 | 784.00 | 1,633,856,000 |
| 野村ホールディングス | 4,302,000 | 779.00 | 3,351,258,000 |
| 岡三証券グループ | 181,000 | 1,005.00 | 181,905,000 |
| 丸三証券 | 65,300 | 730.00 | 47,669,000 |
| 東洋証券 | 81,000 | 409.00 | 33,129,000 |
| 東海東京フィナンシャル・ホールディングス | 242,200 | 752.00 | 182,134,400 |
| 光世証券 | 60,000 | 349.00 | 20,940,000 |
| 水戸証券 | 64,000 | 556.00 | 35,584,000 |
| いちよし証券 | 50,400 | 1,087.00 | 54,784,800 |
| 松井証券 | 127,300 | 1,110.00 | 141,303,000 |
| だいこう証券ビジネス | 14,900 | 682.00 | 10,161,800 |
| マネックスグループ | 2,372 | 44,200.00 | 104,842,400 |
| カブドットコム証券 | 86,500 | 613.00 | 53,024,500 |
| 極東証券 | 29,400 | 1,678.00 | 49,333,200 |
| 岩井コスモホールディングス | 22,900 | 979.00 | 22,419,100 |
| N K S Jホールディングス | 467,700 | 2,331.00 | 1,090,208,700 |
| M S & A Dインシュアランスグループホールディングス | 628,000 | 2,473.00 | 1,553,044,000 |
| ソニーフィナンシャルホールディングス | 202,400 | 1,315.00 | 266,156,000 |
| 第一生命保険 | 11,256 | 134,600.00 | 1,515,057,600 |
| 東京海上ホールディングス | 814,100 | 3,120.00 | 2,539,992,000 |
| T & Dホールディングス | 722,400 | 1,064.00 | 768,633,600 |
| 全国保証 | 17,900 | 3,640.00 | 65,156,000 |
| クレディセゾン | 187,000 | 2,564.00 | 479,468,000 |
| 芙蓉総合リース | 21,700 | 3,940.00 | 85,498,000 |
| 興銀リース | 33,900 | 3,060.00 | 103,734,000 |
| 東京センチュリーリース | 51,900 | 2,808.00 | 145,735,200 |
| 日本証券金融 | 86,900 | 881.00 | 76,558,900 |
| 大阪証券金融 | 53,000 | 346.00 | 18,338,000 |
| アイフル | 51,200 | 821.00 | 42,035,200 |
| ポケットカード | 28,400 | 743.00 | 21,101,200 |
| リコーリース | 16,500 | 2,980.00 | 49,170,000 |
| イオンフィナンシャルサービス | 79,600 | 2,759.00 | 219,616,400 |
| アコム | 44,220 | 3,315.00 | 146,589,300 |
| ジャックス | 126,000 | 617.00 | 77,742,000 |
| オリエン特コーポレーション | 423,000 | 322.00 | 136,206,000 |
| 日立キャピタル | 45,400 | 2,085.00 | 94,659,000 |
| オリックス | 1,101,500 | 1,397.00 | 1,538,795,500 |
| 三菱UFJリース | 546,300 | 515.00 | 281,344,500 |
| 日本取引所グループ | 40,400 | 10,930.00 | 441,572,000 |
| N E Cキャピタルソリューション | 10,800 | 3,675.00 | 39,690,000 |
| 日本駐車場開発 | 2,984 | 7,740.00 | 23,096,160 |
| ヒューリック | 276,200 | 995.00 | 274,819,000 |
| 野村不動産ホールディングス | 102,400 | 2,483.00 | 254,259,200 |
| 常和ホールディングス | 5,800 | 2,840.00 | 16,472,000 |
| フージャースホールディングス | 9,800 | 1,525.00 | 14,945,000 |

| | | | |
|---------------|-----------|------------|---------------|
| パーク24 | 112,400 | 1,921.00 | 215,920,400 |
| 三井不動産 | 993,000 | 3,470.00 | 3,445,710,000 |
| 三菱地所 | 1,473,000 | 3,260.00 | 4,801,980,000 |
| 平和不動産 | 42,100 | 2,120.00 | 89,252,000 |
| 東京建物 | 407,000 | 923.00 | 375,661,000 |
| ダイビル | 57,500 | 1,344.00 | 77,280,000 |
| 東急不動産 | 462,000 | 1,198.00 | 553,476,000 |
| 京阪神ビルディング | 31,300 | 764.00 | 23,913,200 |
| 住友不動産 | 505,000 | 4,850.00 | 2,449,250,000 |
| 東宝不動産 | 22,800 | 868.00 | 19,790,400 |
| 大京 | 333,000 | 365.00 | 121,545,000 |
| テオーシー | 78,500 | 794.00 | 62,329,000 |
| 東京楽天地 | 43,000 | 493.00 | 21,199,000 |
| レオパレス21 | 145,700 | 528.00 | 76,929,600 |
| フジ住宅 | 30,700 | 620.00 | 19,034,000 |
| 空港施設 | 30,500 | 641.00 | 19,550,500 |
| 住友不動産販売 | 8,080 | 6,320.00 | 51,065,600 |
| ゴールドクレスト | 18,000 | 2,757.00 | 49,626,000 |
| 東栄住宅 | 15,600 | 1,974.00 | 30,794,400 |
| 日本エスリード | 11,800 | 1,288.00 | 15,198,400 |
| 東急リパブル | 24,000 | 2,195.00 | 52,680,000 |
| 飯田産業 | 22,900 | 1,924.00 | 44,059,600 |
| 日神不動産 | 16,700 | 907.00 | 15,146,900 |
| アーネストワン | 35,100 | 2,094.00 | 73,499,400 |
| タカラレーベン | 23,700 | 1,762.00 | 41,759,400 |
| サンヨーハウジング名古屋 | 13,300 | 1,407.00 | 18,713,100 |
| イオンモール | 97,400 | 3,235.00 | 315,089,000 |
| タクトホーム | 115 | 193,700.00 | 22,275,500 |
| トーセイ | 306 | 121,800.00 | 37,270,800 |
| エヌ・ティ・ティ都市開発 | 1,339 | 135,200.00 | 181,032,800 |
| 日本空港ビルデング | 76,100 | 1,400.00 | 106,540,000 |
| 日本工営 | 78,000 | 379.00 | 29,562,000 |
| ネクスト | 13,800 | 952.00 | 13,137,600 |
| 日本M&Aセンター | 12,300 | 4,545.00 | 55,903,500 |
| アコーディア・ゴルフ | 1,011 | 103,700.00 | 104,840,700 |
| タケエイ | 3,700 | 3,635.00 | 13,449,500 |
| パソナグループ | 262 | 71,500.00 | 18,733,000 |
| リンクアンドモチベーション | 92 | 66,000.00 | 6,072,000 |
| GCAサヴィアン | 12,700 | 1,125.00 | 14,287,500 |
| エス・エム・エス | 14,600 | 1,425.00 | 20,805,000 |
| テンプホールディングス | 31,400 | 1,946.00 | 61,104,400 |
| クックパッド | 6,400 | 5,400.00 | 34,560,000 |
| 学情 | 12,200 | 438.00 | 5,343,600 |
| スタジオアリス | 11,500 | 1,400.00 | 16,100,000 |
| シミックホールディングス | 10,400 | 1,952.00 | 20,300,800 |
| NECフィールディング | 13,900 | 1,205.00 | 16,749,500 |
| 総合警備保障 | 80,300 | 1,416.00 | 113,704,800 |
| カカクコム | 62,800 | 2,230.00 | 140,044,000 |

| | | | |
|----------------|---------|------------|---------------|
| ルネサンス | 11,900 | 740.00 | 8,806,000 |
| ツクイ | 21,600 | 1,374.00 | 29,678,400 |
| エムスリー | 552 | 195,900.00 | 108,136,800 |
| ベストブライダル | 80 | 155,500.00 | 12,440,000 |
| ディー・エヌ・エー | 111,500 | 2,591.00 | 288,896,500 |
| 博報堂DYホールディングス | 30,780 | 7,540.00 | 232,081,200 |
| ぐるなび | 19,500 | 1,231.00 | 24,004,500 |
| ジェイコムホールディングス | 6,800 | 795.00 | 5,406,000 |
| PGMホールディングス | 331 | 95,000.00 | 31,445,000 |
| J Pホールディングス | 7,800 | 2,185.00 | 17,043,000 |
| イーピーエス | 292 | 144,300.00 | 42,135,600 |
| アミューズ | 9,300 | 2,036.00 | 18,934,800 |
| ケネディクス | 2,174 | 72,100.00 | 156,745,400 |
| 電通 | 202,600 | 3,105.00 | 629,073,000 |
| テイクアンドギヴ・ニーズ | 1,046 | 17,070.00 | 17,855,220 |
| ぴあ | 9,400 | 1,523.00 | 14,316,200 |
| イオンファンタジー | 8,000 | 1,673.00 | 13,384,000 |
| みらかホールディングス | 58,400 | 4,800.00 | 280,320,000 |
| アルプス技研 | 11,500 | 1,021.00 | 11,741,500 |
| サニックス | 38,200 | 537.00 | 20,513,400 |
| オリエンタルランド | 66,200 | 15,650.00 | 1,036,030,000 |
| ダスキン | 55,900 | 1,887.00 | 105,483,300 |
| 明光ネットワークジャパン | 20,700 | 1,395.00 | 28,876,500 |
| ファルコSDホールディングス | 13,200 | 1,222.00 | 16,130,400 |
| ラウンドワン | 73,300 | 720.00 | 52,776,000 |
| リゾートトラスト | 37,800 | 3,150.00 | 119,070,000 |
| ビー・エム・エル | 13,600 | 2,514.00 | 34,190,400 |
| ワタベウェディング | 8,000 | 783.00 | 6,264,000 |
| もしもしホットライン | 39,900 | 1,349.00 | 53,825,100 |
| 東急コミュニティー | 4,800 | 4,550.00 | 21,840,000 |
| リソー教育 | 2,560 | 9,760.00 | 24,985,600 |
| ユー・エス・エス | 25,050 | 11,320.00 | 283,566,000 |
| セントラルスポーツ | 5,900 | 1,537.00 | 9,068,300 |
| フルキャストホールディングス | 365 | 17,000.00 | 6,205,000 |
| リゾートソリューション | 31,000 | 220.00 | 6,820,000 |
| リロ・ホールディング | 7,600 | 4,490.00 | 34,124,000 |
| エイチ・アイ・エス | 18,600 | 3,950.00 | 73,470,000 |
| 共立メンテナンス | 9,800 | 2,687.00 | 26,332,600 |
| イチネンホールディングス | 23,900 | 661.00 | 15,797,900 |
| 建設技術研究所 | 13,600 | 671.00 | 9,125,600 |
| 燦ホールディングス | 3,300 | 1,406.00 | 4,639,800 |
| 東京テアトル | 106,000 | 197.00 | 20,882,000 |
| よみうりランド | 50,000 | 700.00 | 35,000,000 |
| 東京都競馬 | 182,000 | 443.00 | 80,626,000 |
| 常磐興産 | 86,000 | 201.00 | 17,286,000 |
| カナモト | 27,000 | 2,137.00 | 57,699,000 |
| 東京ドーム | 170,000 | 671.00 | 114,070,000 |
| トランス・コスモス | 30,400 | 1,315.00 | 39,976,000 |

| | | | | |
|--------------|-------------|----------|-----------------|--|
| 乃村工藝社 | 52,000 | 597.00 | 31,044,000 | |
| 藤田観光 | 64,000 | 454.00 | 29,056,000 | |
| 日本管財 | 7,600 | 1,538.00 | 11,688,800 | |
| トーカイ | 9,500 | 2,811.00 | 26,704,500 | |
| 白洋舎 | 31,000 | 227.00 | 7,037,000 | |
| セコム | 232,100 | 5,120.00 | 1,188,352,000 | |
| セントラル警備保障 | 4,400 | 882.00 | 3,880,800 | |
| 丹青社 | 29,000 | 364.00 | 10,556,000 | |
| メイテック | 35,500 | 2,468.00 | 87,614,000 | |
| アサツー ディ・ケイ | 36,800 | 2,507.00 | 92,257,600 | |
| 応用地質 | 25,000 | 1,613.00 | 40,325,000 | |
| 船井総合研究所 | 20,500 | 719.00 | 14,739,500 | |
| 進学会 | 13,900 | 329.00 | 4,573,100 | |
| ベネッセホールディングス | 68,300 | 4,150.00 | 283,445,000 | |
| イオンディライト | 22,300 | 1,977.00 | 44,087,100 | |
| ナック | 10,300 | 1,559.00 | 16,057,700 | |
| ニチイ学館 | 46,400 | 862.00 | 39,996,800 | |
| ダイセキ | 35,000 | 1,722.00 | 60,270,000 | |
| 合計 | 332,281,258 | | 334,404,904,740 | |

(b) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

「国内債券パッシブ・マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

(単位：円)

| | (平成24年 4月13日現在) | (平成25年 4月15日現在) |
|--------------|-----------------|-----------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 917,269,688 | 1,125,240,306 |
| 国債証券 | 383,018,714,760 | 380,606,779,560 |
| 地方債証券 | 31,018,015,635 | 29,502,686,966 |
| 特殊債券 | 49,633,555,160 | 45,010,820,559 |
| 社債券 | 32,608,215,000 | 29,478,703,000 |
| 未収入金 | 691,048,200 | 367,638,000 |
| 未収利息 | 1,377,491,146 | 1,368,988,806 |
| 前払費用 | 65,953,245 | 44,581,123 |
| 流動資産合計 | 499,330,262,834 | 487,505,438,320 |
| 資産合計 | 499,330,262,834 | 487,505,438,320 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払金 | | 359,548,000 |
| 未払解約金 | 527,918,081 | 38,168,865 |
| 流動負債合計 | 527,918,081 | 397,716,865 |
| 負債合計 | 527,918,081 | 397,716,865 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 445,931,665,232 | 424,319,458,526 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金 () | 52,870,679,521 | 62,788,262,929 |
| 元本等合計 | 498,802,344,753 | 487,107,721,455 |
| 純資産合計 | 498,802,344,753 | 487,107,721,455 |
| 負債純資産合計 | 499,330,262,834 | 487,505,438,320 |

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

| 項目 | 自平成24年 4月14日 至平成25年 4月15日 |
|-----------------|---|
| 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> |

| | |
|--|---|
| | <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p> |
|--|---|

（貸借対照表に関する注記）

| 項目 | （平成24年 4月13日現在） | （平成25年 4月15日現在） |
|---------------|---|---|
| 1. 受益権総数 | 平成24年 4月13日における受益権の総数 445,931,665,232口 | 平成25年 4月15日における受益権の総数 424,319,458,526口 |
| 2. 1単位当たり純資産額 | 1.1186円 （1万口 = 11,186円） | 1.1480円 （1万口 = 11,480円） |

（金融商品に関する注記）

・金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 自 平成24年 4月14日 至 平成25年 4月15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、社債券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p> |

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

・金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | (平成25年 4月15日現在) |
|--------------------|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | <p>(1) 有価証券（国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成24年4月13日現在)

該当事項はありません。

(平成25年4月15日現在)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

(自平成23年4月14日至平成24年4月13日)

該当事項はありません。?

(自平成24年4月14日至平成25年4月15日)

該当事項はありません。

(その他の注記)

(平成24年 4月13日現在)

| | |
|--|------------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 467,076,484,703円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 29,782,880,351円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 50,927,699,822円 |
| 平成24年 4月13日現在の元本の内訳 | |
| 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型) | 1,269,875,774円 |
| 三井住友・DC年金バランス50(標準型) | 2,302,653,287円 |
| 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型) | 463,599,413円 |
| スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型) | 90,605,692円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020 | 14,385,016円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025 | 10,951,742円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030 | 5,785,887円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035 | 5,468,232円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040 | 4,012,929円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045 | 2,580,523円 |
| SMAM・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定> | 10,039,808,379円 |
| SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用> | 44,787,084,300円 |
| SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用> | 11,081,720,649円 |
| SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用> | 25,869,354,408円 |
| SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定> | 541,431,048円 |
| SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定> | 748,676,684円 |
| 世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定> | 159,090,611円 |
| SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用> | 356,328,962円 |
| SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定> | 128,561,394円 |
| SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用> | 2,697,805,329円 |
| SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用> | 3,157,375,514円 |
| SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用> | 7,367,618,679円 |
| SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用> | 18,571,008,946円 |
| SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定> | 1,306,171,892円 |
| 三井住友・国内債券インデックスファンド・VAS (適格機関投資家専用) | 10,043,419,829円 |
| 三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用) | 63,306,736,030円 |
| SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定> | 878,249,576円 |
| SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用> | 11,402,427,175円 |
| 三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用) | 199,932,414,931円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A <適格機関投資家専用> | 1,349,162,627円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA35A <適格機関投資家専用> | 322,143,913円 |

| | |
|--|------------------|
| S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A <適格機関投資家専用> | 57,380,381円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 L <適格機関投資家専用> | 3,974,578,020円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 2 5 L <適格機関投資家専用> | 4,655,230,926円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 T <適格機関投資家専用> | 3,979,749,212円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A 2 <適格機関投資家専用> | 1,569,561,934円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A 2 <適格機関投資家専用> | 319,815,955円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 <適格機関投資家専用> | 33,116,439円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 3 0 L 2 <適格機関投資家専用> | 798,587,192円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 2 5 L 2 <適格機関投資家専用> | 11,374,771,260円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 T 2 <適格機関投資家専用> | 914,399,533円 |
| S M A M・F G新興国重視型バランス20V A <適格機関投資家限定> | 22,759,855円 |
| S M A M・F Gグローバルバランス25V A <適格機関投資家限定> | 15,205,154円 |
| 合 計 | 445,931,665,232円 |

(平成25年 4月15日現在)

開示対象ファンドの

| | |
|-------------------|------------------|
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 445,931,665,232円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 29,234,023,199円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 50,846,229,905円 |

平成25年 4月15日現在の元本の内訳

| | |
|---|-----------------|
| 三井住友・D C年金バランス30(債券重点型) | 1,508,944,079円 |
| 三井住友・D C年金バランス50(標準型) | 2,756,563,793円 |
| 三井住友・D C年金バランス70(株式重点型) | 597,957,212円 |
| スミセイ・D Cバランスファンド(機動的資産配分型) | 134,207,837円 |
| スミセイ・D Cターゲットイヤーファンド2020 | 17,938,753円 |
| スミセイ・D Cターゲットイヤーファンド2025 | 18,169,057円 |
| スミセイ・D Cターゲットイヤーファンド2030 | 9,826,394円 |
| スミセイ・D Cターゲットイヤーファンド2035 | 8,821,312円 |
| スミセイ・D Cターゲットイヤーファンド2040 | 1,963,731円 |
| スミセイ・D Cターゲットイヤーファンド2045 | 4,791,407円 |
| S M A M・年金グローバル債券ファンド<適格機関投資家限定> | 9,696,316,683円 |
| S M A M・バランスファンドV A 2 5 <適格機関投資家専用> | 46,314,333,692円 |
| S M A M・バランスファンドV A 3 7 . 5 <適格機関投資家専用> | 11,365,358,045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> | 27,299,063,846円 |
| S M A M・バランスファンドV L 3 0 <適格機関投資家限定> | 541,014,699円 |
| S M A M・バランスファンドV L 5 0 <適格機関投資家限定> | 778,872,979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> | 171,971,877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> | 403,643,118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> | 141,608,228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> | 2,725,045,255円 |
| S M A M・インデックス・バランスV A 5 0 <適格機関投資家専用> | 3,131,571,582円 |
| S M A M・バランスファンドV A 4 0 <適格機関投資家専用> | 7,834,360,216円 |
| S M A M・バランスファンドV A 3 5 <適格機関投資家専用> | 18,343,528,933円 |

| | |
|---|------------------|
| SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定> | 1,285,520,833円 |
| 三井住友・国内債券インデックスファンド・VAS (適格機関投資家専用) | 10,389,736,568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) | 62,923,529,643円 |
| SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定> | 838,859,967円 |
| SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用> | 10,199,226,248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) | 176,224,979,659円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A <適格機関投資家専用> | 1,324,338,188円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA35A <適格機関投資家専用> | 322,991,969円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA50A <適格機関投資家専用> | 67,245,415円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20L <適格機関投資家専用> | 3,701,272,733円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA25L <適格機関投資家専用> | 4,599,064,206円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20T <適格機関投資家専用> | 3,983,501,432円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A2 <適格機関投資家専用> | 1,579,476,233円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA35A2 <適格機関投資家専用> | 352,765,974円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA50A2 <適格機関投資家専用> | 36,461,240円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA30L2 <適格機関投資家専用> | 801,956,348円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA25L2 <適格機関投資家専用> | 10,948,564,901円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20T2 <適格機関投資家専用> | 915,903,507円 |
| SMAM・FG新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定> | 3,224,207円 |
| SMAM・FGグローバルバランス25VA<適格機関投資家限定> | 12,806,326円 |
| SMAM・年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション ファンド<適格機関投資家限定> | 2,160,201円 |
| 合計 | 424,319,458,526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) | 470,000,000 | 562,430,200 | |
| | 第2回利付国債(40年) | 722,000,000 | 829,332,520 | |
| | 第3回利付国債(40年) | 850,000,000 | 977,449,000 | |
| | 第4回利付国債(40年) | 1,080,000,000 | 1,244,689,200 | |
| | 第5回利付国債(40年) | 1,010,000,000 | 1,109,555,700 | |
| | 第263回利付国債(10年) | 1,072,000,000 | 1,094,597,760 | |
| | 第264回利付国債(10年) | 2,700,000,000 | 2,753,082,000 | |

| | | | |
|----------------|----------------|----------------|--|
| 第265回利付国債(10年) | 16,490,000,000 | 16,869,270,000 | |
| 第268回利付国債(10年) | 13,945,000,000 | 14,311,474,600 | |
| 第270回利付国債(10年) | 12,167,000,000 | 12,474,338,420 | |
| 第272回利付国債(10年) | 9,895,000,000 | 10,196,599,600 | |
| 第274回利付国債(10年) | 8,415,000,000 | 8,717,855,850 | |
| 第277回利付国債(10年) | 7,720,000,000 | 8,043,390,800 | |
| 第280回利付国債(10年) | 8,697,000,000 | 9,169,247,100 | |
| 第282回利付国債(10年) | 9,370,000,000 | 9,848,432,200 | |
| 第284回利付国債(10年) | 10,007,000,000 | 10,547,077,790 | |
| 第285回利付国債(10年) | 10,563,000,000 | 11,166,675,450 | |
| 第286回利付国債(10年) | 8,500,000,000 | 9,044,340,000 | |
| 第288回利付国債(10年) | 8,065,000,000 | 8,573,256,300 | |
| 第289回利付国債(10年) | 9,069,000,000 | 9,586,386,450 | |
| 第290回利付国債(10年) | 4,867,000,000 | 5,135,415,050 | |
| 第293回利付国債(10年) | 2,300,000,000 | 2,480,872,000 | |
| 第296回利付国債(10年) | 3,363,000,000 | 3,584,251,770 | |
| 第297回利付国債(10年) | 3,143,000,000 | 3,336,891,670 | |
| 第298回利付国債(10年) | 1,100,000,000 | 1,161,721,000 | |
| 第299回利付国債(10年) | 1,980,000,000 | 2,092,780,800 | |
| 第300回利付国債(10年) | 1,650,000,000 | 1,763,173,500 | |
| 第301回利付国債(10年) | 1,995,000,000 | 2,134,969,200 | |
| 第303回利付国債(10年) | 3,695,000,000 | 3,935,138,050 | |
| 第305回利付国債(10年) | 5,425,000,000 | 5,744,369,750 | |
| 第306回利付国債(10年) | 5,550,000,000 | 5,915,911,500 | |
| 第307回利付国債(10年) | 1,100,000,000 | 1,164,724,000 | |
| 第308回利付国債(10年) | 3,450,000,000 | 3,649,996,500 | |
| 第309回利付国債(10年) | 2,200,000,000 | 2,296,184,000 | |
| 第310回利付国債(10年) | 6,090,000,000 | 6,305,768,700 | |
| 第312回利付国債(10年) | 5,020,000,000 | 5,266,130,600 | |
| 第313回利付国債(10年) | 5,750,000,000 | 6,072,805,000 | |
| 第315回利付国債(10年) | 5,630,000,000 | 5,904,744,000 | |
| 第317回利付国債(10年) | 2,630,000,000 | 2,738,776,800 | |
| 第318回利付国債(10年) | 2,700,000,000 | 2,788,857,000 | |
| 第319回利付国債(10年) | 1,750,000,000 | 1,823,657,500 | |
| 第320回利付国債(10年) | 4,280,000,000 | 4,422,994,800 | |
| 第321回利付国債(10年) | 3,100,000,000 | 3,203,664,000 | |
| 第322回利付国債(10年) | 3,390,000,000 | 3,474,648,300 | |
| 第323回利付国債(10年) | 630,000,000 | 645,592,500 | |
| 第324回利付国債(10年) | 4,900,000,000 | 4,978,694,000 | |
| 第325回利付国債(10年) | 6,350,000,000 | 6,448,869,500 | |
| 第326回利付国債(10年) | 1,250,000,000 | 1,257,400,000 | |
| 第327回利付国債(10年) | 4,550,000,000 | 4,618,432,000 | |
| 第328回利付国債(10年) | 1,800,000,000 | 1,792,440,000 | |
| 第2回利付国債(30年) | 570,000,000 | 662,602,200 | |
| 第4回利付国債(30年) | 300,000,000 | 370,056,000 | |
| 第5回利付国債(30年) | 290,000,000 | 325,600,400 | |
| 第7回利付国債(30年) | 549,000,000 | 622,022,490 | |
| 第9回利付国債(30年) | 100,000,000 | 98,108,000 | |
| 第10回利付国債(30年) | 585,000,000 | 543,271,950 | |
| 第11回利付国債(30年) | 570,000,000 | 585,840,300 | |
| 第12回利付国債(30年) | 620,000,000 | 679,228,600 | |
| 第14回利付国債(30年) | 960,000,000 | 1,101,974,400 | |

| | | |
|---------------|---------------|---------------|
| 第16回利付国債(30年) | 1,195,000,000 | 1,394,421,600 |
| 第18回利付国債(30年) | 970,000,000 | 1,097,118,500 |
| 第19回利付国債(30年) | 815,000,000 | 921,952,450 |
| 第21回利付国債(30年) | 715,000,000 | 809,043,950 |
| 第22回利付国債(30年) | 715,000,000 | 836,957,550 |
| 第23回利付国債(30年) | 779,000,000 | 912,177,840 |
| 第24回利付国債(30年) | 660,000,000 | 773,737,800 |
| 第25回利付国債(30年) | 690,000,000 | 783,018,900 |
| 第26回利付国債(30年) | 803,000,000 | 926,156,110 |
| 第27回利付国債(30年) | 1,060,000,000 | 1,246,146,600 |
| 第28回利付国債(30年) | 1,106,000,000 | 1,301,916,840 |
| 第29回利付国債(30年) | 1,212,000,000 | 1,403,726,280 |
| 第30回利付国債(30年) | 1,360,000,000 | 1,548,618,400 |
| 第31回利付国債(30年) | 1,530,000,000 | 1,713,232,800 |
| 第32回利付国債(30年) | 1,480,000,000 | 1,690,855,600 |
| 第33回利付国債(30年) | 1,880,000,000 | 2,029,140,400 |
| 第34回利付国債(30年) | 1,870,000,000 | 2,102,777,600 |
| 第35回利付国債(30年) | 1,950,000,000 | 2,108,574,000 |
| 第36回利付国債(30年) | 1,505,000,000 | 1,628,861,500 |
| 第37回利付国債(30年) | 2,120,000,000 | 2,247,242,400 |
| 第38回利付国債(30年) | 240,000,000 | 248,956,800 |
| 第32回利付国債(20年) | 70,000,000 | 77,216,300 |
| 第35回利付国債(20年) | 170,000,000 | 190,328,600 |
| 第37回利付国債(20年) | 302,000,000 | 339,614,100 |
| 第39回利付国債(20年) | 458,000,000 | 510,344,820 |
| 第40回利付国債(20年) | 390,000,000 | 432,463,200 |
| 第42回利付国債(20年) | 480,000,000 | 543,772,800 |
| 第43回利付国債(20年) | 1,370,000,000 | 1,587,597,100 |
| 第46回利付国債(20年) | 775,000,000 | 867,829,500 |
| 第48回利付国債(20年) | 955,000,000 | 1,092,615,500 |
| 第50回利付国債(20年) | 918,000,000 | 1,011,764,520 |
| 第52回利付国債(20年) | 720,000,000 | 808,279,200 |
| 第54回利付国債(20年) | 965,000,000 | 1,094,589,850 |
| 第56回利付国債(20年) | 818,000,000 | 917,992,320 |
| 第59回利付国債(20年) | 1,455,000,000 | 1,599,175,950 |
| 第61回利付国債(20年) | 1,205,000,000 | 1,244,885,500 |
| 第64回利付国債(20年) | 1,115,000,000 | 1,249,881,550 |
| 第65回利付国債(20年) | 1,420,000,000 | 1,592,430,600 |
| 第69回利付国債(20年) | 800,000,000 | 914,112,000 |
| 第70回利付国債(20年) | 1,360,000,000 | 1,598,788,800 |
| 第72回利付国債(20年) | 1,383,000,000 | 1,581,170,070 |
| 第74回利付国債(20年) | 1,374,000,000 | 1,572,295,680 |
| 第75回利付国債(20年) | 1,250,000,000 | 1,429,987,500 |
| 第78回利付国債(20年) | 1,260,000,000 | 1,412,976,600 |
| 第82回利付国債(20年) | 1,340,000,000 | 1,533,429,000 |
| 第84回利付国債(20年) | 1,740,000,000 | 1,971,228,600 |
| 第85回利付国債(20年) | 1,720,000,000 | 1,968,058,400 |
| 第88回利付国債(20年) | 1,717,000,000 | 2,006,039,780 |
| 第90回利付国債(20年) | 1,690,000,000 | 1,952,017,600 |
| 第92回利付国債(20年) | 2,009,000,000 | 2,294,197,640 |
| 第93回利付国債(20年) | 1,687,000,000 | 1,902,463,640 |
| 第95回利付国債(20年) | 1,660,000,000 | 1,933,916,600 |

| | | |
|------------------|-----------------|-----------------|
| 第97回利付国債(20年) | 1,697,000,000 | 1,953,756,100 |
| 第99回利付国債(20年) | 1,768,000,000 | 2,009,172,880 |
| 第100回利付国債(20年) | 987,000,000 | 1,133,431,320 |
| 第101回利付国債(20年) | 635,000,000 | 746,556,800 |
| 第102回利付国債(20年) | 1,982,000,000 | 2,327,660,800 |
| 第105回利付国債(20年) | 1,510,000,000 | 1,708,021,400 |
| 第106回利付国債(20年) | 200,000,000 | 229,016,000 |
| 第107回利付国債(20年) | 1,968,000,000 | 2,220,730,560 |
| 第109回利付国債(20年) | 2,100,000,000 | 2,307,312,000 |
| 第111回利付国債(20年) | 2,116,000,000 | 2,410,779,960 |
| 第113回利付国債(20年) | 2,102,000,000 | 2,359,978,460 |
| 第114回利付国債(20年) | 2,153,000,000 | 2,412,199,670 |
| 第116回利付国債(20年) | 2,760,000,000 | 3,128,432,400 |
| 第118回利付国債(20年) | 450,000,000 | 495,270,000 |
| 第119回利付国債(20年) | 860,000,000 | 920,372,000 |
| 第120回利付国債(20年) | 1,080,000,000 | 1,123,124,400 |
| 第121回利付国債(20年) | 1,450,000,000 | 1,570,263,000 |
| 第122回利付国債(20年) | 1,250,000,000 | 1,333,112,500 |
| 第123回利付国債(20年) | 1,640,000,000 | 1,820,728,000 |
| 第124回利付国債(20年) | 1,150,000,000 | 1,258,468,000 |
| 第125回利付国債(20年) | 1,210,000,000 | 1,359,398,700 |
| 第126回利付国債(20年) | 80,000,000 | 87,377,600 |
| 第127回利付国債(20年) | 1,340,000,000 | 1,442,188,400 |
| 第128回利付国債(20年) | 580,000,000 | 623,366,600 |
| 第129回利付国債(20年) | 1,900,000,000 | 2,011,568,000 |
| 第130回利付国債(20年) | 820,000,000 | 866,772,800 |
| 第131回利付国債(20年) | 1,660,000,000 | 1,727,877,400 |
| 第132回利付国債(20年) | 450,000,000 | 467,563,500 |
| 第133回利付国債(20年) | 2,050,000,000 | 2,163,385,500 |
| 第134回利付国債(20年) | 900,000,000 | 948,177,000 |
| 第135回利付国債(20年) | 430,000,000 | 445,961,600 |
| 第136回利付国債(20年) | 710,000,000 | 725,272,100 |
| 第137回利付国債(20年) | 260,000,000 | 269,347,000 |
| 第138回利付国債(20年) | 280,000,000 | 280,834,400 |
| 第139回利付国債(20年) | 1,750,000,000 | 1,784,020,000 |
| 第140回利付国債(20年) | 3,110,000,000 | 3,215,646,700 |
| 第141回利付国債(20年) | 2,000,000,000 | 2,062,320,000 |
| 第142回利付国債(20年) | 1,000,000,000 | 1,047,960,000 |
| 第143回利付国債(20年) | 400,000,000 | 405,200,000 |
| 国債証券 小計 | 357,008,000,000 | 380,606,779,560 |
| 地方債証券 | | |
| 第1回東京都公募公債(20年) | 100,000,000 | 107,979,000 |
| 第1回東京都公募公債(30年) | 100,000,000 | 109,075,000 |
| 第6回東京都公募公債(20年) | 100,000,000 | 112,327,000 |
| 第7回東京都公募公債(20年) | 100,000,000 | 114,213,000 |
| 第8回東京都公募公債(20年) | 100,000,000 | 116,563,000 |
| 第8回東京都公募公債(30年) | 400,000,000 | 435,540,000 |
| 第13回東京都公募公債(30年) | 500,000,000 | 513,080,000 |
| 第596回東京都公募公債 | 100,000,000 | 100,016,000 |
| 第602回東京都公募公債 | 200,000,000 | 201,326,000 |
| 第603回東京都公募公債 | 200,000,000 | 201,656,000 |
| 第604回東京都公募公債 | 100,000,000 | 100,935,000 |
| 第608回東京都公募公債 | 600,000,000 | 607,980,000 |

