

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成21年7月9日
【計算期間】	第1期（自 平成20年3月31日 至 平成21年4月13日）
【ファンド名】	スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040
【発行者名】	三井住友アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 前田 良治
【本店の所在の場所】	東京都港区愛宕二丁目5番1号
【事務連絡者氏名】	古池 典生
【連絡場所】	東京都港区愛宕二丁目5番1号
【電話番号】	03-5405-0739
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部【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、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。

《商品分類表》

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単位型	国内	株式
	海外	債券
追加型	内外	不動産投信
		その他資産
		(資産複合)

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

《属性区分表》

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式一般	年1回	グローバル (日本を含む)	3/234	

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

（２）【ファンドの仕組み】

イ 当ファンドの関係法人とその役割

（イ）委託会社 「三井住友アセットマネジメント株式会社」

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

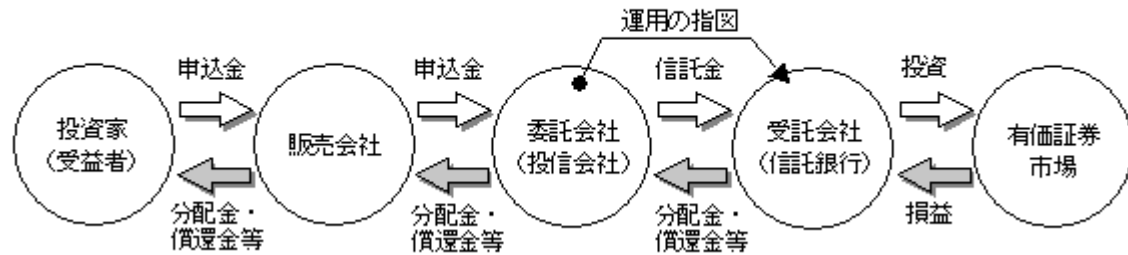
（ロ）受託会社 「住友信託銀行株式会社」

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

(ハ) 販売会社

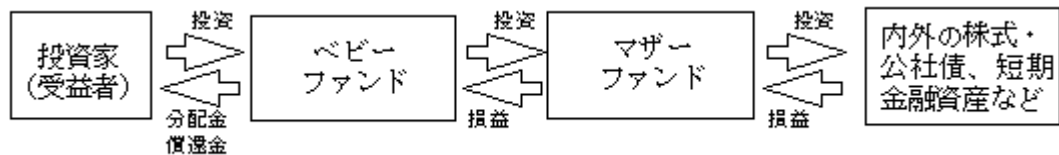
委託会社との間で締結される販売契約（名称の如何を問いません。）に基づき、当ファンドの募集・販売の取扱い、投資信託説明書（目論見書）の提供、受益者からの一部解約実行請求の受付け、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を行います。

運営の仕組み



※ 当ファンドの運用は、「ファミリーファンド方式」で行われます。

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



ロ 委託会社の概況

(イ) 資本金の額

2,000百万円（平成21年5月29日現在）

(ロ) 会社の沿革

昭和60年7月 三生投資顧問株式会社設立

昭和62年2月 証券投資顧問業の登録

昭和62年6月 投資一任契約にかかる業務の認可

平成11年1月 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 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 証券投資信託委託業の認可取得

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

(ハ) 大株主の状況

(平成21年5月29日現在)

名称	住所	所有 株式数	比率 (%)
住友生命保険相互会社	大阪府大阪市中央区城見一丁目4番35号	7,056	40.0
三井住友海上火災保険株式会社	東京都中央区新川二丁目27番2号	4,851	27.5
株式会社三井住友銀行	東京都千代田区有楽町一丁目1番2号	4,851	27.5
三井生命保険株式会社	東京都千代田区大手町一丁目2番3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。

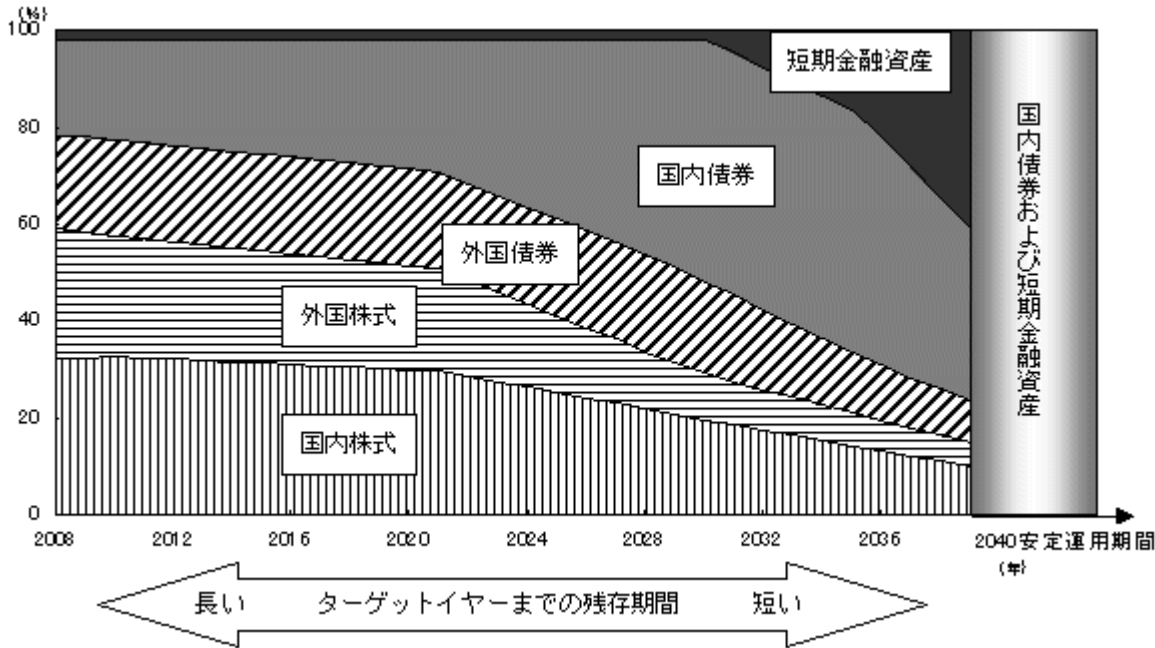
なお、ターゲットイヤー到達後は、主として国内債券パッシブ・マザーファンドおよびマネーインカム・マザーファンドに投資することにより安定した収益の獲得を目指します。

（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、原則として為替ヘッジを行いません。

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

基本資産配分のイメージ図



※上記の図は、各決算時点での基本資産配分を表しています。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。

2009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
32.5%	20.5%	25%	20%	2%

<各マザーファンドの運用プロセス>

○国内株式インデックス・マザーファンド（B号）

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

○国内債券パッシブ・マザーファンド

わが国の公社債および短期金融資産を主要投資対象とし、NOMURA－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当社独自のリスクモデルを併用して、ファンド規模に応じデュレーション、満期構成、セクター（債券種別）配分、事業債の格付け構成および業種を可能な限りNOMURA－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、当社クレジットアナリストの調査結果に基づき、将来的に格下げによりベンチマーク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当社独自のリスクモデルを使用してポートフォリオのリバランスを行います。

○外国株式インデックス・マザーファンド

主として日本を除く世界各国の株式に投資し、MSCI－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。

○外国債券パッシブ・マザーファンド

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

○マネーインカム・マザーファンド

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

（２）【投資対象】**イ 投資対象とする資産の種類**

当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

- １．有価証券
- ２．デリバティブ取引にかかる権利
- ３．約束手形
- ４．金銭債権

（ロ）特定資産以外の資産で、以下に掲げる資産

- １．為替手形

ロ 投資対象とする有価証券

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

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

16. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）
17. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
19. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
20. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
21. 外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

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

ハ 投資対象とする金融商品

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

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

（３）【運用体制】**イ 運用体制**

当ファンドの運用は、次のプロセスに基づいて行われます。

（イ）計画（Plan）

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

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

（ロ）実行（Do）

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

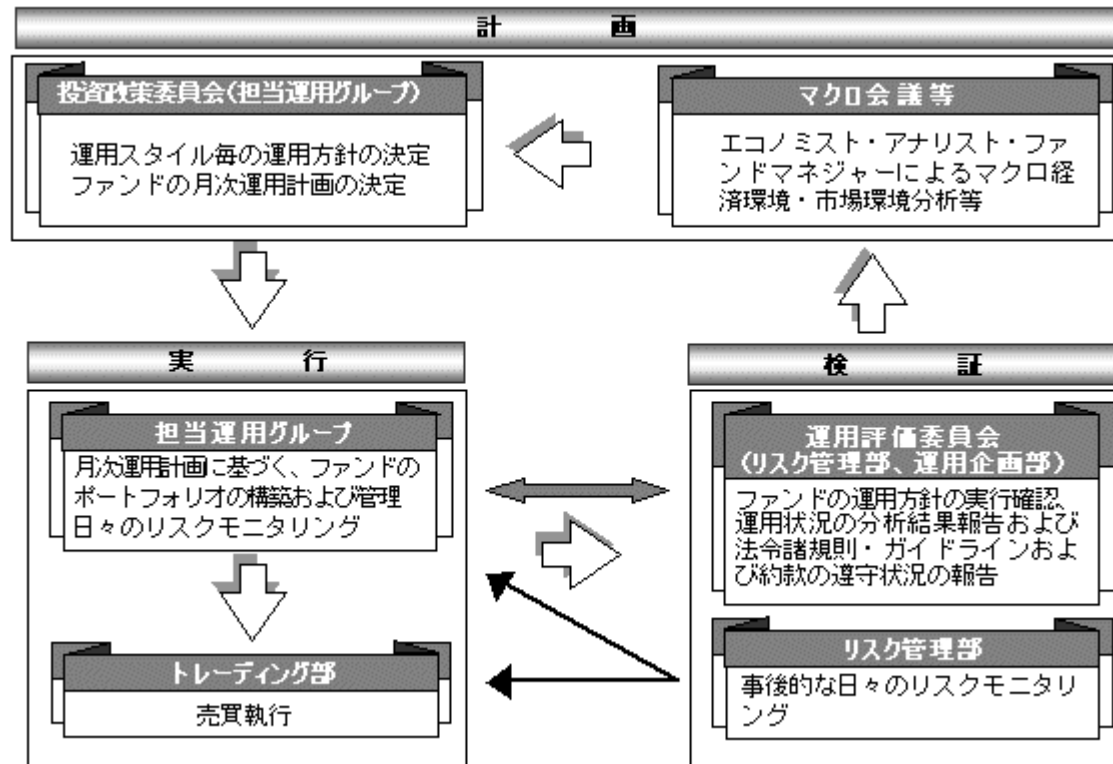
売買執行については、組織的に分離されたトレーディング部が、最良と思われる手法をもって売買を執行します。

（ハ）検証（Check）

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

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

【ファンドの運用体制】



※リスク管理部は8名程度、運用企画部は8名程度で構成されています。

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

ロ 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制

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

（４）【分配方針】

毎年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。）に、原則として以下の方針に基づき収益分配を行います。

- イ 分配対象額は、経費控除後の配当等収益と有価証券売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ロ 収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合等には、委託会社の判断により収益分配を行わない場合があります。
- ハ 留保益の運用については、前記「（１）投資方針」に基づいて運用を行います。

（５）【投資制限】**Ⅰ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限**

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

Ⅱ ファンドの信託約款に基づくその他の投資制限**イ 投資する株式等の範囲**

- （イ）委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場している株式の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- （ロ）上記（イ）にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録することが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができるものとします。

ロ 信用取引の指図

- （イ）委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- （ロ）信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付けにかかる建玉の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- （ハ）上記（ロ）において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該売付けにかかる建玉の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
- （ニ）信託財産の一部解約等の事由により、上記（ロ）の売付けにかかる建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

ハ 先物取引等の指図

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

ニ スワップ取引の指図

- （イ）委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
- （ロ）スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- （ハ）スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会

社は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。

- (ニ) スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額により行うものとします。
- (ホ) 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、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。

ヘ 有価証券の貸付けの指図

（イ）委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。

1. 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
2. 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。

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

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

ト 有価証券の空売りの指図

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

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

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

チ 有価証券の借入れの指図

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

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

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

（ニ）借入れにかかる品借料は、信託財産中から支弁します。

リ 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

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

ヌ 外国為替予約取引の指図

- (イ) 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、ならびに信託財産に属する資産の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- (ロ) 上記(イ)の予約取引の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- (ハ) 上記(ロ)の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。
- (ニ) 上記(ロ)において、信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

ル 資金の借入れ

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

III 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、T O P I X（東証株価指数、配当込み）と連動する投資成果を目指して運用を行います。

ロ 投資態度

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

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

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

（2）投資対象**イ 投資対象とする資産の種類**

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

ロ 投資対象とする有価証券

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

ハ 投資対象とする金融商品

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

（3）投資制限**イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限**

（イ）外貨建資産への投資は行いません。

（ロ）株式への投資割合には制限を設けません。

ロ 法令に基づく投資制限

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

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

（２）投資対象**イ 投資対象とする資産の種類**

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

ロ 投資対象とする有価証券

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

ハ 投資対象とする金融商品

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

（３）投資制限**イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限**

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

ロ 法令に基づく投資制限

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

(外国株式インデックス・マザーファンド)**(1) 投資方針等****イ 基本方針**

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

ロ 投資態度

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

（ロ）外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行わないものとします。

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

(2) 投資対象**イ 投資対象とする資産の種類**

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

ロ 投資対象とする有価証券

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

ハ 投資対象とする金融商品

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

(3) 投資制限**イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限**

（イ）株式への投資割合には制限を設けません。

（ロ）外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

ロ 法令に基づく投資制限

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

(外国債券パッシブ・マザーファンド)**(1) 投資方針等****イ 基本方針**

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

ロ 投資態度

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

(2) 投資対象**イ 投資対象とする資産の種類**

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

ロ 投資対象とする有価証券

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

ハ 投資対象とする金融商品

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

(3) 投資制限**イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限**

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

内とします。

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

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

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

ロ 法令に基づく投資制限

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

（マネーインカム・マザーファンド）**（１）投資方針等****イ 基本方針**

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

ロ 投資態度

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

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

（２）投資対象**イ 投資対象とする資産の種類**

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

ロ 投資対象とする有価証券

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

ハ 投資対象とする金融商品

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

（３）投資制限**イ ファンドの信託約款に基づく主要な投資制限**

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

（ロ）投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

（ハ）外貨建資産への投資は行いません。

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

ロ 法令に基づく投資制限

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

3【投資リスク】

イ ファンドのもつリスクの特性

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

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

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

（イ）株式市場リスク

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

（ロ）債券市場リスク

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

（ハ）為替変動リスク

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

（ニ）信用リスク

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

（ホ）カントリーリスク

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

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

（ヘ）市場流動性リスク

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

（ト）ファミリーファンド方式にかかる留意点

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

ロ 投資リスクの管理体制

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

4【手数料等及び税金】

（１）【申込手数料】

無手数料です。

（２）【換金（解約）手数料】

解約手数料はありません。

（３）【信託報酬等】

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

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

信託報酬の実質的配分は以下の通りです。

決算期	総額	委託会社	販売会社	受託会社
第１期～第32期	年0.441% (0.42%)	年0.1995% (0.19%)	年0.21% (0.20%)	年0.0315% (0.03%)
第33期以降	年0.2205% (0.21%)	年0.084% (0.08%)	年0.105% (0.10%)	年0.0315% (0.03%)

※（ ）内は税抜き。

（４）【その他の手数料等】

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

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

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

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

※ 上記（１）～（４）にかかる手数料等の合計額、その上限額、計算方法等は、手数料等に保有期間に応じて異なるものが含まれていたり、発生時・請求時に初めて具体的金額を認識するものがあ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) 受益者が特別分配金を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該特別分配金を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「特別分配金」については、下記の（収益分配金の課税について）を参照。）

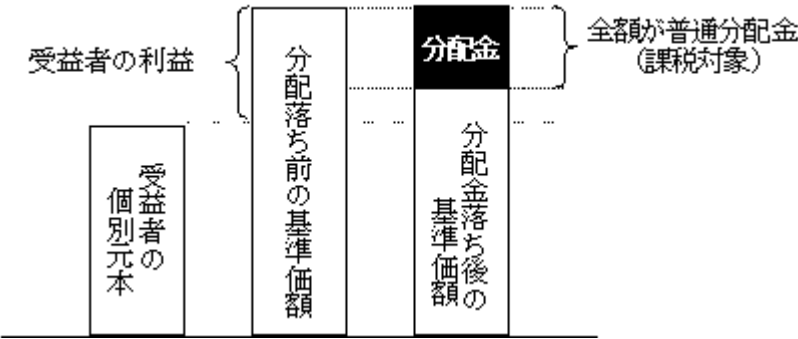
ロ 一部解約時および償還時の課税について

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

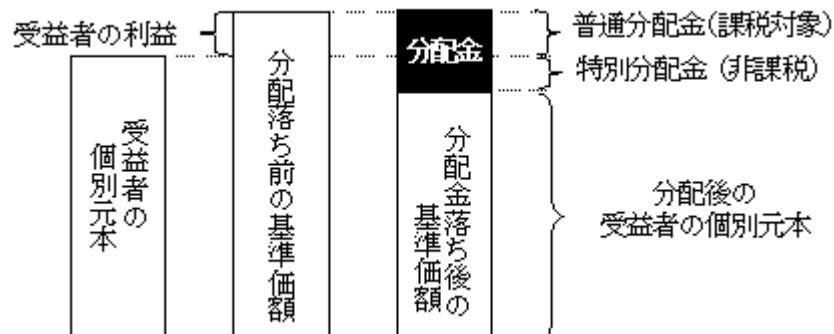
ハ 収益分配金の課税について

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

- ①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。



②収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が特別分配金となり、当該収益分配金から当該特別分配金を控除した額が普通分配金となります。なお、受益者が特別分配金を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該特別分配金を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。



※上記①、②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

i. 収益分配時

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

ii. 一部解約時および償還時

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

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

(ロ) 法人の受益者に対する課税

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

当ファンドは、受取配当にかかる益金不算入制度の適用はありません。

※当ファンドの外貨建資産割合および非株式割合

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%以下とします。

非株式割合に関する制限はありません（約款規定なし）。

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

※上記「(5)課税上の取扱い」ほか税制に関する本書の記載は、平成21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21年５月29日現在

資産の種類	国／地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）受益証券	日本	266,307	32.56
国内債券パッシブ・マザーファンド受益証券	日本	164,337	20.09
外国株式インデックス・マザーファンド受益証券	日本	209,176	25.57
外国債券パッシブ・マザーファンド受益証券	日本	160,989	19.68
マネーインカム・マザーファンド受益証券	日本	16,106	1.97
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,075	0.13
合計(純資産総額)		817,990	100.00

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

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

イ 主要投資銘柄

平成21年５月29日現在

国／ 地域	種類	銘柄名	数量（口）	帳簿価額 単価／金額 (円)	評価額 単価／金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託 受益証券	国内株式インデックス・ マザーファンド（Ｂ号）	232,360	1.0841 251,902	1.1461 266,307	32.56
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	195,895	0.9926 194,446	1.0678 209,176	25.57
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	157,789	1.0387 163,902	1.0415 164,337	20.09
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	132,480	1.2245 162,235	1.2152 160,989	19.68
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	16,010	1.0055 16,099	1.0060 16,106	1.97

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21年 5 月29日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.87
合計	99.87

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【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】**①【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
第１期（平成21年４月13日）（分配付）	789,754	7,898
平成20年５月末日	1,074,570	10,746
平成20年６月末日	1,037,315	10,373
平成20年７月末日	1,037,900	10,379
平成20年８月末日	1,023,853	10,239
平成20年９月末日	917,807	9,178
平成20年10月末日	791,126	7,911
平成20年11月末日	763,337	7,633
平成20年12月末日	768,607	7,686
平成21年１月末日	722,493	7,225
平成21年２月末日	721,251	7,213
平成21年３月末日	743,588	7,436
平成21年４月末日	787,054	7,871
平成21年５月末日	817,990	8,180

②【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

③【収益率の推移】

計算期間	収益率 (%)
第１期	△21.0

（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。

【参考情報：マザーファンドの投資状況・投資資産】

【国内株式インデックス・マザーファンド（B号）】

（１）投資状況

平成21年５月29日現在

資産の種類	国／地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	日本	280,301,942,440	97.95
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		5,875,974,545	2.05
合計(純資産総額)		286,177,916,985	100.00

※当ファンドは、平成21年５月29日現在、株価指数先物取引を買建てしており、その評価額は5,847,615,000円（投資比率2.04%）です。

（２）投資資産

① 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21年５月29日現在

国／ 地域	種類	銘柄名／業種	数量 (株)	帳簿価額 単価／金額 (円)	評価額 単価／金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車 〔輸送用機器〕	3,136,300	2,970.69 9,316,975,047	3,810.00 11,949,303,000	4.18
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ 〔銀行業〕	14,129,300	503.53 7,114,526,429	598.00 8,449,321,400	2.95
日本	株式	本田技研工業 〔輸送用機器〕	2,086,100	2,064.62 4,307,003,782	2,750.00 5,736,775,000	2.00
日本	株式	キヤノン 〔電気機器〕	1,415,100	2,776.33 3,928,784,583	3,150.00 4,457,565,000	1.56
日本	株式	日本電信電話 〔情報・通信業〕	1,107,500	4,214.89 4,667,990,675	3,960.00 4,385,700,000	1.53
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ 〔銀行業〕	1,017,500	3,448.08 3,508,421,400	3,670.00 3,734,225,000	1.30
日本	株式	東京電力 〔電気・ガス業〕	1,537,500	2,844.67 4,373,680,125	2,390.00 3,674,625,000	1.28