| | | | |
|-----------------------|-------------|-------------|--|
| 第610回東京都公募公債 | 100,000,000 | 101,944,000 | |
| 第613回東京都公募公債 | 100,000,000 | 101,967,000 | |
| 第623回東京都公募公債 | 200,000,000 | 204,858,000 | |
| 第628回東京都公募公債 | 100,000,000 | 103,687,000 | |
| 第629回東京都公募公債 | 100,000,000 | 103,314,000 | |
| 第634回東京都公募公債 | 106,000,000 | 111,454,760 | |
| 第642回東京都公募公債 | 300,000,000 | 317,220,000 | |
| 第643回東京都公募公債 | 100,000,000 | 105,527,000 | |
| 第646回東京都公募公債 | 100,000,000 | 107,043,000 | |
| 第652回東京都公募公債 | 200,000,000 | 212,740,000 | |
| 第653回東京都公募公債 | 200,000,000 | 211,356,000 | |
| 第660回東京都公募公債 | 700,000,000 | 745,318,000 | |
| 第662回東京都公募公債 | 100,000,000 | 107,212,000 | |
| 第668回東京都公募公債 | 200,000,000 | 213,638,000 | |
| 平成16年度第3回北海道公募公債 | 100,000,000 | 101,649,000 | |
| 平成17年度第4回北海道公募公債 | 100,000,000 | 102,305,000 | |
| 平成17年度第9回北海道公募公債 | 100,000,000 | 103,323,000 | |
| 平成19年度第2回北海道公募公債 | 100,000,000 | 106,081,000 | |
| 平成19年度第7回北海道公募公債 | 100,000,000 | 106,252,000 | |
| 平成20年度第12回北海道公募公債 | 100,000,000 | 107,320,000 | |
| 平成20年度第15回北海道公募公債(5年) | 200,000,000 | 201,782,000 | |
| 平成20年度第4回北海道公募公債 | 100,000,000 | 108,084,000 | |
| 平成20年度第9回北海道公募公債(5年) | 300,000,000 | 302,460,000 | |
| 第1回神奈川県公募公債(20年) | 100,000,000 | 118,112,000 | |
| 第3回神奈川県公募公債(20年) | 100,000,000 | 113,466,000 | |
| 第7回神奈川県公募公債(20年) | 100,000,000 | 114,559,000 | |
| 第49回神奈川県公募公債(5年) | 100,000,000 | 100,391,000 | |
| 第129回神奈川県公募公債 | 100,000,000 | 102,168,000 | |
| 第143回神奈川県公募公債 | 100,000,000 | 105,465,000 | |
| 第144回神奈川県公募公債 | 300,000,000 | 317,052,000 | |
| 第147回神奈川県公募公債 | 100,000,000 | 106,979,000 | |
| 第149回神奈川県公募公債 | 200,000,000 | 213,462,000 | |
| 第157回神奈川県公募公債 | 115,600,000 | 123,616,860 | |
| 第3回大阪府公募公債(7年) | 200,000,000 | 204,102,000 | |
| 第52回大阪府公募公債(5年) | 400,000,000 | 403,688,000 | |
| 第77回大阪府公募公債(5年) | 100,000,000 | 100,383,000 | |
| 第261回大阪府公募公債(10年) | 105,000,000 | 105,956,550 | |
| 第262回大阪府公募公債(10年) | 100,000,000 | 100,956,000 | |
| 第267回大阪府公募公債(10年) | 100,000,000 | 101,656,000 | |
| 第277回大阪府公募公債(10年) | 600,000,000 | 614,142,000 | |
| 第299回大阪府公募公債(10年) | 200,000,000 | 212,082,000 | |
| 第303回大阪府公募公債(10年) | 100,000,000 | 106,584,000 | |
| 第306回大阪府公募公債(10年) | 200,000,000 | 212,876,000 | |
| 第313回大阪府公募公債(10年) | 100,000,000 | 106,388,000 | |
| 平成19年度第1回京都府公募公債 | 130,260,000 | 138,831,108 | |
| 平成16年度第12回兵庫県公募公債 | 100,000,000 | 102,096,000 | |
| 平成17年度第2回兵庫県公募公債 | 200,000,000 | 204,754,000 | |
| 平成17年度第6回兵庫県公募公債 | 101,000,000 | 103,453,290 | |
| 平成20年度第5回兵庫県公募公債 | 100,000,000 | 108,012,000 | |
| 平成21年度第11回兵庫県公募公債 | 200,000,000 | 214,772,000 | |
| 平成21年度第23回兵庫県公募公債 | 200,000,000 | 211,326,000 | |

| | | | |
|-----------------------|-------------|-------------|--|
| 平成21年度第3回兵庫県公募公債 | 200,000,000 | 214,236,000 | |
| 平成18年度第2回静岡県公募公債 | 100,000,000 | 105,605,000 | |
| 平成18年度第5回静岡県公募公債 | 100,000,000 | 105,563,000 | |
| 平成19年度第7回静岡県公募公債 | 100,000,000 | 106,811,000 | |
| 平成20年度第1回静岡県公募公債 | 200,000,000 | 228,618,000 | |
| 平成20年度第7回静岡県公募公債 | 100,000,000 | 107,553,000 | |
| 平成21年度第5回静岡県公募公債 | 300,000,000 | 317,415,000 | |
| 平成17年度第2回愛知県公募公債(10年) | 100,000,000 | 102,327,000 | |
| 平成18年度第4回愛知県公募公債(10年) | 100,000,000 | 105,369,000 | |
| 平成19年度第3回愛知県公募公債(10年) | 100,000,000 | 106,794,000 | |
| 平成20年度第5回愛知県公募公債(5年) | 500,000,000 | 502,830,000 | |
| 平成21年度第1回愛知県公募公債(10年) | 100,000,000 | 107,271,000 | |
| 平成21年度第7回愛知県公募公債(10年) | 200,000,000 | 213,966,000 | |
| 平成19年度第3回広島県公募公債 | 200,000,000 | 212,266,000 | |
| 平成20年度第1回広島県公募公債 | 100,000,000 | 107,386,000 | |
| 平成15年度第3回埼玉県公募公債 | 205,670,000 | 206,994,514 | |
| 平成16年度第3回埼玉県公募公債 | 100,000,000 | 102,346,000 | |
| 平成16年度第6回埼玉県公募公債 | 100,000,000 | 102,157,000 | |
| 平成17年度第6回埼玉県公募公債 | 100,000,000 | 103,626,000 | |
| 平成18年度第7回埼玉県公募公債 | 100,000,000 | 106,012,000 | |
| 平成19年度第2回埼玉県公募公債 | 100,000,000 | 106,806,000 | |
| 平成21年度第1回埼玉県公募公債 | 100,000,000 | 106,776,000 | |
| 平成21年度第4回埼玉県公募公債 | 200,000,000 | 212,892,000 | |
| 平成18年度第1回福岡県公募公債 | 100,000,000 | 106,210,000 | |
| 平成19年度第2回福岡県公募公債 | 100,000,000 | 107,103,000 | |
| 平成20年度第9回福岡県公募公債 | 200,000,000 | 201,126,000 | |
| 平成16年度第9回千葉県公募公債 | 100,000,000 | 102,535,000 | |
| 平成18年度第1回千葉県公募公債 | 200,000,000 | 210,936,000 | |
| 平成18年度第4回千葉県公募公債 | 200,000,000 | 210,768,000 | |
| 平成19年度第1回千葉県公募公債 | 100,000,000 | 106,031,000 | |
| 平成21年度第2回千葉県公募公債 | 345,000,000 | 369,432,900 | |
| 平成17年度第1回新潟県公募公債 | 200,000,000 | 204,962,000 | |
| 平成19年度第1回岐阜県公募公債(10年) | 200,000,000 | 213,844,000 | |
| 第1回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 100,015,000 | |
| 第7回共同発行市場公募地方債 | 319,400,000 | 321,511,234 | |
| 第12回共同発行市場公募地方債 | 437,000,000 | 442,134,750 | |
| 第15回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 101,697,000 | |
| 第20回共同発行市場公募地方債 | 300,000,000 | 306,321,000 | |
| 第21回共同発行市場公募地方債 | 300,000,000 | 306,138,000 | |
| 第22回共同発行市場公募地方債 | 200,000,000 | 204,282,000 | |
| 第23回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 102,063,000 | |
| 第27回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 102,414,000 | |
| 第29回共同発行市場公募地方債 | 300,000,000 | 308,460,000 | |
| 第30回共同発行市場公募地方債 | 200,000,000 | 205,330,000 | |
| 第31回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 103,250,000 | |
| 第32回共同発行市場公募地方債 | 300,000,000 | 310,878,000 | |
| 第33回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 103,726,000 | |

| | | | |
|-----------------------|----------------|----------------|--|
| 第35回共同発行市場公募地方債 | 400,000,000 | 415,716,000 | |
| 第36回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 104,017,000 | |
| 第38回共同発行市場公募地方債 | 200,000,000 | 210,936,000 | |
| 第40回共同発行市場公募地方債 | 300,000,000 | 318,138,000 | |
| 第46回共同発行市場公募地方債 | 200,000,000 | 211,408,000 | |
| 第55回共同発行市場公募地方債 | 200,000,000 | 213,704,000 | |
| 第56回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 106,385,000 | |
| 第57回共同発行市場公募地方債 | 300,000,000 | 318,531,000 | |
| 第62回共同発行市場公募地方債 | 200,000,000 | 214,292,000 | |
| 第64回共同発行市場公募地方債 | 300,000,000 | 322,731,000 | |
| 第65回共同発行市場公募地方債 | 100,000,000 | 106,851,000 | |
| 第73回共同発行市場公募地方債 | 300,000,000 | 321,408,000 | |
| 第75回共同発行市場公募地方債 | 900,000,000 | 967,896,000 | |
| 第77回共同発行市場公募地方債 | 200,000,000 | 213,948,000 | |
| 平成18年度第2回大阪市公募公債 | 200,000,000 | 210,928,000 | |
| 平成18年度第3回大阪市公募公債 | 100,000,000 | 105,936,000 | |
| 平成18年度第6回大阪市公募公債 | 300,000,000 | 317,874,000 | |
| 平成19年度第10回大阪市公募公債 | 100,000,000 | 106,376,000 | |
| 平成19年度第5回大阪市公募公債 | 100,000,000 | 106,942,000 | |
| 平成21年度第4回大阪市公募公債 | 300,000,000 | 321,588,000 | |
| 第1回名古屋市公募公債(20年) | 200,000,000 | 224,304,000 | |
| 第3回名古屋市公募公債(20年) | 100,000,000 | 112,585,000 | |
| 第11回名古屋市公募公債(5年) | 300,000,000 | 302,586,000 | |
| 第12回ひ号名古屋市公募公債 | 100,000,000 | 102,481,000 | |
| 第455回名古屋市公募公債(10年) | 100,000,000 | 105,255,000 | |
| 第1回京都市公募公債(30年) | 100,000,000 | 114,771,000 | |
| 第7回京都市公募公債(20年) | 100,000,000 | 115,590,000 | |
| 平成18年度第3回京都市公募公債 | 200,000,000 | 212,244,000 | |
| 平成19年度第10回神戸市公募公債 | 100,000,000 | 106,282,000 | |
| 第4回横浜市公募公債(20年) | 100,000,000 | 112,591,000 | |
| 第9回横浜市公募公債(20年) | 100,000,000 | 116,336,000 | |
| 第14回横浜市公募公債(20年) | 100,000,000 | 115,341,000 | |
| 平成17年度第3回横浜市公募公債 | 100,000,000 | 103,397,000 | |
| 平成17年度第4回横浜市公募公債 | 200,000,000 | 207,022,000 | |
| 平成18年度第1回横浜市公募公債 | 100,000,000 | 104,937,000 | |
| 平成18年度第3回横浜市公募公債 | 200,000,000 | 211,660,000 | |
| 平成18年度第4回横浜市公募公債 | 300,000,000 | 318,291,000 | |
| 平成20年度第6回横浜市公募公債 | 200,000,000 | 213,110,000 | |
| 平成18年度第4回札幌市公募公債 | 200,000,000 | 210,516,000 | |
| 第2回川崎市15年公募公債 | 100,000,000 | 107,706,000 | |
| 第4回川崎市15年公募公債 | 100,000,000 | 112,143,000 | |
| 平成15年度第2回北九州市公募公債 | 100,000,000 | 100,921,000 | |
| 平成19年度第2回北九州市公募公債 | 100,000,000 | 105,928,000 | |
| 平成18年度第4回福岡市公募公債 | 100,000,000 | 105,337,000 | |
| 平成20年度第5回福岡市公募公債 | 100,000,000 | 106,614,000 | |
| 平成21年度第7回福岡市公募公債 | 200,000,000 | 201,300,000 | |
| 平成19年度第1回広島市公募公債 | 100,000,000 | 106,403,000 | |
| 平成21年度第1回千葉市公募公債 | 200,000,000 | 214,090,000 | |
| 地方債証券 小計 | 28,064,930,000 | 29,502,686,966 | |
| 特殊債券 | | | |
| 第1回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債 | 100,000,000 | 107,008,000 | |

| | | | |
|---------------------------|-------------|-------------|--|
| 第2回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債 | 200,000,000 | 211,912,000 | |
| 第3回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債 | 200,000,000 | 227,368,000 | |
| 第5回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債 | 100,000,000 | 106,081,000 | |
| 第9回日本政策投資銀行債券 | 100,000,000 | 100,582,000 | |
| 第10回政府保証日本政策投資銀行債券 | 100,000,000 | 102,860,000 | |
| 第15回政府保証日本政策投資銀行債券 | 100,000,000 | 111,428,000 | |
| 第16回日本政策投資銀行債券 | 100,000,000 | 101,816,000 | |
| 第20回政府保証日本政策投資銀行債券 | 100,000,000 | 112,356,000 | |
| 第20回日本政策投資銀行債券 | 100,000,000 | 107,745,000 | |
| 第23回政府保証日本政策投資銀行債券 | 400,000,000 | 427,152,000 | |
| 第24回日本政策投資銀行債券 | 100,000,000 | 103,340,000 | |
| 第27回日本政策投資銀行債券 | 100,000,000 | 105,655,000 | |
| 第30回日本政策投資銀行債券 | 100,000,000 | 108,642,000 | |
| 第36回日本政策投資銀行債券 | 100,000,000 | 113,458,000 | |
| 第51回日本政策投資銀行債券 | 100,000,000 | 107,390,000 | |
| 第1回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 144,000,000 | 149,058,720 | |
| 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 | 218,472,000 | |
| 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 | 164,307,360 | |
| 第7回道路債券 | 100,000,000 | 117,319,000 | |
| 第8回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 104,074,000 | |
| 第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 116,458,000 | |
| 第9回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 110,088,000 | |
| 第9回道路債券 | 100,000,000 | 120,224,000 | |
| 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 | 105,545,000 | |
| 第13回道路債券 | 300,000,000 | 341,511,000 | |
| 第17回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 102,000,000 | 108,070,020 | |
| 第18回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 115,545,000 | |
| 第21回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 105,510,000 | |
| 第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 300,000,000 | 332,502,000 | |
| 第23回道路債券 | 200,000,000 | 201,216,000 | |
| 第23回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 200,000,000 | 230,956,000 | |
| 第25回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 300,000,000 | 317,367,000 | |
| 第26回道路債券 | 300,000,000 | 302,964,000 | |
| 第27回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 500,000,000 | 529,530,000 | |
| 第27回道路債券 | 100,000,000 | 115,700,000 | |
| 第29回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 101,195,000 | |
| 第30回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 200,000,000 | 211,222,000 | |

| | | | |
|---------------------------|-------------|-------------|--|
| 第30回道路債券 | 100,000,000 | 101,417,000 | |
| 第34回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 105,836,000 | |
| 第36回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 153,000,000 | 163,307,610 | |
| 第37回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 300,000,000 | 320,646,000 | |
| 第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 115,372,000 | |
| 第39回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 114,483,000 | |
| 第40回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 300,000,000 | 320,886,000 | |
| 第40回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 106,573,000 | |
| 第41回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 400,000,000 | 424,700,000 | |
| 第42回道路債券 | 200,000,000 | 227,214,000 | |
| 第44回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 200,000,000 | 213,254,000 | |
| 第45回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 200,000,000 | 214,152,000 | |
| 第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 200,000,000 | 229,430,000 | |
| 第48回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 400,000,000 | 429,228,000 | |
| 第49回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 105,663,000 | |
| 第52回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 200,000,000 | 212,498,000 | |
| 第56回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 200,000,000 | 210,846,000 | |
| 第58回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 500,000,000 | 535,345,000 | |
| 第60回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 107,716,000 | |
| 第62回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 107,296,000 | |
| 第67回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 200,000,000 | 214,006,000 | |
| 第69回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 107,067,000 | |
| 第81回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 200,000,000 | 223,706,000 | |
| 第88回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 112,779,000 | |
| 第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 300,000,000 | 334,545,000 | |
| 第325回政府保証道路債券 | 100,000,000 | 100,999,000 | |
| 第327回政府保証道路債券 | 552,000,000 | 559,667,280 | |
| 第329回政府保証道路債券 | 300,000,000 | 305,169,000 | |
| 第330回政府保証道路債券 | 100,000,000 | 102,104,000 | |
| 第335回政府保証道路債券 | 100,000,000 | 102,085,000 | |
| 第336回政府保証道路債券 | 200,000,000 | 204,388,000 | |
| 第337回政府保証道路債券 | 100,000,000 | 102,107,000 | |
| 第338回政府保証道路債券 | 200,000,000 | 205,164,000 | |

| | | | |
|-----------------------|-------------|-------------|--|
| 第339回政府保証道路債券 | 100,000,000 | 102,484,000 | |
| 第340回政府保証道路債券 | 100,000,000 | 108,389,000 | |
| 第341回政府保証道路債券 | 100,000,000 | 102,376,000 | |
| 第346回政府保証道路債券 | 301,000,000 | 309,644,720 | |
| 第1回政府保証地方公営企業等金融機構債券 | 300,000,000 | 320,946,000 | |
| 第1回政府保証地方公共団体金融機構債券 | 300,000,000 | 320,379,000 | |
| 第2回地方公営企業等金融機構債券(20年) | 100,000,000 | 113,740,000 | |
| 第3回公営企業債券(20年) | 100,000,000 | 102,640,000 | |
| 第3回地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 106,927,000 | |
| 第5回公営企業債券(20年) | 100,000,000 | 112,990,000 | |
| 第6回政府保証地方公営企業等金融機構債券 | 100,000,000 | 105,506,000 | |
| 第6回地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 106,656,000 | |
| 第7回政府保証地方公営企業等金融機構債券 | 500,000,000 | 530,560,000 | |
| 第7回地方公営企業等金融機構債券(5年) | 100,000,000 | 100,283,000 | |
| 第10回公営企業債券 | 100,000,000 | 101,843,000 | |
| 第11回公営企業債券(20年) | 100,000,000 | 113,103,000 | |
| 第11回地方公共団体金融機構債券 | 100,000,000 | 106,316,000 | |
| 第12回公営企業債券 | 100,000,000 | 101,899,000 | |
| 第15回公営企業債券 | 100,000,000 | 102,395,000 | |
| 第16回公営企業債券(20年) | 100,000,000 | 112,946,000 | |
| 第17回公営企業債券 | 100,000,000 | 103,256,000 | |
| 第17回公営企業債券(20年) | 100,000,000 | 116,387,000 | |
| 第18回公営企業債券(20年) | 100,000,000 | 118,753,000 | |
| 第20回公営企業債券 | 100,000,000 | 105,612,000 | |
| 第22回公営企業債券(20年) | 100,000,000 | 115,317,000 | |
| 第24回公営企業債券 | 100,000,000 | 105,950,000 | |
| 第24回公営企業債券(20年) | 200,000,000 | 228,770,000 | |
| 第30回公営企業債券 | 100,000,000 | 108,216,000 | |
| 第827回政府保証公営企業債券 | 200,000,000 | 200,104,000 | |
| 第829回政府保証公営企業債券 | 500,000,000 | 501,310,000 | |
| 第833回政府保証公営企業債券 | 200,000,000 | 201,650,000 | |
| 第834回政府保証公営企業債券 | 200,000,000 | 201,898,000 | |
| 第836回政府保証公営企業債券 | 300,000,000 | 303,057,000 | |
| 第838回政府保証公営企業債券 | 100,000,000 | 101,384,000 | |
| 第840回政府保証公営企業債券 | 200,000,000 | 203,392,000 | |
| 第841回政府保証公営企業債券 | 100,000,000 | 102,086,000 | |
| 第843回政府保証公営企業債券 | 100,000,000 | 101,940,000 | |
| 第844回政府保証公営企業債券 | 400,000,000 | 408,796,000 | |
| 第846回政府保証公営企業債券 | 100,000,000 | 102,079,000 | |
| 第847回政府保証公営企業債券 | 100,000,000 | 102,199,000 | |
| 第849回政府保証公営企業債券 | 100,000,000 | 102,556,000 | |
| 第851回政府保証公営企業債券 | 100,000,000 | 102,364,000 | |
| 第852回政府保証公営企業債券 | 100,000,000 | 102,460,000 | |
| 第858回政府保証公営企業債券 | 200,000,000 | 207,054,000 | |
| 第861回政府保証公営企業債券 | 300,000,000 | 312,192,000 | |
| 第863回政府保証公営企業債券 | 100,000,000 | 105,526,000 | |
| 第865回政府保証公営企業債券 | 300,000,000 | 317,247,000 | |
| 第866回政府保証公営企業債券 | 200,000,000 | 211,742,000 | |
| 第875回政府保証公営企業債券 | 200,000,000 | 211,600,000 | |
| 第883回政府保証公営企業債券 | 100,000,000 | 105,338,000 | |
| 第884回政府保証公営企業債券 | 300,000,000 | 316,245,000 | |

| | | | |
|------------------------|-------------|-------------|--|
| 第885回政府保証公営企業債券 | 200,000,000 | 214,084,000 | |
| 第886回政府保証公営企業債券 | 200,000,000 | 215,352,000 | |
| 第3回首都高速道路株式会社社債 | 100,000,000 | 100,428,000 | |
| 第187回政府保証首都高速道路債券 | 193,000,000 | 194,775,600 | |
| 第195回政府保証首都高速道路債券 | 400,000,000 | 408,712,000 | |
| 第197回政府保証首都高速道路債券 | 300,000,000 | 307,671,000 | |
| 第199回政府保証首都高速道路債券 | 200,000,000 | 205,732,000 | |
| 第10回国際協力銀行債券 | 300,000,000 | 302,556,000 | |
| 第15回国際協力銀行債券 | 200,000,000 | 203,542,000 | |
| 第21回国際協力銀行債券 | 100,000,000 | 103,171,000 | |
| 第27回国際協力銀行債券 | 100,000,000 | 105,512,000 | |
| 第8回都市再生債券 | 200,000,000 | 205,564,000 | |
| 第19回都市再生債券 | 100,000,000 | 107,795,000 | |
| 第27回都市再生債券 | 300,000,000 | 301,695,000 | |
| 第3回本州四国連絡橋債券 | 100,000,000 | 102,030,000 | |
| 第7回本州四国連絡橋債券 | 100,000,000 | 113,987,000 | |
| 第332回東京交通債券 | 100,000,000 | 113,859,000 | |
| 第342回東京交通債券 | 100,000,000 | 114,732,000 | |
| 第13回関西国際空港株式会社社債 | 100,000,000 | 106,398,000 | |
| 第16回関西国際空港株式会社社債 | 100,000,000 | 107,278,000 | |
| 第51回政府保証関西国際空港債券 | 100,000,000 | 112,925,000 | |
| 第14回独立行政法人福祉医療機構債券 | 200,000,000 | 213,336,000 | |
| 第17回独立行政法人福祉医療機構債券 | 100,000,000 | 108,125,000 | |
| 第1回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 38,738,000 | 40,466,102 | |
| 第1回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 58,614,000 | 61,043,550 | |
| 第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 71,520,000 | 76,135,185 | |
| 第2回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 60,760,000 | 63,570,150 | |
| 第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 110,778,000 | 118,952,308 | |
| 第3回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 20,727,000 | 21,773,920 | |
| 第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 30,037,000 | 31,718,471 | |
| 第4回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 21,888,000 | 22,884,779 | |
| 第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 50,530,000 | 54,351,078 | |
| 第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 121,239,000 | 128,689,136 | |
| 第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 31,213,000 | 32,832,954 | |
| 第6回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 45,988,000 | 48,184,846 | |
| 第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 32,347,000 | 34,750,058 | |
| 第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 98,256,000 | 105,534,804 | |
| 第7回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 42,657,000 | 45,136,224 | |
| 第8回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 24,272,000 | 25,232,685 | |
| 第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 101,643,000 | 108,755,977 | |
| 第8回一般担保住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 105,835,000 | |
| 第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 67,270,000 | 72,054,242 | |
| 第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 47,795,000 | 50,989,617 | |
| 第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 25,533,000 | 26,318,395 | |
| 第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券 | 103,857,000 | 111,061,560 | |
| 第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 52,881,000 | 56,105,683 | |

| | | | |
|------------------------|-------------|-------------|--|
| 第11回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 53,418,000 | 56,883,759 | |
| 第12回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 32,129,000 | 33,452,714 | |
| 第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 54,533,000 | 57,244,380 | |
| 第14回一般担保住宅金融支援機構債券 | 200,000,000 | 214,162,000 | |
| 第16回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 114,216,000 | 119,778,319 | |
| 第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 116,682,000 | 122,764,632 | |
| 第19回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 63,139,000 | 67,498,747 | |
| 第21回一般担保住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 108,085,000 | |
| 第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 128,134,000 | 138,380,875 | |
| 第25回一般担保住宅金融支援機構債券 | 200,000,000 | 213,868,000 | |
| 第26回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 186,825,000 | 199,846,702 | |
| 第27回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 64,073,000 | 68,217,882 | |
| 第28回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 44,679,000 | 46,889,270 | |
| 第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 70,228,000 | 74,473,984 | |
| 第29回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 47,197,000 | 49,663,987 | |
| 第29回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 71,503,000 | 75,731,687 | |
| 第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 72,060,000 | 76,441,968 | |
| 第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 50,202,000 | 52,528,360 | |
| 第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 53,051,000 | 55,486,040 | |
| 第32回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 147,638,000 | 155,328,463 | |
| 第33回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 51,406,000 | 53,733,663 | |
| 第34回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 108,788,000 | 114,555,939 | |
| 第35回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 53,464,000 | 56,170,347 | |
| 第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 80,892,000 | 85,494,754 | |
| 第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 50,552,000 | 53,364,207 | |
| 第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 82,366,000 | 86,771,757 | |
| 第38回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 98,772,000 | 104,408,918 | |
| 第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 49,825,000 | 52,474,693 | |
| 第40回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 100,162,000 | 105,963,383 | |
| 第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 50,366,000 | 53,728,937 | |
| 第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 96,158,000 | 103,893,911 | |
| 第43回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 94,856,000 | 102,203,545 | |
| 第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 89,372,000 | 93,105,068 | |
| 第44回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 45,149,000 | 48,712,610 | |
| 第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 178,536,000 | 188,375,118 | |
| 第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 89,212,000 | 94,530,819 | |
| 第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 179,982,000 | 191,058,092 | |
| 第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 90,991,000 | 95,682,495 | |
| 第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 48,089,000 | 51,584,589 | |
| 第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 275,787,000 | 287,764,429 | |
| 第52回一般担保住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 107,561,000 | |
| 第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券 | 48,963,000 | 52,204,350 | |
| 第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 188,710,000 | 193,637,218 | |
| 第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 94,659,000 | 97,323,650 | |
| 第58回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 95,109,000 | 97,488,627 | |
| 第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 191,060,000 | 196,518,584 | |
| 第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 287,628,000 | 293,665,311 | |
| 第61回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 96,231,000 | 97,570,535 | |

| | | |
|------------------------|-------------|-------------|
| 第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 98,635,000 | 98,585,682 |
| 第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 298,020,000 | 302,213,141 |
| 第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 199,698,000 | 202,176,252 |
| 第130回一般担保住宅金融支援機構債券 | 200,000,000 | 203,318,000 |
| 第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 99,626,000 | 106,366,695 |
| 第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 99,886,000 | 106,936,952 |
| 第3回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 37,278,000 | 39,727,537 |
| 第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 49,470,000 | 52,809,225 |
| 第5回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 83,690,000 | 88,346,511 |
| 第15回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券 | 110,102,000 | 115,426,532 |
| 第6回農林漁業金融公庫債券 | 100,000,000 | 101,352,000 |
| 第10回農林漁業金融公庫債券 | 100,000,000 | 106,143,000 |
| 第4回政府保証新東京国際空港債券 | 100,000,000 | 100,274,000 |
| 第5回新東京国際空港債券 | 100,000,000 | 100,930,000 |
| 第3回沖縄振興開発金融公庫債券 | 200,000,000 | 202,556,000 |
| 第5回沖縄振興開発金融公庫債券 | 100,000,000 | 102,130,000 |
| い第703号商工債 | 200,000,000 | 201,822,000 |
| い第711号商工債 | 100,000,000 | 101,071,000 |
| い第712号商工債 | 100,000,000 | 100,916,000 |
| い第722号商工債 | 100,000,000 | 100,590,000 |
| い第723号商工債 | 100,000,000 | 100,611,000 |
| い第725号商工債 | 200,000,000 | 200,528,000 |
| い第727号商工債 | 200,000,000 | 202,196,000 |
| い第733号商工債 | 500,000,000 | 504,350,000 |
| い第704号農林債 | 200,000,000 | 201,750,000 |
| い第707号農林債 | 100,000,000 | 101,147,000 |
| い第708号農林債 | 300,000,000 | 303,033,000 |
| い第712号農林債 | 300,000,000 | 302,811,000 |
| い第713号農林債 | 100,000,000 | 100,840,000 |
| い第714号農林債 | 400,000,000 | 404,160,000 |
| い第723号農林債 | 200,000,000 | 201,316,000 |
| い第728号農林債 | 400,000,000 | 402,984,000 |
| い第735号農林債 | 400,000,000 | 401,728,000 |
| い第752号農林債 | 300,000,000 | 298,626,000 |
| 第240回信金中金債(5年) | 200,000,000 | 202,178,000 |
| 第243回信金中金債(5年) | 100,000,000 | 100,875,000 |
| 第228回信金中金債(5年) | 400,000,000 | 403,204,000 |
| 第229回信金中金債(5年) | 300,000,000 | 302,616,000 |
| 第230回信金中金債(5年) | 100,000,000 | 100,860,000 |
| 第231回信金中金債(5年) | 100,000,000 | 101,039,000 |
| 第233回信金中金債(5年) | 500,000,000 | 505,890,000 |
| 第236回信金中金債(5年) | 200,000,000 | 201,750,000 |
| 第149号商工債(3年) | 200,000,000 | 200,042,000 |
| 第156号商工債(3年) | 600,000,000 | 599,082,000 |
| 第1回政府保証東日本高速道路債券 | 137,000,000 | 142,023,790 |
| 第3回政府保証東日本高速道路債券 | 100,000,000 | 105,508,000 |
| 第1回政府保証中日本高速道路債券 | 250,000,000 | 259,167,500 |
| 第1回中日本高速道路株式会社社債 | 100,000,000 | 101,203,000 |
| 第3回政府保証中日本高速道路債券 | 163,000,000 | 169,471,100 |

| | | | | |
|-----|---------------------------------|----------------|----------------|--|
| | 第5回中日本高速道路株式会社社債 | 200,000,000 | 214,846,000 | |
| | 第6回中日本高速道路株式会社社債 | 100,000,000 | 106,911,000 | |
| | 第10回政府保証中日本高速道路債券 | 100,000,000 | 105,520,000 | |
| | 第12回政府保証中日本高速道路債券 | 103,000,000 | 108,927,650 | |
| | 第14回政府保証中日本高速道路債券 | 100,000,000 | 106,698,000 | |
| | 第19回政府保証中日本高速道路債券 | 124,000,000 | 130,962,600 | |
| | 第21回政府保証中日本高速道路債券 | 200,000,000 | 214,022,000 | |
| | 第25回政府保証中日本高速道路債券 | 200,000,000 | 213,522,000 | |
| | 第46回中日本高速道路株式会社社債 | 200,000,000 | 199,042,000 | |
| | 第8回政府保証西日本高速道路債券 | 233,000,000 | 246,486,040 | |
| | 第15回政府保証西日本高速道路債券 | 100,000,000 | 107,633,000 | |
| | 第19回政府保証西日本高速道路債券 | 100,000,000 | 106,084,000 | |
| | 第5回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 | 200,000,000 | 204,960,000 | |
| | 第3回東京地下鉄株式会社社債 | 200,000,000 | 210,838,000 | |
| | 特殊債券 小計 | 42,934,740,000 | 45,010,820,559 | |
| 社債券 | 第18回ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポレーション | 100,000,000 | 100,237,000 | |
| | 第1回ジェイ・ピー・モルガン・チェース・アンド・カ | 100,000,000 | 101,835,000 | |
| | 第2回ジェー・ピー・モルガン・チェース・アンド・カ | 100,000,000 | 102,861,000 | |
| | 第3回ジェイ・ピー・モルガン・チェース・アンド・カ | 300,000,000 | 313,710,000 | |
| | 第9回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク | 100,000,000 | 104,949,000 | |
| | 第11回シティグループ・インク円貨社債(2003) | 200,000,000 | 200,170,000 | |
| | 第17回シティグループ・インク円貨債券 | 100,000,000 | 104,289,000 | |
| | 第22回シティグループ・インク円貨債券 | 300,000,000 | 306,060,000 | |
| | 第3回バンク・オブ・アメリカ・コーポレーション円貨 | 100,000,000 | 102,145,000 | |
| | 第4回パークレイズ・バンク・ピーエルシー円貨社債(2010) | 300,000,000 | 300,555,000 | |
| | 第5回オーストラリア・コモンウェルス銀行円貨社債(2011) | 300,000,000 | 304,881,000 | |
| | 第8回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債 | 300,000,000 | 306,159,000 | |
| | 第10回コーペラティブ・セントラル・ライフアイゼン・ボエレン | 300,000,000 | 302,190,000 | |
| | 第18回コーペラティブ・セントラル・ライフアイゼン・ボエレン | 300,000,000 | 301,092,000 | |
| | 第4回ウォルマート・ストアーズ・インク円貨社債(2010) | 100,000,000 | 101,471,000 | |
| | H S B C 銀行 P L C 第1回円貨社債 | 100,000,000 | 101,548,000 | |
| | H S B C 銀行 P L C 第2回円貨社債 | 100,000,000 | 101,212,000 | |
| | 第11回森永乳業株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,985,000 | |
| | 第3回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,656,000 | |
| | 第7回キリンホールディングス株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 214,090,000 | |
| | 第2回サントリーホールディングス株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 101,026,000 | |
| | 第19回味の素株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 101,589,000 | |
| | 第38回住友化学株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 105,506,000 | |
| | 第35回三菱化学株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 105,852,000 | |