日本	株式	パナソニック 〔電気機器〕	2,601,900	1,147.30 2,985,159,870	1,368.00 3,559,399,200	1.24
日本	株式	武田薬品工業 〔医薬品〕	898,000	4,541.57 4,078,329,860	3,770.00 3,385,460,000	1.18
日本	株式	任天堂 〔その他製品〕	128,900	29,928.83 3,857,826,187	25,800.00 3,325,620,000	1.16
日本	株式	エヌ・ティ・ティ・ドコモ 〔情報・通信業〕	23,303	162,431.12 3,785,132,389	142,500.00 3,320,677,500	1.16
日本	株式	三菱商事 〔卸売業〕	1,799,900	1,202.63 2,164,613,737	1,799.00 3,238,020,100	1.13
日本	株式	ソニー 〔電気機器〕	1,294,100	1,838.28 2,378,918,148	2,495.00 3,228,779,500	1.13
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ 〔銀行業〕	13,569,400	242.99 3,297,228,506	228.00 3,093,823,200	1.08
日本	株式	東京海上ホールディングス 〔保険業〕	1,036,800	2,317.90 2,403,198,720	2,795.00 2,897,856,000	1.01
日本	株式	三菱地所 〔不動産業〕	1,687,000	1,308.99 2,208,266,130	1,564.00 2,638,468,000	0.92
日本	株式	東日本旅客鉄道 〔陸運業〕	454,900	7,018.95 3,192,920,355	5,680.00 2,583,832,000	0.90
日本	株式	三井物産 〔卸売業〕	2,076,200	862.32 1,790,348,784	1,216.00 2,524,659,200	0.88
日本	株式	野村ホールディングス 〔証券、商品先物取引業〕	3,432,000	599.42 2,057,209,440	716.00 2,457,312,000	0.86
日本	株式	新日本製鐵 〔鉄鋼〕	6,707,000	286.42 1,921,018,940	364.00 2,441,348,000	0.85
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス 〔小売業〕	961,900	2,629.15 2,528,979,385	2,300.00 2,212,370,000	0.77
日本	株式	信越化学工業 〔化学〕	425,400	3,773.77 1,605,361,758	4,980.00 2,118,492,000	0.74
日本	株式	関西電力 〔電気・ガス業〕	1,012,400	2,527.75 2,559,094,100	2,070.00 2,095,668,000	0.73

日本	株式	ジェイ エフ イー ホールディングス 〔鉄鋼〕	652,300	2,311.43 1,507,745,789	3,180.00 2,074,314,000	0.72
日本	株式	KDDI 〔情報・通信業〕	3,740	603,660.35 2,257,689,709	498,000.00 1,862,520,000	0.65
日本	株式	アステラス製薬 〔医薬品〕	572,200	3,763.03 2,153,205,766	3,230.00 1,848,206,000	0.65
日本	株式	ファナック 〔電気機器〕	235,800	5,836.72 1,376,298,576	7,660.00 1,806,228,000	0.63
日本	株式	日産自動車 〔輸送用機器〕	3,083,000	310.59 957,548,970	571.00 1,760,393,000	0.62
日本	株式	中部電力 〔電気・ガス業〕	826,300	2,627.36 2,170,987,568	2,120.00 1,751,756,000	0.61
日本	株式	富士フイルムホールディングス 〔化学〕	623,900	2,252.78 1,405,509,442	2,755.00 1,718,844,500	0.60

ロ 種類別・業種別の投資比率

平成21年5月29日現在

種類	業種	投資 比率 (%)	種類	業種	投資 比率 (%)
株式（国内）	水産・農林業	0.10	株式（国内）	精密機器	1.27
	鉱業	0.43		その他製品	2.31
	建設業	2.20		電気・ガス業	5.23
	食料品	2.98		陸運業	4.03
	繊維製品	0.89		海運業	0.66
	パルプ・紙	0.43		空運業	0.54
	化学	5.67		倉庫・運輸関連業	0.24
	医薬品	4.28		情報・通信業	5.69
	石油・石炭製品	0.96		卸売業	4.63
	ゴム製品	0.58		小売業	3.47
	ガラス・土石製品	1.10		銀行業	9.76
	鉄鋼	2.78		証券、商品先物取引業	1.61
	非鉄金属	1.28		保険業	2.60
	金属製品	0.65		その他金融業	0.77
	機械	4.20		不動産業	2.40
	電気機器	13.02		サービス業	1.59
	輸送用機器	9.59		合計	97.95

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

平成21年5月29日現在

種類	取引所等および 資産の名称	買建／売建	数量 (枚)	簿価（円）	時価（円）	投資 比率 (%)
株価指数 先物取引	東京証券取引所 TOPIX先物	買建	653	5,571,534,254	5,847,615,000	2.04

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については以下のように評価しております。

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

〔国内債券バッシブ・マザーファンド〕

(1) 投資状況

平成21年5月29日現在

資産の種類	国／地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	235,769,556,670	73.77
地方債証券	日本	19,173,985,988	6.00
特殊債券	日本	38,152,158,213	11.94
	韓国	178,940,000	0.06
	小 計	38,331,098,213	11.99
社債券	日本	22,364,184,300	7.00
	アメリカ	1,433,929,000	0.45
	オランダ	97,143,000	0.03
	小 計	23,895,256,300	7.48
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,440,354,452	0.76
合計(純資産総額)		319,610,251,623	100.00

(2) 投資資産

① 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21年5月29日現在

国／ 地域	種類	銘柄名	額面金額 (円)	帳簿価額 単価／金額 (円)	評価額 単価／金額 (円)	利率／ 償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第227回利付国債 (10年)	13,545,000,000	102.28 13,855,157,050	102.29 13,855,993,200	1.6 2011/3/21	4.34
日本	国債証券	第225回利付国債 (10年)	10,155,000,000	102.52 10,411,174,650	102.52 10,410,906,000	1.9 2010/12/20	3.26
日本	国債証券	第239回利付国債 (10年)	7,500,000,000	102.72 7,704,055,000	102.70 7,702,500,000	1.4 2012/6/20	2.41
日本	国債証券	第244回利付国債 (10年)	7,392,000,000	101.44 7,499,110,080	101.40 7,496,005,440	1 2012/12/20	2.35

日本	国債証券	第236回利付国債 (10年)	7,160,000,000	102.73 7,355,904,000	102.72 7,354,895,200	1.5 2011/12/20	2.30
日本	国債証券	第253回利付国債 (10年)	6,810,000,000	103.72 7,063,740,600	103.66 7,059,858,900	1.6 2013/9/20	2.21
日本	国債証券	第256回利付国債 (10年)	6,810,000,000	102.82 7,002,246,300	102.79 6,999,999,000	1.4 2013/12/20	2.19
日本	国債証券	第247回利付国債 (10年)	6,835,000,000	100.63 6,878,185,200	100.59 6,875,463,200	0.8 2013/3/20	2.15
日本	国債証券	第258回利付国債 (10年)	6,713,000,000	102.34 6,870,084,200	102.28 6,866,392,050	1.3 2014/3/20	2.15
日本	国債証券	第231回利付国債 (10年)	6,695,000,000	101.91 6,823,334,300	101.92 6,823,544,000	1.3 2011/6/20	2.13
日本	国債証券	第250回利付国債 (10年)	5,745,000,000	99.25 5,702,353,600	99.25 5,702,027,400	0.5 2013/6/20	1.78
日本	国債証券	第234回利付国債 (10年)	5,480,000,000	102.30 5,606,314,000	102.30 5,606,040,000	1.4 2011/9/20	1.75
日本	国債証券	第237回利付国債 (10年)	5,010,000,000	102.92 5,156,692,800	102.89 5,155,139,700	1.5 2012/3/20	1.61
日本	国債証券	第289回利付国債 (10年)	4,534,000,000	101.21 4,589,141,120	100.99 4,579,067,960	1.5 2017/12/20	1.43
日本	国債証券	第284回利付国債 (10年)	4,017,000,000	103.54 4,159,317,750	103.31 4,150,243,890	1.7 2016/12/20	1.30
日本	国債証券	第263回利付国債 (10年)	3,837,000,000	103.78 3,982,122,190	103.69 3,978,853,890	1.6 2014/9/20	1.24
日本	国債証券	第290回利付国債 (10年)	3,842,000,000	100.22 3,850,833,000	99.96 3,840,463,200	1.4 2018/3/20	1.20
日本	国債証券	第223回利付国債 (10年)	3,755,000,000	101.90 3,826,499,000	101.90 3,826,682,950	1.7 2010/9/20	1.20
日本	国債証券	第299回利付国債 (10年)	3,850,000,000	98.66 3,798,756,500	98.33 3,785,859,000	1.3 2019/3/20	1.18
日本	国債証券	第265回利付国債 (10年)	3,660,000,000	103.23 3,778,364,400	103.14 3,775,033,800	1.5 2014/12/20	1.18

日本	国債証券	第282回利付国債 (10年)	3,545,000,000	103.69 3,676,061,950	103.39 3,665,175,500	1.7 2016/9/20	1.15
日本	国債証券	第274回利付国債 (10年)	3,545,000,000	102.98 3,650,782,800	102.78 3,643,834,600	1.5 2015/12/20	1.14
日本	国債証券	第285回利付国債 (10年)	3,518,000,000	103.38 3,637,119,480	103.12 3,627,831,960	1.7 2017/3/20	1.14
日本	国債証券	第260回利付国債 (10年)	3,445,000,000	103.75 3,574,425,700	103.70 3,572,602,800	1.6 2014/6/20	1.12
日本	国債証券	第277回利付国債 (10年)	3,440,000,000	103.46 3,559,289,200	103.25 3,552,075,200	1.6 2016/3/20	1.11
日本	国債証券	第297回利付国債 (10年)	3,573,000,000	99.70 3,562,459,650	99.37 3,550,561,560	1.4 2018/12/20	1.11
日本	国債証券	第272回利付国債 (10年)	3,445,000,000	102.46 3,529,988,150	102.30 3,524,545,050	1.4 2015/9/20	1.10
日本	国債証券	第288回利付国債 (10年)	3,420,000,000	102.99 3,522,508,200	102.76 3,514,563,000	1.7 2017/9/20	1.10
日本	国債証券	第268回利付国債 (10年)	3,365,000,000	103.25 3,474,564,400	103.13 3,470,425,450	1.5 2015/3/20	1.09
日本	国債証券	第270回利付国債 (10年)	3,287,000,000	101.97 3,351,923,220	101.88 3,348,927,080	1.3 2015/6/20	1.05

ロ 種類別の投資比率

平成21年5月29日現在

種類	投資比率 (%)
国債証券	73.77
地方債証券	6.00
特殊債券	11.99
社債券	7.48
合計	99.24

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ 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21年5月29日現在

資産の種類	国／地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	105,605,606,377	51.46
	カナダ	10,831,976,062	5.28
	ドイツ	8,620,662,095	4.20
	イタリア	3,846,302,928	1.87
	フランス	10,573,592,462	5.15
	オーストラリア	6,605,177,348	3.22
	イギリス	21,812,446,384	10.63
	スイス	9,057,260,686	4.41
	バミューダ	861,629,215	0.42
	香港	2,491,008,864	1.21
	シンガポール	1,351,803,700	0.66
	ニュージーランド	102,794,718	0.05
	オランダ	2,528,660,607	1.23
	スペイン	4,631,865,889	2.26
	ベルギー	993,949,586	0.48
	スウェーデン	2,466,624,875	1.20
	ノルウェー	813,081,371	0.40
	オーストリア	367,311,286	0.18
	ルクセンブルク	588,176,599	0.29
	フィンランド	1,438,221,548	0.70
	デンマーク	1,009,594,909	0.49
	アイルランド	315,159,795	0.15
	ギリシャ	608,326,250	0.30
	ポルトガル	354,274,166	0.17
	ケイマン諸島	130,056,504	0.06