| | | | |
|---------------------------------|-------------|-------------|--|
| 第38回三菱化学株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 108,735,000 | |
| 第35回三井化学株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 105,427,000 | |
| 第11回武田薬品工業株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 200,274,000 | |
| 第26回新日本石油株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 211,412,000 | |
| 第16回住友ゴム工業株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 107,252,000 | |
| 第12回旭硝子株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 216,458,000 | |
| 第30回新日本製鐵株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 111,141,000 | |
| 第55回新日本製鐵株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 104,814,000 | |
| 第62回住友金属工業株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,589,000 | |
| 第46回株式会社神戸製鋼所無担保社債 | 100,000,000 | 102,789,000 | |
| 第15回株式会社豊田自動織機無担保社債 | 100,000,000 | 103,289,000 | |
| 第18回株式会社豊田自動織機無担保社債 | 100,000,000 | 109,393,000 | |
| 第12回株式会社クボタ無担保社債 | 200,000,000 | 198,882,000 | |
| 第13回株式会社クボタ無担保社債 | 100,000,000 | 99,692,000 | |
| 第45回株式会社東芝無担保社債 | 200,000,000 | 210,772,000 | |
| 日本電産株式会社第1回無担保社債 | 100,000,000 | 99,621,000 | |
| 第7回パナソニック株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 201,634,000 | |
| 第11回パナソニック株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,746,000 | |
| 第22回三菱重工工業株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 213,618,000 | |
| 第1回日本生命2011基金特定目的会社特定社債 第1回 - B | 200,000,000 | 202,848,000 | |
| 第1回住友生命第4回基金流動化特定目的会社特定社債 | 100,000,000 | 100,891,000 | |
| 第1回日本生命2012基金特定目的会社特定社債 | 100,000,000 | 99,992,000 | |
| 第9回トヨタ自動車株式会社無担保社債 | 300,000,000 | 303,030,000 | |
| 第5回アイシン精機株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 101,946,000 | |
| 第43回伊藤忠商事株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 106,179,000 | |
| 第66回伊藤忠商事株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 199,212,000 | |
| 第70回伊藤忠商事株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,178,000 | |
| 第89回丸紅株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 101,338,000 | |
| 第61回三井物産株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 105,260,000 | |
| 第63回三井物産株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 114,242,000 | |
| 第33回住友商事株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 105,195,000 | |
| 第67回三菱商事株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 105,636,000 | |
| 第68回三菱商事株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 211,804,000 | |
| 第69回三菱商事株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 107,696,000 | |
| 第33回株式会社クレディセゾン無担保社債 | 100,000,000 | 105,878,000 | |
| 第2回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債 | 100,000,000 | 102,266,000 | |
| 第3回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債 | 100,000,000 | 107,908,000 | |
| 第7回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債 | 200,000,000 | 221,384,000 | |
| 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 | 115,935,000 | |
| 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 | 201,958,000 | |
| 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 | 404,432,000 | |
| 株式会社東京三菱銀行第8回無担保社債 | 100,000,000 | 103,030,000 | |
| 第9回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債 | 100,000,000 | 114,453,000 | |

| | | | |
|-----------------------------|-------------|-------------|--|
| 第11回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債 | 200,000,000 | 213,216,000 | |
| 株式会社三菱東京UFJ銀行第12回無担保社債 | 200,000,000 | 214,444,000 | |
| 第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債 | 300,000,000 | 311,532,000 | |
| 第72回株式会社東京三菱銀行無担保社債 | 100,000,000 | 100,716,000 | |
| 第100回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債 | 200,000,000 | 200,624,000 | |
| 第104回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債 | 100,000,000 | 101,145,000 | |
| 第110回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債 | 100,000,000 | 106,250,000 | |
| 第2回株式会社りそな銀行無担保社債 | 100,000,000 | 103,873,000 | |
| 第4回株式会社りそな銀行無担保社債 | 200,000,000 | 223,636,000 | |
| 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 | 101,207,000 | |
| 第11回株式会社静岡銀行無担保社債 | 100,000,000 | 102,307,000 | |
| 第9回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 213,208,000 | |
| 第7回住友信託銀行株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 105,620,000 | |
| 第8回住友信託銀行株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 114,589,000 | |
| 第11回住友信託銀行株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 105,425,000 | |
| 中央三井信託銀行第3回無担保社債 | 100,000,000 | 102,815,000 | |
| 第6回株式会社セブン銀行無担保社債 | 200,000,000 | 200,244,000 | |
| 第7回株式会社三井住友銀行無担保社債 | 100,000,000 | 101,425,000 | |
| 第8回株式会社三井住友銀行無担保社債 | 100,000,000 | 102,525,000 | |
| 第9回株式会社三井住友銀行無担保社債 | 100,000,000 | 103,319,000 | |
| 第20回株式会社三井住友銀行無担保社債 | 300,000,000 | 329,634,000 | |
| 第24回株式会社三井住友銀行無担保社債 | 100,000,000 | 106,107,000 | |
| 第43回株式会社三井住友銀行無担保社債 | 100,000,000 | 100,012,000 | |
| 第45回株式会社三井住友銀行無担保社債 | 200,000,000 | 201,640,000 | |
| 第8回株式会社みずほ銀行無担保社債 | 200,000,000 | 211,250,000 | |
| 第9回株式会社みずほ銀行無担保社債 | 100,000,000 | 113,496,000 | |
| 第10回株式会社みずほ銀行無担保社債 | 200,000,000 | 213,652,000 | |
| 第16回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債 | 200,000,000 | 201,844,000 | |
| 第22回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債 | 200,000,000 | 199,410,000 | |
| 第19回株式会社ホンダファイナンス無担保社債 | 200,000,000 | 199,782,000 | |
| 第17回トヨタファイナンス株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 109,044,000 | |
| 第21回トヨタファイナンス株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 105,542,000 | |
| 第41回日立キャピタル株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,758,000 | |
| 第113回オリックス株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 106,334,000 | |
| 第162回オリックス株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 202,496,000 | |
| 第19回三菱UFJリース株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 100,014,000 | |
| 第22回三菱UFJリース株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 199,332,000 | |
| 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 | 305,532,000 | |

| | | | |
|---------------------------|-------------|-------------|--|
| 第21回野村ホールディングス株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 208,214,000 | |
| 第38回野村ホールディングス株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 199,844,000 | |
| 第39回野村ホールディングス株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 199,582,000 | |
| 第34回三井不動産株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 109,350,000 | |
| 第58回三菱地所株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 118,941,000 | |
| 第65回三菱地所株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 104,598,000 | |
| 第87回三菱地所株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 106,252,000 | |
| 第81回住友不動産株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,664,000 | |
| 第84回住友不動産株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,194,000 | |
| 第63回東京急行電鉄株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 108,804,000 | |
| 第41回小田急電鉄株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 212,506,000 | |
| 第42回京成電鉄株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 106,237,000 | |
| 第2回東日本旅客鉄道株式会社社債 | 200,000,000 | 217,332,000 | |
| 第7回東日本旅客鉄道株式会社社債 | 200,000,000 | 225,310,000 | |
| 第9回東日本旅客鉄道株式会社社債 | 100,000,000 | 112,938,000 | |
| 第15回東日本旅客鉄道株式会社社債 | 100,000,000 | 114,652,000 | |
| 第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 228,110,000 | |
| 第34回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 100,000,000 | 117,182,000 | |
| 第52回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 100,000,000 | 106,116,000 | |
| 第3回西日本旅客鉄道株式会社社債 | 200,000,000 | 222,818,000 | |
| 第5回西日本旅客鉄道株式会社社債 | 200,000,000 | 224,852,000 | |
| 第3回東海旅客鉄道株式会社普通社債 | 100,000,000 | 110,992,000 | |
| 第7回東海旅客鉄道株式会社社債 | 100,000,000 | 112,945,000 | |
| 第11回東海旅客鉄道株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 103,752,000 | |
| 第21回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 100,000,000 | 104,132,000 | |
| 第28回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 100,000,000 | 105,655,000 | |
| 第41回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 100,000,000 | 111,638,000 | |
| 第42回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債 | 200,000,000 | 227,144,000 | |
| 第40回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 104,521,000 | |
| 第45回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 99,454,000 | |
| 第48回日本電信電話株式会社電信電話債券 | 100,000,000 | 101,959,000 | |
| 第51回日本電信電話株式会社電信電話債券 | 300,000,000 | 316,731,000 | |
| 第53回日本電信電話株式会社電信電話債券 | 300,000,000 | 316,083,000 | |
| 第60回日本電信電話株式会社電信電話債券 | 100,000,000 | 104,941,000 | |
| 第15回K D I 株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 108,570,000 | |
| 第15回株式会社エヌ・ティ・ティ・ドコモ無担保社債 | 200,000,000 | 216,146,000 | |
| 第425回東京電力株式会社社債 | 100,000,000 | 102,987,000 | |
| 第514回東京電力株式会社社債 | 100,000,000 | 98,408,000 | |
| 第515回東京電力株式会社社債 | 200,000,000 | 195,770,000 | |
| 第516回東京電力株式会社社債 | 100,000,000 | 97,608,000 | |
| 第522回東京電力株式会社社債 | 300,000,000 | 291,030,000 | |
| 第524回東京電力株式会社社債 | 100,000,000 | 95,460,000 | |

| | | | |
|-------------------|-------------|-------------|--|
| 第526回東京電力株式会社社債 | 300,000,000 | 285,393,000 | |
| 第527回東京電力株式会社社債 | 100,000,000 | 98,879,000 | |
| 第528回東京電力株式会社社債 | 100,000,000 | 92,516,000 | |
| 第532回東京電力株式会社社債 | 200,000,000 | 188,270,000 | |
| 第533回東京電力株式会社社債 | 200,000,000 | 196,772,000 | |
| 第535回東京電力株式会社社債 | 200,000,000 | 188,020,000 | |
| 第537回東京電力株式会社社債 | 100,000,000 | 90,723,000 | |
| 第544回東京電力株式会社社債 | 200,000,000 | 188,606,000 | |
| 第547回東京電力株式会社社債 | 100,000,000 | 90,770,000 | |
| 第552回東京電力株式会社社債 | 100,000,000 | 99,395,000 | |
| 第409回中部電力株式会社社債 | 200,000,000 | 220,910,000 | |
| 第475回中部電力株式会社社債 | 200,000,000 | 208,928,000 | |
| 第486回中部電力株式会社社債 | 200,000,000 | 209,856,000 | |
| 第440回関西電力株式会社社債 | 100,000,000 | 102,141,000 | |
| 第444回関西電力株式会社社債 | 100,000,000 | 102,074,000 | |
| 第449回関西電力株式会社社債 | 100,000,000 | 104,140,000 | |
| 第451回関西電力株式会社社債 | 100,000,000 | 103,232,000 | |
| 第453回関西電力株式会社社債 | 100,000,000 | 103,340,000 | |
| 第467回関西電力株式会社社債 | 100,000,000 | 102,709,000 | |
| 第472回関西電力株式会社社債 | 100,000,000 | 103,174,000 | |
| 第306回中国電力株式会社社債 | 200,000,000 | 220,848,000 | |
| 第310回中国電力株式会社社債 | 100,000,000 | 110,727,000 | |
| 第349回中国電力株式会社社債 | 200,000,000 | 210,224,000 | |
| 第286回北陸電力株式会社社債 | 100,000,000 | 106,942,000 | |
| 第368回東北電力株式会社社債 | 50,000,000 | 52,152,000 | |
| 第376回東北電力株式会社社債 | 100,000,000 | 107,783,000 | |
| 第431回東北電力株式会社社債 | 100,000,000 | 105,457,000 | |
| 第445回東北電力株式会社社債 | 100,000,000 | 104,310,000 | |
| 第459回東北電力株式会社社債 | 100,000,000 | 100,257,000 | |
| 第229回四国電力株式会社社債 | 100,000,000 | 110,558,000 | |
| 第245回四国電力株式会社社債 | 100,000,000 | 107,411,000 | |
| 第253回四国電力株式会社社債 | 100,000,000 | 98,659,000 | |
| 第268回四国電力株式会社社債 | 100,000,000 | 104,404,000 | |
| 第346回九州電力株式会社社債 | 100,000,000 | 105,569,000 | |
| 第384回九州電力株式会社社債 | 100,000,000 | 102,796,000 | |
| 第394回九州電力株式会社社債 | 100,000,000 | 104,480,000 | |
| 第400回九州電力株式会社社債 | 100,000,000 | 104,248,000 | |
| 第405回九州電力株式会社社債 | 100,000,000 | 104,476,000 | |
| 第408回九州電力株式会社社債 | 100,000,000 | 103,748,000 | |
| 第419回九州電力株式会社社債 | 100,000,000 | 100,027,000 | |
| 第258回北海道電力株式会社社債 | 200,000,000 | 220,878,000 | |
| 第300回北海道電力株式会社社債 | 100,000,000 | 104,801,000 | |
| 第11回電源開発株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 107,274,000 | |
| 第19回電源開発株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 105,237,000 | |
| 第21回電源開発株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 104,400,000 | |
| 第23回電源開発株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 105,374,000 | |
| 第17回東京瓦斯株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 222,602,000 | |
| 第25回東京瓦斯株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 101,506,000 | |
| 第18回大阪瓦斯株式会社無担保社債 | 200,000,000 | 212,910,000 | |
| 第22回大阪瓦斯株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 105,289,000 | |
| 第27回東邦瓦斯株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 103,281,000 | |
| 第30回東邦瓦斯株式会社無担保社債 | 100,000,000 | 105,509,000 | |

| | | | | |
|--|--------|-----------------|-----------------|--|
| | 社債券 小計 | 28,350,000,000 | 29,478,703,000 | |
| | 合計 | 456,357,670,000 | 484,598,990,085 | |

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

「外国株式インデックス・マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

(単位：円)

| | (平成24年 4月13日現在) | (平成25年 4月15日現在) |
|-------------|-----------------|-----------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 1,219,131,111 | 1,357,307,903 |
| コール・ローン | 187,824,056 | 745,411,787 |
| 株式 | 212,115,436,192 | 242,686,562,019 |
| 投資証券 | 4,356,239,606 | 6,008,062,958 |
| 派生商品評価勘定 | | 19,783,454 |
| 未収入金 | 4,393,074 | 30,933,223 |
| 未収配当金 | 426,794,584 | 422,417,691 |
| 未収利息 | 257 | 612 |
| 差入委託証拠金 | 745,301,709 | 1,350,418,515 |
| 流動資産合計 | 219,055,120,589 | 252,620,898,162 |
| 資産合計 | 219,055,120,589 | 252,620,898,162 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | 80,779,385 | 7,190,005 |
| 未払解約金 | 1,721,904 | 605,493,840 |
| 流動負債合計 | 82,501,289 | 612,683,845 |
| 負債合計 | 82,501,289 | 612,683,845 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 165,644,585,873 | 134,912,911,626 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金() | 53,328,033,427 | 117,095,302,691 |
| 元本等合計 | 218,972,619,300 | 252,008,214,317 |
| 純資産合計 | 218,972,619,300 | 252,008,214,317 |
| 負債純資産合計 | 219,055,120,589 | 252,620,898,162 |

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

| 項目 | 自平成24年 4月14日 至平成25年 4月15日 |
|--------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 株式、投資証券は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。 (1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。 |

| | |
|----------------------------|---|
| | <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p> |
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | <p>(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。</p> <p>(2) 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p> |
| 3. 収益及び費用の計上基準 | <p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p> |
| 4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p> |

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | (平成24年 4月13日現在) | (平成25年 4月15日現在) |
|---------------|---|---|
| 1. 受益権総数 | 平成24年 4月13日における受益権の総数 165,644,585,873口 | 平成25年 4月15日における受益権の総数 134,912,911,626口 |
| 2. 1単位当たり純資産額 | 1.3219円 (1万口 = 13,219円) | 1.8679円 (1万口 = 18,679円) |

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 自 平成24年 4月14日 至 平成25年 4月15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、投資証券を組み入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> |

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

・金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | (平成25年 4月15日現在) |
|--------------------|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | <p>(1) 有価証券（株式、投資証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> |

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

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成24年4月13日現在)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引
株式関連

(単位：円)

| 区分 | 種類 | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
|------|----------------|---------------|-------|---------------|------------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 買建 | | | | |
| | SP500 12/06 | 1,656,168,561 | | 1,627,538,594 | 28,629,967 |
| | FTSE 12/06 | 295,439,299 | | 285,713,142 | 9,726,157 |
| | DJ EUR 12/06 | 560,155,626 | | 517,732,365 | 42,423,261 |
| | 小計 | 2,511,763,486 | | 2,430,984,101 | 80,779,385 |
| 合計 | | 2,511,763,486 | | 2,430,984,101 | 80,779,385 |

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については以下のように評価しております。

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

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引
該当事項はありません。

(平成25年4月15日現在)

1. ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引
株式関連

(単位：円)

| 区分 | 種類 | 契約額等 | | 時価 | 評価損益 |
|------|----------------|---------------|-------|---------------|------------|
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 買建 | | | | |
| | SP500 13/06 | 916,932,782 | | 936,231,696 | 19,298,914 |
| | FTSE 13/06 | 154,998,208 | | 153,631,700 | 1,366,508 |
| | DJ EUR 13/06 | 311,199,700 | | 305,860,743 | 5,338,957 |
| | 小計 | 1,383,130,690 | | 1,395,724,139 | 12,593,449 |
| 合計 | | 1,383,130,690 | | 1,395,724,139 | 12,593,449 |

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については以下のように評価しております。

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

このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配

値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

2. ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

（自 平成23年4月14日 至 平成24年4月13日）
該当事項はありません。

（自 平成24年4月14日 至 平成25年4月15日）
該当事項はありません。

（その他の注記）

（平成24年 4月13日現在）

| | |
|---------------------------------|------------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 175,017,042,490円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 27,306,486,339円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 36,678,942,956円 |
| 平成24年 4月13日現在の元本の内訳 | |
| 三井住友・DC外国株式インデックスファンドS | 4,429,304,438円 |
| 三井住友・DC年金バランス30（債券重点型） | 188,307,173円 |
| 三井住友・DC年金バランス50（標準型） | 800,885,604円 |
| 三井住友・DC年金バランス70（株式重点型） | 501,126,771円 |
| スミセイ・DCバランスファンド（機動的資産配分型） | 16,276,985円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020 | 1,973,893円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025 | 2,775,208円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030 | 3,161,753円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035 | 3,990,254円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040 | 3,723,999円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045 | 2,892,544円 |
| 外国株式指数ファンド | 237,380,978円 |
| 三井住友・DC全海外株式インデックスファンド | 613,025円 |
| SMAM・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用） | 33,783,904,764円 |
| バランスファンドVA（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞ | 286,187,769円 |
| SMAM・バランスファンドVA安定成長型＜適格機関投資家限定＞ | 20,175,227,743円 |
| SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞ | 9,110,284,758円 |
| SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞ | 5,329,172,366円 |
| SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞ | 21,129,317,278円 |
| SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞ | 73,420,328円 |
| SMAM・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞ | 303,987,649円 |
| 世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞ | 55,461,630円 |
| SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞ | 2,340,121,195円 |
| SMAM・バランスファンドVL国際分散型＜適格機関投資家限定＞ | 157,170,465円 |
| SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞ | 549,342,233円 |
| SMAM・インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞ | 2,545,245,260円 |
| SMAM・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞ | 4,000,140,493円 |
| SMAM・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞ | 6,499,911,846円 |
| SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞ | 1,064,812,154円 |

| | |
|---|------------------|
| 三井住友・外国株式インデックスファンド・V A S (適格機関投資家専用) | 2,889,635,876円 |
| 三井住友・5資産バランスファンド・V A S (適格機関投資家専用) | 8,594,952,211円 |
| S M A M・グローバルバランス40V A <適格機関投資家限定> | 535,448,848円 |
| S M A M・バランスファンドV A 20 <適格機関投資家専用> | 2,331,703,375円 |
| 三井住友・7資産バランスファンド・V A S (適格機関投資家専用) | 36,344,490,401円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 20 A <適格機関投資家専用> | 84,773,356円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 35 A <適格機関投資家専用> | 52,310,735円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 50 A <適格機関投資家専用> | 19,865,917円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 20 L <適格機関投資家専用> | 221,321,296円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 25 L <適格機関投資家専用> | 501,521,996円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 20 T <適格機関投資家専用> | 441,769,401円 |
| S M A M・F G新興国重視型バランス20V A <適格機関投資家限定> | 18,318,140円 |
| S M A M・F Gグローバルバランス25V A <適格機関投資家限定> | 12,353,765円 |
| 合計 | 165,644,585,873円 |

(平成25年 4月15日現在)

| | |
|-------------------------------------|------------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 165,644,585,873円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 5,388,678,050円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 36,120,352,297円 |
| 平成25年 4月15日現在の元本の内訳 | |
| 三井住友・D C外国株式インデックスファンドS | 5,114,133,514円 |
| 三井住友・D C年金バランス30(債券重点型) | 183,615,095円 |
| 三井住友・D C年金バランス50(標準型) | 780,670,070円 |
| 三井住友・D C年金バランス70(株式重点型) | 522,896,487円 |
| スミセイ・D Cバランスファンド(機動的資産配分型) | 24,829,155円 |
| スミセイ・D Cターゲットイヤーファンド2020 | 1,864,608円 |
| スミセイ・D Cターゲットイヤーファンド2025 | 3,179,776円 |
| スミセイ・D Cターゲットイヤーファンド2030 | 3,639,294円 |
| スミセイ・D Cターゲットイヤーファンド2035 | 4,877,882円 |
| スミセイ・D Cターゲットイヤーファンド2040 | 1,383,687円 |
| スミセイ・D Cターゲットイヤーファンド2045 | 4,193,595円 |
| 外国株式指数ファンド | 235,567,376円 |
| 三井住友・D C全海外株式インデックスファンド | 759,348円 |
| S M A M・外国株式パッシブ・ファンド(適格機関投資家専用) | 29,018,803,196円 |
| バランスファンドV A(安定運用型)<適格機関投資家限定> | 208,798,862円 |
| S M A M・バランスファンドV A安定成長型<適格機関投資家限定> | 16,366,217,839円 |
| S M A M・バランスファンドV A 25<適格機関投資家専用> | 7,602,488,267円 |
| S M A M・バランスファンドV A 37.5<適格機関投資家専用> | 4,390,052,897円 |
| S M A M・バランスファンドV A 50<適格機関投資家専用> | 17,776,304,966円 |
| S M A M・バランスファンドV L 30<適格機関投資家限定> | 61,330,948円 |
| S M A M・バランスファンドV L 50<適格機関投資家限定> | 263,974,230円 |

| | |
|--|------------------|
| 世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定> | 46,350,691円 |
| SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用> | 2,151,285,118円 |
| SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定> | 143,201,316円 |
| SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用> | 440,356,235円 |
| SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用> | 2,090,967,465円 |
| SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用> | 3,499,495,884円 |
| SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用> | 5,148,314,683円 |
| SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定> | 807,784,217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) | 2,210,394,147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) | 6,801,789,394円 |
| SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定> | 409,327,625円 |
| SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用> | 1,603,285,548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) | 25,908,387,252円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A <適格機関投資家専用> | 69,293,138円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA35A <適格機関投資家専用> | 42,543,397円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA50A <適格機関投資家専用> | 17,835,303円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20L <適格機関投資家専用> | 165,265,306円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA25L <適格機関投資家専用> | 408,026,473円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20T <適格機関投資家専用> | 368,484,356円 |
| SMAM・FG新興国重視型バランス20VA<適格機関投資家限定> | 2,215,917円 |
| SMAM・FGグローバルバランス25VA<適格機関投資家限定> | 8,727,069円 |
| 合計 | 134,912,911,626円 |

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

| 銘柄 | 株数 | 評価額 単価 | 評価額 金額 | 備考 |
|-------------------------------|---------|-----------|---------------|----|
| 米ドル | | | | |
| REGENERON PHARMACEUTICALS | 7,652 | 215.84 | 1,651,607.68 | |
| ANADARKO PETROLEUM CORP | 50,153 | 85.29 | 4,277,549.37 | |
| APACHE CORPORATION | 38,894 | 75.09 | 2,920,550.46 | |
| BAKER HUGHES INC | 44,152 | 46.00 | 2,030,992.00 | |
| CABOT OIL & GAS CORPORATION | 21,000 | 67.70 | 1,421,700.00 | |
| CAMERON INTERNATIONAL CORP | 24,953 | 62.64 | 1,563,055.92 | |
| CHESAPEAKE ENERGY CORPORATION | 67,103 | 19.68 | 1,320,587.04 | |
| CHEVRON CORPORATION | 195,235 | 119.94 | 23,416,485.90 | |
| CIMAREX ENERGY CO | 8,230 | 72.33 | 595,275.90 | |
| COBALT INTERNATIONAL ENERGY | 23,600 | 27.84 | 657,024.00 | |
| CONCHO RESOURCES INC | 9,862 | 86.50 | 853,063.00 | |

| | | | |
|---|---------|--------|---------------|
| CONOCOPHILLIPS | 115,081 | 59.36 | 6,831,208.16 |
| CONSOL ENERGY INC | 23,362 | 33.57 | 784,262.34 |
| CONTINENTAL RESOURCES, INC. | 4,300 | 80.31 | 345,333.00 |
| CORE LABORATORIES N.V. | 4,790 | 136.20 | 652,398.00 |
| DENBURY RESOURCES INC | 39,546 | 17.81 | 704,314.26 |
| DEVON ENERGY CORPORATION | 37,745 | 55.05 | 2,077,862.25 |
| DIAMOND OFFSHORE DRILLING, INC. | 6,436 | 68.78 | 442,668.08 |
| ENSCO PLC-CL A | 22,991 | 56.98 | 1,310,027.18 |
| EOG RESOURCES INC | 27,035 | 124.13 | 3,355,854.55 |
| EXXON MOBIL CORPORATION | 454,689 | 88.99 | 40,462,774.11 |
| FMC TECHNOLOGIES INC | 23,290 | 52.80 | 1,229,712.00 |
| HALLIBURTON CO | 93,238 | 40.86 | 3,809,704.68 |
| HELMERICH & PAYNE INC | 10,300 | 61.35 | 631,905.00 |
| HESS CORPORATION | 30,615 | 71.39 | 2,185,604.85 |
| HOLLYFRONTIER CORP | 19,800 | 46.83 | 927,234.00 |
| KINDER MORGAN INC | 66,207 | 38.78 | 2,567,507.46 |
| KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC | 10,347 | 87.94 | 909,915.18 |
| MARATHON OIL CORP | 70,269 | 32.54 | 2,286,553.26 |
| MARATHON PETROLEUM CORPORATION | 33,786 | 80.29 | 2,712,677.94 |
| MURPHY OIL CORPORATION | 18,107 | 61.54 | 1,114,304.78 |
| NABORS INDUSTRIES LTD | 27,384 | 16.09 | 440,608.56 |
| NATIONAL-OILWELL VARCO INC. | 43,022 | 68.86 | 2,962,494.92 |
| NEWFIELD EXPLORATION CO | 12,087 | 21.70 | 262,287.90 |
| NOBLE CORPORATION | 25,918 | 36.70 | 951,190.60 |
| NOBLE ENERGY INC | 17,949 | 113.54 | 2,037,929.46 |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP | 80,753 | 83.39 | 6,733,992.67 |
| OCEANEERING INTL INC | 10,800 | 64.60 | 697,680.00 |
| PEABODY ENERGY CORP | 27,953 | 20.77 | 580,583.81 |
| PHILLIPS 66 | 59,195 | 60.67 | 3,591,360.65 |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 12,975 | 118.61 | 1,538,964.75 |
| PLAINS EXPLORATION & PRODUCTION COMPANY | 12,700 | 47.07 | 597,789.00 |
| RANGE RESOURCES CORPORATION | 16,582 | 78.91 | 1,308,485.62 |
| ROWAN COMPANIES PLC | 11,545 | 33.04 | 381,446.80 |
| SCHLUMBERGER LTD | 132,346 | 75.66 | 10,013,298.36 |
| SOUTHWESTERN ENERGY COMPANY | 34,575 | 37.95 | 1,312,121.25 |
| SPECTRA ENERGY CORPORATION | 65,463 | 30.53 | 1,998,585.39 |
| SUPERIOR ENERGY SERVICES INC | 16,400 | 25.36 | 415,904.00 |
| ULTRA PETROLEUM CORP | 16,448 | 21.83 | 359,059.84 |
| VALERO ENERGY CORP | 54,702 | 40.91 | 2,237,858.82 |
| WEATHERFORD INTL LTD | 78,118 | 12.54 | 979,599.72 |
| WHITING PETROLEUM CORP | 11,800 | 48.81 | 575,958.00 |
| WILLIAMS COS INC | 66,743 | 37.73 | 2,518,213.39 |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | 21,249 | 86.93 | 1,847,175.57 |
| AIRGAS INC | 6,440 | 97.20 | 625,968.00 |
| ALBEMARLE CORPORATION | 8,500 | 60.87 | 517,395.00 |
| ALCOA INC | 107,499 | 8.22 | 883,641.78 |
| ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC | 9,880 | 29.73 | 293,732.40 |
| BALL CORPORATION | 14,406 | 47.89 | 689,903.34 |

| | | | |
|---------------------------------|-----------|--------|---------------|
| CELANESE CORPORATION | 16,023 | 43.96 | 704,371.08 |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC | 6,218 | 182.24 | 1,133,168.32 |
| CLIFFS NATURAL RESOURCES INC | 14,155 | 19.20 | 271,776.00 |
| CROWN HOLDINGS INC | 14,900 | 41.34 | 615,966.00 |
| DOW CHEMICAL | 119,678 | 31.75 | 3,799,776.50 |
| DU PONT (E.I.) DE NEMOURS | 92,803 | 49.82 | 4,623,445.46 |
| EASTMAN CHEMICAL COMPANY | 15,554 | 68.00 | 1,057,672.00 |
| ECOLAB INC | 28,881 | 82.22 | 2,374,595.82 |
| FMC CORPORATION | 13,500 | 58.43 | 788,805.00 |
| FREEPORT-MCMORAN COPPER-B | 95,808 | 31.92 | 3,058,191.36 |
| INTERNATIONAL PAPER CO | 41,581 | 48.20 | 2,004,204.20 |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES | 8,042 | 75.48 | 607,010.16 |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A | 31,059 | 59.46 | 1,846,768.14 |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS | 4,393 | 98.73 | 433,720.89 |
| MEADWESTVACO CORP | 17,015 | 35.77 | 608,626.55 |
| MONSANTO CO | 53,356 | 105.45 | 5,626,390.20 |
| MOSAIC CO/THE | 30,088 | 59.20 | 1,781,209.60 |
| NEWMONT MINING CORP | 50,119 | 36.37 | 1,822,828.03 |
| NUCOR CORP | 30,905 | 44.31 | 1,369,400.55 |
| OWENS-ILLINOIS INC | 16,039 | 26.24 | 420,863.36 |
| PPG INDUSTRIES INC | 14,346 | 136.25 | 1,954,642.50 |
| PRAXAIR INC | 29,547 | 111.00 | 3,279,717.00 |
| ROCK-TENN COMPANY CL A | 7,500 | 89.25 | 669,375.00 |
| SEALED AIR CORP | 18,538 | 22.65 | 419,885.70 |
| SIGMA-ALDRICH | 12,406 | 76.42 | 948,066.52 |
| UNITED STATES STEEL CORPORATION | 15,109 | 17.45 | 263,652.05 |
| VULCAN MATERIALS CO | 12,853 | 48.88 | 628,254.64 |
| WEYERHAEUSER CO | 53,743 | 31.78 | 1,707,952.54 |
| 3M COMPANY | 65,578 | 107.68 | 7,061,439.04 |
| AGCO CORP | 9,254 | 50.92 | 471,213.68 |
| AMETEK INC | 23,760 | 40.95 | 972,972.00 |
| BOEING CO | 71,392 | 88.89 | 6,346,034.88 |
| CATERPILLAR INC | 65,240 | 85.05 | 5,548,662.00 |
| CUMMINS INC | 17,862 | 117.11 | 2,091,818.82 |
| DANAHER CORP | 59,135 | 61.56 | 3,640,350.60 |
| DEERE & CO | 37,002 | 86.14 | 3,187,352.28 |
| DOVER CORP | 17,440 | 73.41 | 1,280,270.40 |
| EATON CORP PLC | 45,893 | 60.30 | 2,767,347.90 |
| EMERSON ELECTRIC CO | 71,987 | 55.83 | 4,019,034.21 |
| FASTENAL COMPANY | 28,436 | 49.51 | 1,407,866.36 |
| FLOWSERVE CORPORATION | 5,269 | 161.55 | 851,206.95 |
| FLUOR CORP | 16,331 | 60.22 | 983,452.82 |
| GENERAL DYNAMICS CORP | 30,017 | 70.60 | 2,119,200.20 |
| GENERAL ELECTRIC CO | 1,046,045 | 23.46 | 24,540,215.70 |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC | 74,214 | 74.25 | 5,510,389.50 |
| ILLINOIS TOOL WORKS | 41,439 | 63.44 | 2,628,890.16 |
| INGERSOLL-RAND PLC | 29,864 | 56.16 | 1,677,162.24 |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC | 12,890 | 53.08 | 684,201.20 |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|--------------|
| JOY GLOBAL INC | 10,760 | 54.47 | 586,097.20 |
| KBR, INC. | 14,485 | 29.40 | 425,859.00 |
| L-3 COMMUNICATIONS HLDGS INC | 9,770 | 82.45 | 805,536.50 |
| LOCKHEED MARTIN CORPORATION | 27,553 | 97.18 | 2,677,600.54 |
| MASCO CORP | 35,966 | 20.11 | 723,276.26 |
| NORTHROP GRUMMAN CORP | 23,333 | 72.11 | 1,682,542.63 |
| PACCAR INC | 33,884 | 50.23 | 1,701,993.32 |
| PALL CORPORATION | 11,626 | 67.05 | 779,523.30 |
| PARKER HANNIFIN CORPORATIOM | 14,892 | 89.04 | 1,325,983.68 |
| PENTAIR LTD-REGISTERED | 20,879 | 53.35 | 1,113,894.65 |
| PRECISION CASTPARTS CORP | 14,638 | 188.93 | 2,765,557.34 |
| QUANTA SERVICES INC | 20,759 | 28.06 | 582,497.54 |
| RAYTHEON COMPANY | 32,427 | 58.34 | 1,891,791.18 |
| ROCKWELL AUTOMATION INC | 14,309 | 87.63 | 1,253,897.67 |
| ROCKWELL COLLINS INC. | 13,344 | 62.88 | 839,070.72 |
| ROPER INDUSTRIES INC | 9,590 | 123.36 | 1,183,022.40 |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING | 10,000 | 32.42 | 324,200.00 |
| SPX CORP | 5,088 | 76.33 | 388,367.04 |
| TEXTRON INC | 29,568 | 29.81 | 881,422.08 |
| THE ADT CORPORATION | 22,959 | 45.98 | 1,055,654.82 |
| TRANSDIGM GROUP INC | 4,850 | 152.90 | 741,565.00 |
| TYCO INTERNATIONAL LTD | 45,571 | 32.25 | 1,469,664.75 |
| UNITED TECHNOLOGIES CORP | 86,779 | 95.69 | 8,303,882.51 |
| WW GRAINGER INC | 5,756 | 228.00 | 1,312,368.00 |
| XYLEM INC | 18,566 | 28.60 | 530,987.60 |
| AVERY DENNISON CORP | 9,562 | 42.81 | 409,349.22 |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC | 3,229 | 341.91 | 1,104,027.39 |
| CINTAS CORP | 10,936 | 45.88 | 501,743.68 |
| DUN & BRADSTREET CORP | 4,801 | 86.00 | 412,886.00 |
| EQUIFAX INC | 11,902 | 58.95 | 701,622.90 |
| IHS INC-CLASS A | 5,440 | 102.17 | 555,804.80 |
| IRON MOUNTAIN INC | 14,247 | 37.20 | 529,988.40 |
| MANPOWERGROUP | 7,792 | 55.61 | 433,313.12 |
| NETFLIX INC | 5,278 | 173.20 | 914,149.60 |
| NIELSEN HOLDINGS NV | 17,200 | 35.49 | 610,428.00 |
| PITNEY BOWES INC | 20,973 | 15.09 | 316,482.57 |
| REPUBLIC SERVICES INC | 31,894 | 33.52 | 1,069,086.88 |
| ROBERT HALF INTL INC | 12,891 | 36.39 | 469,103.49 |
| STERICYCLE, INC. | 8,651 | 109.20 | 944,689.20 |
| VERISK ANALYTICS INC-CLASS A | 14,200 | 61.16 | 868,472.00 |
| WASTE MANAGEMENT INC | 43,929 | 39.21 | 1,722,456.09 |
| WYNDHAM WORLDWIDE CORP | 14,300 | 65.26 | 933,218.00 |
| C.H.ROBINSON WORLDWIDE, INC. | 16,262 | 59.00 | 959,458.00 |
| CSX CORPORATION | 101,422 | 24.51 | 2,485,853.22 |
| DELTA AIR LINES INC | 21,520 | 15.48 | 333,129.60 |
| EXPEDITORS INTL WASH INC | 21,578 | 36.70 | 791,912.60 |
| FEDEX CORP | 30,031 | 96.33 | 2,892,886.23 |
| HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC | 34,575 | 23.88 | 825,651.00 |

| | | | |
|----------------------------------|---------|--------|---------------|
| J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC | 9,480 | 72.01 | 682,654.80 |
| KANSAS CITY SOUTHERN | 11,340 | 107.77 | 1,222,111.80 |
| NORFOLK SOUTHERN CORP | 31,873 | 76.81 | 2,448,165.13 |
| SOUTHWEST AIRLINES | 18,800 | 13.15 | 247,220.00 |
| UNION PACIFIC CORP | 46,881 | 141.27 | 6,622,878.87 |
| UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC | 8,200 | 30.28 | 248,296.00 |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B | 72,198 | 84.14 | 6,074,739.72 |
| AUTOLIV INC | 9,100 | 70.63 | 642,733.00 |
| BORGLWARNER INC | 11,800 | 74.81 | 882,758.00 |
| DELPHI AUTOMOTIVE PLC | 30,300 | 44.89 | 1,360,167.00 |
| FORD MOTOR COMPANY | 354,419 | 13.53 | 4,795,289.07 |
| GENERAL MOTORS CO | 77,828 | 29.62 | 2,305,265.36 |
| GOODYEAR TIRE & RUBBER CO | 26,234 | 12.50 | 327,925.00 |
| HARLEY-DAVIDSON INC | 22,186 | 52.00 | 1,153,672.00 |
| JOHNSON CONTROLS INC | 68,917 | 34.07 | 2,348,002.19 |
| TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP | 11,550 | 56.78 | 655,809.00 |
| BEAM INC | 13,962 | 62.13 | 867,459.06 |
| COACH INC | 28,045 | 52.37 | 1,468,716.65 |
| D.R.HORTON INC | 29,248 | 23.42 | 684,988.16 |
| FOSSIL INC | 4,850 | 98.07 | 475,639.50 |
| GARMIN LTD | 11,416 | 34.72 | 396,363.52 |
| HASBRO INC | 11,514 | 44.91 | 517,093.74 |
| LEGGETT & PLATT INC | 14,915 | 33.79 | 503,977.85 |
| LULULEMON ATHLETICA INC | 10,380 | 69.60 | 722,448.00 |
| MATTEL INC | 33,505 | 44.02 | 1,474,890.10 |
| MOHAWK INDUSTRIES INC | 5,703 | 116.27 | 663,087.81 |
| NEWELL RUBBERMAID INC | 29,044 | 25.65 | 744,978.60 |
| NIKE INC -CL B | 71,914 | 60.58 | 4,356,550.12 |
| POLARIS INDUSTRIES INC | 6,260 | 88.72 | 555,387.20 |
| PULTE GROUP INC | 33,400 | 19.22 | 641,948.00 |
| PVH CORP | 8,130 | 109.73 | 892,104.90 |
| RALPH LAUREN CORPORATION | 6,228 | 174.02 | 1,083,796.56 |
| STANLEY BLACK & DECKER INC | 15,599 | 79.24 | 1,236,064.76 |
| TOLL BROTHERS INC | 15,339 | 33.04 | 506,800.56 |
| UNDER ARMOUR INC | 8,300 | 57.00 | 473,100.00 |
| VF CORP | 8,571 | 171.60 | 1,470,783.60 |
| WHIRLPOOL CORP | 7,784 | 119.00 | 926,296.00 |
| CARNIVAL CORP | 43,619 | 34.13 | 1,488,716.47 |
| DARDEN RESTAURANTS INC | 12,540 | 50.26 | 630,260.40 |
| H&R BLOCK INC | 26,392 | 28.58 | 754,283.36 |
| INTL GAME TECHNOLOGY | 24,960 | 16.94 | 422,822.40 |
| LAS VEGAS SANDS CORP | 40,639 | 55.99 | 2,275,377.61 |
| MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A | 25,847 | 42.59 | 1,100,823.73 |
| MCDONALD'S CORPORATION | 100,110 | 103.59 | 10,370,394.90 |
| MGM MIRAGE | 38,000 | 13.04 | 495,520.00 |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD | 13,771 | 33.28 | 458,298.88 |
| STARBUCKS CORP | 74,226 | 59.09 | 4,386,014.34 |
| STARWOOD HOTELS & RESORTS | 19,280 | 63.86 | 1,231,220.80 |

| | | | |
|-----------------------------------|---------|--------|---------------|
| WYNN RESORTS LTD | 8,164 | 128.54 | 1,049,400.56 |
| YUM! BRANDS INC | 44,852 | 67.80 | 3,040,965.60 |
| CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A | 19,920 | 14.84 | 295,612.80 |
| CBS CORP-CL B | 59,629 | 46.57 | 2,776,922.53 |
| CHARTER COMMUNICATION-A | 5,700 | 105.06 | 598,842.00 |
| COMCAST CORP-CL A | 211,461 | 42.00 | 8,881,362.00 |
| COMCAST CORP-SPECIAL CL A | 51,814 | 39.99 | 2,072,041.86 |
| DIRECTV | 57,155 | 56.05 | 3,203,537.75 |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-A | 14,630 | 81.03 | 1,185,468.90 |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-C | 8,430 | 73.48 | 619,436.40 |
| DISH NETWORK CORP. | 21,864 | 37.63 | 822,742.32 |
| INTERPUBLIC GROUP OF COS INC | 44,125 | 13.65 | 602,306.25 |
| LIBERTY GLOBAL INC-A | 13,840 | 75.54 | 1,045,473.60 |
| LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C | 10,963 | 70.72 | 775,303.36 |
| LIBERTY MEDIA CORP | 10,450 | 112.05 | 1,170,922.50 |
| MCGRAW-HILL COMPANIES INC | 25,528 | 51.80 | 1,322,350.40 |
| NEWS CORP-CL A | 154,105 | 31.54 | 4,860,471.70 |
| NEWS CORPORATION-CLASS B | 43,531 | 31.68 | 1,379,062.08 |
| OMNICOM GROUP | 26,888 | 60.15 | 1,617,313.20 |
| SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE | 8,800 | 68.10 | 599,280.00 |
| SIRIUS XM RADIO INC | 346,000 | 3.08 | 1,065,680.00 |
| THE WALT DISNEY CO. | 167,838 | 60.55 | 10,162,590.90 |
| TIME WARNER CABLE, INC. | 29,976 | 93.67 | 2,807,851.92 |
| TIME WARNER INC | 94,351 | 59.46 | 5,610,110.46 |
| VIACOM INC-CLASS B | 45,359 | 66.50 | 3,016,373.50 |
| VIRGIN MEDIA INC | 24,877 | 50.15 | 1,247,581.55 |
| ADVANCE AUTO PARTS | 7,338 | 81.99 | 601,642.62 |
| AMAZON.COM INC | 36,153 | 272.87 | 9,865,069.11 |
| AUTOZONE INC | 3,237 | 393.57 | 1,273,986.09 |
| BED BATH & BEYOND INC | 22,339 | 66.76 | 1,491,351.64 |
| BEST BUY COMPANY INC | 30,816 | 24.09 | 742,357.44 |
| CARMAX INC | 22,622 | 43.99 | 995,141.78 |
| DICK'S SPORTING GOODS INC | 9,600 | 49.05 | 470,880.00 |
| DOLLAR GENERAL CORP | 26,500 | 50.31 | 1,333,215.00 |
| DOLLAR TREE INC | 23,170 | 47.82 | 1,107,989.40 |
| EXPEDIA INC | 9,491 | 64.43 | 611,505.13 |
| FAMILY DOLLAR STORES | 10,136 | 61.05 | 618,802.80 |
| GAMESTOP CORP-CL A | 11,747 | 32.02 | 376,138.94 |
| GAP INC/THE | 31,505 | 38.18 | 1,202,860.90 |
| GENUINE PARTS CO | 15,084 | 77.74 | 1,172,630.16 |
| HOME DEPOT INC | 149,173 | 73.62 | 10,982,116.26 |
| J.C.PENNEY CO INC (HLDG CO) | 15,697 | 14.62 | 229,490.14 |
| KOHL'S CORP | 21,371 | 48.42 | 1,034,783.82 |
| L BRANDS INC | 25,103 | 50.43 | 1,265,944.29 |
| LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION-A | 52,572 | 21.30 | 1,119,783.60 |
| LKQ CORPORATION | 29,000 | 22.04 | 639,160.00 |
| LOWE'S COMPANIES INC | 112,073 | 38.92 | 4,361,881.16 |
| MACY'S INC | 39,722 | 44.43 | 1,764,848.46 |

| | | | |
|--------------------------------------|---------|--------|---------------|
| NORDSTROM INC | 16,335 | 56.82 | 928,154.70 |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC NEW | 11,520 | 103.14 | 1,188,172.80 |
| PETSMART INC | 10,691 | 66.16 | 707,316.56 |
| PRICELINE.COM INC | 4,945 | 743.11 | 3,674,678.95 |
| ROSS STORES INC | 22,806 | 64.67 | 1,474,864.02 |
| SEARS HOLDINGS CORP | 3,910 | 52.24 | 204,258.40 |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE | 8,770 | 170.74 | 1,497,389.80 |
| STAPLES INC | 66,576 | 13.70 | 912,091.20 |
| TARGET CORP | 61,483 | 69.49 | 4,272,453.67 |
| TIFFANY & CO | 12,907 | 72.67 | 937,951.69 |
| TJX COMPANIES INC | 73,449 | 48.58 | 3,568,152.42 |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY | 7,080 | 107.36 | 760,108.80 |
| ULTA SALON COSMETICS & FRAGRANCE INC | 6,020 | 87.69 | 527,893.80 |
| URBAN OUTFITTERS, INC. | 11,200 | 41.38 | 463,456.00 |
| COSTCO WHOLESALE CORP | 43,033 | 106.13 | 4,567,092.29 |
| CVS CAREMARK CORPORATION | 124,431 | 57.52 | 7,157,271.12 |
| KROGER CO | 48,987 | 33.11 | 1,621,959.57 |
| SAFEWAY INC | 23,549 | 26.85 | 632,290.65 |
| SYSCO CORP | 58,799 | 34.62 | 2,035,621.38 |
| WALGREEN CO | 89,791 | 48.77 | 4,379,107.07 |
| WAL-MART STORES INC | 166,758 | 78.56 | 13,100,508.48 |
| WHOLE FOODS MARKET INC | 17,794 | 88.01 | 1,566,049.94 |
| ALTRIA GROUP INC | 201,873 | 35.91 | 7,249,259.43 |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO | 66,103 | 32.64 | 2,157,601.92 |
| BROWN-FORMAN CORPORATION | 12,092 | 70.80 | 856,113.60 |
| BUNGE LIMITED | 14,460 | 69.24 | 1,001,210.40 |
| CAMPBELL SOUP CO | 19,279 | 45.50 | 877,194.50 |
| COCA-COLA CO/THE | 402,474 | 41.08 | 16,533,631.92 |
| COCA-COLA ENTERPRISES INC | 28,304 | 37.27 | 1,054,890.08 |
| CONAGRA FOODS INC | 40,233 | 35.16 | 1,414,592.28 |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A | 15,423 | 49.19 | 758,657.37 |
| DR.PEPPER SNAPPLE GROUP, INC | 21,170 | 47.64 | 1,008,538.80 |
| GENERAL MILLS INC | 63,976 | 49.35 | 3,157,215.60 |
| GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTERS, INC. | 12,150 | 57.44 | 697,896.00 |
| HJ HEINZ CO | 32,253 | 72.32 | 2,332,536.96 |
| HORMEL FOODS CORPORATION | 15,200 | 40.93 | 622,136.00 |
| JM SMUCKER CO/THE-NEW COM | 10,625 | 101.10 | 1,074,187.50 |
| KELLOGG CO | 25,128 | 64.70 | 1,625,781.60 |
| KRAFT FOODS GROUP INC | 56,488 | 52.07 | 2,941,330.16 |
| LORILLARD INC | 39,230 | 41.56 | 1,630,398.80 |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS | 11,700 | 71.72 | 839,124.00 |
| MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY | 20,610 | 77.51 | 1,597,481.10 |
| MOLSON COORS BREWING COMPANY | 15,225 | 51.91 | 790,329.75 |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC | 167,406 | 30.55 | 5,114,253.30 |
| MONSTER BEVERAGE CORPORATION | 15,000 | 56.75 | 851,250.00 |
| PEPSICO INC | 154,297 | 79.99 | 12,342,217.03 |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC. | 166,650 | 96.44 | 16,071,726.00 |
| REYNOLDS AMERICAN INC | 32,643 | 46.18 | 1,507,453.74 |

| | | | |
|-----------------------------|---------|--------|---------------|
| THE HERSHEY COMPANY | 15,530 | 86.52 | 1,343,655.60 |
| TYSON FOODS INC-CL A | 29,800 | 23.88 | 711,624.00 |
| AVON PRODUCTS INC | 43,990 | 21.54 | 947,544.60 |
| CHURCH & DWIGHT CO INC | 14,070 | 63.90 | 899,073.00 |
| CLOROX COMPANY | 12,341 | 88.76 | 1,095,387.16 |
| COLGATE-PALMOLIVE CO | 47,082 | 118.37 | 5,573,096.34 |
| ENERGIZER HOLDINGS INC | 5,897 | 97.79 | 576,667.63 |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A | 23,222 | 68.24 | 1,584,669.28 |
| HERBALIFE LTD | 11,050 | 37.38 | 413,049.00 |
| KIMBERLY-CLARK CORP | 38,845 | 101.23 | 3,932,279.35 |
| PROCTER & GAMBLE CO | 272,645 | 80.08 | 21,833,411.60 |
| AETNA INC | 33,339 | 56.78 | 1,892,988.42 |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC | 19,284 | 100.10 | 1,930,328.40 |
| AMERISOURCEBERGEN CORP | 23,518 | 54.18 | 1,274,205.24 |
| BARD(C.R.) INC | 7,680 | 103.05 | 791,424.00 |
| BAXTER INTERNATIONAL INC | 54,866 | 71.78 | 3,938,281.48 |
| BECTON DICKINSON & CO | 19,558 | 96.36 | 1,884,608.88 |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP | 136,525 | 7.66 | 1,045,781.50 |
| CARDINAL HEALTH INC | 34,505 | 43.27 | 1,493,031.35 |
| CAREFUSION CORPORATION | 22,145 | 35.29 | 781,497.05 |
| CERNER CORP | 14,710 | 94.68 | 1,392,742.80 |
| CIGNA CORP | 28,852 | 66.72 | 1,925,005.44 |
| COVENTRY HEALTH CARE INC | 12,913 | 49.27 | 636,223.51 |
| COVIDIEN PLC | 47,307 | 67.84 | 3,209,306.88 |
| DAVITA HEALTH PARTNERS INC | 9,578 | 126.91 | 1,215,543.98 |
| DENTSPLY INTERNATIONAL INC | 14,009 | 42.04 | 588,938.36 |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP | 11,700 | 84.80 | 992,160.00 |
| EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO | 81,260 | 56.30 | 4,574,938.00 |
| HCA HOLDINGS, INC. | 26,700 | 38.32 | 1,023,144.00 |
| HENRY SCHEIN INC | 8,700 | 91.91 | 799,617.00 |
| HOLOGIC INC | 25,380 | 21.90 | 555,822.00 |
| HOSPIRA INC | 17,533 | 31.61 | 554,218.13 |
| HUMANA INC. | 15,773 | 77.56 | 1,223,353.88 |
| INTUITIVE SURGICAL INC | 3,954 | 512.05 | 2,024,645.70 |
| LABORATORY CRP OF AMR HLDGS | 9,083 | 94.36 | 857,071.88 |
| MCKESSON CORP | 23,624 | 108.36 | 2,559,896.64 |
| MEDTRONIC INC | 101,531 | 47.20 | 4,792,263.20 |
| OMNICARE INC | 11,095 | 42.22 | 468,430.90 |
| PATTERSON COS INC | 8,832 | 37.28 | 329,256.96 |
| QUEST DIAGNOSTICS | 16,316 | 59.34 | 968,191.44 |
| RESMED INC | 14,100 | 45.73 | 644,793.00 |
| ST JUDE MEDICAL INC | 30,650 | 42.48 | 1,302,012.00 |
| STRYKER CORP | 30,727 | 66.50 | 2,043,345.50 |
| UNITEDHEALTH GROUP INC | 101,791 | 63.03 | 6,415,886.73 |
| VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC | 10,467 | 72.78 | 761,788.26 |
| WELLPOINT INC | 29,946 | 69.79 | 2,089,931.34 |
| ZIMMER HOLDINGS INC | 17,097 | 75.46 | 1,290,139.62 |
| ABBOTT LABORATORIES | 157,882 | 37.13 | 5,862,158.66 |

| | | | | |
|-----------------------------------|-----------|--------|---------------|--|
| ABBVIE INC | 156,512 | 43.09 | 6,744,102.08 | |
| ACTAVIS INC | 13,000 | 97.33 | 1,265,290.00 | |
| ALLERGAN INC | 30,390 | 116.02 | 3,525,847.80 | |
| AMGEN INC | 76,669 | 111.57 | 8,553,960.33 | |
| BIOGEN IDEC INC | 22,409 | 207.01 | 4,638,887.09 | |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | 164,853 | 41.42 | 6,828,211.26 | |
| CELGENE CORP | 42,100 | 123.00 | 5,178,300.00 | |
| ELI LILLY & CO | 104,261 | 57.51 | 5,996,050.11 | |
| FOREST LABORATORIES, INC. | 27,330 | 37.99 | 1,038,266.70 | |
| GILEAD SCIENCES INC | 150,976 | 51.93 | 7,840,183.68 | |
| ILLUMINA INC | 12,489 | 57.84 | 722,363.76 | |
| JOHNSON & JOHNSON | 276,364 | 82.74 | 22,866,357.36 | |
| LIFE TECHNOLOGIES CORPORATION | 16,883 | 68.00 | 1,148,044.00 | |
| MERCK & CO. INC. | 303,122 | 47.11 | 14,280,077.42 | |
| MYLAN INC | 41,100 | 28.68 | 1,178,748.00 | |
| PERRIGO CO | 9,150 | 119.92 | 1,097,268.00 | |
| PFIZER INC | 734,501 | 30.67 | 22,527,145.67 | |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 35,712 | 79.59 | 2,842,318.08 | |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC | 21,108 | 55.74 | 1,176,559.92 | |
| WARNER CHILCOTT PLC | 21,500 | 14.16 | 304,440.00 | |
| WATERS CORP | 8,921 | 94.33 | 841,517.93 | |
| BB & T CORPORATION | 69,807 | 31.01 | 2,164,715.07 | |
| COMERICA INC | 19,150 | 35.05 | 671,207.50 | |
| FIFTH THIRD BANCORP | 91,338 | 16.49 | 1,506,163.62 | |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA | 9,100 | 40.00 | 364,000.00 | |
| HUDSON CITY BANCORP INC | 44,269 | 8.29 | 366,990.01 | |
| KEYCORP | 90,915 | 9.84 | 894,603.60 | |
| M & T BANK CORP | 11,198 | 100.24 | 1,122,487.52 | |
| NEW YORK COMMUNITY BANCORP | 41,868 | 13.64 | 571,079.52 | |
| PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC | 34,000 | 13.30 | 452,200.00 | |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 52,745 | 65.81 | 3,471,148.45 | |
| REGIONS FINANCIAL CORPORATION | 145,022 | 8.11 | 1,176,128.42 | |
| SUNTRUST BANKS INC | 52,809 | 28.79 | 1,520,371.11 | |
| US BANCORP | 187,623 | 34.08 | 6,394,191.84 | |
| WELLS FARGO & COMPANY | 498,829 | 37.21 | 18,561,427.09 | |
| AFFILIATED MANAGERS GROUP | 5,280 | 153.76 | 811,852.80 | |
| AMERICAN EXPRESS COMPANY | 100,377 | 65.68 | 6,592,761.36 | |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC | 20,067 | 74.73 | 1,499,606.91 | |
| BANK OF AMERICA CORP | 1,075,218 | 12.17 | 13,085,403.06 | |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP(THE) | 117,197 | 28.45 | 3,334,254.65 | |
| BLACKROCK INC | 13,488 | 263.13 | 3,549,097.44 | |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP | 57,834 | 54.66 | 3,161,206.44 | |
| CIT GROUP INC | 18,700 | 42.99 | 803,913.00 | |
| CITIGROUP INC | 292,381 | 44.78 | 13,092,821.18 | |
| CME GROUP INC. | 31,561 | 60.48 | 1,908,809.28 | |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES | 50,230 | 43.31 | 2,175,461.30 | |
| EATON VANCE CORP | 10,700 | 41.16 | 440,412.00 | |
| FRANKLIN RESOURCES INC | 14,598 | 155.27 | 2,266,631.46 | |

| | | | |
|--------------------------------------|---------|--------|---------------|
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 44,548 | 149.12 | 6,642,997.76 |
| INTERCONTINENTALEXCHANGE INC | 7,108 | 158.20 | 1,124,485.60 |
| INVESCO LIMITED | 43,739 | 30.13 | 1,317,856.07 |
| JPMORGAN CHASE & CO | 379,049 | 49.01 | 18,577,191.49 |
| LEGG MASON INC | 12,803 | 32.10 | 410,976.30 |
| LEUCADIA NATIONAL CORPORATION | 30,784 | 29.03 | 893,659.52 |
| MOODY'S CORP | 19,668 | 54.40 | 1,069,939.20 |
| MORGAN STANLEY | 148,154 | 21.82 | 3,232,720.28 |
| NASDAQ STOCK MARKET INC | 13,480 | 29.18 | 393,346.40 |
| NORTHERN TRUST CORP | 21,205 | 55.64 | 1,179,846.20 |
| NYSE EURONEXT | 24,829 | 38.05 | 944,743.45 |
| SCHWAB (CHARLES) CORP | 107,669 | 17.28 | 1,860,520.32 |
| SEI INVESTMENTS COMPANY | 14,524 | 28.82 | 418,581.68 |
| SLM CORPORATION | 46,561 | 20.92 | 974,056.12 |
| STATE STREET CORP | 46,371 | 59.75 | 2,770,667.25 |
| T ROWE PRICE GROUP INC | 25,389 | 76.82 | 1,950,382.98 |
| TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION | 21,694 | 20.00 | 433,880.00 |
| ACE LIMITED | 34,236 | 91.99 | 3,149,369.64 |
| AFLAC INC | 46,665 | 50.11 | 2,338,383.15 |
| ALLEGHANY CORPORATION | 1,360 | 392.50 | 533,800.00 |
| ALLSTATE CORP | 47,846 | 50.35 | 2,409,046.10 |
| AMERICAN INTERNATIONAL GROUP | 139,756 | 40.13 | 5,608,408.28 |
| AON PLC | 30,031 | 62.62 | 1,880,541.22 |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD. | 13,600 | 52.20 | 709,920.00 |
| ASSURANT INC | 7,289 | 47.49 | 346,154.61 |
| AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD | 11,103 | 42.49 | 471,766.47 |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 98,675 | 107.04 | 10,562,172.00 |
| CHUBB CORP | 26,077 | 89.14 | 2,324,503.78 |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP | 16,226 | 48.80 | 791,828.80 |
| EVEREST RE GROUP LTD | 5,043 | 127.99 | 645,453.57 |
| FIDELITY NATIONAL FINANCIAL INC-CL A | 21,361 | 26.75 | 571,406.75 |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP | 41,986 | 27.49 | 1,154,195.14 |
| LINCOLN NATIONAL CORP | 27,627 | 32.88 | 908,375.76 |
| LOEWS CORPORATION | 32,038 | 43.99 | 1,409,351.62 |
| MARSH & MCLENNAN COS | 53,671 | 38.34 | 2,057,746.14 |
| METLIFE INC | 86,807 | 36.80 | 3,194,497.60 |
| PARTNERRE LTD | 6,343 | 92.19 | 584,761.17 |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP | 30,228 | 35.45 | 1,071,582.60 |
| PROGRESSIVE CORP | 56,883 | 25.59 | 1,455,635.97 |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC | 45,913 | 56.90 | 2,612,449.70 |
| RENAISSANCERE HOLDINGS LTD | 4,963 | 90.99 | 451,583.37 |
| TORCHMARK CORPORATION | 9,408 | 59.62 | 560,904.96 |
| TRAVELERS COS INC(THE) | 38,473 | 86.26 | 3,318,680.98 |
| UNUM GROUP | 28,370 | 27.46 | 779,040.20 |
| W.R.BERKLEY CORPORATION | 11,184 | 45.23 | 505,852.32 |
| WILLIS GROUP HOLDINGS PLC | 18,098 | 39.33 | 711,794.34 |
| XL GROUP PLC | 30,600 | 31.29 | 957,474.00 |
| CBRE GROUP INC-A | 30,300 | 25.29 | 766,287.00 |

| | | | |
|--|---------|--------|---------------|
| LENNAR CORP-CL A | 15,400 | 40.48 | 623,392.00 |
| ACCENTURE PLC-CL A | 63,764 | 77.23 | 4,924,493.72 |
| ACTIVISION BLIZZARD INC | 44,020 | 14.66 | 645,333.20 |
| ADOBE SYSTEMS INC | 48,617 | 45.04 | 2,189,709.68 |
| AKAMAI TECHNOLOGIES | 18,666 | 35.41 | 660,963.06 |
| ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP | 5,050 | 157.87 | 797,243.50 |
| ANSYS INC | 9,000 | 78.31 | 704,790.00 |
| AUTODESK INC | 22,734 | 38.36 | 872,076.24 |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING | 48,860 | 65.91 | 3,220,362.60 |
| BMC SOFTWARE INC | 14,978 | 44.93 | 672,961.54 |
| CA INC | 33,313 | 24.93 | 830,493.09 |
| CITRIX SYSTEMS INC | 18,285 | 70.39 | 1,287,081.15 |
| COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATION | 30,311 | 75.56 | 2,290,299.16 |
| COMPUTER SCIENCES CORP | 15,762 | 46.69 | 735,927.78 |
| EBAY INC | 116,057 | 57.31 | 6,651,226.67 |
| ELECTRONIC ARTS INC | 30,681 | 17.58 | 539,371.98 |
| EQUINIX INC | 4,920 | 217.49 | 1,070,050.80 |
| F5 NETWORKS INC | 7,611 | 74.98 | 570,672.78 |
| FACEBOOK INC-A | 159,160 | 27.40 | 4,360,984.00 |
| FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES | 24,012 | 40.75 | 978,489.00 |
| FISERV INC | 13,185 | 87.83 | 1,158,038.55 |
| GOOGLE INC-CL A | 26,431 | 790.05 | 20,881,811.55 |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP | 107,066 | 211.38 | 22,631,611.08 |
| INTUIT INC | 28,033 | 64.70 | 1,813,735.10 |
| LINKEDIN CORP-A | 8,559 | 185.39 | 1,586,753.01 |
| MASTERCARD INC-CL A | 10,709 | 532.99 | 5,707,789.91 |
| MICROSOFT CORP | 755,265 | 28.83 | 21,774,289.95 |
| NUANCE COMMUNICATIONS INC | 25,200 | 21.61 | 544,572.00 |
| ORACLE CORPORATION | 384,547 | 33.46 | 12,866,942.62 |
| PAYCHEX INC | 33,344 | 36.14 | 1,205,052.16 |
| RACKSPACE HOSTING INC | 11,400 | 48.40 | 551,760.00 |
| RED HAT INC | 19,920 | 50.55 | 1,006,956.00 |
| SAIC INC | 26,000 | 13.75 | 357,500.00 |
| SALESFORCE.COM, INC. | 13,520 | 169.52 | 2,291,910.40 |
| SYMANTEC CORPORATION | 68,586 | 24.25 | 1,663,210.50 |
| SYNOPSYS INC | 14,584 | 34.79 | 507,377.36 |
| TOTAL SYSTEM SERVICES INC | 16,119 | 24.90 | 401,363.10 |
| VERIFONE SYSTEMS INC | 10,600 | 21.04 | 223,024.00 |
| VERISIGN INC | 15,218 | 46.73 | 711,137.14 |
| VISA INC | 53,430 | 165.75 | 8,856,022.50 |
| VMWARE INC | 8,400 | 76.67 | 644,028.00 |
| WESTERN UNION COMPANY | 60,004 | 15.04 | 902,460.16 |
| YAHOO! INC | 111,308 | 24.69 | 2,748,194.52 |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC | 35,168 | 44.75 | 1,573,768.00 |
| AMPHENOL CORPORATION -CL A | 15,578 | 73.49 | 1,144,827.22 |
| APPLE INC | 93,834 | 429.80 | 40,329,853.20 |
| ARROW ELECTRONICS INC | 10,490 | 40.12 | 420,858.80 |

| | | | |
|-------------------------------------|---------|-------|---------------|
| AVAGO TECHNOLOGIES LTD. | 24,800 | 34.91 | 865,768.00 |
| AVNET INC | 13,000 | 33.93 | 441,090.00 |
| CISCO SYSTEMS INC | 529,315 | 21.54 | 11,401,445.10 |
| CORNING INC | 144,463 | 13.30 | 1,921,357.90 |
| DELL INC | 148,851 | 14.09 | 2,097,310.59 |
| DOLBY LABORATORIES INC-CL A | 3,700 | 33.01 | 122,137.00 |
| EMC CORP/MASS | 209,916 | 23.11 | 4,851,158.76 |
| FLEXTRONICS INTL LTD | 67,131 | 6.86 | 460,518.66 |
| FLIR SYSTEMS INC | 15,640 | 25.62 | 400,696.80 |
| HARRIS CORP | 10,650 | 44.06 | 469,239.00 |
| HEWLETT-PACKARD CO | 196,234 | 20.90 | 4,101,290.60 |
| JUNIPER NETWORKS INC | 50,480 | 18.72 | 944,985.60 |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC | 25,045 | 63.87 | 1,599,624.15 |
| NETAPP INC | 35,383 | 35.46 | 1,254,681.18 |
| QUALCOMM INC | 170,065 | 66.68 | 11,339,934.20 |
| SANDISK CORP | 24,177 | 57.73 | 1,395,738.21 |
| SEAGATE TECHNOLOGY | 34,768 | 36.09 | 1,254,777.12 |
| TE CONNECTIVITY LTD | 41,990 | 41.61 | 1,747,203.90 |
| TERADATA CORP | 16,624 | 55.20 | 917,644.80 |
| TRIMBLE NAVIGATION LTD | 25,400 | 28.77 | 730,758.00 |
| WESTERN DIGITAL CORP | 22,323 | 52.32 | 1,167,939.36 |
| XEROX CORP | 124,463 | 9.06 | 1,127,634.78 |
| AT&T INC | 566,424 | 38.59 | 21,858,302.16 |
| CENTURYLINK INC | 62,555 | 37.22 | 2,328,297.10 |
| CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP | 29,017 | 73.39 | 2,129,557.63 |
| FRONTIER COMMUNICATIONS CORPORATION | 104,153 | 4.22 | 439,525.66 |
| LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC | 15,366 | 21.57 | 331,444.62 |
| METROPCS COMMUNICATIONS INC. | 28,531 | 11.52 | 328,677.12 |
| SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A | 12,500 | 75.49 | 943,625.00 |
| SPRINT NEXTEL CORP | 306,323 | 6.22 | 1,905,329.06 |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC | 284,717 | 50.86 | 14,480,706.62 |
| WINDSTREAM CORPORATION | 59,400 | 8.87 | 526,878.00 |
| AES CORPORATION | 64,966 | 13.10 | 851,054.60 |
| ALLIANT ENERGY CORP | 11,048 | 51.61 | 570,187.28 |
| AMEREN CORPORATION | 23,724 | 35.49 | 841,964.76 |
| AMERICAN ELECTRIC POWER | 48,987 | 49.98 | 2,448,370.26 |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC | 18,000 | 42.35 | 762,300.00 |
| CALPINE CORP | 31,000 | 21.69 | 672,390.00 |
| CENTERPOINT ENERGY INC | 39,509 | 24.02 | 949,006.18 |
| CMS ENERGY CORPORATION | 25,400 | 28.73 | 729,742.00 |
| CONSOLIDATED EDISON INC | 29,082 | 61.91 | 1,800,466.62 |
| DOMINION RESOURCES INC/VA | 57,134 | 60.12 | 3,434,896.08 |
| DTE ENERGY COMPANY | 17,573 | 70.35 | 1,236,260.55 |
| DUKE ENERGY CORP | 70,306 | 72.97 | 5,130,228.82 |
| EDISON INTERNATIONAL | 30,685 | 51.95 | 1,594,085.75 |
| ENERGEN CORPORATION | 7,400 | 49.17 | 363,858.00 |
| ENTERGY CORP | 18,071 | 69.70 | 1,259,548.70 |
| EQT CORPORATION | 14,580 | 68.91 | 1,004,707.80 |