	モーリシャス	18,071,547	0.01
	リベリア	25,895,261	0.01
	パナマ	61,078,410	0.03
	ジャージー	324,585,330	0.16
	マン島	16,510,340	0.01
	小 計	198,451,705,112	96.70
投資証券	アメリカ	1,351,150,045	0.66
	カナダ	321,399,952	0.16
	フランス	233,107,291	0.11
	オーストラリア	516,912,673	0.25
	イギリス	246,484,955	0.12
	香港	57,045,237	0.03
	シンガポール	46,461,491	0.02
	オランダ	25,160,511	0.01
	小 計	2,797,722,155	1.36
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,975,196,732	1.94
合計(純資産総額)		205,224,623,999	100.00

(2) 投資資産

① 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21年5月29日現在

国／ 地域	種類	銘柄名／業種	数量 (株)	帳簿価額 単価／金額 (円)	評価額 単価／金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORPORATION 〔エネルギー〕	683,962	7,616.13 5,209,144,327	6,679.31 4,568,394,499	2.23
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP 〔ソフトウェア・サービス〕	1,077,802	1,917.05 2,066,208,515	1,973.01 2,126,520,590	1.04
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO 〔家庭用品・パーソナル用品〕	396,170	5,970.18 2,365,207,161	5,073.88 2,010,120,307	0.98
イギリス	株式	BP PLC 〔エネルギー〕	2,516,952	795.19 2,001,474,441	781.73 1,967,600,357	0.96
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON 〔医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス〕	373,076	5,572.68 2,079,034,954	5,261.05 1,962,773,131	0.96
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC 〔銀行〕	2,306,703	833.65 1,922,983,417	838.64 1,934,514,220	0.94
アメリカ	株式	AT&T INC 〔電気通信サービス〕	792,351	2,681.17 2,124,435,020	2,376.30 1,882,865,582	0.92
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP 〔テクノロジー・ハードウェアおよび機器〕	180,563	8,045.46 1,452,713,694	10,100.49 1,823,774,992	0.89
スイス	株式	NESTLE SA-REGISTERED 〔食品・飲料・タバコ〕	514,750	3,820.14 1,966,419,999	3,502.02 1,802,666,339	0.88
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO 〔資本財〕	1,414,843	1,548.50 2,190,890,044	1,272.57 1,800,488,454	0.88
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO 〔各種金融〕	501,543	2,906.94 1,457,956,612	3,535.99 1,773,452,035	0.86
アメリカ	株式	CHEVRON CORPORATION 〔エネルギー〕	273,067	7,410.62 2,023,598,174	6,349.34 1,733,797,628	0.84
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〕	119,459	8,934.04 1,067,252,440	13,031.55 1,556,736,361	0.76

フランス	株式	TOTAL SA 〔エネルギー〕	286,846	5,458.71 1,565,809,415	5,395.42 1,547,656,222	0.75
アメリカ	株式	WAL-MART STORES INC 〔小売〕	317,240	5,275.52 1,673,607,995	4,780.58 1,516,592,468	0.74
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〕	786,781	1,585.16 1,247,178,805	1,785.84 1,405,068,757	0.68
アメリカ	株式	WELLS FARGO & COMPANY 〔銀行〕	587,638	2,557.13 1,502,666,998	2,389.80 1,404,342,933	0.68
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〕	906,797	1,552.36 1,407,678,292	1,417.29 1,285,195,408	0.63
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A 〔電気通信サービス〕	32,182	29,073.28 935,636,399	39,611.79 1,274,786,741	0.62
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC 〔電気通信サービス〕	7,045,038	193.80 1,365,332,591	180.26 1,269,976,028	0.62
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE 〔食品・飲料・タバコ〕	279,787	4,425.53 1,238,207,888	4,524.91 1,266,011,553	0.62
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〕	319,606	4,852.93 1,551,025,737	3,822.81 1,221,795,889	0.60
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〕	94,401	14,778.89 1,395,142,325	12,822.92 1,210,497,320	0.59
イギリス	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS 〔エネルギー〕	476,573	2,656.29 1,265,920,240	2,530.17 1,205,812,851	0.59
スペイン	株式	TELEFONICA S.A. 〔電気通信サービス〕	569,172	2,111.31 1,201,699,673	2,056.10 1,170,277,679	0.57
オーストラリア	株式	BHP BILLITON LTD 〔素材〕	451,230	2,339.38 1,055,598,617	2,581.43 1,164,822,088	0.57
アメリカ	株式	INTEL CORP 〔テクノロジー・ハードウェアおよび機器〕	748,022	1,334.31 998,099,518	1,516.66 1,134,499,235	0.55
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〕	698,443	1,738.05 1,213,930,951	1,616.54 1,129,063,212	0.55
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP 〔各種金融〕	1,029,379	1,330.95 1,370,057,971	1,090.22 1,122,253,690	0.55

アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC. 〔食品・飲料・タバコ〕	272,052	3,990.41 1,085,599,783	4,104.25 1,116,571,923	0.54
------	----	---	---------	---------------------------	---------------------------	------

ロ 種類別・業種別の投資比率

平成21年 5月29日現在

種類	業種	投資 比率 (%)	種類	業種	投資 比率 (%)
株式（外国）	エネルギー	12.66	株式（外国）	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.75
	素材	6.86		銀行	9.41
	資本財	7.00		各種金融	4.45
	商業・専門サービス	1.12		保険	3.99
	運輸	1.61		不動産	0.51
	自動車・自動車部品	0.96		ソフトウェア・サービス	3.00
	耐久消費財・アパレル	0.76		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	6.56
	消費者サービス	1.01		電気通信サービス	5.93
	メディア	2.28		公益事業	4.91
	小売	3.50		半導体・半導体製造装置	0.06
	食品・生活必需品小売り	1.18	投資証券		1.36
	食品・飲料・タバコ	6.65	合計		98.06
	家庭用品・パーソナル用品	2.05			
	ヘルスケア機器・サービス	2.49			

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

平成21年5月29日現在

種類	取引所等および 資産の名称	買建／ 売建	数量 (枚)	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
海外金融 先物取引	シカゴ商業取引所 S P 500 09/06	買建	109	2,355,626,687	2,379,580,308	1.16
海外金融 先物取引	ロンドン国際金融先物オプション取引所 F T S E 09/06	買建	73	493,155,773	490,051,733	0.24
海外金融 先物取引	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所 D J E U R 09/06	買建	315	1,021,510,106	1,040,433,817	0.51

(注) 時価の算定方法

海外金融先物取引の時価については以下のように評価しております。

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

平成21年5月29日現在

種類	取引所等および 資産の名称	買建／売建	数量 (枚)	簿価 (円)	時価 (円)	投資 比率 (%)
為替予約取引	市場外取引 米ドル	買建	5,000,000	482,555,000	482,350,000	0.24

(注)

1. 基準日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。

(1) 基準日において為替予約の受渡日（以下「当該日」という）の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該顧客先物売買相場の仲値で評価しております。

(2) 基準日において当該日の対顧客先物売買相場が発表されていない場合は、以下の計算方法によっております。

① 基準日に当該日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後の二つの対顧客先物売買相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

②基準日に当該日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

〔外国債券パッシブ・マザーファンド〕

（１）投資状況

平成21年５月29日現在

資産の種類	国／地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	アメリカ	63,078,859,423	30.54
	カナダ	5,215,734,682	2.53
	ドイツ	23,696,702,864	11.47
	イタリア	24,133,638,345	11.69
	フランス	21,036,580,223	10.19
	オーストラリア	1,078,764,441	0.52
	イギリス	18,556,079,977	8.99
	スイス	1,454,277,872	0.70
	シンガポール	852,219,296	0.41
	マレーシア	1,009,197,372	0.49
	オランダ	5,349,652,578	2.59
	スペイン	9,322,822,639	4.51
	ベルギー	6,748,381,965	3.27
	スウェーデン	1,365,175,357	0.66
	ノルウェー	568,564,920	0.28
	オーストリア	3,791,427,572	1.84
	フィンランド	1,435,750,059	0.70
	デンマーク	1,716,656,808	0.83
	アイルランド	1,478,141,379	0.72
	ギリシャ	5,566,496,437	2.70
	ポーランド	1,652,273,259	0.80
	ボルトガル	2,517,988,662	1.22
	小 計	201,625,386,130	97.63
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,893,922,510	2.37
合計(純資産総額)		206,519,308,640	100.00

(2) 投資資産**① 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21年5月29日現在

国／ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額 単価／金額 (円)	評価額 単価／金額 (円)	利率／ 償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	US T 3.75% 18/11/15	12,000,000	10,636.02 1,276,323,216	9,700.76 1,164,091,500	3.75 2018/11/15	0.56
アメリカ	国債証券	US T 2.75% 19/02/15	13,000,000	9,475.91 1,231,868,700	8,916.86 1,159,192,125	2.75 2019/2/15	0.56
イギリス	国債証券	UKT 5% 12/03/07	6,560,000	16,581.16 1,087,724,170	16,642.24 1,091,731,075	5 2012/3/7	0.53
イタリア	国債証券	BTPS 6% 31/05/01	6,900,000	14,635.86 1,009,875,000	14,516.61 1,001,646,538	6 2031/5/1	0.49
イギリス	国債証券	UKT 4.5% 13/03/07	5,700,000	16,475.47 939,102,336	16,485.97 939,700,349	4.5 2013/3/7	0.46
ドイツ	国債証券	DBR 4.25% 14/07/04	6,500,000	14,468.45 940,449,460	14,414.95 936,972,123	4.25 2014/7/4	0.45
イタリア	国債証券	BTPS 6.5% 27/11/01	5,960,000	15,585.91 928,920,727	15,375.68 916,390,736	6.5 2027/11/1	0.44
アメリカ	国債証券	US T 0.875% 11/02/28	9,000,000	9,649.29 868,436,831	9,649.50 868,455,675	0.875 2011/2/28	0.42
アメリカ	国債証券	US T 0.875% 11/03/31	9,000,000	9,647.07 868,237,087	9,648.00 868,320,000	0.875 2011/3/31	0.42
ドイツ	国債証券	DBR 5% 11/07/04	5,900,000	14,387.13 848,841,005	14,400.81 849,648,232	5 2011/7/4	0.41
イタリア	国債証券	BTPS 5% 12/02/01	5,900,000	14,010.08 826,594,806	14,369.84 847,821,032	5 2012/2/1	0.41
イギリス	国債証券	UKT 4.25 110307	5,200,000	16,048.13 834,502,922	16,225.26 843,713,680	4.25 2011/3/7	0.41
イタリア	国債証券	BTPS 5.25% 29/11/01	6,200,000	13,755.14 852,819,240	13,518.86 838,169,320	5.25 2029/11/1	0.41