| | | | | |
|-----------------------------------|------------|-------|-------------------|--|
| EXELON CORP | 85,567 | 36.22 | 3,099,236.74 | |
| FIRSTENERGY CORP | 42,076 | 45.72 | 1,923,714.72 | |
| INTEGRYS ENERGY GROUP, INC. | 8,000 | 60.45 | 483,600.00 | |
| MDU RESOURCES GROUP INC | 17,500 | 24.90 | 435,750.00 | |
| NEXTERA ENERGY INC | 39,800 | 79.49 | 3,163,702.00 | |
| NISOURCE INC | 31,292 | 30.63 | 958,473.96 | |
| NORTHEAST UTILITIES | 30,435 | 44.66 | 1,359,227.10 | |
| NRG ENERGY INC | 31,225 | 27.14 | 847,446.50 | |
| OGE ENERGY CORP | 10,100 | 70.29 | 709,929.00 | |
| ONEOK INC | 19,600 | 49.40 | 968,240.00 | |
| P G & E CORPORATION | 43,581 | 47.23 | 2,058,330.63 | |
| PEPCO HOLDINGS INC | 21,434 | 22.05 | 472,619.70 | |
| PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION | 10,544 | 59.49 | 627,262.56 | |
| PPL CORPORATION | 58,462 | 31.99 | 1,870,199.38 | |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP | 51,351 | 35.06 | 1,800,366.06 | |
| QEP RESOURCES INC | 17,566 | 30.80 | 541,032.80 | |
| SCANA CORP | 11,983 | 52.60 | 630,305.80 | |
| SEMPRA ENERGY | 22,753 | 82.43 | 1,875,529.79 | |
| SOUTHERN CO | 86,643 | 47.88 | 4,148,466.84 | |
| WISCONSIN ENERGY CORP | 22,732 | 43.59 | 990,887.88 | |
| XCEL ENERGY INC | 49,660 | 30.92 | 1,535,487.20 | |
| ALTERA CORPORATION | 31,408 | 33.30 | 1,045,886.40 | |
| ANALOG DEVICES INC | 29,444 | 44.59 | 1,312,907.96 | |
| APPLIED MATERIALS INC | 121,598 | 13.63 | 1,657,380.74 | |
| BROADCOM CORP-CL A | 50,636 | 33.87 | 1,715,041.32 | |
| CREE INC | 10,800 | 54.20 | 585,360.00 | |
| INTEL CORP | 496,039 | 21.68 | 10,754,125.52 | |
| KLA-TENCOR CORPORATION | 16,924 | 53.77 | 910,003.48 | |
| LAM RESEARCH CORP | 17,564 | 41.81 | 734,350.84 | |
| LINEAR TECHNOLOGY CORP | 22,954 | 36.69 | 842,182.26 | |
| LSI CORPORATION | 57,857 | 6.40 | 370,284.80 | |
| MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD | 48,074 | 10.44 | 501,892.56 | |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS | 29,000 | 32.25 | 935,250.00 | |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC | 20,208 | 36.32 | 733,954.56 | |
| MICRON TECHNOLOGY INC | 102,482 | 10.01 | 1,025,844.82 | |
| NVIDIA CORP | 62,994 | 13.09 | 824,591.46 | |
| TEXAS INSTRUMENTS INC | 111,101 | 35.85 | 3,982,970.85 | |
| XILINX INC | 26,853 | 37.08 | 995,709.24 | |
| 米ドル小計 | 30,469,093 | | 1,450,540,444.03 | |
| (邦貨換算額：円) | | | (143,081,309,399) | |
| カナダドル | | | | |
| ARC RESOURCES LTD | 29,500 | 27.19 | 802,105.00 | |
| ATHABASCA OIL CORP | 29,700 | 8.56 | 254,232.00 | |
| BAYTEX ENERGY CORPORATION | 11,707 | 41.04 | 480,455.28 | |
| BONAVISTA ENERGY CORPORATION | 17,500 | 15.69 | 274,575.00 | |
| CAMECO CORP | 39,443 | 19.18 | 756,516.74 | |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES | 108,819 | 31.28 | 3,403,858.32 | |

| | | | |
|-------------------------------------|---------|--------|--------------|
| CANADIAN OIL SANDS LTD | 49,442 | 20.02 | 989,828.84 |
| CENOVUS ENERGY INC | 75,433 | 30.43 | 2,295,426.19 |
| CRESCENT POINT ENERGY CORP | 36,362 | 36.57 | 1,329,758.34 |
| ENBRIDGE INC | 76,549 | 46.23 | 3,538,860.27 |
| ENCANA CORP | 72,844 | 19.77 | 1,440,125.88 |
| ENERPLUS CORP | 19,590 | 14.08 | 275,827.20 |
| HUSKY ENERGY INC | 34,142 | 28.73 | 980,899.66 |
| IMPERIAL OIL LTD | 29,451 | 40.09 | 1,180,690.59 |
| MEG ENERGY CORPORATION | 14,600 | 31.62 | 461,652.00 |
| PACIFIC RUBIALES ENERGY CORPORATION | 30,700 | 20.98 | 644,086.00 |
| PEMBINA PIPELINE CORP | 29,400 | 31.74 | 933,156.00 |
| PENGROWTH ENERGY CORPORATION | 47,700 | 5.08 | 242,316.00 |
| PENN WEST PETROLEUM LTD | 49,053 | 10.06 | 493,473.18 |
| SUNCOR ENERGY INC | 152,601 | 28.82 | 4,397,960.82 |
| TALISMAN ENERGY INC | 102,007 | 11.98 | 1,222,043.86 |
| TOURMALINE OIL CORP | 12,700 | 39.47 | 501,269.00 |
| TRANSCANADA CORP | 70,099 | 48.51 | 3,400,502.49 |
| VERMILION ENERGY INC | 10,000 | 49.98 | 499,800.00 |
| AGNICO-EAGLE MINES | 16,750 | 36.12 | 605,010.00 |
| AGRIUM INC | 14,773 | 94.59 | 1,397,378.07 |
| BARRICK GOLD CORP | 100,108 | 22.94 | 2,296,477.52 |
| CENTERRA GOLD INC | 14,200 | 5.00 | 71,000.00 |
| ELDORADO GOLD CORPORATION | 67,231 | 7.65 | 514,317.15 |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD | 57,910 | 17.99 | 1,041,800.90 |
| FRANCO-NEVADA CORPORATION | 14,800 | 40.44 | 598,512.00 |
| GOLDCORP INC | 81,456 | 30.07 | 2,449,381.92 |
| IAMGOLD CORP | 38,500 | 5.85 | 225,225.00 |
| KINROSS GOLD CORP | 116,427 | 6.41 | 746,297.07 |
| NEW GOLD INC | 44,500 | 7.86 | 349,770.00 |
| OSISKO MINING CORPORATION | 42,630 | 5.11 | 217,839.30 |
| PAN AMERICAN SILVER CORP | 13,972 | 14.90 | 208,182.80 |
| POTASH CORP OF SASKATCHEWAN | 86,003 | 39.95 | 3,435,819.85 |
| SILVER WHEATON CORPORATION | 34,886 | 26.82 | 935,642.52 |
| TECK RESOURCES LIMITED-CL B | 56,705 | 28.14 | 1,595,678.70 |
| TURQUOISE HILL RESOURCES LTD | 40,466 | 6.09 | 246,437.94 |
| YAMANA GOLD INC | 75,790 | 13.27 | 1,005,733.30 |
| BOMBARDIER INC 'B' | 138,759 | 4.02 | 557,811.18 |
| CAE INC | 26,614 | 10.37 | 275,987.18 |
| FINNING INTERNATIONAL INC | 17,895 | 23.53 | 421,069.35 |
| SNC-LAVALIN GROUP INC | 15,781 | 43.49 | 686,315.69 |
| RITCHIE BROS. AUCTIONEERS | 9,000 | 20.20 | 181,800.00 |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO | 43,264 | 99.11 | 4,287,895.04 |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD | 17,071 | 125.61 | 2,144,288.31 |
| MAGNA INTERNATIONAL INC | 21,636 | 59.82 | 1,294,265.52 |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC | 11,200 | 40.40 | 452,480.00 |
| TIM HORTONS INC | 14,900 | 54.74 | 815,626.00 |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B | 38,871 | 24.20 | 940,678.20 |
| THOMSON REUTERS CORP | 37,978 | 33.07 | 1,255,932.46 |

| | | | | |
|--|-----------|-------|------------------|--|
| CANADIAN TIRE CORP -CL A | 8,038 | 71.80 | 577,128.40 | |
| DOLLARAMA INC | 6,700 | 68.23 | 457,141.00 | |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B | 13,700 | 57.05 | 781,585.00 | |
| EMPIRE CO LTD A | 3,300 | 65.14 | 214,962.00 | |
| LOBLAW COMPANIES LTD | 11,203 | 41.49 | 464,812.47 | |
| METRO INC | 10,150 | 64.44 | 654,066.00 | |
| SHOPPERS DRUG MART CORP | 19,860 | 44.10 | 875,826.00 | |
| WESTON (GEORGE) LTD | 4,720 | 74.33 | 350,837.60 | |
| SAPUTO INC | 12,890 | 49.53 | 638,441.70 | |
| CATAMARAN CORPORATION | 20,800 | 55.26 | 1,149,408.00 | |
| VALEANT PHARMACEUTICALS INTERN | 27,784 | 74.23 | 2,062,406.32 | |
| BANK OF MONTREAL | 64,653 | 63.21 | 4,086,716.13 | |
| BANK OF NOVA SCOTIA | 117,510 | 57.71 | 6,781,502.10 | |
| CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE | 40,353 | 78.16 | 3,153,990.48 | |
| NATIONAL BANK OF CANADA | 15,907 | 74.48 | 1,184,753.36 | |
| ROYAL BANK OF CANADA | 144,014 | 61.60 | 8,871,262.40 | |
| TORONTO-DOMINION BANK | 91,618 | 81.45 | 7,462,286.10 | |
| CI FINANCIAL CORP | 15,500 | 28.36 | 439,580.00 | |
| IGM FINANCIAL INC | 10,001 | 44.99 | 449,944.99 | |
| ONEX CORPORATION | 8,923 | 48.97 | 436,959.31 | |
| GREAT-WEST LIFECO INC | 29,204 | 26.41 | 771,277.64 | |
| INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANC | 9,000 | 36.22 | 325,980.00 | |
| INTACT FINANCIAL CORPORATION | 13,310 | 62.78 | 835,601.80 | |
| MANULIFE FINANCIAL CORP | 182,597 | 14.33 | 2,616,615.01 | |
| POWER CORP OF CANADA | 35,560 | 26.05 | 926,338.00 | |
| POWER FINANCIAL CORP | 25,030 | 28.66 | 717,359.80 | |
| SUN LIFE FINANCIAL INC | 59,333 | 27.64 | 1,639,964.12 | |
| BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC | 55,990 | 38.46 | 2,153,375.40 | |
| BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES | 27,463 | 18.05 | 495,707.15 | |
| CGI GROUP INC - CL A | 19,687 | 26.19 | 515,602.53 | |
| OPEN TEXT CORPORATION | 6,300 | 57.00 | 359,100.00 | |
| RESEARCH IN MOTION | 48,255 | 13.85 | 668,331.75 | |
| BCE INC | 25,770 | 46.86 | 1,207,582.20 | |
| BELL ALIANT INC. | 7,550 | 26.51 | 200,150.50 | |
| ROGERS COMMUNICATIONS -CL B | 37,800 | 51.74 | 1,955,772.00 | |
| TELUS CORPORATION | 10,687 | 70.20 | 750,227.40 | |
| CANADIAN UTILITIES LIMITED | 5,620 | 79.51 | 446,846.20 | |
| FORTIS INC | 19,740 | 33.72 | 665,632.80 | |
| TRANSALTA CORP | 23,868 | 14.48 | 345,608.64 | |
| カナダドル小計 | 3,749,806 | | 120,744,753.93 | |
| (邦貨換算額：円) | | | (11,747,257,109) | |
| オーストラリアドル | | | | |
| CALTEX AUSTRALIA LIMITED | 14,400 | 21.00 | 302,400.00 | |
| ORIGIN ENERGY LIMITED | 106,459 | 12.72 | 1,354,158.48 | |
| SANTOS LTD | 96,611 | 12.59 | 1,216,332.49 | |
| WHITEHAVEN COAL LTD | 40,000 | 2.14 | 85,600.00 | |
| WOODSIDE PETROLEUM LTD | 66,748 | 36.40 | 2,429,627.20 | |

| | | | |
|--------------------------------|---------|-------|---------------|
| WORLEY PARSONS LIMITED | 20,150 | 24.62 | 496,093.00 |
| ALUMINA LTD | 226,977 | 1.02 | 232,651.42 |
| AMCOR LIMITED | 120,877 | 9.66 | 1,167,671.82 |
| BHP BILLITON LTD | 320,439 | 33.35 | 10,686,640.65 |
| BORAL LIMITED | 79,596 | 4.94 | 393,204.24 |
| FORTESCUE METALS GROUP LIMITED | 140,000 | 4.01 | 561,400.00 |
| ILUKA RESOURCES LIMITED | 44,000 | 9.73 | 428,120.00 |
| INCITEC PIVOT LTD | 157,000 | 3.08 | 483,560.00 |
| JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC | 41,803 | 9.89 | 413,431.67 |
| NEWCREST MINING LIMITED | 76,579 | 19.53 | 1,495,587.87 |
| ORICA LIMITED | 35,773 | 23.79 | 851,039.67 |
| OZ MINERALS LIMITED | 30,546 | 5.28 | 161,282.88 |
| RIO TINTO LIMITED | 43,151 | 56.90 | 2,455,291.90 |
| SIMS METAL MANAGEMENT LTD | 18,995 | 9.69 | 184,061.55 |
| LEIGHTON HOLDINGS LIMITED | 16,305 | 19.52 | 318,273.60 |
| ALS LTD | 31,500 | 10.23 | 322,245.00 |
| BRAMBLES LIMITED | 157,132 | 8.29 | 1,302,624.28 |
| FLIGHT CENTRE LIMITED | 5,800 | 35.94 | 208,452.00 |
| ASCIANO LTD | 96,966 | 5.25 | 509,071.50 |
| AURIZON HOLDINGS LTD | 175,000 | 3.94 | 689,500.00 |
| QANTAS AIRWAYS LIMITED | 97,138 | 1.78 | 173,391.33 |
| TOLL HOLDINGS LIMITED | 72,620 | 5.78 | 419,743.60 |
| CROWN LTD | 39,265 | 12.67 | 497,487.55 |
| ECHO ENTERTAINMENT GROUP LTD | 78,345 | 3.67 | 287,526.15 |
| TABCORP HOLDINGS LIMITED | 61,345 | 3.29 | 201,825.05 |
| TATTS GROUP LTD | 136,000 | 3.25 | 442,000.00 |
| HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD | 57,850 | 2.58 | 149,253.00 |
| METCASH LTD | 92,000 | 4.11 | 378,120.00 |
| WESFARMERS LIMITED | 100,446 | 40.67 | 4,085,138.82 |
| WOOLWORTHS LIMITED | 122,598 | 34.78 | 4,263,958.44 |
| COCA-COLA AMATIL LIMITED | 58,117 | 14.48 | 841,534.16 |
| TREASURY WINE ESTATES LTD | 59,000 | 5.72 | 337,480.00 |
| COCHLEAR LIMITED | 5,313 | 61.05 | 324,358.65 |
| RAMSAY HEALTH CARE LTD | 13,100 | 31.93 | 418,283.00 |
| SONIC HEALTHCARE LTD | 38,826 | 13.30 | 516,385.80 |
| CSL LIMITED | 50,124 | 59.28 | 2,971,350.72 |
| AUST AND NZ BANKING GROUP LT | 270,953 | 28.71 | 7,779,060.63 |
| BENDIGO AND ADELAIDE BANK | 41,400 | 10.26 | 424,764.00 |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL | 160,416 | 68.06 | 10,917,912.96 |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD | 231,723 | 31.62 | 7,327,081.26 |
| WESTPAC BANKING CORPORATION | 307,384 | 31.52 | 9,688,743.68 |
| ASX LTD | 17,610 | 36.79 | 647,871.90 |
| MACQUARIE GROUP LTD | 32,583 | 38.17 | 1,243,693.11 |
| AMP LIMITED | 293,325 | 5.14 | 1,507,690.50 |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT | 209,006 | 5.73 | 1,197,604.38 |
| QBE INSURANCE GROUP LIMITED | 119,381 | 13.20 | 1,575,829.20 |
| SUNCORP GROUP LTD | 129,581 | 11.80 | 1,529,055.80 |
| COMPUTERSHARE LIMITED | 44,029 | 10.13 | 446,013.77 |

| | | | |
|--|-----------|-------|-----------------|
| TELSTRA CORPORATION LIMITED | 432,387 | 4.61 | 1,993,304.07 |
| AGL ENERGY LIMITED | 56,569 | 15.52 | 877,950.88 |
| オーストラリアドル小計 | 5,591,241 | | 92,212,733.63 |
| (邦貨換算額:円) | | | (9,567,071,114) |
| 英ポンド | | | |
| AMEC PLC | 28,335 | 10.53 | 298,367.55 |
| BG GROUP PLC | 338,986 | 11.12 | 3,769,524.32 |
| BP PLC | 1,900,750 | 4.48 | 8,515,360.00 |
| PETROFAC LIMITED | 27,200 | 14.00 | 380,800.00 |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS | 372,913 | 21.23 | 7,918,807.55 |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS | 261,166 | 21.78 | 5,688,195.48 |
| TULLOW OIL PLC | 91,194 | 11.60 | 1,057,850.40 |
| ANGLO AMERICAN PLC | 138,766 | 16.42 | 2,278,537.72 |
| ANTOFAGASTA PLC | 39,670 | 10.13 | 401,857.10 |
| BHP BILLITON PLC | 210,531 | 18.92 | 3,984,299.17 |
| CRODA INTERNATIONAL PLC | 13,900 | 26.08 | 362,512.00 |
| EURASIAN NATURAL RESOURCES CORPORATION | 28,187 | 2.49 | 70,298.37 |
| EVRAZ PLC | 38,000 | 1.83 | 69,692.00 |
| FRESNILLO PLC | 17,200 | 12.73 | 218,956.00 |
| GLENCORE INTERNATIONAL PLC | 391,100 | 3.44 | 1,346,166.20 |
| JOHNSON MATTHEY PLC | 20,078 | 24.15 | 484,883.70 |
| KAZAKHMYS PLC | 19,600 | 3.74 | 73,421.60 |
| MELROSE INDUSTRIES PLC | 125,000 | 2.59 | 324,500.00 |
| RANDGOLD RESOURCES LTD | 8,522 | 49.58 | 422,520.76 |
| REXAM PLC | 78,884 | 5.24 | 413,352.16 |
| RIO TINTO PLC | 133,667 | 30.80 | 4,117,611.93 |
| VEDANTA RESOURCES PLC | 9,900 | 11.51 | 113,949.00 |
| XSTRATA PLC | 208,839 | 10.43 | 2,178,190.77 |
| BABCOCK INTERNATIONAL GROUP PLC | 34,300 | 10.79 | 370,097.00 |
| BAE SYSTEMS PLC | 326,792 | 3.96 | 1,296,383.86 |
| BALFOUR BEATTY PLC | 69,839 | 2.50 | 174,737.17 |
| BUNZL PLC | 34,408 | 12.92 | 444,551.36 |
| COBHAM PLC | 103,074 | 2.40 | 247,480.67 |
| IMI PLC | 30,600 | 12.67 | 387,702.00 |
| INVENSYS PLC | 85,258 | 3.53 | 301,472.28 |
| MEGGITT PLC | 80,900 | 4.81 | 389,776.20 |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC | 185,203 | 11.29 | 2,090,941.87 |
| SMITHS GROUP PLC | 39,266 | 12.53 | 492,002.98 |
| WEIR GROUP PLC/THE | 20,900 | 23.36 | 488,224.00 |
| WOLSELEY PLC | 27,076 | 31.94 | 864,807.44 |
| AGGREKO PLC | 27,593 | 17.92 | 494,466.56 |
| CAPITA PLC | 65,299 | 8.80 | 574,631.20 |
| EXPERIAN PLC | 101,194 | 11.52 | 1,165,754.88 |
| G4S PLC | 146,927 | 2.97 | 437,107.82 |
| INTERTEK GROUP PLC | 16,500 | 34.46 | 568,590.00 |
| SERCO GROUP PLC | 46,128 | 6.17 | 284,840.40 |
| GKN PLC | 161,000 | 2.62 | 421,981.00 |

| | | | |
|-----------------------------------|-----------|-------|---------------|
| BURBERRY GROUP PLC | 43,337 | 12.94 | 560,780.78 |
| CARNIVAL PLC | 18,247 | 22.48 | 410,192.56 |
| COMPASS GROUP PLC | 181,073 | 8.15 | 1,475,744.95 |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC | 26,499 | 19.49 | 516,465.51 |
| TUI TRAVEL PLC | 44,000 | 3.12 | 137,280.00 |
| WHITBREAD PLC | 18,456 | 24.56 | 453,279.36 |
| BRITISH SKY BROADCASTING PLC | 108,121 | 8.61 | 931,462.41 |
| ITV PLC | 368,592 | 1.26 | 467,743.24 |
| PEARSON PLC | 83,353 | 11.43 | 952,724.79 |
| REED ELSEVIER PLC | 117,978 | 7.62 | 899,582.25 |
| WPP PLC | 127,650 | 10.78 | 1,376,067.00 |
| KINGFISHER PLC | 232,225 | 2.96 | 688,547.12 |
| MARKS & SPENCER GROUP PLC | 157,699 | 3.99 | 630,165.20 |
| NEXT PLC | 16,334 | 43.68 | 713,469.12 |
| SAINSBURY (J) PLC | 124,638 | 3.85 | 479,980.93 |
| TESCO PLC | 802,101 | 3.87 | 3,110,146.62 |
| WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC | 223,042 | 2.81 | 627,417.14 |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 36,200 | 18.44 | 667,528.00 |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 192,791 | 35.90 | 6,921,196.90 |
| DIAGEO PLC | 249,657 | 19.87 | 4,960,684.59 |
| IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC | 97,596 | 23.10 | 2,254,467.60 |
| SABMILLER PLC | 95,274 | 34.29 | 3,266,945.46 |
| TATE & LYLE PLC | 47,800 | 8.47 | 404,866.00 |
| UNILEVER PLC | 128,047 | 27.92 | 3,575,072.24 |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC | 64,388 | 46.20 | 2,974,725.60 |
| SMITH & NEPHEW PLC | 87,623 | 7.53 | 660,239.30 |
| ASTRAZENECA PLC | 124,081 | 33.19 | 4,118,868.79 |
| GLAXOSMITHKLINE PLC | 489,733 | 15.69 | 7,686,359.43 |
| SHIRE PLC | 56,463 | 19.90 | 1,123,613.70 |
| BARCLAYS PLC | 1,160,018 | 2.99 | 3,471,933.87 |
| HSBC HOLDINGS PLC | 1,836,231 | 6.88 | 12,635,105.51 |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC | 4,201,412 | 0.48 | 2,045,667.50 |
| ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP | 214,067 | 2.85 | 610,090.95 |
| STANDARD CHARTERED PLC | 240,282 | 16.30 | 3,916,596.60 |
| 3I GROUP PLC | 100,000 | 3.21 | 321,200.00 |
| ABERDEEN ASSET MGMT PLC | 89,400 | 4.22 | 377,804.40 |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC | 24,000 | 8.83 | 211,920.00 |
| ICAP PLC | 57,716 | 2.98 | 172,282.26 |
| INVESTEC PLC | 57,200 | 4.49 | 257,285.60 |
| LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC | 18,902 | 13.10 | 247,616.20 |
| SCHRODERS PLC | 11,800 | 21.87 | 258,066.00 |
| ADMIRAL GROUP PLC | 19,200 | 13.50 | 259,200.00 |
| AVIVA PLC | 289,709 | 3.02 | 876,949.14 |
| LEGAL & GENERAL GROUP PLC | 598,945 | 1.68 | 1,010,420.21 |
| OLD MUTUAL PLC | 484,057 | 2.01 | 974,406.74 |
| PRUDENTIAL PLC | 255,061 | 10.63 | 2,711,298.43 |
| RESOLUTION LTD | 133,468 | 2.74 | 366,102.72 |
| RSA INSURANCE GROUP PLC | 350,885 | 1.09 | 385,622.61 |

| | | | | |
|----------------------------------|------------|-----------|------------------|--|
| STANDARD LIFE PLC | 232,048 | 3.50 | 813,096.19 | |
| SAGE GROUP PLC (THE) | 117,463 | 3.41 | 401,371.07 | |
| ARM HOLDINGS PLC | 140,400 | 8.96 | 1,257,984.00 | |
| BT GROUP PLC | 799,571 | 2.78 | 2,224,406.52 | |
| INMARSAT PLC | 41,500 | 6.88 | 285,727.50 | |
| VODAFONE GROUP PLC | 4,901,697 | 1.90 | 9,340,183.63 | |
| CENTRICA PLC | 522,581 | 3.79 | 1,982,672.31 | |
| NATIONAL GRID PLC | 362,067 | 7.92 | 2,869,380.97 | |
| SEVERN TRENT PLC | 22,594 | 17.06 | 385,453.64 | |
| SSE PLC | 95,508 | 15.34 | 1,465,092.72 | |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC | 69,091 | 7.21 | 498,146.11 | |
| 英ポンド小計 | 27,914,516 | | 161,663,902.46 | |
| (邦貨換算額：円) | | | (24,532,497,198) | |
| | | | | |
| スイスフラン | | | | |
| TRANSOCEAN LTD | 35,855 | 46.47 | 1,666,181.85 | |
| EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG | 700 | 269.25 | 188,475.00 | |
| GIVAUDAN-REG | 852 | 1,145.00 | 975,540.00 | |
| HOLCIM LTD-REG | 23,155 | 73.00 | 1,690,315.00 | |
| SIKA AG | 222 | 2,164.00 | 480,408.00 | |
| SYNGENTA AG | 9,214 | 383.60 | 3,534,490.40 | |
| ABB LTD | 218,919 | 21.02 | 4,601,677.38 | |
| GEBERIT AG-REG | 3,660 | 223.60 | 818,376.00 | |
| SCHINDLER HOLDING AG-REG | 2,140 | 132.50 | 283,550.00 | |
| SCHINDLER HOLDING-PART CERT | 4,900 | 134.60 | 659,540.00 | |
| SULZER AG | 2,450 | 159.00 | 389,550.00 | |
| ADECCO SA-REG | 12,934 | 50.85 | 657,693.90 | |
| SGS SA | 551 | 2,269.00 | 1,250,219.00 | |
| KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG | 5,502 | 105.60 | 581,011.20 | |
| CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-BR A | 51,793 | 72.45 | 3,752,402.85 | |
| THE SWATCH GROUP AG-B | 3,037 | 535.00 | 1,624,795.00 | |
| THE SWATCH GROUP AG-REG | 4,600 | 93.35 | 429,410.00 | |
| ARYZTA AG | 8,920 | 56.20 | 501,304.00 | |
| BARRY CALLEBAUT AG-REG | 150 | 890.50 | 133,575.00 | |
| LINDT & SPRUENGLI AG | 80 | 3,671.00 | 293,680.00 | |
| LINDT & SPRUENGLI AG-REG | 11 | 42,805.00 | 470,855.00 | |
| NESTLE SA-REGISTERED | 321,665 | 67.40 | 21,680,221.00 | |
| SONOVA HOLDING AG | 4,912 | 111.70 | 548,670.40 | |
| ACTELION LTD | 10,716 | 52.20 | 559,375.20 | |
| LONZA GROUP AG-REG | 5,587 | 59.25 | 331,029.75 | |
| NOVARTIS AG-REG SHS | 229,258 | 67.80 | 15,543,692.40 | |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 70,065 | 225.00 | 15,764,625.00 | |
| BANQUE CANTONALE VAUDOISE | 340 | 557.50 | 189,550.00 | |
| CREDIT SUISSE GROUP AG-REG | 124,835 | 26.10 | 3,258,193.50 | |
| JULIUS BAER GROUP LTD | 21,169 | 36.27 | 767,799.63 | |
| PARGESA HOLDING SA-BR | 2,300 | 63.70 | 146,510.00 | |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG | 1,700 | 236.00 | 401,200.00 | |
| UBS AG-REGISTERED | 362,908 | 14.90 | 5,407,329.20 | |

| | | | |
|--|-----------|--------|------------------|
| BALOISE HOLDING AG | 4,910 | 91.05 | 447,055.50 |
| SWISS LIFE HOLDING AG | 3,160 | 141.40 | 446,824.00 |
| SWISS RE AG | 35,534 | 73.20 | 2,601,088.80 |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 14,787 | 249.20 | 3,684,920.40 |
| SWISS PRIME SITE-REG | 5,000 | 76.60 | 383,000.00 |
| SWISSCOM AG-REG | 2,321 | 424.10 | 984,336.10 |
| スイスフラン小計 | 1,610,812 | | 98,128,470.46 |
| (邦貨換算額:円) | | | (10,423,206,132) |
| 香港ドル | | | |
| HUTCHISON WHAMPOA LTD | 213,000 | 81.25 | 17,306,250.00 |
| NWS HOLDINGS LTD | 160,500 | 13.62 | 2,186,010.00 |
| GALAXY ENTERTAINMENT GROUP LIMITED | 214,000 | 32.00 | 6,848,000.00 |
| CATHAY PACIFIC AIRWAYS | 109,000 | 12.68 | 1,382,120.00 |
| MTR CORPORATION | 144,500 | 30.85 | 4,457,825.00 |
| ORIENT OVERSEAS INTL LTD | 21,500 | 48.55 | 1,043,825.00 |
| YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG | 78,000 | 26.20 | 2,043,600.00 |
| MGM CHINA HOLDINGS LTD | 100,000 | 16.68 | 1,668,000.00 |
| SANDS CHINA LTD | 232,000 | 39.10 | 9,071,200.00 |
| SHANGRI-LA ASIA LTD. | 140,000 | 14.56 | 2,038,400.00 |
| SJM HOLDINGS LIMITED | 201,000 | 19.12 | 3,843,120.00 |
| WYNN MACAU LTD | 158,000 | 21.35 | 3,373,300.00 |
| LI & FUNG LTD | 595,200 | 10.52 | 6,261,504.00 |
| BANK OF EAST ASIA | 125,220 | 30.05 | 3,762,861.00 |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD | 359,500 | 25.80 | 9,275,100.00 |
| HANG SENG BANK LTD | 78,300 | 125.10 | 9,795,330.00 |
| WING HANG BANK LIMITED | 15,500 | 82.35 | 1,276,425.00 |
| FIRST PACIFIC COMPANY | 220,000 | 10.84 | 2,384,800.00 |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED | 107,100 | 130.50 | 13,976,550.00 |
| AIA GROUP LTD | 1,200,000 | 33.20 | 39,840,000.00 |
| CHEUNG KONG HOLDINGS LTD | 138,000 | 114.90 | 15,856,200.00 |
| HANG LUNG PROPERTIES LTD | 224,000 | 29.65 | 6,641,600.00 |
| HENDERSON LAND DEVELOPMENT | 92,000 | 55.05 | 5,064,600.00 |
| HOPEWELL HOLDINGS LTD | 57,000 | 30.45 | 1,735,650.00 |
| HYSAN DEVELOPMENT CO | 62,000 | 38.05 | 2,359,100.00 |
| KERRY PROPERTIES LTD | 76,500 | 34.40 | 2,631,600.00 |
| NEW WORLD DEVELOPMENT | 371,000 | 12.88 | 4,778,480.00 |
| SINO LAND CO | 294,200 | 12.72 | 3,742,224.00 |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES | 157,000 | 107.50 | 16,877,500.00 |
| SWIRE PACIFIC LTD 'A' | 68,500 | 94.60 | 6,480,100.00 |
| SWIRE PROPERTIES LIMITED | 110,000 | 26.85 | 2,953,500.00 |
| WHARF HOLDINGS LTD | 153,000 | 68.30 | 10,449,900.00 |
| WHEELLOCK&COMPANY LTD | 96,000 | 41.65 | 3,998,400.00 |
| PCCW LIMITED | 370,000 | 3.80 | 1,406,000.00 |
| CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE | 50,000 | 55.05 | 2,752,500.00 |
| CLP HOLDINGS LTD | 172,100 | 67.95 | 11,694,195.00 |
| HONG KONG & CHINA GAS | 527,415 | 22.85 | 12,051,432.75 |
| POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED | 138,500 | 74.40 | 10,304,400.00 |

| | | | |
|---------------------------------------|-----------|--------|-----------------|
| ASM PACIFIC TECHNOLOGY | 20,000 | 80.30 | 1,606,000.00 |
| 香港ドル小計 | 7,649,535 | | 265,217,601.75 |
| (邦貨換算額：円) | | | (3,370,915,718) |
| シンガポールドル | | | |
| FRASER & NEAVE LTD | 94,000 | 9.44 | 887,360.00 |
| KEPPEL CORP LTD | 145,400 | 11.42 | 1,660,468.00 |
| NOBLE GROUP LTD | 409,400 | 1.17 | 478,998.00 |
| SEMBCORP INDUSTRIES LTD | 94,820 | 5.00 | 474,100.00 |
| SEMBCORP MARINE LTD | 88,400 | 4.34 | 383,656.00 |
| SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG | 150,000 | 4.29 | 643,500.00 |
| YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD | 160,000 | 0.93 | 149,600.00 |
| COMFORTDELGRO CORP LTD | 205,000 | 1.92 | 393,600.00 |
| SINGAPORE AIRLINES LTD | 50,266 | 10.65 | 535,332.90 |
| GENTING SINGAPORE PLC | 610,000 | 1.44 | 878,400.00 |
| SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD | 155,250 | 4.60 | 714,150.00 |
| CYCLE & CARRIAGE LTD | 11,000 | 50.80 | 558,800.00 |
| OLAM INTERNATIONAL LTD | 176,000 | 1.66 | 292,160.00 |
| GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD | 676,600 | 0.56 | 382,279.00 |
| WILMAR INTERNATIONAL LTD | 200,000 | 3.34 | 668,000.00 |
| DBS GROUP HOLDINGS LTD | 181,000 | 15.67 | 2,836,270.00 |
| OVERSEA-CHINESE BANKING CORP | 261,000 | 10.63 | 2,774,430.00 |
| UNITED OVERSEAS BANK LTD | 125,000 | 20.37 | 2,546,250.00 |
| SINGAPORE EXCHANGE LTD | 85,000 | 7.70 | 654,500.00 |
| CAPITALAND LTD | 249,000 | 3.55 | 883,950.00 |
| CAPITAMALLS ASIA LTD | 140,000 | 2.02 | 282,800.00 |
| CITY DEVELOPMENTS LTD | 47,000 | 11.29 | 530,630.00 |
| GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LIMITED | 221,000 | 2.81 | 621,010.00 |
| KEPPEL LAND LTD | 86,000 | 4.00 | 344,000.00 |
| UOL GROUP LIMITED | 48,000 | 7.11 | 341,280.00 |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 797,015 | 3.56 | 2,837,373.40 |
| STARHUB LIMITED | 57,000 | 4.41 | 251,370.00 |
| シンガポールドル小計 | 5,523,151 | | 24,004,267.30 |
| (邦貨換算額：円) | | | (1,914,820,402) |
| ニュージーランドドル | | | |
| FLETCHER BUILDING LTD | 73,057 | 8.66 | 632,673.62 |
| AUCKLAND INTL AIRPORT LTD | 76,557 | 2.87 | 220,101.37 |
| SKYCITY ENTERTAINMENT GROUP | 61,890 | 4.26 | 263,651.40 |
| TELECOM CORP OF NEW ZEALAND | 187,409 | 2.43 | 455,403.87 |
| CONTACT ENERGY LIMITED | 36,256 | 5.81 | 210,647.36 |
| ニュージーランドドル小計 | 435,169 | | 1,782,477.62 |
| (邦貨換算額：円) | | | (150,601,534) |
| スウェーデンクローナ | | | |
| LUNDIN PETROLEUM AB | 21,100 | 150.00 | 3,165,000.00 |
| BOLIDEN AB | 26,900 | 104.90 | 2,821,810.00 |
| SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS | 57,667 | 160.10 | 9,232,486.70 |

| | | | |
|------------------------------------|-----------|--------|-----------------|
| ALFA LAVAL AB | 32,952 | 149.00 | 4,909,848.00 |
| ASSA ABLOY AB-B | 32,916 | 255.90 | 8,423,204.40 |
| ATLAS COPCO AB-A SHS | 66,409 | 184.00 | 12,219,256.00 |
| ATLAS COPCO AB-B SHS | 39,896 | 164.50 | 6,562,892.00 |
| HEXAGON AB-B SHS | 23,300 | 181.90 | 4,238,270.00 |
| SANDVIK AB | 99,054 | 97.75 | 9,682,528.50 |
| SCANIA AB-B SHS | 31,732 | 135.30 | 4,293,339.60 |
| SKANSKA AB-B SHS | 37,990 | 110.40 | 4,194,096.00 |
| SKF AB-B SHARES | 40,538 | 154.60 | 6,267,174.80 |
| VOLVO AB-B SHS | 150,194 | 89.65 | 13,464,892.10 |
| SECURITAS AB-B SHS | 31,057 | 60.65 | 1,883,607.05 |
| ELECTROLUX AB-SER B | 25,083 | 167.20 | 4,193,877.60 |
| HUSQVARNA AB-B SHS | 39,983 | 36.05 | 1,441,387.15 |
| HENNES & MAURITZ AB-B SHS | 94,544 | 228.90 | 21,641,121.60 |
| SWEDISH MATCH AB | 20,671 | 217.50 | 4,495,942.50 |
| ELEKTA AB-B SHS | 36,600 | 98.95 | 3,621,570.00 |
| GETINGE AB-B SHS | 19,938 | 199.00 | 3,967,662.00 |
| NORDEA BANK AB | 265,287 | 75.15 | 19,936,318.05 |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A | 138,023 | 67.65 | 9,337,255.95 |
| SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS | 48,826 | 280.40 | 13,690,810.40 |
| SWEDBANK AB - A SHARES | 81,064 | 150.60 | 12,208,238.40 |
| INDUSTRIVARDEN AB-C SHS | 12,800 | 118.20 | 1,512,960.00 |
| INVESTOR AB-B SHS | 45,549 | 191.50 | 8,722,633.50 |
| KINNEVIK INVESTMENT AB-B | 21,000 | 164.20 | 3,448,200.00 |
| RATOS AB-B SHS | 18,400 | 68.20 | 1,254,880.00 |
| ERICSSON LM-B SHS | 302,769 | 76.80 | 23,252,659.20 |
| MILLICOM INTL CELLULAR-SDR | 6,215 | 524.50 | 3,259,767.50 |
| TELE2 AB -B SHS | 33,698 | 107.20 | 3,612,425.60 |
| TELIASONERA AB | 213,671 | 44.14 | 9,431,437.94 |
| スウェーデンクローナ小計 | 2,115,826 | | 240,387,552.54 |
| (邦貨換算額：円) | | | (3,721,199,313) |
| | | | |
| ノルウェークローネ | | | |
| AKER SOLUTIONS ASA | 17,600 | 111.90 | 1,969,440.00 |
| SEADRILL LID | 34,581 | 207.40 | 7,172,099.40 |
| STATOIL ASA | 110,806 | 137.00 | 15,180,422.00 |
| SUBSEA 7 SA | 28,800 | 131.70 | 3,792,960.00 |
| NORSK HYDRO ASA | 97,297 | 25.70 | 2,500,532.90 |
| YARA INTERNATIONAL ASA | 18,012 | 264.10 | 4,756,969.20 |
| ORKLA ASA | 73,950 | 49.72 | 3,676,794.00 |
| DNB ASA | 96,719 | 85.10 | 8,230,786.90 |
| GJENSIDIGE FORSIKRING ASA | 19,200 | 96.30 | 1,848,960.00 |
| TELENOR ASA | 71,462 | 127.90 | 9,139,989.80 |
| ノルウェークローネ小計 | 568,427 | | 58,268,954.20 |
| (邦貨換算額：円) | | | (1,006,304,839) |
| | | | |
| デンマーククローネ | | | |
| NOVOZYMES A/S-B SHARES | 24,535 | 203.70 | 4,997,779.50 |

| | | | | |
|--|---------|-----------|-----------------|--|
| A P MOLLER - MAERSK A/S | 131 | 41,760.00 | 5,470,560.00 | |
| A P MOLLER-MAERSK A/S-A | 58 | 40,040.00 | 2,322,320.00 | |
| DSV A/S | 17,580 | 138.20 | 2,429,556.00 | |
| CARLSBERG AS-B | 10,546 | 568.00 | 5,990,128.00 | |
| COLOPLAST-B | 11,205 | 322.10 | 3,609,130.50 | |
| WILLIAM DEMANT HOLDING | 2,860 | 467.60 | 1,337,336.00 | |
| NOVO NORDISK A/S-B | 40,608 | 954.00 | 38,740,032.00 | |
| DANSKE BANK A/S | 66,738 | 106.40 | 7,100,923.20 | |
| TRYG A/S | 2,368 | 481.80 | 1,140,902.40 | |
| TDC A/S | 68,300 | 45.08 | 3,078,964.00 | |
| デンマーククローネ小計 | 244,929 | | 76,217,631.60 | |
| (邦貨換算額：円) | | | (1,320,851,555) | |
| | | | | |
| イスラエルシュケル | | | | |
| DELEK GROUP LTD | 530 | 963.70 | 510,761.00 | |
| ISRAEL CHEMICALS LIMITED | 44,600 | 43.20 | 1,926,720.00 | |
| ISRAEL CORPORATION LTD/THE | 245 | 2,406.00 | 589,470.00 | |
| TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD | 89,653 | 142.40 | 12,766,587.20 | |
| BANK HAPOALIM BM | 104,000 | 16.75 | 1,742,000.00 | |
| BANK LEUMI LE-ISRAEL | 139,000 | 12.61 | 1,752,790.00 | |
| MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD | 10,000 | 37.97 | 379,700.00 | |
| NICE SYSTEMS LTD | 4,800 | 127.70 | 612,960.00 | |
| MELLANOX TECHNOLOGIES LTD | 3,800 | 223.50 | 849,300.00 | |
| BEZEQ ISRAELI TELECOMMUNICATION CORP LTD | 203,000 | 5.25 | 1,065,750.00 | |
| イスラエルシュケル小計 | 599,628 | | 22,196,038.20 | |
| (邦貨換算額：円) | | | (604,398,120) | |
| | | | | |
| ユーロ | | | | |
| COMPAGNIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE-VERITA | 16,650 | 17.12 | 285,131.25 | |
| ENI SPA | 253,748 | 17.84 | 4,526,864.32 | |
| FUGRO NV-CVA | 6,795 | 44.67 | 303,532.65 | |
| GALP ENERGIA SGPS S.A | 25,700 | 12.03 | 309,171.00 | |
| NESTE OIL OYJ | 12,285 | 11.32 | 139,066.20 | |
| OMV AG | 15,199 | 36.30 | 551,723.70 | |
| REPSOL SA | 83,368 | 16.87 | 1,406,418.16 | |
| SAIPEM | 27,165 | 22.03 | 598,444.95 | |
| TECHNIP S.A. | 10,029 | 81.92 | 821,575.68 | |
| TENARIS S.A. | 45,474 | 15.48 | 703,937.52 | |
| TOTAL SA | 212,327 | 37.19 | 7,896,441.13 | |
| AIR LIQUIDE | 31,079 | 92.74 | 2,882,266.46 | |
| AKZO NOBEL | 23,935 | 47.04 | 1,126,022.07 | |
| ARCELOR MITTAL | 100,411 | 9.33 | 936,834.63 | |
| ARKEMA | 6,380 | 68.03 | 434,031.40 | |
| BASF SE | 91,659 | 68.40 | 6,269,475.60 | |
| CRH PLC | 72,280 | 16.34 | 1,181,055.20 | |
| HEIDELBERGCEMENT AG | 14,185 | 54.13 | 767,834.05 | |
| IMERYS SA | 3,513 | 49.00 | 172,137.00 | |

| | | | |
|-----------------------------|--------|--------|--------------|
| K+S AG | 17,220 | 34.27 | 590,215.50 |
| KONINKLIJKE DSM NV | 15,446 | 47.55 | 734,457.30 |
| LAFARGE SA | 18,711 | 48.94 | 915,716.34 |
| LANXESS | 8,700 | 53.25 | 463,275.00 |
| LINDE AG | 18,414 | 143.20 | 2,636,884.80 |
| SALZGITTER AG | 3,239 | 30.45 | 98,627.55 |
| SOLVAY SA | 6,085 | 101.95 | 620,365.75 |
| STORA ENSO OYJ-R SHS | 51,712 | 5.09 | 263,214.08 |
| THYSSENKRUPP AG | 37,326 | 13.91 | 519,391.29 |
| UMICORE | 10,900 | 35.08 | 382,426.50 |
| UPM-KYMMENE OYJ | 51,916 | 8.05 | 418,183.38 |
| VOESTALPINE AG | 10,523 | 23.17 | 243,870.52 |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV | 15,235 | 18.14 | 276,362.90 |
| ALSTOM RGPT | 21,413 | 31.56 | 675,794.28 |
| ANDRITZ AG | 7,400 | 51.46 | 380,804.00 |
| BOSKALIS WESTMINSTER NV | 7,300 | 32.36 | 236,264.50 |
| BOUYGUES SA | 18,431 | 21.26 | 391,843.06 |
| BRENNTAG AG | 5,120 | 125.45 | 642,304.00 |
| COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN | 40,724 | 28.72 | 1,169,796.90 |
| EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE | 45,378 | 37.65 | 1,708,708.59 |
| FINMECCANICA SPA | 46,589 | 3.83 | 178,435.87 |
| GEA GROUP AG | 18,500 | 26.17 | 484,237.50 |
| HOCHTIEF AG | 2,837 | 50.71 | 143,864.27 |
| KONE OYJ-B | 15,675 | 61.55 | 964,796.25 |
| LEGRAND SA | 23,429 | 34.00 | 796,586.00 |
| MAN SE | 4,188 | 84.51 | 353,927.88 |
| METSO OYJ | 12,535 | 30.80 | 386,078.00 |
| PHILIPS ELECTRONICS NV | 96,341 | 22.85 | 2,201,391.85 |
| PRYSMIAN SPA | 19,400 | 15.92 | 308,848.00 |
| REXEL SA | 15,500 | 16.38 | 253,890.00 |
| SAFRAN SA | 23,319 | 35.04 | 817,097.76 |
| SCHNEIDER ELECTRIC SA | 52,382 | 56.75 | 2,972,678.50 |
| SIEMENS AG-REG | 83,541 | 80.79 | 6,749,277.39 |
| THALES SA | 8,775 | 32.64 | 286,459.87 |
| VALLOUREC | 10,347 | 35.90 | 371,457.30 |
| VINCI S.A. | 45,781 | 35.86 | 1,641,706.66 |
| WARTSILA OYJ-B SHARES | 17,402 | 35.17 | 612,028.34 |
| WENDEL | 3,300 | 83.14 | 274,362.00 |
| ZARDOYA OTIS SA | 15,500 | 10.86 | 168,330.00 |
| ZODIAC AEROSPACE | 3,360 | 94.40 | 317,184.00 |
| BIC | 2,800 | 89.50 | 250,600.00 |
| BUREAU VERITAS SA | 5,450 | 95.40 | 519,930.00 |
| EDENRED | 16,767 | 25.32 | 424,540.44 |
| RANDSTAD HOLDING NV | 12,498 | 30.43 | 380,314.14 |
| ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA | 37,410 | 13.21 | 494,373.15 |
| AEROPORTS DE PARIS (ADP) | 2,760 | 65.74 | 181,442.40 |
| ATLANTIA SPA | 32,810 | 12.56 | 412,093.60 |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG | 22,479 | 14.23 | 319,876.17 |

| | | | |
|---|--------|--------|--------------|
| DEUTSCHE POST AG-REG | 89,622 | 17.56 | 1,574,210.43 |
| FERROVIAL SA | 40,068 | 12.78 | 512,069.04 |
| FRAPORT AG | 4,030 | 44.84 | 180,725.35 |
| GROUPE EUROTUNNEL SA | 57,800 | 6.30 | 364,429.00 |
| INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP | 90,344 | 2.85 | 257,661.08 |
| RYANAIR HOLDINGS PLC | 1,656 | 6.00 | 9,944.28 |
| TNT EXPRESS NV | 31,093 | 5.85 | 182,173.88 |
| VOPAK | 6,800 | 46.43 | 315,724.00 |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | 32,887 | 67.40 | 2,216,583.80 |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE(BMW)AG-PFD | 5,340 | 50.50 | 269,670.00 |
| CONTINENTAL AG | 10,858 | 87.82 | 953,549.56 |
| DAIMLER AG | 90,453 | 40.12 | 3,628,974.36 |
| FIAT INDUSTRIAL SPA | 87,004 | 8.62 | 749,974.48 |
| FIAT SPA | 93,416 | 4.22 | 394,776.01 |
| MICHELIN (CGDE)-B | 18,285 | 62.40 | 1,140,984.00 |
| NOKIAN RENKAAT OYJ | 10,683 | 32.43 | 346,449.69 |
| PIRELLI & C. | 21,502 | 7.34 | 157,824.68 |
| PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PREF | 14,965 | 56.55 | 846,270.75 |
| PSA PEUGEOT CITROEN | 21,455 | 5.64 | 121,070.56 |
| RENAULT SA | 18,745 | 49.54 | 928,627.30 |
| VOLKSWAGEN AG | 3,097 | 140.40 | 434,818.80 |
| VOLKSWAGEN AG PFD | 14,590 | 147.80 | 2,156,402.00 |
| ADIDAS AG | 21,099 | 77.95 | 1,644,667.05 |
| CHRISTIAN DIOR SA | 5,530 | 128.05 | 708,116.50 |
| HUGO BOSS AG | 2,390 | 88.28 | 210,989.20 |
| LUXOTTICA GROUP SPA | 16,530 | 38.78 | 641,033.40 |
| LVMH MOET HENNESSY LOUI V SA | 25,288 | 130.85 | 3,308,934.80 |
| ACCOR SA | 14,767 | 26.74 | 394,869.58 |
| OPAP SA | 23,406 | 7.39 | 172,970.34 |
| SODEXO | 9,386 | 72.60 | 681,423.60 |
| AXEL SPRINGER AG | 4,100 | 35.26 | 144,566.00 |
| EUTELSAT COMMUNICATIONS | 14,100 | 26.60 | 375,130.50 |
| JC DECAUX S.A. | 7,300 | 20.75 | 151,511.50 |
| KABEL DEUTSCHLAND HOLDINGS AG | 8,850 | 71.35 | 631,447.50 |
| LAGARDERE S.C.A. | 12,171 | 28.23 | 343,648.18 |
| PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-PFD | 10,000 | 27.83 | 278,300.00 |
| PUBLICIS GROUPE | 17,500 | 54.37 | 951,475.00 |
| REED ELSEVIER NV | 67,146 | 12.87 | 864,504.75 |
| SES | 29,696 | 24.52 | 728,294.40 |
| WOLTERS KLUWER-CVA | 30,015 | 17.78 | 533,816.77 |
| INDITEX | 21,683 | 101.15 | 2,193,235.45 |
| PPR | 7,519 | 169.15 | 1,271,838.85 |
| CARREFOUR SA | 60,133 | 21.60 | 1,299,173.46 |
| CASINO GUICHARD PERRACHON | 5,420 | 81.95 | 444,169.00 |
| COLRUYT NV | 7,245 | 37.61 | 272,484.45 |
| DELHAIZE GROUP | 10,118 | 42.93 | 434,416.33 |
| DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL | 62,133 | 5.70 | 354,344.49 |
| JERONIMO MARTINS SGPS S.A. | 21,100 | 16.35 | 345,090.50 |

| | | | | |
|---|-----------|--------|--------------|--|
| KESKO OYJ-B SHS | 6,334 | 23.94 | 151,635.96 | |
| KONINKLIJKE AHOLD NV | 101,933 | 12.07 | 1,230,331.31 | |
| METRO AG | 13,448 | 23.01 | 309,438.48 | |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV NV | 80,124 | 76.13 | 6,099,840.12 | |
| COCA-COLA HELLENIC BOTTLING | 20,429 | 20.05 | 409,601.45 | |
| DANONE | 58,215 | 54.27 | 3,159,328.05 | |
| DE MASTER BLENDERS 1753 NV-W/I | 51,032 | 12.11 | 617,997.52 | |
| HEINEKEN HOLDING NV | 9,689 | 48.42 | 469,141.38 | |
| HEINEKEN NV | 23,200 | 56.74 | 1,316,368.00 | |
| KERRY GROUP PLC-A | 15,498 | 43.20 | 669,513.60 | |
| PERNOD-RICARD SA | 21,093 | 95.65 | 2,017,545.45 | |
| REMY COINTREAU | 2,500 | 88.59 | 221,475.00 | |
| SUEDZUCKER AG | 7,500 | 32.64 | 244,837.50 | |
| UNILEVER NV-CVA | 162,434 | 31.89 | 5,180,020.26 | |
| BEIERSDORF AG | 10,440 | 69.40 | 724,536.00 | |
| HENKEL AG & CO KGAA | 17,783 | 73.07 | 1,299,403.81 | |
| HENKEL AG & CO KGAA | 13,070 | 60.96 | 796,747.20 | |
| L'OREAL | 24,084 | 123.45 | 2,973,169.80 | |
| CELESIO AG | 8,204 | 15.30 | 125,521.20 | |
| ESSILOR INTERNATIONAL | 20,283 | 84.18 | 1,707,422.94 | |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO. KGAA | 20,680 | 54.84 | 1,134,091.20 | |
| FRESENIUS SE & CO KGAA | 12,348 | 98.54 | 1,216,771.92 | |
| BAYER AG | 82,529 | 80.32 | 6,628,729.28 | |
| ELAN CORPORATION PLC | 52,166 | 9.01 | 470,067.82 | |
| GRIFOLS S.A. | 15,050 | 28.20 | 424,410.00 | |
| MERCK KGAA | 6,619 | 118.30 | 783,027.70 | |
| ORION OYJ | 10,798 | 20.10 | 217,039.80 | |
| QIAGEN N.V. | 23,000 | 15.83 | 364,090.00 | |
| SANOFI | 118,690 | 79.50 | 9,435,855.00 | |
| UCB SA | 10,897 | 47.75 | 520,331.75 | |
| BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA | 633,414 | 0.18 | 119,715.24 | |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA | 554,615 | 6.82 | 3,785,801.99 | |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA-RTS | 554,615 | 0.12 | 67,663.03 | |
| BANCO DE SABADELL SA | 311,818 | 1.45 | 454,318.82 | |
| BANCO ESPIRITO SANTO,S.A(BES) | 192,900 | 0.80 | 155,284.50 | |
| BANCO POPOLARE SPA | 173,182 | 0.97 | 167,986.54 | |
| BANCO POPULAR ESPANOL | 610,047 | 0.59 | 364,198.05 | |
| BANCO SANTANDER SA | 1,070,113 | 5.24 | 5,617,023.13 | |
| BANCO SANTANDER SA-RIGHTS | 1,070,113 | 0.15 | 163,727.28 | |
| BNP PARIBAS | 100,002 | 40.72 | 4,072,581.45 | |
| COMMERZBANK AG | 387,990 | 1.16 | 453,172.32 | |
| CREDIT AGRICOLE SA | 97,158 | 6.50 | 632,012.79 | |
| ERSTE GROUP BANK AG | 22,083 | 23.91 | 528,114.94 | |
| INTESA SANPAOLO | 993,840 | 1.24 | 1,233,355.44 | |
| INTESA SANPAOLO-RSP | 108,503 | 1.04 | 113,277.13 | |
| IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD | 96,000 | | 96.00 | |
| KBC GROUPE SA | 24,401 | 28.38 | 692,622.38 | |
| NATIXIS | 98,051 | 3.06 | 300,428.26 | |

| | | | |
|---|---------|--------|--------------|
| RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG | 5,550 | 26.70 | 148,185.00 |
| SOCIETE GENERALE | 70,648 | 26.40 | 1,865,107.20 |
| UNICREDIT SPA | 402,112 | 3.49 | 1,406,587.77 |
| UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA | 87,494 | 2.81 | 245,858.14 |
| AGEAS | 23,100 | 26.70 | 616,770.00 |
| DEUTSCHE BANK AG -REG | 92,563 | 31.29 | 2,896,759.08 |
| DEUTSCHE BOERSE AG | 19,017 | 46.61 | 886,382.37 |
| EURAZEO | 2,348 | 39.96 | 93,837.82 |
| EXOR SPA | 5,897 | 21.52 | 126,903.44 |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA | 7,875 | 60.20 | 474,075.00 |
| ING GROEP NV-CVA | 380,781 | 5.91 | 2,251,938.83 |
| MEDIOBANCA SPA | 52,143 | 4.36 | 227,343.48 |
| POHJOLA BANK PLC | 13,403 | 12.14 | 162,712.42 |
| AEGON NV | 173,688 | 4.66 | 810,428.20 |
| ALLIANZ SE-REG | 45,485 | 107.30 | 4,880,540.50 |
| ASSICURAZIONI GENERALI | 116,673 | 12.99 | 1,515,582.27 |
| AXA SA | 175,373 | 13.71 | 2,404,363.83 |
| CNP ASSURANCES | 15,184 | 11.33 | 172,034.72 |
| DELTA LLOYD NV | 18,400 | 13.64 | 251,068.00 |
| HANNOVER RUECKVERSICHERUNG SE | 5,820 | 61.45 | 357,639.00 |
| MAPFRE SA | 93,649 | 2.63 | 246,952.41 |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG | 17,825 | 152.60 | 2,720,095.00 |
| SAMPO OYJ-A SHS | 40,954 | 30.47 | 1,247,868.38 |
| SCOR SE | 16,258 | 22.45 | 364,992.10 |
| VIENNA INSURANCE GROUP AG WIENER VERSICH | 3,600 | 38.11 | 137,196.00 |
| IMMOFINANZ AG | 89,200 | 3.16 | 282,407.20 |
| AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS | 30,450 | 21.47 | 653,761.50 |
| ATOS | 5,851 | 51.96 | 304,017.96 |
| CAP GEMINI SA | 15,504 | 34.25 | 531,012.00 |
| DASSAULT SYSTEMES SA | 6,263 | 88.86 | 556,530.18 |
| SAP AG | 91,825 | 59.30 | 5,445,222.50 |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE | 9,300 | 20.00 | 186,000.00 |
| GEMALTO | 7,900 | 66.77 | 527,483.00 |
| NOKIA OYJ | 380,180 | 2.61 | 995,311.24 |
| BELGACOM SA | 13,781 | 19.90 | 274,310.80 |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG | 280,260 | 8.77 | 2,460,402.54 |
| ELISA OYJ | 14,922 | 14.58 | 217,562.76 |
| FRANCE TELECOM SA | 184,801 | 7.82 | 1,445,143.82 |
| ILIAD SA | 2,130 | 165.50 | 352,515.00 |
| KONINKLIJKE KPN NV | 91,258 | 2.98 | 272,678.90 |
| PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG | 65,052 | 4.03 | 262,159.56 |
| TELECOM ITALIA SPA | 973,901 | 0.63 | 618,914.08 |
| TELECOM ITALIA-RNC | 566,811 | 0.54 | 311,462.64 |
| TELEFONICA S.A. | 407,994 | 10.74 | 4,383,895.53 |
| TELEKOM AUSTRIA AG | 17,354 | 5.27 | 91,542.35 |
| TELENET GROUP HOLDINGS NV | 5,400 | 40.24 | 217,296.00 |
| VIVENDI SA | 131,680 | 16.13 | 2,124,656.80 |
| ZIGGO NV | 12,300 | 27.06 | 332,838.00 |

| | | | | |
|--------------------------------|-------------|-------|-------------------|--|
| ACCIONA S.A. | 2,330 | 46.97 | 109,440.10 | |
| E.ON SE | 179,315 | 14.48 | 2,596,481.20 | |
| EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA | 192,624 | 2.47 | 475,781.28 | |
| ELECTRICITE DE FRANCE(EDF) | 23,549 | 16.15 | 380,434.09 | |
| ENAGAS | 18,900 | 18.85 | 356,265.00 | |
| ENEL GREEN POWER SPA | 171,000 | 1.54 | 263,511.00 | |
| ENEL SPA | 663,395 | 2.65 | 1,757,996.75 | |
| FORTUM OYJ | 44,611 | 15.03 | 670,503.33 | |
| GAS NATURAL SDG SA | 34,646 | 14.50 | 502,367.00 | |
| GDF SUEZ | 132,098 | 16.16 | 2,135,364.17 | |
| IBERDROLA SA | 470,578 | 3.88 | 1,826,783.79 | |
| RED ELECTRICA CORPORATION S.A. | 10,600 | 38.22 | 405,132.00 | |
| RWE AG | 48,530 | 30.24 | 1,467,789.85 | |
| RWE AG-NON VTG PFD | 4,413 | 29.54 | 130,360.02 | |
| SNAM SPA | 167,376 | 3.71 | 621,634.46 | |
| SUEZ ENVIRONNEMENT SA | 28,900 | 10.44 | 301,716.00 | |
| TERNA SPA | 122,846 | 3.34 | 410,305.64 | |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT | 33,330 | 10.27 | 342,465.75 | |
| VERBUND AG | 7,470 | 17.89 | 133,675.65 | |
| ASML HOLDING NV | 31,715 | 52.43 | 1,662,817.45 | |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG | 107,949 | 5.93 | 641,109.11 | |
| STMICROELECTRONICS NV | 61,301 | 5.95 | 364,802.25 | |
| ユーロ小計 | 19,360,716 | | 241,824,391.20 | |
| (邦貨換算額：円) | | | (31,246,129,586) | |
| 合計 | 105,832,849 | | 242,686,562,019 | |
| (外貨建有価証券邦貨換算額合計：円) | | | (242,686,562,019) | |

(注) 金額欄の()内は、外貨建有価証券にかかるもので、内書きであります。

| 通貨 | 銘柄数 | | 組入株式時価比率 | 合計金額に対する比率 |
|------------|-----|-------|----------|------------|
| 米ドル | 株式 | 576銘柄 | 56.8% | 59.0% |
| カナダドル | 株式 | 93銘柄 | 4.7% | 4.8% |
| オーストラリアドル | 株式 | 55銘柄 | 3.8% | 3.9% |
| 英ポンド | 株式 | 101銘柄 | 9.7% | 10.1% |
| スイスフラン | 株式 | 39銘柄 | 4.1% | 4.3% |
| 香港ドル | 株式 | 39銘柄 | 1.3% | 1.4% |
| シンガポールドル | 株式 | 27銘柄 | 0.8% | 0.8% |
| ニュージーランドドル | 株式 | 5銘柄 | 0.1% | 0.1% |
| スウェーデンクローナ | 株式 | 32銘柄 | 1.5% | 1.5% |
| ノルウェークローネ | 株式 | 10銘柄 | 0.4% | 0.4% |
| デンマーククローネ | 株式 | 11銘柄 | 0.5% | 0.5% |
| イスラエルシケル | 株式 | 10銘柄 | 0.2% | 0.2% |
| ユーロ | 株式 | 233銘柄 | 12.4% | 12.9% |

(b) 株式以外の有価証券

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|----|----|----|------|-----|----|
|----|----|----|------|-----|----|

| | | | | | |
|-----------|---------------------------------|-------------------------------------|--------------|----------------------------------|--|
| 投資証券 | 米ドル | AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP | 39,137 | 1,277,823.05 | |
| | | AMERICAN TOWER CORP | 39,276 | 3,168,394.92 | |
| | | ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC | 95,398 | 1,516,828.20 | |
| | | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 11,349 | 1,538,583.93 | |
| | | BOSTON PROPERTIES INC | 15,126 | 1,669,305.36 | |
| | | CAMDEN PROPERTY TRUST | 8,060 | 583,221.60 | |
| | | DIGITAL REALTY TRUST INC | 12,700 | 905,637.00 | |
| | | DUKE REALTY CORP | 31,773 | 563,335.29 | |
| | | EQUITY RESIDENTIAL | 32,255 | 1,905,947.95 | |
| | | FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST | 6,474 | 736,223.28 | |
| | | GENERAL GROWTH PROPERTIES | 43,020 | 912,024.00 | |
| | | HCP, INC. | 45,653 | 2,374,869.06 | |
| | | HEALTH CARE REIT INC | 25,813 | 1,835,562.43 | |
| | | HOST HOTELS AND RESORTS INC | 72,738 | 1,299,828.06 | |
| | | HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST | 503,000 | 425,035.00 | |
| | | KIMCO REALTY CORPORATION | 41,132 | 955,907.68 | |
| | | LIBERTY PROPERTY TRUST | 12,565 | 521,950.10 | |
| | | MACERICH COMPANY/THE | 13,839 | 934,686.06 | |
| | | PLUM CREEK TIMBER COMPANY | 16,293 | 847,073.07 | |
| | | PROLOGIS INC | 45,262 | 1,860,720.82 | |
| | | PUBLIC STORAGE | 14,340 | 2,273,033.40 | |
| | | RAYONIER INC | 11,900 | 701,981.00 | |
| | | REALTY INCOME CORPORATION | 18,600 | 887,778.00 | |
| | | REGENCY CENTERS CORP | 8,500 | 466,225.00 | |
| | | SIMON PROPERTY GROUP INC | 30,860 | 5,359,147.60 | |
| | | SL GREEN REALTY CORP | 8,800 | 777,128.00 | |
| | | UDR INC | 23,800 | 592,382.00 | |
| | VENTAS INC | 29,709 | 2,292,940.62 | | |
| | VORNADO REALTY TRUST | 16,350 | 1,429,153.50 | | |
| | | 米ドル小計 (邦貨換算額：円) | 1,273,722 | 40,612,725.98 (4,006,039,290) | |
| | カナダドル | H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 9,500 | 222,300.00 | |
| | | RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 15,800 | 440,820.00 | |
| | | カナダドル小計 (邦貨換算額：円) | 25,300 | 663,120.00 (64,514,944) | |
| オーストラリアドル | APA GROUP | 81,000 | 499,770.00 | | |
| | CFS RETAIL PROPERTY TRUST GROUP | 183,612 | 392,929.68 | | |
| | DEXUS PROPERTY GROUP | 473,804 | 535,398.52 | | |
| | FEDERATION CENTRES | 140,000 | 343,000.00 | | |

| | | | | |
|----------|---------------------------------------|-----------|----------------------------------|--|
| | GOODMAN GROUP | 163,000 | 823,150.00 | |
| | GPT GROUP | 146,994 | 580,626.30 | |
| | LEND LEASE GROUP | 51,172 | 548,052.12 | |
| | MIRVAC GROUP | 336,710 | 567,356.35 | |
| | SP AUSNET | 167,000 | 203,740.00 | |
| | STOCKLAND | 222,614 | 857,063.90 | |
| | SYDNEY AIRPORT | 12,800 | 42,880.00 | |
| | TRANSURBAN GROUP | 133,832 | 869,908.00 | |
| | WESTFIELD GROUP | 210,027 | 2,381,706.18 | |
| | WESTFIELD RETAIL TRUST | 298,993 | 938,838.02 | |
| | オーストラリアドル小計 (邦貨換算額：円) | 2,621,558 | 9,584,419.07 (994,383,478) | |
| 英ポンド | BRITISH LAND CO PLC | 94,605 | 554,385.30 | |
| | HAMMERSON PLC | 73,997 | 383,674.44 | |
| | INTU PROPERTIES PLC | 54,855 | 187,165.26 | |
| | LAND SECURITIES GROUP PLC | 80,127 | 688,290.93 | |
| | SEGREO PLC | 71,434 | 187,371.38 | |
| | 英ポンド小計 (邦貨換算額：円) | 375,018 | 2,000,887.31 (303,634,649) | |
| 香港ドル | HKT TRUST AND HKT LTD | 250,000 | 1,925,000.00 | |
| | LINK REIT | 231,500 | 10,220,725.00 | |
| | 香港ドル小計 (邦貨換算額：円) | 481,500 | 12,145,725.00 (154,372,164) | |
| シンガポールドル | ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 183,000 | 508,740.00 | |
| | CAPITACOMMERCIAL TRUST | 220,000 | 371,800.00 | |
| | CAPITAMALL TRUST | 226,000 | 506,240.00 | |
| | シンガポールドル小計 (邦貨換算額：円) | 629,000 | 1,386,780.00 (110,623,440) | |
| ユーロ | CORIO NV | 6,966 | 254,363.49 | |
| | FONCIERE DES REGIONS | 2,450 | 153,051.50 | |
| | GECINA SA | 2,280 | 210,193.20 | |
| | ICADE | 2,150 | 151,338.50 | |
| | KLEPIERRE | 10,332 | 333,155.34 | |
| | UNIBAIL-RODAMCO SE | 9,439 | 1,796,241.70 | |
| | ユーロ小計 (邦貨換算額：円) | 33,617 | 2,898,343.73 (374,494,993) | |
| | 投資証券合計 | | 6,008,062,958 (6,008,062,958) | |
| | 合計 | | 6,008,062,958 | |
| | (外貨建有価証券邦貨換算額合計：円) | | (6,008,062,958) | |