アメリカ	国債証券	US T 1.25% 10/11/30	8,500,000	9,742.35 828,099,900	9,721.86 826,358,737	1.25 2010/11/30	0.40
ドイツ	国債証券	DBR 4.5% 13/01/04	5,700,000	14,421.75 822,040,269	14,477.56 825,221,376	4.5 2013/1/4	0.40
イタリア	国債証券	BTPS 4.25% 14/08/01	5,900,000	13,717.77 809,348,834	13,945.70 822,796,329	4.25 2014/8/1	0.40
アメリカ	国債証券	US T 0.875% 11/01/31	8,500,000	9,644.76 819,804,881	9,656.29 820,784,760	0.875 2011/1/31	0.40
ドイツ	国債証券	DBR 4.25% 14/01/04	5,700,000	14,456.59 824,025,684	14,397.45 820,654,721	4.25 2014/1/4	0.40
フランス	国債証券	FRTR 4.25% 19/04/25	5,900,000	14,146.05 834,617,253	13,710.06 808,893,717	4.25 2019/4/25	0.39
イタリア	国債証券	BTPS 3.75% 16/08/01	6,000,000	13,266.63 795,998,286	13,378.82 802,729,440	3.75 2016/8/1	0.39
アメリカ	国債証券	US T 4% 2015/02/15	7,700,000	10,998.26 846,866,767	10,279.64 791,532,472	4 2015/2/15	0.38
イギリス	国債証券	UKT 4.25% 32/06/07	5,300,000	15,480.74 820,479,449	14,934.18 791,511,643	4.25 2032/6/7	0.38
イタリア	国債証券	BTPS 5.25% 11/08/01	5,500,000	14,132.37 777,280,590	14,375.23 790,637,870	5.25 2011/8/1	0.38
アメリカ	国債証券	US T 4.25% 15/08/15	7,600,000	11,144.31 846,967,770	10,398.73 790,303,860	4.25 2015/8/15	0.38
イギリス	国債証券	UKT 4% 16/09/07	4,800,000	16,064.76 771,108,900	16,323.85 783,545,054	4 2016/9/7	0.38
アメリカ	国債証券	US T 1.5% 10/10/31	8,000,000	9,798.32 783,866,082	9,755.78 780,462,903	1.5 2010/10/31	0.38
アメリカ	国債証券	US T 0.875% 10/12/31	8,000,000	9,649.03 771,922,912	9,660.06 772,804,800	0.875 2010/12/31	0.37
アメリカ	国債証券	US T 1.375% 12/04/15	8,000,000	9,645.36 771,628,950	9,627.64 770,211,903	1.375 2012/4/15	0.37
イギリス	国債証券	UKT 5% 18/03/07	4,500,000	17,326.32 779,684,423	17,087.52 768,938,487	5 2018/3/7	0.37

ドイツ	国債証券	DBR 5% 12/07/04	5,220,000	14,556.33 759,840,856	14,643.18 764,374,387	5 2012/7/4	0.37
-----	------	-----------------	-----------	--------------------------	--------------------------	---------------	------

ロ 種類別の投資比率

平成21年5月29日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	97.63
合計	97.63

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

平成21年5月29日現在

種類	取引所等および 資産の名称	買建／ 売建	数量 (枚)	簿価（円）	時価（円）	投資 比率 (%)
為替予約取引	市場外取引 米ドル	買建	8,718,827.70	834,231,520	841,105,308	0.41
為替予約取引	市場外取引 カナダドル	買建	1,029,000.00	88,205,159	89,142,270	0.04
為替予約取引	市場外取引 英ポンド	買建	1,127,084.78	171,703,476	173,345,639	0.08
為替予約取引	市場外取引 ポーランドズロチ	買建	3,161,610.00	95,292,506	94,279,210	0.05
為替予約取引	市場外取引 ユーロ	買建	10,961,949.88	1,462,255,856	1,475,883,902	0.71

(注)

1. 基準日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。

(1) 基準日において為替予約の受渡日（以下「当該日」という）の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該顧客先物売買相場の仲値で評価しております。

(2) 基準日において当該日の対顧客先物売買相場が発表されていない場合は、以下の計算方法によっております。

①基準日に当該日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後の二つの対顧客先物売買相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。

②基準日に当該日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

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

【マネーインカム・マザーファンド】

（１）投資状況

平成21年５月29日現在

資産の種類	国／地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
国債証券	日本	44,007,172	95.92
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,871,949	4.08
合計(純資産総額)		45,879,121	100.00

（２）投資資産

① 投資有価証券の主要銘柄

イ 主要投資銘柄

平成21年５月29日現在

国／ 地域	種類	銘柄名	額面金額 (円)	帳簿価額 単価／金額 (円)	評価額 単価／金額 (円)	利率／ 償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第214回利付国債（10年）	19,000,000	100.58 19,110,859	100.48 19,092,909	1.8 2009/9/21	41.62
日本	国債証券	第211回利付国債（10年）	10,150,000	100.28 10,178,927	100.08 10,158,627	1.8 2009/6/22	22.14
日本	国債証券	第219回利付国債（10年）	7,300,000	101.36 7,399,542	101.29 7,394,462	1.8 2010/3/22	16.12
日本	国債証券	第216回利付国債（10年）	7,300,000	100.92 7,367,751	100.83 7,361,174	1.7 2009/12/21	16.04

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21年５月29日現在

種類	投資比率（％）
国債証券	95.92
合計	95.92

② 投資不動産物件

該当事項はありません。

③ その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

第二部【ファンドの詳細情報】

第1【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。

第2【手続等】

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り引口座を開設の上、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（わが国の取引所の半日立会日の場合は午前11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。

へ 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。

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（わが国の取引所の半日立会日の場合は午前11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。

第3【管理及び運営】

1【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

イ 基準価額の算出方法

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

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

ロ 基準価額の算出頻度・照会方法

基準価額は、委託会社の営業日において日々算出されます。

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

- 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。
- 委託会社は、上記aの事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、当ファンドの知られたる受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。
- 書面決議において、受益者（委託会社等を除きます。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを

行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

- d. 書面決議は議決権を行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b～dまでの取扱いは、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、当ファンドのすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状況に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b～dまでの取扱いを行うことが困難な場合も同様とします。

(ロ) 信託契約に関する監督官庁の命令

委託会社は、監督官庁より当ファンドの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令に従い信託契約を解約し、信託を終了させます。

(ハ) 委託会社の登録取消等に伴う取扱い

委託会社が、監督官庁より登録の取消しを受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁が当ファンドに関する委託会社の業務を他の委託会社に引継ぐことを命じたときは、当ファンドは、その委託会社と受託会社との間において存続します。

(ニ) 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

- a. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。また、受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたこと、その他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申し立てることができます。
- b. 上記により受託会社が辞任し、または解任された場合は、委託会社は新受託会社を選任します。
- c. 委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は当ファンドの信託契約を解約し、信託を終了させます。

ロ 収益分配金、償還金の支払い

(イ) 収益分配金

- a. 分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。分配対象額が少額の場合等には委託会社の判断により分配を行わないことがあります。
- b. 分配金は、税金を差し引いた後、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(ロ) 償還金

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

ハ 信託約款の変更等

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

ニ 反対者の買取請求権

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

ホ 販売会社との契約の更改等

委託会社と販売会社との間で締結される販売契約（名称の如何を問わず、ファンドの募集・販売の取扱い、受益者からの一部解約実行請求の受付け、受益者への収益分配金、一部解約金および償還金の支払事務等を規定するもの）は、期間満了の3ヵ月前に当事者のいずれからでも、何らの意思表示もない場合は、自動的に1年間更新されます。販売契約の内容は、必要に応じて、委託会社と販売会社との合意により変更されることがあります。

ヘ 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

ト 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、日本経済新聞に掲載します。

チ 運用にかかる報告書の開示方法

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

運用報告書は、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。

2【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します。）に支払われます。

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

ハ 一部解約実行請求権

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

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た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4【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）並びに同規則第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1期（平成20年3月31日から平成21年4月13日まで）の財務諸表について、あずさ監査法人により監査を受けております。

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】**

期 別	第 1 期 (平成21年 4 月13日現在)
科 目	金額(円)
資産の部	
I 流動資産	
親投資信託受益証券	791,475
流動資産合計	791,475
資産合計	791,475
負債の部	
I 流動負債	
未払受託者報酬	163
未払委託者報酬	1,558
流動負債合計	1,721
負債合計	1,721
純資産の部	
I 元本等	
1 元本	
元本	1,000,000
元本合計	1,000,000
2 剰余金	
期末欠損金	210,246
剰余金合計	△210,246
元本等合計	789,754
純資産合計	789,754
負債・純資産合計	791,475

（２）【損益及び剰余金計算書】

期 別	第 1 期 自 平成20年 3 月31日 至 平成21年 4 月13日
科 目	金額(円)
I 営業収益	
有価証券売買等損益	△206,312
営業収益合計	△206,312
II 営業費用	
受託者報酬	343
委託者報酬	3,591
営業費用合計	3,934
営業損失	210,246
経常損失	210,246
当期純損失	210,246
III 一部解約に伴う当期純損失分配額	—
IV 期首剰余金	—
V 欠損金減少額	—
VI 欠損金増加額	—
VII 分配金	—
VIII 期末欠損金	210,246

（３）【注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

項 目	第 1 期 (平成21年 4 月13日現在)
1. 受益権総数	当該計算期間の末日における受益権の総数 1,000,000口
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 210,246円
3. 1 単位当たり純資産額	0.7898円 (1 万口＝7,898円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

項 目	第 1 期 自 平成20年 3 月31日 至 平成21年 4 月13日
分配金の計算過程	計算期間末における費用控除後の配当等収益（23,653円）、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益（0円）、収益調整金（0円）、および分配準備積立金（0円）より、分配対象収益は23,653円（1 万口当たり236.53円）であります。分配を行っておりません。

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

第 1 期（自 平成20年 3 月31日 至 平成21年 4 月13日）

種 類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	791,475円	△196,458円
合 計	791,475円	△196,458円

(デリバティブ取引に関する注記)

I. 取引の状況に関する事項

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

II. 取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

第 1 期（平成21年 4 月13日現在）

第 1 期末現在、デリバティブ取引は行っておりません。

（関連当事者との取引に関する注記）

第 1 期（自 平成20年 3 月31日 至 平成21年 4 月13日）

該当事項はありません。

(その他の注記)

項 目	第 1 期 (平成21年 4 月13日現在)
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	—円
期中一部解約元本額	—円

(4) 【附属明細表】

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

種 別	銘柄名	元本額	評価額	
			単価	金額
親投資信託 受益証券	国内株式インデックス・マザーファンド (B号)	238,656円	1.0841円	258,726円
親投資信託 受益証券	国内債券パッシブ・マザーファンド	145,762円	1.0387円	151,402円
親投資信託 受益証券	外国株式インデックス・マザーファンド	218,631円	0.9926円	217,013円
親投資信託 受益証券	外国債券パッシブ・マザーファンド	121,885円	1.2244円	149,235円
親投資信託 受益証券	マネーインカム・マザーファンド	15,015円	1.0056円	15,099円
合 計	—	739,949円	—	791,475円

(参考情報)

[「国内株式インデックス・マザーファンド（B号）」の状況へ](#)

[「国内債券パッシブ・マザーファンド」の状況へ](#)

[「外国株式インデックス・マザーファンド」の状況へ](#)

[「外国債券パッシブ・マザーファンド」の状況へ](#)

[「マネーインカム・マザーファンド」の状況へ](#)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

平成21年5月29日現在

I 資産総額	818,415 円
II 負債総額	425 円
III 純資産総額(I － II)	817,990 円
IV 発行済口数	1,000,000 口
V 1口当たり純資産額(III／IV)	0.8180 円
(1 万口当たり純資産額	8,180 円)