(注) 金額欄の()内は、外貨建有価証券にかかるもので、内書きであります。

| 通貨 | 銘柄数 | | 組入投資証券 時価比率 | 合計金額に対する比率 |
|-----|------|------|----------------|------------|
| 米ドル | 投資証券 | 29銘柄 | 1.6% | 66.7% |

| | | | | |
|-----------|------|------|------|-------|
| カナダドル | 投資証券 | 2銘柄 | 0.0% | 1.1% |
| オーストラリアドル | 投資証券 | 14銘柄 | 0.4% | 16.6% |
| 英ポンド | 投資証券 | 5銘柄 | 0.1% | 5.1% |
| 香港ドル | 投資証券 | 2銘柄 | 0.1% | 2.6% |
| シンガポールドル | 投資証券 | 3銘柄 | 0.0% | 1.8% |
| ユーロ | 投資証券 | 6銘柄 | 0.1% | 6.2% |

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

「外国債券パッシブ・マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

(単位：円)

| | (平成24年 4月13日現在) | (平成25年 4月15日現在) |
|-------------|-----------------|-----------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | 3,242,880,891 | 1,005,108,297 |
| コール・ローン | 1,178,688,095 | 682,776,034 |
| 国債証券 | 245,124,630,662 | 272,837,427,371 |
| 派生商品評価勘定 | | 13,556,281 |
| 未収入金 | | 1,659,430,893 |
| 未収利息 | 2,912,044,379 | 3,067,588,966 |
| 前払費用 | 97,919,956 | 91,857,983 |
| 流動資産合計 | 252,556,163,983 | 279,357,745,825 |
| 資産合計 | 252,556,163,983 | 279,357,745,825 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 派生商品評価勘定 | | 861 |
| 未払解約金 | 6,909,514 | 1,554,286,456 |
| 流動負債合計 | 6,909,514 | 1,554,287,317 |
| 負債合計 | 6,909,514 | 1,554,287,317 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 217,156,318,934 | 186,647,334,846 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金() | 35,392,935,535 | 91,156,123,662 |
| 元本等合計 | 252,549,254,469 | 277,803,458,508 |
| 純資産合計 | 252,549,254,469 | 277,803,458,508 |
| 負債純資産合計 | 252,556,163,983 | 279,357,745,825 |

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

| 項目 | 自平成24年 4月14日 至平成25年 4月15日 |
|--------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> |

| | |
|----------------------------|---|
| | (3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。 |
| 2. デリバティブの評価基準及び評価方法 | 為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。 |
| 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 項目 | (平成24年 4月13日現在) | (平成25年 4月15日現在) |
|---------------|---|---|
| 1. 受益権総数 | 平成24年 4月13日における受益権の総数 217,156,318,934口 | 平成25年 4月15日における受益権の総数 186,647,334,846口 |
| 2. 1単位当たり純資産額 | 1.1630円 (1万口 = 11,630円) | 1.4884円 (1万口 = 14,884円) |

(金融商品に関する注記)

. 金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 自 平成24年 4月14日 至 平成25年 4月15日 |
|------------------------|--|
| 1. 金融商品に対する取組方針 | 当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。 |
| 2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | (1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券を組み入れております。 2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。 当計算期間については、為替予約取引を行っております。 3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 (2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。 |

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

・金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | (平成25年 4月15日現在) |
|--------------------|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | <p>(1) 有価証券（国債証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

(デリバティブ取引に関する注記)

(平成24年4月13日現在)

該当事項はありません。

（平成25年4月15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 | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 買建 | | | | |
| | 米ドル | 34,423 | | 34,081 | 342 |
| | ユーロ | 68,948 | | 68,429 | 519 |
| | 小計 | 103,371 | | 102,510 | 861 |
| | 売建 | | | | |
| | 米ドル | 1,140,150,503 | | 1,129,904,007 | 10,246,496 |
| | 英ポンド | 94,884,395 | | 94,220,906 | 663,489 |
| | ユーロ | 326,694,467 | | 324,048,171 | 2,646,296 |
| 小計 | 1,561,729,365 | | 1,548,173,084 | 13,556,281 | |
| 合計 | | 1,561,832,736 | | 1,548,275,594 | 13,555,420 |

（注）時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法について

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

2．ヘッジ会計が適用されているデリバティブ取引
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

（自 平成23年4月14日 至 平成24年4月13日）
該当事項はありません。

（自 平成24年4月14日 至 平成25年4月15日）
該当事項はありません。

（その他の注記）

（平成24年 4月13日現在）

| | |
|-------------------|------------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 228,852,611,475円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 14,006,743,946円 |

| | |
|--|-----------------|
| 同期中における一部解約元本額 | 25,703,036,487円 |
| 平成24年 4月13日現在の元本の内訳 | |
| 三井住友・DC外国債券インデックスファンドS | 2,940,352,240円 |
| 三井住友・DC年金バランス30(債券重点型) | 218,447,260円 |
| 三井住友・DC年金バランス50(標準型) | 619,539,465円 |
| 三井住友・DC年金バランス70(株式重点型) | 291,157,739円 |
| スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型) | 31,332,999円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020 | 4,474,872円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025 | 4,942,862円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030 | 3,666,600円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035 | 4,103,305円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040 | 3,494,230円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045 | 2,173,257円 |
| SMAM・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定> | 2,784,286,156円 |
| SMAM・バランスファンドVA安定成長型<適格機関投資家限定> | 11,756,880,190円 |
| SMAM・バランスファンドVA25<適格機関投資家専用> | 36,977,049,946円 |
| SMAM・バランスファンドVA37.5<適格機関投資家専用> | 11,433,567,140円 |
| SMAM・バランスファンドVA50<適格機関投資家専用> | 24,430,597,098円 |
| SMAM・バランスファンドVL30<適格機関投資家限定> | 85,985,806円 |
| SMAM・バランスファンドVL50<適格機関投資家限定> | 176,913,226円 |
| 世界6資産バランスファンドVA<適格機関投資家限定> | 42,758,003円 |
| SMAM・バランスファンドVA75<適格機関投資家専用> | 1,346,639,758円 |
| SMAM・バランスファンドVL国際分散型<適格機関投資家限定> | 181,037,481円 |
| SMAM・インデックス・バランスVA25<適格機関投資家専用> | 2,230,337,710円 |
| SMAM・インデックス・バランスVA50<適格機関投資家専用> | 2,962,479,291円 |
| SMAM・バランスファンドVA40<適格機関投資家専用> | 6,963,939,734円 |
| SMAM・バランスファンドVA35<適格機関投資家専用> | 15,088,463,167円 |
| SMAM・バランスVA株40T<適格機関投資家限定> | 1,242,006,429円 |
| SMAM・外国債券パッシブファンドVA<適格機関投資家限定> | 23,246,322,516円 |
| 三井住友・外国債券インデックスファンド・VAS (適格機関投資家専用) | 2,099,565,852円 |
| 三井住友・5資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用) | 10,047,273,025円 |
| SMAM・グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定> | 414,204,825円 |
| SMAM・バランスファンドVA20<適格機関投資家専用> | 10,806,443,520円 |
| 三井住友・7資産バランスファンド・VAS(適格機関投資家専用) | 42,215,328,702円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A <適格機関投資家専用> | 294,003,741円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA35A <適格機関投資家専用> | 90,136,498円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA50A <適格機関投資家専用> | 22,868,534円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20L <適格機関投資家専用> | 383,390,593円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA25L <適格機関投資家専用> | 1,344,668,843円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20T <適格機関投資家専用> | 382,724,925円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA20A2 <適格機関投資家専用> | 344,139,271円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA35A2 <適格機関投資家専用> | 91,396,793円 |
| SMAM・アセットバランスファンドVA50A2 <適格機関投資家専用> | 13,193,042円 |

| | |
|--|------------------|
| S M A M・アセットバランスファンドV A 2 5 L 2 <適格機関投資家専用> | 3,260,134,903円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 T 2 <適格機関投資家専用> | 89,443,849円 |
| S M A M・F G新興国重視型バランス20V A <適格機関投資家限定> | 127,132,965円 |
| S M A M・F Gグローバルバランス25V A <適格機関投資家限定> | 57,320,573円 |
| 合 計 | 217,156,318,934円 |

(平成25年 4月15日現在)

| | |
|--|------------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 217,156,318,934円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 2,578,408,133円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 33,087,392,221円 |
| 平成25年 4月15日現在の元本の内訳 | |
| 三井住友・D C外国債券インデックスファンドS | 3,408,540,525円 |
| 三井住友・D C年金バランス30(債券重点型) | 229,960,770円 |
| 三井住友・D C年金バランス50(標準型) | 655,109,607円 |
| 三井住友・D C年金バランス70(株式重点型) | 331,395,072円 |
| スミセイ・D Cバランスファンド(機動的資産配分型) | 32,401,468円 |
| スミセイ・D Cターゲットイヤーファンド2020 | 4,300,431円 |
| スミセイ・D Cターゲットイヤーファンド2025 | 6,572,493円 |
| スミセイ・D Cターゲットイヤーファンド2030 | 4,779,579円 |
| スミセイ・D Cターゲットイヤーファンド2035 | 5,484,188円 |
| スミセイ・D Cターゲットイヤーファンド2040 | 1,406,052円 |
| スミセイ・D Cターゲットイヤーファンド2045 | 3,496,097円 |
| S M A M・年金外国債券パッシブ・ファンド<適格機関投資家限定> | 2,560,148,460円 |
| S M A M・バランスファンドV A安定成長型<適格機関投資家限定> | 10,290,177,647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> | 32,992,590,554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> | 10,147,738,912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> | 22,183,680,893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> | 74,799,440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> | 160,997,541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> | 37,695,327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> | 1,342,786,734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> | 174,683,670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> | 1,975,852,173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> | 2,598,037,663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> | 6,496,007,155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> | 12,812,790,066円 |
| S M A M・バランスV A株4 0 T<適格機関投資家限定> | 996,132,152円 |
| S M A M・外国債券パッシブファンドV A<適格機関投資家限定> | 21,589,523,914円 |
| 三井住友・外国債券インデックスファンド・V A S (適格機関投資家専用) | 1,841,948,220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) | 7,920,113,060円 |
| S M A M・グローバルバランス4 0 V A<適格機関投資家限定> | 344,512,597円 |
| S M A M・バランスファンドV A 2 0<適格機関投資家専用> | 7,902,721,167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) | 32,065,959,599円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 2 0 A <適格機関投資家専用> | 253,521,813円 |
| S M A M・アセットバランスファンドV A 3 5 A <適格機関投資家専用> | 79,883,524円 |

| | |
|--|------------------|
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A < 適格機関投資家専用 > | 21,756,303円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 L < 適格機関投資家専用 > | 317,608,167円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L < 適格機関投資家専用 > | 1,161,139,056円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T < 適格機関投資家専用 > | 340,291,203円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 A 2 < 適格機関投資家専用 > | 298,284,966円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 3 5 A 2 < 適格機関投資家専用 > | 82,841,102円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 5 0 A 2 < 適格機関投資家専用 > | 11,794,548円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 5 L 2 < 適格機関投資家専用 > | 2,747,609,456円 |
| S M A M ・ アセットバランスファンドV A 2 0 T 2 < 適格機関投資家専用 > | 77,454,841円 |
| S M A M ・ F G 新興国重視型バランス20V A < 適格機関投資家限定 > | 16,708,947円 |
| S M A M ・ F G グローバルバランス25V A < 適格機関投資家限定 > | 43,452,714円 |
| S M A M ・ 年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション ファンド< 適格機関投資家限定 > | 1,322,490円 |
| S M A M ・ 年金マルチ・インカム・ダイナミック・アロケーション ファンド< 適格機関投資家限定 > | 1,322,490円 |
| 合 計 | 186,647,334,846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 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|------|-----|-----------------------|------------|---------------|----|
| 国債証券 | 米ドル | US TREASURY N/B 0.125 | 7,000,000 | 6,994,531.25 | |
| | | US TREASURY N/B 0.25 | 4,000,000 | 4,003,750.00 | |
| | | US TREASURY N/B 0.25 | 6,000,000 | 6,004,218.78 | |
| | | US TREASURY N/B 0.25 | 9,000,000 | 9,007,734.42 | |
| | | US TREASURY N/B 0.25 | 6,000,000 | 6,003,281.28 | |
| | | US TREASURY N/B 0.25 | 7,000,000 | 7,003,554.67 | |
| | | US TREASURY N/B 0.25 | 7,000,000 | 7,003,828.16 | |
| | | US TREASURY N/B 0.25 | 13,000,000 | 13,006,093.75 | |
| | | US TREASURY N/B 0.25 | 7,000,000 | 7,002,734.41 | |
| | | US TREASURY N/B 0.25 | 13,000,000 | 12,997,968.75 | |
| | | US TREASURY N/B 0.25 | 14,000,000 | 13,995,625.00 | |
| | | US TREASURY N/B 0.25 | 8,000,000 | 7,996,875.04 | |
| | | US TREASURY N/B 0.25 | 14,000,000 | 13,989,609.34 | |
| | | US TREASURY N/B 0.25 | 8,000,000 | 7,988,125.04 | |
| | | US TREASURY N/B 0.375 | 9,000,000 | 9,022,851.54 | |
| | | US TREASURY N/B 0.375 | 4,000,000 | 4,010,937.52 | |
| | | US TREASURY N/B 0.375 | 8,000,000 | 8,021,875.04 | |

| | | | |
|-----------------------|------------|---------------|--|
| US TREASURY N/B 0.375 | 8,000,000 | 8,020,625.04 | |
| US TREASURY N/B 0.375 | 4,000,000 | 4,008,750.00 | |
| US TREASURY N/B 0.375 | 12,000,000 | 12,015,937.56 | |
| US TREASURY N/B 0.5 | 8,000,000 | 8,033,125.04 | |
| US TREASURY N/B 0.5 | 10,000,000 | 10,044,531.30 | |
| US TREASURY N/B 0.5 | 8,000,000 | 7,975,625.04 | |
| US TREASURY N/B 0.625 | 7,000,000 | 7,038,828.16 | |
| US TREASURY N/B 0.625 | 5,000,000 | 5,017,968.75 | |
| US TREASURY N/B 0.625 | 10,000,000 | 10,021,093.80 | |
| US TREASURY N/B 0.625 | 5,000,000 | 5,000,781.25 | |
| US TREASURY N/B 0.75 | 9,000,000 | 9,060,468.75 | |
| US TREASURY N/B 0.75 | 5,000,000 | 5,040,625.00 | |
| US TREASURY N/B 0.75 | 7,000,000 | 7,024,062.50 | |
| US TREASURY N/B 0.875 | 6,000,000 | 6,092,812.50 | |
| US TREASURY N/B 0.875 | 8,000,000 | 8,123,125.04 | |
| US TREASURY N/B 0.875 | 7,000,000 | 7,105,000.00 | |
| US TREASURY N/B 0.875 | 3,000,000 | 3,045,000.00 | |
| US TREASURY N/B 1 | 11,000,000 | 11,099,687.50 | |
| US TREASURY N/B 1 | 2,000,000 | 2,040,156.26 | |
| US TREASURY N/B 1 | 5,000,000 | 5,100,781.25 | |
| US TREASURY N/B 1 | 4,000,000 | 4,081,250.00 | |
| US TREASURY N/B 1 | 7,000,000 | 7,136,718.75 | |
| US TREASURY N/B 1 | 5,000,000 | 5,010,546.90 | |
| US TREASURY N/B 1 | 8,000,000 | 7,998,125.04 | |
| US TREASURY N/B 1 | 2,000,000 | 1,997,031.26 | |
| US TREASURY N/B 1 | 8,000,000 | 7,973,750.00 | |
| US TREASURY N/B 1.125 | 3,000,000 | 3,033,046.89 | |
| US TREASURY N/B 1.25 | 5,000,000 | 5,054,296.90 | |
| US TREASURY N/B 1.25 | 8,000,000 | 8,186,875.04 | |
| US TREASURY N/B 1.25 | 7,000,000 | 7,167,890.66 | |
| US TREASURY N/B 1.25 | 5,000,000 | 5,121,484.40 | |
| US TREASURY N/B 1.25 | 5,000,000 | 5,096,484.40 | |
| US TREASURY N/B 1.25 | 5,000,000 | 5,046,093.75 | |
| US TREASURY N/B 1.375 | 5,000,000 | 5,140,625.00 | |
| US TREASURY N/B 1.375 | 6,500,000 | 6,702,617.22 | |
| US TREASURY N/B 1.375 | 5,000,000 | 5,152,343.75 | |
| US TREASURY N/B 1.375 | 8,000,000 | 8,230,625.04 | |
| US TREASURY N/B 1.5 | 5,500,000 | 5,698,085.96 | |
| US TREASURY N/B 1.5 | 8,000,000 | 8,291,250.00 | |
| US TREASURY N/B 1.5 | 2,000,000 | 2,076,718.76 | |
| US TREASURY N/B 1.625 | 8,000,000 | 7,993,125.04 | |
| US TREASURY N/B 1.625 | 13,000,000 | 12,925,859.44 | |
| US TREASURY N/B 1.75 | 8,000,000 | 8,122,500.00 | |
| US TREASURY N/B 1.75 | 5,000,000 | 5,169,921.90 | |
| US TREASURY N/B 1.75 | 3,000,000 | 3,129,609.39 | |
| US TREASURY N/B 1.75 | 3,000,000 | 3,153,515.64 | |
| US TREASURY N/B 1.75 | 6,000,000 | 6,086,250.00 | |
| US TREASURY N/B 1.875 | 8,000,000 | 8,141,875.04 | |

| | | | |
|-----------------------|------------|---------------|--|
| US TREASURY N/B 1.875 | 7,000,000 | 7,249,375.00 | |
| US TREASURY N/B 1.875 | 3,000,000 | 3,168,750.00 | |
| US TREASURY N/B 1.875 | 10,000,000 | 10,572,656.30 | |
| US TREASURY N/B 1.875 | 6,000,000 | 6,340,781.28 | |
| US TREASURY N/B 11.25 | 2,000,000 | 2,403,437.50 | |
| US TREASURY N/B 2 | 7,000,000 | 7,326,484.41 | |
| US TREASURY N/B 2 | 3,000,000 | 3,127,031.25 | |
| US TREASURY N/B 2 | 6,600,000 | 6,858,843.75 | |
| US TREASURY N/B 2 | 4,000,000 | 4,099,375.00 | |
| US TREASURY N/B 2.125 | 10,500,000 | 10,827,304.74 | |
| US TREASURY N/B 2.125 | 8,000,000 | 8,317,500.00 | |
| US TREASURY N/B 2.125 | 3,000,000 | 3,146,953.14 | |
| US TREASURY N/B 2.125 | 3,000,000 | 3,154,218.75 | |
| US TREASURY N/B 2.125 | 11,000,000 | 11,611,015.68 | |
| US TREASURY N/B 2.25 | 7,000,000 | 7,163,515.66 | |
| US TREASURY N/B 2.25 | 10,000,000 | 10,362,500.00 | |
| US TREASURY N/B 2.25 | 4,000,000 | 4,297,187.52 | |
| US TREASURY N/B 2.25 | 2,000,000 | 2,155,937.50 | |
| US TREASURY N/B 2.375 | 8,000,000 | 8,238,750.00 | |
| US TREASURY N/B 2.375 | 10,000,000 | 10,315,625.00 | |
| US TREASURY N/B 2.375 | 8,000,000 | 8,266,250.00 | |
| US TREASURY N/B 2.375 | 9,000,000 | 9,360,000.00 | |
| US TREASURY N/B 2.375 | 5,500,000 | 5,831,289.09 | |
| US TREASURY N/B 2.375 | 5,000,000 | 5,384,375.00 | |
| US TREASURY N/B 2.375 | 2,000,000 | 2,167,812.50 | |
| US TREASURY N/B 2.5 | 9,000,000 | 9,397,968.75 | |
| US TREASURY N/B 2.5 | 10,000,000 | 10,458,593.80 | |
| US TREASURY N/B 2.5 | 5,000,000 | 5,407,812.50 | |
| US TREASURY N/B 2.625 | 9,000,000 | 9,265,781.25 | |
| US TREASURY N/B 2.625 | 6,000,000 | 6,189,375.00 | |
| US TREASURY N/B 2.625 | 8,000,000 | 8,326,875.04 | |
| US TREASURY N/B 2.625 | 5,000,000 | 5,329,296.90 | |
| US TREASURY N/B 2.625 | 5,000,000 | 5,345,312.50 | |
| US TREASURY N/B 2.625 | 4,000,000 | 4,374,062.52 | |
| US TREASURY N/B 2.625 | 4,000,000 | 4,382,812.52 | |
| US TREASURY N/B 2.625 | 8,000,000 | 8,808,750.00 | |
| US TREASURY N/B 2.625 | 12,000,000 | 13,203,750.00 | |
| US TREASURY N/B 2.75 | 6,000,000 | 6,495,000.00 | |
| US TREASURY N/B 2.75 | 7,000,000 | 7,635,468.75 | |
| US TREASURY N/B 2.75 | 4,000,000 | 4,395,000.00 | |
| US TREASURY N/B 2.75 | 9,000,000 | 9,964,687.50 | |
| US TREASURY N/B 2.75 | 2,000,000 | 1,929,375.00 | |
| US TREASURY N/B 2.75 | 13,000,000 | 12,526,718.75 | |
| US TREASURY N/B 2.875 | 4,000,000 | 4,429,375.00 | |
| US TREASURY N/B 3 | 4,000,000 | 4,350,312.52 | |
| US TREASURY N/B 3 | 5,000,000 | 5,445,312.50 | |
| US TREASURY N/B 3 | 7,000,000 | 7,676,484.41 | |
| US TREASURY N/B 3 | 7,000,000 | 7,117,031.25 | |

| | | | |
|-----------------------|------------|---------------|--|
| US TREASURY N/B 3.125 | 6,000,000 | 6,570,468.78 | |
| US TREASURY N/B 3.125 | 7,000,000 | 7,697,812.50 | |
| US TREASURY N/B 3.125 | 7,000,000 | 7,729,531.25 | |
| US TREASURY N/B 3.125 | 2,000,000 | 2,264,062.50 | |
| US TREASURY N/B 3.125 | 6,000,000 | 6,816,562.50 | |
| US TREASURY N/B 3.125 | 2,000,000 | 2,087,812.50 | |
| US TREASURY N/B 3.125 | 3,000,000 | 3,129,609.39 | |
| US TREASURY N/B 3.25 | 4,000,000 | 4,358,437.52 | |
| US TREASURY N/B 3.25 | 4,000,000 | 4,365,937.52 | |
| US TREASURY N/B 3.25 | 5,000,000 | 5,470,703.15 | |
| US TREASURY N/B 3.25 | 4,000,000 | 4,412,187.52 | |
| US TREASURY N/B 3.25 | 4,000,000 | 4,432,187.52 | |
| US TREASURY N/B 3.375 | 9,000,000 | 10,364,062.50 | |
| US TREASURY N/B 3.5 | 8,500,000 | 9,650,820.35 | |
| US TREASURY N/B 3.5 | 7,500,000 | 8,718,164.10 | |
| US TREASURY N/B 3.5 | 4,000,000 | 4,498,750.00 | |
| US TREASURY N/B 3.625 | 9,000,000 | 10,476,562.50 | |
| US TREASURY N/B 3.625 | 9,000,000 | 10,525,781.25 | |
| US TREASURY N/B 3.625 | 10,000,000 | 11,748,437.50 | |
| US TREASURY N/B 3.75 | 7,000,000 | 8,136,406.25 | |
| US TREASURY N/B 3.75 | 5,000,000 | 5,858,203.15 | |
| US TREASURY N/B 3.875 | 6,000,000 | 6,954,843.78 | |
| US TREASURY N/B 3.875 | 7,000,000 | 8,381,406.25 | |
| US TREASURY N/B 4 | 7,700,000 | 8,230,578.12 | |
| US TREASURY N/B 4 | 3,500,000 | 4,098,828.12 | |
| US TREASURY N/B 4.125 | 4,200,000 | 4,537,312.50 | |
| US TREASURY N/B 4.25 | 5,400,000 | 5,691,937.50 | |
| US TREASURY N/B 4.25 | 6,100,000 | 6,487,921.87 | |
| US TREASURY N/B 4.25 | 5,000,000 | 5,821,093.75 | |
| US TREASURY N/B 4.25 | 4,000,000 | 5,080,625.00 | |
| US TREASURY N/B 4.25 | 6,000,000 | 7,631,250.00 | |
| US TREASURY N/B 4.375 | 2,200,000 | 2,840,406.25 | |
| US TREASURY N/B 4.375 | 5,000,000 | 6,478,515.65 | |
| US TREASURY N/B 4.375 | 5,000,000 | 6,480,078.15 | |
| US TREASURY N/B 4.375 | 6,000,000 | 7,787,343.78 | |
| US TREASURY N/B 4.5 | 5,800,000 | 6,428,031.25 | |
| US TREASURY N/B 4.5 | 2,400,000 | 2,683,687.51 | |
| US TREASURY N/B 4.5 | 3,000,000 | 3,481,875.00 | |
| US TREASURY N/B 4.5 | 3,500,000 | 4,581,992.20 | |
| US TREASURY N/B 4.5 | 3,000,000 | 3,945,468.75 | |
| US TREASURY N/B 4.5 | 4,000,000 | 5,279,687.52 | |
| US TREASURY N/B 4.625 | 5,200,000 | 5,972,687.50 | |
| US TREASURY N/B 4.625 | 3,000,000 | 3,473,437.50 | |
| US TREASURY N/B 4.625 | 5,000,000 | 6,727,734.40 | |
| US TREASURY N/B 4.75 | 6,400,000 | 6,717,000.00 | |
| US TREASURY N/B 4.75 | 3,000,000 | 3,538,828.14 | |
| US TREASURY N/B 4.75 | 1,000,000 | 1,356,718.75 | |
| US TREASURY N/B 4.75 | 5,000,000 | 6,864,843.75 | |

| | | | |
|-----------------------|-------------------|---------------------------------------|--------------|
| US TREASURY N/B 4.875 | 3,400,000 | 3,904,687.50 | |
| US TREASURY N/B 5 | 2,000,000 | 2,807,343.76 | |
| US TREASURY N/B 5.125 | 3,700,000 | 4,239,968.75 | |
| US TREASURY N/B 5.25 | 2,000,000 | 2,762,500.00 | |
| US TREASURY N/B 5.25 | 2,000,000 | 2,769,062.50 | |
| US TREASURY N/B 5.375 | 3,020,000 | 4,295,478.12 | |
| US TREASURY N/B 5.5 | 2,000,000 | 2,826,562.50 | |
| US TREASURY N/B 6 | 1,000,000 | 1,444,531.25 | |
| US TREASURY N/B 6.125 | 1,000,000 | 1,484,765.63 | |
| US TREASURY N/B 6.125 | 1,100,000 | 1,663,062.50 | |
| US TREASURY N/B 6.25 | 2,500,000 | 3,574,023.45 | |
| US TREASURY N/B 6.25 | 1,000,000 | 1,541,718.75 | |
| US TREASURY N/B 6.5 | 1,000,000 | 1,516,015.63 | |
| US TREASURY N/B 6.75 | 1,000,000 | 1,541,718.75 | |
| US TREASURY N/B 6.875 | 1,000,000 | 1,536,015.63 | |
| US TREASURY N/B 7.125 | 1,400,000 | 2,102,625.00 | |
| US TREASURY N/B 7.25 | 4,000,000 | 4,844,062.52 | |
| US TREASURY N/B 7.25 | 2,500,000 | 3,746,093.75 | |
| US TREASURY N/B 7.5 | 2,400,000 | 3,001,125.00 | |
| US TREASURY N/B 7.5 | 1,000,000 | 1,586,718.75 | |
| US TREASURY N/B 8 | 2,800,000 | 4,300,625.00 | |
| US TREASURY N/B 8.125 | 1,000,000 | 1,525,703.13 | |
| US TREASURY N/B 8.75 | 3,000,000 | 3,997,734.39 | |
| US TREASURY N/B 8.75 | 1,000,000 | 1,536,796.88 | |
| US TREASURY N/B 8.875 | 2,000,000 | 2,714,062.50 | |
| US TREASURY N/B 8.875 | 2,100,000 | 3,065,179.69 | |
| 米ドル小計 (邦貨換算額：円) | 1,054,920,000 | 1,135,278,035.00 (111,983,825,372) | |
| カナダドル | CANADA-GOV'T 1 | 1,500,000 | 1,500,855.00 |
| | CANADA-GOV'T 1.5 | 1,000,000 | 1,011,400.00 |
| | CANADA-GOV'T 1.5 | 2,000,000 | 2,026,500.00 |
| | CANADA-GOV'T 1.5 | 1,000,000 | 1,013,420.00 |
| | CANADA-GOV'T 2 | 3,000,000 | 3,025,800.00 |
| | CANADA-GOV'T 2 | 4,000,000 | 4,065,800.00 |
| | CANADA-GOV'T 2 | 2,000,000 | 2,056,680.00 |
| | CANADA-GOV'T 2.5 | 2,000,000 | 2,010,980.00 |
| | CANADA-GOV'T 2.5 | 2,000,000 | 2,064,760.00 |
| | CANADA-GOV'T 2.75 | 2,000,000 | 2,108,260.00 |
| | CANADA-GOV'T 2.75 | 2,000,000 | 2,189,800.00 |
| | CANADA-GOV'T 3 | 4,500,000 | 4,600,980.00 |
| | CANADA-GOV'T 3 | 3,000,000 | 3,153,540.00 |
| | CANADA-GOV'T 3.25 | 3,000,000 | 3,397,260.00 |
| | CANADA-GOV'T 3.5 | 3,000,000 | 3,419,670.00 |
| | CANADA-GOV'T 3.75 | 3,000,000 | 3,422,100.00 |
| | CANADA-GOV'T 4 | 3,000,000 | 3,269,010.00 |
| | CANADA-GOV'T 4 | 2,000,000 | 2,226,920.00 |
| | CANADA-GOV'T 4 | 4,000,000 | 5,316,000.00 |
| | CANADA-GOV'T 4.25 | 2,500,000 | 2,874,500.00 |

| | | | | |
|--------------|---------------------------------|-------------------|----------------------|------------------------|
| | CANADA-GOV'T 4.5 | 2,000,000 | 2,148,740.00 | |
| | CANADA-GOV'T 5 | 2,500,000 | 2,611,950.00 | |
| | CANADA-GOV'T 5 | 4,000,000 | 5,897,000.00 | |
| | CANADA-GOV'T 5.75 | 1,300,000 | 1,932,528.00 | |
| | CANADA-GOV'T 5.75 | 3,000,000 | 4,650,120.00 | |
| | CANADA-GOV'T 8 | 400,000 | 633,468.00 | |
| | CANADA-GOV'T 8 | 1,000,000 | 1,735,970.00 | |
| | CANADA-GOV'T 9 | 980,000 | 1,737,883.00 | |
| | カナダドル小計 (邦貨換算額:円) | 65,680,000 | 76,101,894.00 | (7,403,953,267) |
| オーストラリアドル | AUSTRALIAN GOVT. 2.75 | 1,000,000 | 941,529.00 | |
| | AUSTRALIAN GOVT. 4.25 | 1,000,000 | 1,054,250.00 | |
| | AUSTRALIAN GOVT. 4.5 | 3,000,000 | 3,078,660.00 | |
| | AUSTRALIAN GOVT. 4.5 | 4,000,000 | 4,341,776.00 | |
| | AUSTRALIAN GOVT. 4.75 | 1,000,000 | 1,043,800.00 | |
| | AUSTRALIAN GOVT. 4.75 | 4,000,000 | 4,234,364.00 | |
| | AUSTRALIAN GOVT. 4.75 | 1,200,000 | 1,344,960.00 | |
| | AUSTRALIAN GOVT. 5.25 | 5,000,000 | 5,594,820.00 | |
| | AUSTRALIAN GOVT. 5.5 | 2,000,000 | 2,227,000.00 | |
| | AUSTRALIAN GOVT. 5.5 | 2,000,000 | 2,373,200.00 | |
| | AUSTRALIAN GOVT. 5.75 | 4,000,000 | 4,718,800.00 | |
| | AUSTRALIAN GOVT. 5.75 | 2,000,000 | 2,393,600.00 | |
| | AUSTRALIAN GOVT. 6 | 3,300,000 | 3,679,500.00 | |
| | AUSTRALIAN GOVT. 6.25 | 1,500,000 | 1,559,155.50 | |
| | AUSTRALIAN GOVT. 6.25 | 3,000,000 | 3,200,400.00 | |
| | オーストラリアドル小計 (邦貨換算額:円) | 38,000,000 | 41,785,814.50 | (4,335,278,254) |
| 英ポンド | TREASURY 1 | 4,800,000 | 4,886,400.00 | |
| | TREASURY 1.75 | 3,000,000 | 3,146,100.00 | |
| | TREASURY 1.75 | 2,000,000 | 2,003,740.00 | |
| | TREASURY 2 | 3,000,000 | 3,141,720.00 | |
| | TREASURY 2.75 | 5,000,000 | 5,224,000.00 | |
| | TREASURY 3.75 | 3,600,000 | 4,201,704.00 | |
| | TREASURY 3.75 | 5,000,000 | 5,875,600.00 | |
| | TREASURY 3.75 | 5,000,000 | 5,891,100.00 | |
| | TREASURY 3.75 | 2,300,000 | 2,604,129.00 | |
| | TREASURY 4 | 4,800,000 | 5,393,808.00 | |
| | TREASURY 4 | 2,000,000 | 2,402,020.00 | |
| | TREASURY 4 | 2,000,000 | 2,407,000.00 | |
| | TREASURY 4.25 | 2,300,000 | 2,841,029.00 | |
| | TREASURY 4.25 | 2,800,000 | 3,449,320.00 | |
| | TREASURY 4.25 | 3,800,000 | 4,680,308.00 | |
| | TREASURY 4.25 | 2,500,000 | 3,051,150.00 | |
| | TREASURY 4.25 | 3,500,000 | 4,291,700.00 | |
| | TREASURY 4.25 | 3,900,000 | 4,800,120.00 | |
| | TREASURY 4.25 | 2,700,000 | 3,339,468.00 | |
| | TREASURY 4.25 | 3,900,000 | 4,893,798.00 | |
| TREASURY 4.5 | 4,200,000 | 5,064,234.00 | | |