第5【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	—

（注）本邦外における設定および解約の実績はありません。

第三部【特別情報】

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21年5月29日現在

資本金の額	2,000百万円
会社が発行する株式の総数	60,000株
発行済株式総数	17,640株

ロ 最近5年間における資本金の額の増減
該当ありません。

ハ 会社の機構

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

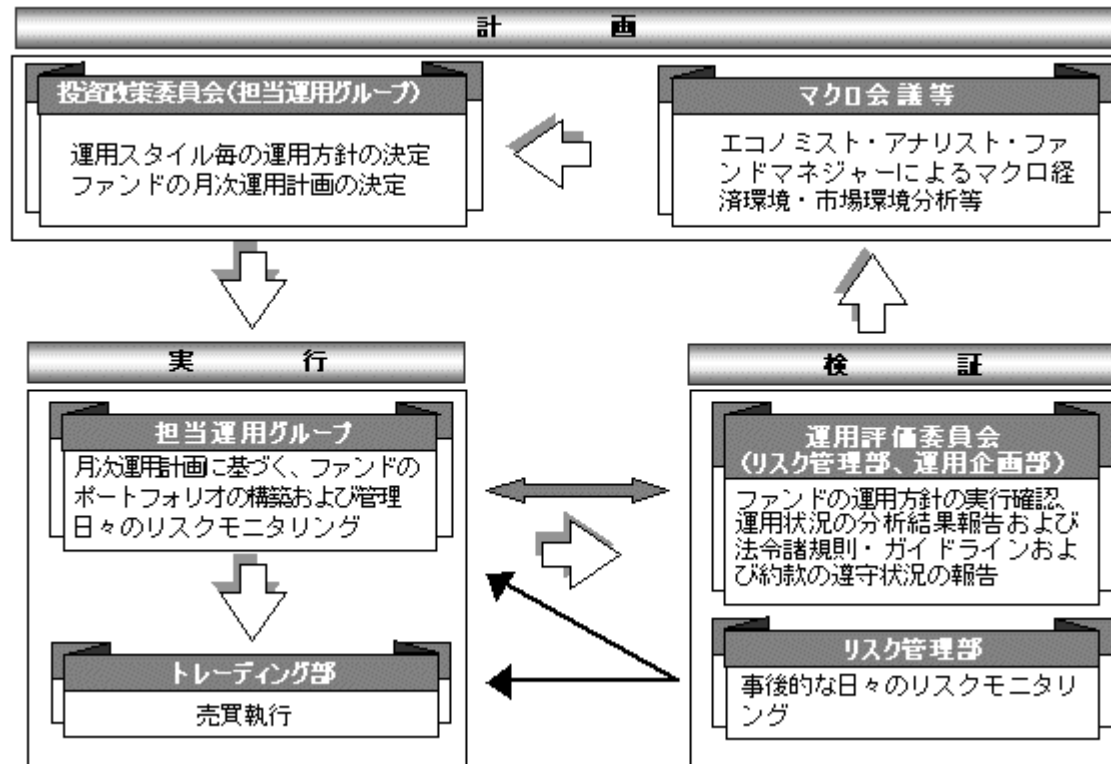
取締役の任期は、選任後1年以内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとし、補欠または増員によって選任された取締役の任期は、他の現任取締役の任期の満了する時までとします。

委託会社の業務上重要な事項は、取締役会の決議により決定します。

取締役会は、取締役会の決議によって、代表取締役を若干名を選定します。

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

ニ 投資信託の運用の流れ



2【事業の内容及び営業の概況】

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

平成21年5月29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21年5月29日現在、単位：百万円）

		本 数	純資産総額
株式投資信託	単位型	77 (1)	194,877 (176)
	追加型	218 (98)	3,196,991 (2,103,563)
	計	295 (99)	3,391,868 (2,103,739)
公社債投資信託	単位型	0 (0)	0 (0)
	追加型	0 (0)	0 (0)
	計	0 (0)	0 (0)
合 計		295 (99)	3,391,868 (2,103,739)

※（ ）内は、私募投資信託分であり、内書き表記しております。

3【委託会社等の経理状況】

- 1 当社の財務諸表は、第23期（平成19年4月1日から平成20年3月31日まで）については、改正前の「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号。以下「財務諸表等規則」という。）並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しており、第24期（平成20年4月1日から平成21年3月31日まで）については、改正後の「財務諸表等規則」並びに同規則第2条の規定により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」（平成19年内閣府令第52号）に基づいて作成しております。
- 2 当社は、第23期（平成19年4月1日から平成20年3月31日まで）及び第24期（平成20年4月1日から平成21年3月31日まで）の財務諸表については、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、あずさ監査法人の監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

		第 23 期	第 24 期
		(平成20年3月31日現在)	(平成21年3月31日現在)
(資 産 の 部)			
流動資産			
現金及び預金	※ 2	18,130,988	15,883,303
有価証券		5,994,478	2,998,947
前払費用		222,628	323,949
未収入金		-	3,593
未収委託者報酬		4,184,389	2,158,082
未収運用受託報酬		1,008,548	635,902
未収投資助言報酬	※ 2	493,368	406,959
未収収益		8,180	8,062
未収還付法人税等		-	1,068,737
未収還付消費税等		-	182,000
繰延税金資産		439,833	68,795
その他の流動資産		24,816	2,641
流動資産計		30,507,231	23,740,977
固定資産			
有形固定資産	※ 1		
建物		169,017	169,629
器具備品		225,583	200,701
有形固定資産合計		394,601	370,331
無形固定資産	※ 1		
電話加入権		173	161
商標権		10,048	8,104
無形固定資産合計		10,222	8,266
投資その他の資産			
投資有価証券		1,598,911	2,542,125

関係会社株式	236,178	236,178
長期差入保証金	702,453	783,231
長期前払費用	18,200	14,643
会員権	17,113	20,113
繰延税金資産	15,024	34,393
投資その他の資産合計	2,587,882	3,630,686
固定資産計	2,992,706	4,009,284
資産合計	33,499,937	27,750,261

(単位：千円)

	第 23 期 (平成20年3月31日現在)	第 24 期 (平成21年3月31日現在)
(負 債 の 部)		
流動負債		
預り金	40,052	44,497
未払金		
未払収益分配金	2,787	947
未払償還金	28,571	23,376
未払手数料 ※ 2	1,727,481	891,493
その他未払金	149,275	112,743
未払費用	760,613	612,126
未払消費税等	366,587	-
未払法人税等	3,334,415	-
前受収益	5,985	-
賞与引当金	375,721	291,836
その他の流動負債	254	-
流動負債計	6,791,746	1,977,020
固定負債		
退職給付引当金	749,327	972,202
固定負債計	749,327	972,202
負債合計	7,541,073	2,949,223
(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	13,483,283	12,356,655
利益剰余金合計	15,304,488	14,177,860
株主資本計	25,933,472	24,806,844
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	25,392	△ 5,805
評価・換算差額等計	25,392	△ 5,805
純資産合計	25,958,864	24,801,038
負債・純資産合計	33,499,937	27,750,261

（２）【損益計算書】

(単位：千円)

	第 23 期 (自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日)	第 24 期 (自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	32,260,683	20,072,582
運用受託報酬	4,320,395	3,506,635
投資助言報酬	2,276,198	2,048,748
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	75,471	60,260
その他	-	2,749
営業収益計	38,937,748	25,695,976
営業費用		
支払手数料	15,226,126	9,326,200
広告宣伝費	834,129	529,276
公告費	8,062	1,227
受益証券発行費	218	-
調査費		
調査費	541,419	538,515
委託調査費	2,298,023	1,310,113
営業雑経費		
通信費	27,577	30,202
印刷費	325,929	302,661
協会費	18,986	23,322
諸会費	15,281	14,373
情報機器関連費	1,936,376	2,036,426
販売促進費	36,029	55,223
その他	60,681	55,485
営業費用計	21,328,842	14,223,029

一般管理費		
給料		
役員報酬	166,266	174,486
給料・手当	3,698,904	4,004,575
賞与	1,119,415	1,051,279
賞与引当金繰入額	375,721	291,836
交際費	20,571	23,229
寄付金	-	4,000
事務委託費	250,163	356,543
旅費交通費	249,775	258,981
租税公課	116,931	81,166
不動産賃借料	624,843	762,812
退職給付費用	277,530	262,634
固定資産減価償却費	149,507	119,811
諸経費	398,374	281,968
一般管理費計	7,448,006	7,673,326
営業利益	10,160,899	3,799,620

営業外収益		
受取配当金	8,036	-
有価証券利息	7,450	22,216
受取利息	※ 1	34,555
為替差益	634	11,209
時効成立分配金・償還金	5,827	7,832
原稿・講演料	4,424	3,910
雑収入	3,743	4,132
営業外収益計	64,671	85,555
営業外費用		
時効成立後支払分配金・償還金	1,826	693
雑損失	0	82
営業外費用計	1,826	775
経常利益	10,223,744	3,884,401
特別利益		
貸倒引当金戻入益	25,000	-
投資有価証券償還益	5,787	1,136
投資有価証券売却益	124,622	122
ゴルフ会員権売却益	5,555	-
特別利益計	160,966	1,259
特別損失		
固定資産除却損	※ 2	12,288
投資有価証券償還損	503	84,238
投資有価証券評価損	17,700	65,553
投資有価証券売却損	56	464,272
投資有価証券清算損	256	-
ゴルフ会員権売却損	24,476	-
特別損失計	55,282	614,753
税引前当期純利益	10,329,428	3,270,907
法人税、住民税及び事業税	4,544,339	1,206,047
法人税等調整額	△134,250	369,088
法人税等合計	4,410,088	1,575,135

当期純利益		
	5,919,339	1,695,771

（３）【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	第 23 期 (自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日)	第 24 期 (自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日)
株主資本		
資本金		
前期末残高	2,000,000	2,000,000
当期末残高	2,000,000	2,000,000
資本剰余金		
資本準備金		
前期末残高	8,628,984	8,628,984
当期末残高	8,628,984	8,628,984
資本剰余金合計		
前期末残高	8,628,984	8,628,984
当期末残高	8,628,984	8,628,984
利益剰余金		
利益準備金		
前期末残高	284,245	284,245
当期末残高	284,245	284,245
その他利益剰余金		
配当準備積立金		
前期末残高	60,000	60,000
当期末残高	60,000	60,000
特別償却準備金		
前期末残高	9,041	-
当期変動額		
特別償却準備金取崩	△ 9,041	-
当期変動額合計	△ 9,041	-
当期末残高	-	-
別途積立金		

前期末残高	1,476,959	1,476,959
当期末残高	1,476,959	1,476,959
繰越利益剰余金		
前期末残高	8,613,302	13,483,283
当期変動額		
特別償却準備金取崩	9,041	-
剰余金の配当	△ 1,058,400	△ 2,822,400
当期純利益	5,919,339	1,695,771
当期変動額合計	4,869,980	△ 1,126,628
当期末残高	13,483,283	12,356,655
利益剰余金合計		
前期末残高	10,443,548	15,304,488
当期変動額		
剰余金の配当	△ 1,058,400	△ 2,822,400
当期純利益	5,919,339	1,695,771
当期変動額合計	4,860,939	△ 1,126,628
当期末残高	15,304,488	14,177,860