| | | | | |
|------------|---------------------------|-------------|------------------------------------|--|
| | TREASURY 4.5 | 2,500,000 | 3,177,925.00 | |
| | TREASURY 4.5 | 3,500,000 | 4,483,255.00 | |
| | TREASURY 4.75 | 4,400,000 | 4,876,344.00 | |
| | TREASURY 4.75 | 3,700,000 | 4,582,968.00 | |
| | TREASURY 4.75 | 3,800,000 | 4,960,140.00 | |
| | TREASURY 4.75 | 3,500,000 | 4,647,265.00 | |
| | TREASURY 5 | 4,500,000 | 4,800,150.00 | |
| | TREASURY 5 | 3,500,000 | 4,230,450.00 | |
| | TREASURY 5 | 3,100,000 | 4,081,336.00 | |
| | TREASURY 6 | 2,000,000 | 2,951,300.00 | |
| | TREASURY 8 | 1,900,000 | 2,290,982.00 | |
| | TREASURY 8 | 2,620,000 | 3,953,187.00 | |
| | TREASURY 8.75 | 1,300,000 | 1,760,525.00 | |
| | 英ポンド小計 (邦貨換算額:円) | 112,420,000 | 134,384,275.00 (20,392,813,731) | |
| スイスフラン | SWISS (GOVT) 2.25 | 1,300,000 | 1,473,940.00 | |
| | SWISS (GOVT) 2.5 | 2,000,000 | 2,148,200.00 | |
| | SWISS (GOVT) 3 | 1,000,000 | 1,136,700.00 | |
| | SWISS (GOVT) 3 | 1,500,000 | 1,749,600.00 | |
| | SWISS (GOVT) 4 | 1,000,000 | 1,317,300.00 | |
| | SWISS (GOVT) 4 | 900,000 | 1,260,090.00 | |
| | SWISS (GOVT) 4.25 | 1,000,000 | 1,173,300.00 | |
| | スイスフラン小計 (邦貨換算額:円) | 8,700,000 | 10,259,130.00 (1,089,724,788) | |
| シンガポールドル | SINGAPORE GOV'T 2.25 | 500,000 | 541,393.50 | |
| | SINGAPORE GOV'T 2.875 | 1,000,000 | 1,109,868.00 | |
| | SINGAPORE GOV'T 3.125 | 1,000,000 | 1,156,294.00 | |
| | SINGAPORE GOV'T 3.25 | 2,000,000 | 2,312,250.00 | |
| | SINGAPORE GOV'T 3.5 | 1,500,000 | 1,788,784.50 | |
| | SINGAPORE GOV'T 3.625 | 2,500,000 | 2,605,210.00 | |
| | SINGAPORE GOV'T 3.75 | 1,000,000 | 1,119,611.00 | |
| | SINGAPORE GOV'T 4 | 3,200,000 | 3,784,988.80 | |
| | シンガポールドル小計 (邦貨換算額:円) | 12,700,000 | 14,418,399.80 (1,150,155,752) | |
| マレーシアリンギット | MALAYSIAN GOV'T 3.418 | 8,000,000 | 8,030,608.00 | |
| | MALAYSIAN GOV'T 3.502 | 9,000,000 | 8,908,794.00 | |
| | MALAYSIAN GOV'T 3.741 | 10,000,000 | 10,132,400.00 | |
| | MALAYSIAN GOV'T 3.814 | 2,000,000 | 2,055,230.00 | |
| | MALAYSIAN GOV'T 4.24 | 5,000,000 | 5,244,350.00 | |
| | MALAYSIAN GOV'T 4.262 | 3,000,000 | 3,120,414.00 | |
| | MALAYSIAN GOV'T 4.378 | 5,000,000 | 5,318,685.00 | |
| | MALAYSIAN GOV'T 5.094 | 6,000,000 | 6,126,486.00 | |
| | マレーシアリンギット小計 (邦貨換算額:円) | 48,000,000 | 48,936,967.00 (1,589,472,688) | |
| スウェーデンクローナ | SWEDISH GOVRNMNT 1.5 | 15,000,000 | 14,734,350.00 | |

| | | | | |
|---------------------------|-----------------------|-------------|-----------------------------------|--|
| | SWEDISH GOVRNMNT 3 | 11,000,000 | 11,680,900.00 | |
| | SWEDISH GOVRNMNT 3.5 | 5,000,000 | 5,805,800.00 | |
| | SWEDISH GOVRNMNT 3.5 | 10,000,000 | 12,162,900.00 | |
| | SWEDISH GOVRNMNT 3.75 | 13,200,000 | 14,654,640.00 | |
| | SWEDISH GOVRNMNT 4.25 | 15,000,000 | 17,485,350.00 | |
| | SWEDISH GOVRNMNT 4.5 | 13,000,000 | 14,046,500.00 | |
| | SWEDISH GOVRNMNT 5 | 5,000,000 | 6,268,000.00 | |
| | SWEDISH GOVRNMNT 6.75 | 16,100,000 | 17,074,050.00 | |
| スウェーデンクローナ小計 (邦貨換算額:円) | | 103,300,000 | 113,912,490.00 (1,763,365,345) | |
| ノルウェークローネ | NORWEGIAN GOV'T 3.75 | 16,000,000 | 18,164,800.00 | |
| | NORWEGIAN GOV'T 4.25 | 10,000,000 | 11,120,000.00 | |
| | NORWEGIAN GOV'T 4.5 | 6,000,000 | 6,990,000.00 | |
| | NORWEGIAN GOV'T 5 | 12,000,000 | 12,908,400.00 | |
| ノルウェークローネ小計 (邦貨換算額:円) | | 44,000,000 | 49,183,200.00 (849,393,864) | |
| デンマーククローネ | DENMARK - BULLET 2 | 13,000,000 | 13,440,700.00 | |
| | DENMARK - BULLET 3 | 10,000,000 | 11,610,300.00 | |
| | DENMARK - BULLET 4 | 16,000,000 | 17,638,720.00 | |
| | DENMARK - BULLET 4 | 15,000,000 | 17,524,350.00 | |
| | DENMARK - BULLET 4 | 21,000,000 | 25,536,000.00 | |
| | DENMARK - BULLET 4.5 | 24,000,000 | 35,937,600.00 | |
| | DENMARK - BULLET 7 | 5,080,000 | 8,145,272.00 | |
| デンマーククローネ小計 (邦貨換算額:円) | | 104,080,000 | 129,832,942.00 (2,250,004,884) | |
| メキシコペソ | MEXICAN BONOS 7.25 | 70,000,000 | 77,115,360.00 | |
| | MEXICAN BONOS 7.75 | 20,000,000 | 22,898,360.00 | |
| | MEXICAN BONOS 8 | 50,000,000 | 60,813,150.00 | |
| | MEXICAN BONOS 8.5 | 50,000,000 | 67,517,200.00 | |
| | MEXICAN BONOS 8.5 | 55,000,000 | 76,440,705.00 | |
| | MEXICAN BONOS 9.5 | 60,000,000 | 65,331,600.00 | |
| メキシコペソ小計 (邦貨換算額:円) | | 305,000,000 | 370,116,375.00 (3,027,551,947) | |
| ポーランドズロチ | POLAND GOVT BOND 5 | 1,500,000 | 1,514,250.00 | |
| | POLAND GOVT BOND 5 | 4,000,000 | 4,204,000.00 | |
| | POLAND GOVT BOND 5.25 | 8,000,000 | 8,706,400.00 | |
| | POLAND GOVT BOND 5.25 | 5,000,000 | 5,595,000.00 | |
| | POLAND GOVT BOND 5.5 | 8,000,000 | 8,352,000.00 | |
| | POLAND GOVT BOND 5.5 | 6,000,000 | 6,732,000.00 | |
| | POLAND GOVT BOND 5.75 | 8,000,000 | 8,200,000.00 | |
| | POLAND GOVT BOND 5.75 | 4,000,000 | 4,640,000.00 | |
| | POLAND GOVT BOND 5.75 | 10,200,000 | 11,923,800.00 | |
| | POLAND GOVT BOND 6.25 | 7,500,000 | 8,077,500.00 | |
| ポーランドズロチ小計 (邦貨換算額:円) | | 62,200,000 | 67,944,950.00 (2,140,265,925) | |

| | | | | |
|-------------------------|-----------------------|--------------|-----------------------------------|--|
| 南アフリカ ランド | REP SOUTH AFRICA 6.5 | 10,000,000 | 8,311,000.00 | |
| | REP SOUTH AFRICA 6.75 | 40,000,000 | 41,316,000.00 | |
| | REP SOUTH AFRICA 7 | 35,000,000 | 32,788,000.00 | |
| | REP SOUTH AFRICA 8 | 50,000,000 | 54,800,000.00 | |
| | REP SOUTH AFRICA 8.25 | 8,000,000 | 8,794,400.00 | |
| | REP SOUTH AFRICA 8.75 | 8,000,000 | 8,451,040.00 | |
| 南アフリカランド小計 (邦貨換算額:円) | | 151,000,000 | 154,460,440.00 (1,705,243,257) | |
| ユーロ | BELGIAN 0326 4 | 1,000,000 | 1,179,430.00 | |
| | BELGIAN 0282 8 | 2,000,000 | 2,304,460.00 | |
| | BELGIAN 0291 5.5 | 3,000,000 | 4,119,690.00 | |
| | BELGIAN 0300 5.5 | 1,740,000 | 2,102,668.20 | |
| | BELGIAN 0303 4.25 | 2,500,000 | 2,649,875.00 | |
| | BELGIAN 0304 5 | 3,500,000 | 4,712,575.00 | |
| | BELGIAN 0306 3.75 | 2,300,000 | 2,497,455.00 | |
| | BELGIAN 0307 3.25 | 2,500,000 | 2,736,125.00 | |
| | BELGIAN 0308 4 | 3,500,000 | 4,144,280.00 | |
| | BELGIAN 0309 4 | 2,500,000 | 2,825,375.00 | |
| | BELGIAN 0312 4 | 2,000,000 | 2,306,500.00 | |
| | BELGIAN 0315 4 | 2,500,000 | 2,923,000.00 | |
| | BELGIAN 0316 3.5 | 1,500,000 | 1,597,230.00 | |
| | BELGIAN 0318 3.75 | 3,000,000 | 3,494,100.00 | |
| | BELGIAN 0319 2.75 | 2,000,000 | 2,139,160.00 | |
| | BELGIAN 0320 4.25 | 2,000,000 | 2,464,700.00 | |
| | BELGIAN 0321 4.25 | 3,000,000 | 3,615,540.00 | |
| | BELGIAN 0323 3.5 | 2,000,000 | 2,228,700.00 | |
| | BELGIAN 0324 4.5 | 1,000,000 | 1,235,300.00 | |
| | BELGIAN 0325 4.25 | 2,000,000 | 2,406,060.00 | |
| | BELGIAN 0327 3 | 2,000,000 | 2,224,540.00 | |
| | BTAN 1 | 3,500,000 | 3,555,230.00 | |
| | BTAN 1.75 | 3,500,000 | 3,661,175.00 | |
| | BTAN 2 | 5,000,000 | 5,202,400.00 | |
| | BTAN 2.25 | 4,000,000 | 4,221,000.00 | |
| | BTAN 2.5 | 7,200,000 | 7,498,800.00 | |
| | BTAN 2.5 | 3,600,000 | 3,843,828.00 | |
| | BTAN 3 | 5,500,000 | 5,697,725.00 | |
| | BTPS 2.5 | 3,000,000 | 3,046,050.00 | |
| | BTPS 3 | 2,000,000 | 2,038,260.00 | |
| | BTPS 3 | 2,500,000 | 2,560,425.00 | |
| | BTPS 3 | 6,400,000 | 6,540,352.00 | |
| BTPS 3 | 4,000,000 | 4,090,400.00 | | |
| BTPS 3.5 | 4,000,000 | 4,101,200.00 | | |
| BTPS 3.75 | 6,200,000 | 6,431,446.00 | | |
| BTPS 3.75 | 3,000,000 | 3,125,700.00 | | |
| BTPS 3.75 | 4,700,000 | 4,892,465.00 | | |
| BTPS 3.75 | 5,000,000 | 5,011,600.00 | | |
| BTPS 3.75 | 6,300,000 | 6,320,034.00 | | |
| BTPS 4 | 4,500,000 | 4,704,300.00 | | |

| | | | |
|----------------------|-----------|--------------|--|
| BTPS 4 | 4,500,000 | 4,595,400.00 | |
| BTPS 4 | 5,000,000 | 4,410,500.00 | |
| BTPS 4.25 | 3,300,000 | 3,416,655.00 | |
| BTPS 4.25 | 4,900,000 | 5,081,790.00 | |
| BTPS 4.25 | 5,000,000 | 5,232,500.00 | |
| BTPS 4.25 | 5,400,000 | 5,632,092.00 | |
| BTPS 4.25 | 6,000,000 | 6,254,580.00 | |
| BTPS 4.25 | 5,000,000 | 5,177,500.00 | |
| BTPS 4.5 | 6,000,000 | 6,366,120.00 | |
| BTPS 4.5 | 5,000,000 | 5,292,750.00 | |
| BTPS 4.5 | 2,000,000 | 2,109,800.00 | |
| BTPS 4.5 | 3,700,000 | 3,885,111.00 | |
| BTPS 4.5 | 3,000,000 | 3,023,190.00 | |
| BTPS 4.75 | 3,500,000 | 3,752,630.00 | |
| BTPS 4.75 | 4,000,000 | 4,271,720.00 | |
| BTPS 4.75 | 2,000,000 | 2,135,960.00 | |
| BTPS 4.75 | 6,000,000 | 6,358,200.00 | |
| BTPS 4.75 | 5,500,000 | 5,722,310.00 | |
| BTPS 5 | 2,000,000 | 2,136,900.00 | |
| BTPS 5 | 5,000,000 | 5,230,750.00 | |
| BTPS 5 | 3,970,000 | 4,016,647.50 | |
| BTPS 5 | 4,000,000 | 4,005,920.00 | |
| BTPS 5 | 4,000,000 | 3,989,400.00 | |
| BTPS 5.25 | 5,000,000 | 5,452,500.00 | |
| BTPS 5.25 | 5,700,000 | 5,979,756.00 | |
| BTPS 5.5 | 5,000,000 | 5,480,500.00 | |
| BTPS 5.5 | 3,000,000 | 3,285,390.00 | |
| BTPS 5.75 | 2,700,000 | 2,967,921.00 | |
| BTPS 6 | 1,000,000 | 1,070,600.00 | |
| BTPS 6 | 5,600,000 | 6,308,848.00 | |
| BTPS 6.5 | 5,960,000 | 7,011,165.20 | |
| BTPS 7.25 | 2,000,000 | 2,506,660.00 | |
| BTPS 9 | 2,000,000 | 2,775,260.00 | |
| BUNDESUBL-154 2.25 | 4,000,000 | 4,088,200.00 | |
| BUNDESUBL-155 2.5 | 4,000,000 | 4,147,800.00 | |
| BUNDESUBL-156 2.5 | 4,500,000 | 4,709,385.00 | |
| BUNDESUBL-157 2.25 | 5,500,000 | 5,743,925.00 | |
| BUNDESUBL-158 1.75 | 4,000,000 | 4,171,200.00 | |
| BUNDESUBL-159 2 | 3,000,000 | 3,167,550.00 | |
| BUNDESUBL-160 2.75 | 4,000,000 | 4,320,000.00 | |
| BUNDESUBL-161 1.25 | 2,000,000 | 2,079,760.00 | |
| BUNDESUBL-162 0.75 | 2,500,000 | 2,556,325.00 | |
| BUNDESUBL-163 0.5 | 5,000,000 | 5,063,900.00 | |
| BUNDESUBL-164 0.5 | 3,000,000 | 3,033,450.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 1.5 | 3,000,000 | 3,081,540.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 1.5 | 3,500,000 | 3,577,280.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 1.75 | 3,500,000 | 3,683,050.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 2 | 2,000,000 | 2,158,060.00 | |

| | | | |
|-----------------------|-----------|--------------|--|
| DEUTSCHLAND REP 2.25 | 3,500,000 | 3,877,475.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 2.25 | 3,000,000 | 3,309,240.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 2.5 | 4,000,000 | 4,503,520.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 2.5 | 2,000,000 | 2,141,000.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 3 | 4,000,000 | 4,645,920.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 3.25 | 5,500,000 | 5,893,525.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 3.25 | 4,000,000 | 4,693,920.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 3.25 | 3,000,000 | 3,550,500.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 3.25 | 3,000,000 | 3,709,650.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 3.5 | 5,200,000 | 5,688,280.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 3.5 | 5,000,000 | 5,911,150.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 3.75 | 6,000,000 | 6,387,000.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 3.75 | 4,000,000 | 4,537,720.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 3.75 | 5,000,000 | 5,933,900.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 4 | 3,900,000 | 4,389,762.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 4 | 6,000,000 | 7,049,580.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 4 | 4,200,000 | 5,654,796.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 4.25 | 6,500,000 | 6,834,750.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 4.25 | 4,000,000 | 4,679,920.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 4.25 | 4,200,000 | 5,045,250.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 4.25 | 2,500,000 | 3,556,950.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 4.75 | 2,300,000 | 3,187,179.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 4.75 | 3,100,000 | 4,512,143.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 4.75 | 3,000,000 | 4,608,150.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 5.5 | 3,300,000 | 5,022,105.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 5.625 | 2,980,000 | 4,451,613.40 | |
| DEUTSCHLAND REP 6 | 890,000 | 1,056,367.70 | |
| DEUTSCHLAND REP 6.25 | 1,200,000 | 1,790,280.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 6.25 | 1,700,000 | 2,745,976.00 | |
| DEUTSCHLAND REP 6.5 | 2,000,000 | 3,206,460.00 | |
| FINNISH GOV'T 1.625 | 2,000,000 | 2,027,560.00 | |
| FINNISH GOV'T 1.75 | 1,200,000 | 1,255,800.00 | |
| FINNISH GOV'T 3.125 | 1,500,000 | 1,565,850.00 | |
| FINNISH GOV'T 3.375 | 1,200,000 | 1,390,956.00 | |
| FINNISH GOV'T 3.5 | 1,000,000 | 1,172,830.00 | |
| FINNISH GOV'T 3.875 | 2,000,000 | 2,294,540.00 | |
| FINNISH GOV'T 4 | 1,000,000 | 1,235,400.00 | |
| FINNISH GOV'T 4.25 | 1,300,000 | 1,419,574.00 | |
| FINNISH GOV'T 4.375 | 1,000,000 | 1,213,570.00 | |
| FRANCE O.A.T. 2.25 | 1,000,000 | 1,038,600.00 | |
| FRANCE O.A.T. 2.5 | 5,500,000 | 5,977,290.00 | |
| FRANCE O.A.T. 3 | 7,200,000 | 7,702,560.00 | |
| FRANCE O.A.T. 3 | 8,000,000 | 8,879,040.00 | |
| FRANCE O.A.T. 3.25 | 6,700,000 | 7,282,565.00 | |
| FRANCE O.A.T. 3.25 | 7,000,000 | 7,953,960.00 | |
| FRANCE O.A.T. 3.5 | 5,600,000 | 5,977,608.00 | |
| FRANCE O.A.T. 3.5 | 6,000,000 | 6,943,800.00 | |
| FRANCE O.A.T. 3.5 | 6,000,000 | 6,815,580.00 | |

| | | | |
|-----------------------|-----------|--------------|--|
| FRANCE O.A.T. 3.75 | 5,000,000 | 5,635,750.00 | |
| FRANCE O.A.T. 3.75 | 5,000,000 | 5,853,650.00 | |
| FRANCE O.A.T. 3.75 | 5,700,000 | 6,704,625.00 | |
| FRANCE O.A.T. 4 | 5,300,000 | 5,512,954.00 | |
| FRANCE O.A.T. 4 | 5,000,000 | 5,296,250.00 | |
| FRANCE O.A.T. 4 | 4,000,000 | 4,644,080.00 | |
| FRANCE O.A.T. 4 | 4,700,000 | 5,625,571.00 | |
| FRANCE O.A.T. 4 | 2,870,000 | 3,477,492.90 | |
| FRANCE O.A.T. 4 | 2,000,000 | 2,436,600.00 | |
| FRANCE O.A.T. 4.25 | 4,500,000 | 5,220,810.00 | |
| FRANCE O.A.T. 4.25 | 5,000,000 | 5,919,900.00 | |
| FRANCE O.A.T. 4.25 | 7,400,000 | 8,835,970.00 | |
| FRANCE O.A.T. 4.25 | 7,000,000 | 8,497,510.00 | |
| FRANCE O.A.T. 4.5 | 4,700,000 | 6,092,516.00 | |
| FRANCE O.A.T. 4.75 | 3,600,000 | 4,765,860.00 | |
| FRANCE O.A.T. 5 | 5,600,000 | 6,489,280.00 | |
| FRANCE O.A.T. 5.5 | 5,500,000 | 7,672,115.00 | |
| FRANCE O.A.T. 5.75 | 4,700,000 | 6,911,350.00 | |
| FRANCE O.A.T. 6 | 3,500,000 | 4,956,525.00 | |
| FRANCE O.A.T. 8.5 | 2,550,000 | 3,754,747.50 | |
| FRANCE O.A.T. 8.5 | 2,200,000 | 3,536,676.00 | |
| IRISH GOVT 4.4 | 1,500,000 | 1,602,600.00 | |
| IRISH GOVT 4.5 | 2,000,000 | 2,167,400.00 | |
| IRISH GOVT 4.5 | 2,490,000 | 2,655,037.20 | |
| IRISH GOVT 4.6 | 1,800,000 | 1,951,434.00 | |
| IRISH GOVT 5 | 2,000,000 | 2,194,260.00 | |
| IRISH GOVT 5.4 | 2,000,000 | 2,231,660.00 | |
| IRISH GOVT 5.5 | 3,000,000 | 3,367,740.00 | |
| IRISH GOVT 5.9 | 2,000,000 | 2,300,300.00 | |
| ITALY GOV'T INT 5.75 | 1,000,000 | 1,092,400.00 | |
| NETHERLANDS GOVT 0.75 | 2,000,000 | 2,025,900.00 | |
| NETHERLANDS GOVT 1.25 | 1,500,000 | 1,543,020.00 | |
| NETHERLANDS GOVT 2.25 | 3,000,000 | 3,194,550.00 | |
| NETHERLANDS GOVT 2.5 | 3,000,000 | 3,230,340.00 | |
| NETHERLANDS GOVT 2.5 | 1,600,000 | 1,641,760.00 | |
| NETHERLANDS GOVT 2.75 | 3,500,000 | 3,663,730.00 | |
| NETHERLANDS GOVT 3.25 | 3,600,000 | 3,852,108.00 | |
| NETHERLANDS GOVT 3.25 | 3,500,000 | 4,032,000.00 | |
| NETHERLANDS GOVT 3.5 | 3,000,000 | 3,500,340.00 | |
| NETHERLANDS GOVT 3.75 | 3,400,000 | 3,557,522.00 | |
| NETHERLANDS GOVT 3.75 | 2,000,000 | 2,392,100.00 | |
| NETHERLANDS GOVT 3.75 | 2,500,000 | 3,190,500.00 | |
| NETHERLANDS GOVT 4 | 3,300,000 | 3,692,370.00 | |
| NETHERLANDS GOVT 4 | 3,500,000 | 4,090,730.00 | |
| NETHERLANDS GOVT 4 | 1,500,000 | 1,782,195.00 | |
| NETHERLANDS GOVT 4 | 2,700,000 | 3,489,021.00 | |
| NETHERLANDS GOVT 4.5 | 3,000,000 | 3,500,700.00 | |
| NETHERLANDS GOVT 5.5 | 2,500,000 | 3,570,325.00 | |

| | | | |
|--------------------------------|-------------|-----------------|-------------------|
| NETHERLANDS GOVT 7.5 | 1,000,000 | 1,538,100.00 | |
| REP OF AUSTRIA 3.15 | 1,000,000 | 1,126,450.00 | |
| REP OF AUSTRIA 3.2 | 2,700,000 | 2,977,965.00 | |
| REP OF AUSTRIA 3.4 | 2,000,000 | 2,100,660.00 | |
| REP OF AUSTRIA 3.5 | 3,200,000 | 3,438,880.00 | |
| REP OF AUSTRIA 3.5 | 3,000,000 | 3,504,150.00 | |
| REP OF AUSTRIA 3.65 | 2,000,000 | 2,359,900.00 | |
| REP OF AUSTRIA 3.9 | 3,000,000 | 3,570,450.00 | |
| REP OF AUSTRIA 4 | 1,000,000 | 1,122,550.00 | |
| REP OF AUSTRIA 4.15 | 1,800,000 | 2,339,730.00 | |
| REP OF AUSTRIA 4.3 | 2,400,000 | 2,526,912.00 | |
| REP OF AUSTRIA 4.3 | 1,500,000 | 1,742,505.00 | |
| REP OF AUSTRIA 4.35 | 2,200,000 | 2,639,010.00 | |
| REP OF AUSTRIA 4.65 | 2,000,000 | 2,374,160.00 | |
| REP OF AUSTRIA 4.85 | 2,000,000 | 2,640,500.00 | |
| REP OF AUSTRIA 6.25 | 1,500,000 | 2,263,995.00 | |
| SPANISH GOV'T 3 | 6,000,000 | 6,100,680.00 | |
| SPANISH GOV'T 3.15 | 3,800,000 | 3,858,520.00 | |
| SPANISH GOV'T 3.25 | 5,000,000 | 5,075,750.00 | |
| SPANISH GOV'T 3.3 | 5,000,000 | 5,116,750.00 | |
| SPANISH GOV'T 3.4 | 1,000,000 | 1,021,750.00 | |
| SPANISH GOV'T 3.75 | 2,000,000 | 2,060,600.00 | |
| SPANISH GOV'T 3.8 | 4,500,000 | 4,618,125.00 | |
| SPANISH GOV'T 4 | 2,500,000 | 2,590,700.00 | |
| SPANISH GOV'T 4 | 4,000,000 | 4,004,080.00 | |
| SPANISH GOV'T 4.1 | 3,000,000 | 3,094,200.00 | |
| SPANISH GOV'T 4.2 | 3,250,000 | 2,761,622.50 | |
| SPANISH GOV'T 4.25 | 4,000,000 | 4,164,320.00 | |
| SPANISH GOV'T 4.3 | 4,000,000 | 4,111,680.00 | |
| SPANISH GOV'T 4.4 | 3,800,000 | 3,965,604.00 | |
| SPANISH GOV'T 4.5 | 1,500,000 | 1,573,170.00 | |
| SPANISH GOV'T 4.6 | 3,500,000 | 3,669,680.00 | |
| SPANISH GOV'T 4.65 | 2,500,000 | 2,439,200.00 | |
| SPANISH GOV'T 4.7 | 2,000,000 | 1,820,200.00 | |
| SPANISH GOV'T 4.75 | 3,500,000 | 3,643,255.00 | |
| SPANISH GOV'T 4.8 | 3,300,000 | 3,304,290.00 | |
| SPANISH GOV'T 4.85 | 4,000,000 | 4,173,520.00 | |
| SPANISH GOV'T 4.9 | 4,000,000 | 3,757,800.00 | |
| SPANISH GOV'T 5.4 | 1,000,000 | 1,055,380.00 | |
| SPANISH GOV'T 5.5 | 3,380,000 | 3,691,399.40 | |
| SPANISH GOV'T 5.5 | 4,000,000 | 4,327,000.00 | |
| SPANISH GOV'T 5.75 | 2,700,000 | 2,891,565.00 | |
| SPANISH GOV'T 5.85 | 3,500,000 | 3,833,025.00 | |
| SPANISH GOV'T 5.9 | 1,000,000 | 1,086,600.00 | |
| SPANISH GOV'T 6 | 2,400,000 | 2,638,152.00 | |
| Σ 一口小計 (邦貨換算額 : 円) | 784,980,000 | 875,755,578.50 | (113,156,378,297) |
| 国債証券合計 | | 272,837,427,371 | |

| | | | |
|--------------------|--|-------------------|--|
| | | (272,837,427,371) | |
| 合計 | | 272,837,427,371 | |
| (外貨建有価証券邦貨換算額合計：円) | | (272,837,427,371) | |

(注)金額欄の()内は、外貨建有価証券にかかるもので、内書きであります。

| 通貨 | 銘柄数 | | 組入債券時価比率 | 合計金額に対する比率 |
|------------|------|-------|----------|------------|
| 米ドル | 国債証券 | 187銘柄 | 40.3% | 41.0% |
| カナダドル | 国債証券 | 28銘柄 | 2.7% | 2.7% |
| オーストラリアドル | 国債証券 | 15銘柄 | 1.6% | 1.6% |
| 英ポンド | 国債証券 | 34銘柄 | 7.3% | 7.5% |
| スイスフラン | 国債証券 | 7銘柄 | 0.4% | 0.4% |
| シンガポールドル | 国債証券 | 8銘柄 | 0.4% | 0.4% |
| マレーシアリングット | 国債証券 | 8銘柄 | 0.6% | 0.6% |
| スウェーデンクローナ | 国債証券 | 9銘柄 | 0.6% | 0.6% |
| ノルウェークローネ | 国債証券 | 4銘柄 | 0.3% | 0.3% |
| デンマーククローネ | 国債証券 | 7銘柄 | 0.8% | 0.8% |
| メキシコペソ | 国債証券 | 6銘柄 | 1.1% | 1.1% |
| ポーランドズロチ | 国債証券 | 10銘柄 | 0.8% | 0.8% |
| 南アフリカランド | 国債証券 | 6銘柄 | 0.6% | 0.6% |
| ユーロ | 国債証券 | 229銘柄 | 40.7% | 41.5% |

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

「マネーインカム・マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

(単位：円)

| | (平成24年 4月13日現在) | (平成25年 4月15日現在) |
|--------------|-----------------|-----------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 165,585,215 | 15,987,599 |
| 国債証券 | 1,679,805,940 | 1,604,735,000 |
| 未収入金 | | 15,010,500 |
| 未収利息 | 2,897,710 | 2,507,625 |
| 前払費用 | 1,551,580 | 532,355 |
| 流動資産合計 | 1,849,840,445 | 1,638,773,079 |
| 資産合計 | 1,849,840,445 | 1,638,773,079 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払金 | 143,038,765 | |
| 未払解約金 | 4,300,000 | 5,000,000 |
| 流動負債合計 | 147,338,765 | 5,000,000 |
| 負債合計 | 147,338,765 | 5,000,000 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1,686,382,428 | 1,616,825,023 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金 () | 16,119,252 | 16,948,056 |
| 元本等合計 | 1,702,501,680 | 1,633,773,079 |
| 純資産合計 | 1,702,501,680 | 1,633,773,079 |
| 負債純資産合計 | 1,849,840,445 | 1,638,773,079 |

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

| 項目 | 自平成24年 4月14日 至平成25年 4月15日 |
|-----------------|--|
| 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>国債証券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p> |

（貸借対照表に関する注記）

| 項目 | （平成24年 4月13日現在） | （平成25年 4月15日現在） |
|---------------|---|---|
| 1. 受益権総数 | 平成24年 4月13日における受益権の総数 1,686,382,428口 | 平成25年 4月15日における受益権の総数 1,616,825,023口 |
| 2. 1単位当たり純資産額 | 1.0096円 （1万口 = 10,096円） | 1.0105円 （1万口 = 10,105円） |

（金融商品に関する注記）

. 金融商品の状況に関する事項

| 項目 | 自 平成24年 4月14日 至 平成25年 4月15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。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクがあります。</p> |

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

・金融商品の時価等に関する事項

| 項目 | (平成25年 4月15日現在) |
|--------------------|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 | 金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | <p>(1) 有価証券（国債証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p> |

（デリバティブ取引に関する注記）

（平成24年4月13日現在）

該当事項はありません。

（平成25年4月15日現在）

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

（自平成23年4月14日 至 平成24年4月13日）

該当事項はありません。

（自平成24年4月14日 至 平成25年4月15日）

該当事項はありません。

（その他の注記）

（平成24年 4月13日現在）

| | |
|---------------------------------|----------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 597,626,140円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 2,070,756,966円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 982,000,678円 |
| 平成24年 4月13日現在の元本の内訳 | |
| スミセイ・DCバランスファンド（機動的資産配分型） | 11,075,069円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020 | 2,370,421円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025 | 577,171円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030 | 430,534円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035 | 482,929円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040 | 403,456円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045 | 276,183円 |
| 三井住友・ロシア株式オープン | 999,001円 |
| SMA M円高期待ファンド（豪ドル安型） | 11,709,408円 |
| SMA M円高期待ファンド（米ドル安型） | 8,145,059円 |
| SMA M円高期待ファンド（ユーロ安型） | 11,707,385円 |
| アジア高成長国CBファンド | 29,767,812円 |
| 日興ニューバーガー米国小型ハイクオリティファンド（毎月決算型） | 99,128円 |
| 日興ニューバーガー米国小型ハイクオリティファンド（資産成長型） | 297,384円 |
| SMA M・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞ | 239,009,345円 |
| SMA M・バランス先物ファンドVA20＜適格機関投資家限定＞ | 793,236,688円 |
| SMA M・FGマネーファンドVA＜適格機関投資家限定＞ | 575,795,455円 |
| 合計 | 1,686,382,428円 |

（平成25年 4月15日現在）

| | |
|---------------------|----------------|
| 開示対象ファンドの | |
| 期首における当該親投資信託の元本額 | 1,686,382,428円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 1,004,956,000円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 1,074,513,405円 |
| 平成25年 4月15日現在の元本の内訳 | |

| | |
|--------------------------------------|----------------|
| スミセイ・DCバランスファンド(機動的資産配分型) | 16,635,103円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020 | 4,356,694円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025 | 970,112円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030 | 701,739円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035 | 812,495円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040 | 203,309円 |
| スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045 | 564,167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) | 22,893,420円 |
| S M A M円高期待ファンド(米ドル安型) | 4,184,319円 |
| S M A M円高期待ファンド(ユーロ安型) | 33,673,483円 |
| アジア高成長国C Bファンド | 29,767,812円 |
| 日興ニューバーガー米国小型ハイクオリティファンド(毎月決算型) | 99,128円 |
| 日興ニューバーガー米国小型ハイクオリティファンド(資産成長型) | 297,384円 |
| S M A M・マネーインカムファンド<適格機関投資家限定> | 266,730,509円 |
| S M A M・バランス先物ファンドV A 2 0<適格機関投資家限定> | 829,775,000円 |
| S M A M・F GマネーファンドV A<適格機関投資家限定> | 404,161,348円 |
| 合計 | 1,616,825,023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250回利付国債(10年) | 775,000,000 | 775,542,500 | |
| | 第253回利付国債(10年) | 274,000,000 | 275,753,600 | |
| | 第256回利付国債(10年) | 274,000,000 | 276,408,460 | |
| | 第258回利付国債(10年) | 274,000,000 | 277,030,440 | |
| | 国債証券 小計 | 1,597,000,000 | 1,604,735,000 | |
| 合計 | | 1,597,000,000 | 1,604,735,000 | |

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

独立監査人の監査報告書

平成25年5月28日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 鈴木 敏夫 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているスミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040の平成24年4月14日から平成25年4月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040の平成25年4月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

[委託会社の監査報告書\(当期\)へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成25年6月14日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 鈴木 敏夫

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 辰巳 幸久

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理の状況」に掲げられている三井住友アセットマネジメント株式会社の平成24年4月1日から平成25年3月31日までの第28期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友アセットマネジメント株式会社の平成25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。

強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、会社は平成24年9月28日に、トヨタアセットマネジメント株式会社、トヨタファイナンシャルサービス株式会社、あいおいニッセイ同和損害保険株式会社、三井住友海上火災保険株式会社と、平成25年4月1日を効力発生日としてトヨタアセットマネジメント株式会社と経営統合する旨の合意書を締結し、平成25年1月17日の合併契約書の締結を経て、平成25年4月1日に合併が成立した。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以上

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