株主資本合計		
前期末残高	21,072,532	25,933,472
当期変動額		
剰余金の配当	△ 1,058,400	△ 2,822,400
当期純利益	5,919,339	1,695,771
当期変動額合計	4,860,939	△ 1,126,628
当期末残高	25,933,472	24,806,844
評価・換算差額等		
 その他有価証券評価差額金		
前期末残高	433,303	25,392
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△ 407,911	△ 31,197
当期変動額合計	△ 407,911	△ 31,197
当期末残高	25,392	△ 5,805
評価・換算差額合計		
前期末残高	433,303	25,392
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△ 407,911	△ 31,197
当期変動額合計	△ 407,911	△ 31,197
当期末残高	25,392	△ 5,805
純資産合計		
前期末残高	21,505,836	25,958,864
当期変動額		
剰余金の配当	△ 1,058,400	△ 2,822,400
当期純利益	5,919,339	1,695,771
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△ 407,911	△ 31,197
当期変動額合計	4,453,028	△ 1,157,826
当期末残高	25,958,864	24,801,038

重要な会計方針

項 目	第23期 (自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日)	第24期 (自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日)
1 有価証券の評価基準及び評価方法	満期保有目的の債券 償却原価法 子会社株式 移動平均法による原価法 その他有価証券 時価のあるもの 決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 時価のないもの 移動平均法による原価法	満期保有目的の債券 同左 子会社株式 同左 その他有価証券 時価のあるもの 同左 時価のないもの 同左
2 固定資産の減価償却の方法	有形固定資産 定率法によっております。但し、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、定額法によっております。 なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。 建物 3～50年 器具備品 3～20年 無形固定資産 定額法によっております。	有形固定資産 同左 無形固定資産 同左
3 引当金の計上基準 (1) 賞与引当金 (2) 退職給付引当金	従業員賞与の支給に充てるため、将来の支給見込額のうち当期の負担額を計上しております。 従業員の退職金支給に備えるため、当事業年度末における退職給付債務に基づき計上しております。	同左 従業員の退職金支給に備えるため、当事業年度末における退職給付債務に基づき計上しております。 過去勤務債務については、その発生時において一時に費用処理しております。 数理計算上の差異については、その発生時において一時に費用処理しております。

4 リース取引の処理方法	リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引については、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。	所有権移転外ファイナンス・リース取引のうち、リース取引開始日が平成20年4月1日前に開始する事業年度に属するものについては、通常の賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっております。
5 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	消費税等の会計処理は税抜方式によっております。	同左

会計方針の変更

(会計処理の変更)

第23期 (自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日)	第24期 (自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日)
有形固定資産の減価償却の方法 法人税法の改正（（所得税法等の一部を改正する法律 平成19年3月30日法律第6号）及び（法人税法施行令の一部を改正する政令 平成19年3月30日 政令第83号））に伴い、当事業年度から平成19年4月1日以降に取得したもののについては、改正後の法人税法に基づく方法に変更しております。 なお、この変更による影響は軽微であります。	—
—	リース取引に関する会計基準 所有権移転外ファイナンス・リース取引については、従来、賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっておりましたが、企業会計基準第13号「リース取引に関する会計基準」（平成19年3月30日 企業会計基準委員会）及び企業会計基準適用指針第16号「リース取引に関する会計基準の適用指針」（同前）が平成20年4月1日以後開始する事業年度から適用されることになったことに伴い、当事業年度から同会計基準及び適用指針を適用しております。 当事業年度において、通常の売買取引に係る方法に準じた会計処理による取引はありません。

（表示方法の変更）

第23期 （自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日）	第24期 （自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日）
1.前事業年度において区分掲記しておりました「現金」（当事業年度877千円）及び「預金」（当事業年度18,130,111千円）は、金融商品取引法の施行により「現金及び預金」として表示しております。 2.金融商品取引法の施行に伴い、区分表示をより明瞭にするため、以下の表示方法の変更を行っております。 (貸借対照表) 前事業年度において「未収投資顧問料」として表示しておりました投資一任契約の未収運用受託報酬及び投資顧問（助言）契約の未収投資助言報酬は、当事業年度においては「未収運用受託報酬」及び「未収投資助言報酬」として区分して表示しております。なお、前事業年度における「未収運用受託報酬」及び「未収投資助言報酬」は、それぞれ1,001,467千円、444,216千円であります。 (損益計算書) 前事業年度において「投資顧問料」として表示しておりました投資一任契約の運用受託報酬及び投資顧問（助言）契約の投資助言報酬は、当事業年度においては「運用受託報酬」及び「投資助言報酬」として区分して表示しております。なお、前事業年度における「運用受託報酬」及び「投資助言報酬」は、それぞれ3,970,091千円、2,451,535千円であります。 3.前事業年度において区分掲記しておりました「時効成立分配金」（当事業年度53千円）及び「時効成立償還金」（当事業年度5,773千円）は、金額的重要性が乏しいため、「時効成立分配金・償還金」として表示しております。	—

(追加情報)

第23期 (自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日)	第24期 (自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日)
(有形固定資産の減価償却の方法) 当事業年度から、平成19年3月31日以前に取得したものについては、償却可能限度額まで償却が終了した翌年から5年間で均等償却する方法によっております。なお、この変更による影響は軽微であります。 (退職給付会計) 退職給付債務の算定にあたり、従来、簡便法によっておりましたが、従業員の増加に伴い、当事業年度より原則法による算定方法に変更しております。 この結果、従来と同一の方法を採用した場合と比べ、営業利益、経常利益、税引前当期純利益及び当期純利益は、それぞれ123,774千円減少しております。 また、この変更は従業員の増加等に伴い、当下期に行ったため、当中間会計期間は、前事業年度と同一の方法によっております。従って当中間会計期間は、変更後の方法によった場合に比べ、営業利益、経常利益及び税引前中間純利益及び中間純利益は128,390千円多く計上されております。	—

注 記 事 項

(貸借対照表関係)

第23期 (平成20年3月31日現在)	第24期 (平成21年3月31日現在)
※1 有形固定資産の減価償却累計額 建 物 126,027千円 器具備品 859,261千円 無形固定資産の減価償却累計額 電話加入権 60千円 ソフトウェア 111,411千円 商標権 9,393千円	※1 有形固定資産の減価償却累計額 建 物 150,704千円 器具備品 941,423千円 無形固定資産の減価償却累計額 電話加入権 72千円 商標権 11,337千円
※2 関係会社に対する債権債務 現金及び預金 12,481,426千円 未収投資助言報酬 478,296千円 未払手数料 509,702千円	※2 関係会社に対する債権債務 現金及び預金 10,311,398千円 未収投資助言報酬 398,818千円 未払手数料 331,400 千円
3 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行 1 行と当座貸越契約を締結しております。 当事業年度末における当座貸越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。 当座貸越極度額の総額 10,000,000千円 借入実行残高 一十千円	3 当社は、運転資金の効率的な調達を行うため取引銀行 1 行と当座貸越契約を締結しております。 当事業年度末における当座貸越契約に係る借入金未実行残高等は次のとおりであります。 当座貸越極度額の総額 10,000,000千円 借入実行残高 一十千円

差引額	10,000,000千円	差引額	10,000,000千円
4 当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York)Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成27年6月までの賃借料総額149,005千円の支払保証を行っております。		4 当社は、子会社であるSumitomo Mitsui Asset Management(New York)Inc.における賃貸借契約に係る賃借料に対し、平成27年6月までの賃借料総額128,926千円の支払保証を行っております。	

(損益計算書関係)

第23期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	第24期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)
※1 関係会社との取引に係るもの 受取利息 24,820千円	※1 関係会社との取引に係るもの 受取利息 18,943千円
※2 固定資産除却損は、器具備品12,082千円、電話加入権206千円であります。	※2 固定資産除却損は、器具備品688千円であります。

(株主資本等変動計算書関係)

第23期(自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)

1.発行済株式数に関する事項

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

2.剰余金の配当に関する事項

(1)配当金支払額等

決議	株式の種類	配当金の総額 (千円)	一株当たり 配当額(円)	基準日	効力発生日
平成19年6月25日 定時株主総会	普通株式	1,058,400	60,000	平成19年 3月31日	平成19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20年6月23日開催の第23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20年6月23日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	2,822,400	160,000	平成20年 3月31日	平成20年 6月24日

第24期(自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)

1.発行済株式数に関する事項

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

2.剰余金の配当に関する事項

(1)配当金支払額等

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

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

平成21年6月30日開催の第24回定時株主総会において次の通り付議いたします。

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

(リース取引関係)

第23期 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	第24期 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)																								
1.リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引 (借主側) ①リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額(単位：千円)	1.リース物件の所有権が借主に移転すると認められるもの以外のファイナンス・リース取引 (借主側) ①リース物件の取得価額相当額、減価償却累計額相当額及び期末残高相当額(単位：千円)																								
<table><tr><td></td><td>器具備品</td><td>合計</td></tr><tr><td>取得価額相当額</td><td>9,504</td><td>9,504</td></tr><tr><td>減価償却累計額相当額</td><td>7,603</td><td>7,603</td></tr><tr><td>期末残高相当額</td><td>1,900</td><td>1,900</td></tr></table>		器具備品	合計	取得価額相当額	9,504	9,504	減価償却累計額相当額	7,603	7,603	期末残高相当額	1,900	1,900	<table><tr><td></td><td>器具備品</td><td>合計</td></tr><tr><td>取得価額相当額</td><td>5,330</td><td>5,330</td></tr><tr><td>減価償却累計額相当額</td><td>5,330</td><td>5,330</td></tr><tr><td>期末残高相当額</td><td>-</td><td>-</td></tr></table>		器具備品	合計	取得価額相当額	5,330	5,330	減価償却累計額相当額	5,330	5,330	期末残高相当額	-	-
	器具備品	合計																							
取得価額相当額	9,504	9,504																							
減価償却累計額相当額	7,603	7,603																							
期末残高相当額	1,900	1,900																							
	器具備品	合計																							
取得価額相当額	5,330	5,330																							
減価償却累計額相当額	5,330	5,330																							
期末残高相当額	-	-																							
②未経過リース料期末残高相当額(単位：千円)	②未経過リース料期末残高相当額(単位：千円)																								
<table><tr><td>1年以内</td><td>2,030</td></tr><tr><td>合計</td><td>2,030</td></tr></table>	1年以内	2,030	合計	2,030	<table><tr><td>1年以内</td><td>-</td></tr><tr><td>合計</td><td>-</td></tr></table>	1年以内	-	合計	-																
1年以内	2,030																								
合計	2,030																								
1年以内	-																								
合計	-																								
③支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額 (単位：千円)	③支払リース料、減価償却費相当額及び支払利息相当額 (単位：千円)																								
<table><tr><td>支払リース料</td><td>2,067</td></tr><tr><td>減価償却費相当額</td><td>1,900</td></tr><tr><td>支払利息相当額</td><td>104</td></tr></table>	支払リース料	2,067	減価償却費相当額	1,900	支払利息相当額	104	<table><tr><td>支払リース料</td><td>2,067</td></tr><tr><td>減価償却費相当額</td><td>1,900</td></tr><tr><td>支払利息相当額</td><td>37</td></tr></table>	支払リース料	2,067	減価償却費相当額	1,900	支払利息相当額	37												
支払リース料	2,067																								
減価償却費相当額	1,900																								
支払利息相当額	104																								
支払リース料	2,067																								
減価償却費相当額	1,900																								
支払利息相当額	37																								
④減価償却費相当額及び利息相当額の算定方法	④減価償却費相当額及び利息相当額の算定方法																								
減価償却費相当額の算定方法	減価償却費相当額の算定方法																								
・リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法によっております。	・同左																								
利息相当額の算定方法	利息相当額の算定方法																								
・リース料総額とリース物件の取得価額相当額との差額を利息相当額とし、各期への配分方法については、利息法によっております。	・同左																								
2.オペレーティング・リース取引	2.オペレーティング・リース取引																								

(借主側)			(借主側)		
未経過リース料 (単位:千円)			未経過リース料(解約不能のもの)(単位:千円)		
1年以内		1,119	1年以内		710,121
1年超		1,959	1年超		962,627
合計		3,078	合計		1,672,748

(有価証券関係)

第23期(平成20年3月31日現在)

1.満期保有目的の債券で時価のあるもの

(単位：千円)

区分	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)貸借対照表日の時価が貸借対照表計上額を超えるもの	—	—	—
小計	—	—	—
(2)貸借対照表日の時価が貸借対照表計上額を超えないもの	5,994,478	5,993,700	△778
小計	5,994,478	5,993,700	△778
合計	5,994,478	5,993,700	△778

2.その他有価証券で時価のあるもの

(単位：千円)

区分	取得原価	貸借対照表計上額	差額
(1)貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 投資信託等	800,100	877,780	77,680
小計	800,100	877,780	77,680
(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	655,700	620,832	△34,867
小計	655,700	620,832	△34,867
合計	1,455,800	1,498,613	42,813

3.時価評価されていない有価証券の内容及び貸借対照表計上額

(単位：千円)

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

4.当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：千円)

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
-----	---------	---------

628,566	124,622	56
---------	---------	----

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

(単位：千円)

区分	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
(1)満期保有目的の債券 国債・地方債等	6,000,000	—	—	—
小計	6,000,000	—	—	—
(2)その他有価証券	—	—	—	—
小計	—	—	—	—
合計	6,000,000	—	—	—

第24期(平成21年3月31日現在)

1.満期保有目的の債券で時価のあるもの

(単位：千円)

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

2.その他有価証券で時価のあるもの

(単位：千円)

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

3.時価評価されていない有価証券の内容及び貸借対照表計上額

(単位：千円)

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

4.当事業年度中に売却したその他有価証券

(単位：千円)

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

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

(単位：千円)

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

（デリバティブ取引関係）

第23期(自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

第24期(自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)

当社は、デリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

（退職給付関係）

第23期 (自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日)	第24期 (自 平成20年4月 1日 至 平成21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、退職一時金制度を設けております	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。																						
2. 退職給付債務の額 (単位：千円) <table> <tr> <td>退職給付債務</td><td>749,327</td></tr> <tr> <td>退職給付引当金</td><td>749,327</td></tr> </table>	退職給付債務	749,327	退職給付引当金	749,327	2. 退職給付債務の額 (単位：千円) <table> <tr> <td>退職給付債務</td><td>972,202</td></tr> <tr> <td>退職給付引当金</td><td>972,202</td></tr> </table>	退職給付債務	972,202	退職給付引当金	972,202														
退職給付債務	749,327																						
退職給付引当金	749,327																						
退職給付債務	972,202																						
退職給付引当金	972,202																						
3. 退職給付費用の額 (単位：千円) <table> <tr> <td>勤務費用</td><td>126,881</td></tr> <tr> <td>利息費用</td><td>9,519</td></tr> <tr> <td>簡便法から原則法への変更による差額</td><td>125,138</td></tr> <tr> <td>その他</td><td>15,991</td></tr> <tr> <td>退職給付費用</td><td>277,530</td></tr> </table>	勤務費用	126,881	利息費用	9,519	簡便法から原則法への変更による差額	125,138	その他	15,991	退職給付費用	277,530	3. 退職給付費用の額 (単位：千円) <table> <tr> <td>勤務費用</td><td>145,258</td></tr> <tr> <td>利息費用</td><td>12,449</td></tr> <tr> <td>過去勤務債務の費用処理額</td><td>87,363</td></tr> <tr> <td>数理計算上の差異の費用処理額</td><td>6,153</td></tr> <tr> <td>その他</td><td>11,409</td></tr> <tr> <td>退職給付費用</td><td>262,634</td></tr> </table>	勤務費用	145,258	利息費用	12,449	過去勤務債務の費用処理額	87,363	数理計算上の差異の費用処理額	6,153	その他	11,409	退職給付費用	262,634
勤務費用	126,881																						
利息費用	9,519																						
簡便法から原則法への変更による差額	125,138																						
その他	15,991																						
退職給付費用	277,530																						
勤務費用	145,258																						
利息費用	12,449																						
過去勤務債務の費用処理額	87,363																						
数理計算上の差異の費用処理額	6,153																						
その他	11,409																						
退職給付費用	262,634																						
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%	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）
--	---

第23期 (平成20年3月31日現在)	第24期 (平成21年3月31日現在)
1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 (単位：千円)	1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 (単位：千円)
(1) 流動の部	(1) 流動の部
繰延税金資産	繰延税金資産
賞与引当金	賞与引当金
未払事業税	未払社会保険料
未払社会保険料	未払事業所税
未払事業所税	その他
その他	繰延税金資産計
繰延税金資産計	評価性引当額
評価性引当額	繰延税金資産合計
繰延税金資産合計	繰延税金負債
繰延税金資産の純額	未収還付事業税
	繰延税金負債合計
	繰延税金資産の純額
(2) 固定の部	(2) 固定の部
繰延税金資産	繰延税金資産
退職給付引当金	退職給付引当金
ソフトウェア償却	ソフトウェア償却
投資有価証券評価損	投資有価証券評価損
特定外国子会社留保金額	特定外国子会社留保金額
その他	その他有価証券評価差額金
繰延税金資産計	その他
評価性引当額	繰延税金資産計
繰延税金資産合計	評価性引当額
繰延税金負債	繰延税金資産合計
その他有価証券評価差額金	繰延税金資産の純額
繰延税金負債合計	

繰延税金資産の純額		15,024
2．法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳		
	(%)	
法定実効税率	40.7	
(調整)		
評価性引当額の増減	2.4	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.1	
住民税均等割等	0.0	
その他	△0.5	
税効果会計適用後の法人税等の負担率	42.7	
2．法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳		
	(%)	
法定実効税率	40.7	
(調整)		
評価性引当額の増減	5.4	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.5	
住民税均等割等	0.2	
その他	1.4	
税効果会計適用後の法人税等の負担率	48.2	

(関連当事者との取引)

第23期(自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)

(1) 親会社及び法人主要株主等

(単位：千円)

属性	会社等の 名称	住所	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	関係内容		取引の内容	取引金額	科目	期末残高
						役員の 兼任等	事業上の関係				
その他の 関係会社	住友生命 保険(相)	大阪市 中央区	199,000,000	生命保険業	% (被所有) 直接 35	—	当社の主要顧客 投信の販売委託	投資助言報酬 委託販売手数料	1,324,757 276,418	未収投資 助言報酬 未払手数料	331,981 42,572
その他の 関係会社	三井生命 保険(株)	東京都 千代田区	137,280,000	生命保険業	% (被所有) 直接 30	—	当社の主要顧客 投信の販売委託	投資助言報酬 委託販売手数料	273,276 251,915	未収投資 助言報酬 未払手数料	143,563 88,117
その他の 関係会社	三井住友 海上火災 保険(株)	東京都 中央区	139,595,523	損害保険業	% (被所有) 直接17.5	—	当社の主要顧客 投信の販売委託	投資助言報酬 委託販売手数料	579,567 441,750	未払手数料	53,804
その他の 関係会社	(株)三井 住友銀行	東京都 千代田区	664,986,500	銀行業	% (被所有) 直接17.5	1名	投信の販売委託	委託販売手数料	2,407,945	未払手数料	325,208

(注) 1. 上記金額のうち、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(2) 子会社等

(単位：千円)

属性	会社等の 名称	住所	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	関係内容		取引の内容	取引金額	科目	期末残高
						役員の 兼任等	事業上の関係				
子会社	Sumitomo Mitsui Asset Management (New York) Inc.	米国 ニューヨーク	65,334	投資顧問業	% 直接100	出向 2 名	業務委託	調査費	199,897	未払金	2,360
子会社	Sumitomo Mitsui Asset Management (London) Limited	英国 ロンドン	106,622	投資顧問業	% 直接100	出向 2 名	業務委託	調査費	139,844	—	—
子会社	Sumitomo Mitsui Asset Management (Hong Kong) Limited	香港	52,736	投資顧問業	% 直接100	出向 2 名	業務委託	調査費	563,312	未払費用	227,521

（注） 1．取引条件及び取引条件の決定方針等
（１）その他営業取引については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

（３）兄弟会社等

（単位：千円）

属性	会社等の 名称	住所	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	関係内容		取引の内容	取引金額	科目	期末残高
						役員の 兼任等	事業上の関係				
主要株主 の子会社	住生コン ピュー ターサー ビス(株)	大阪市 淀川区	300,000	情報処理 サービス業	%	—	IT機器等購入	IT機器・消耗品購入 IT運用保守サポート等	542,560	前払費用	4,225
							ITサポート			長期前払費用	11,572
主要株主 の子会社	エムエル アイ・シ ステムズ (株)	千葉県 柏市	100,000	情報システ ムの企画、 設計、保守 等	%	—	ITサポート	IT運用保守サポート等	116,364	未払費用	40,881
										未払金	1,412
主要株主 の子会社	エムエル アイ・シ ステムズ (株)	千葉県 柏市	100,000	情報システ ムの企画、 設計、保守 等	%	—	ITサポート	IT運用保守サポート等	116,364	前払費用	560
										未払費用	8,785

（注） 1．上記金額のうち、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）その他営業取引については、一般取引条件を基に、協議の上決定しております。

第24期(自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)

(1) 親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等

(単位：千円)

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

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

(追加情報)

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

(1 株当たり情報)

第23期 (自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日)		第24期 (自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日)	
1 株当たり純資産額	1,471,590円96銭	1 株当たり純資産額	1,405,954円57銭
1 株当たり当期純利益	335,563円48銭	1 株当たり当期純利益	96,132円19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	25,958,864千円	貸借対照表の純資産の部の合計額	24,801,038千円
普通株式に係る純資産額	25,958,864千円	普通株式に係る純資産額	24,801,038千円
普通株式の発行済株式数	17,640株	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	5,919,339千円	損益計算書上の当期純利益	1,695,771千円
普通株式に係る当期純利益	5,919,339千円	普通株式に係る当期純利益	1,695,771千円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳		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。		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23期(自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)

該当事項はありません。

第24期(自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)

該当事項はありません。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

5【その他】

- イ 定款の変更、その他の重要事項
平成21年6月30日に開催された定時株主総会において、株券不発行会社に移行するため株券を発行することを定める条項を削除する定款変更が決議されました。
- ロ 訴訟事件その他会社に重要な影響を与えることが予想される事実
該当ありません。

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

イ 受託会社

- （イ）名称 住友信託銀行株式会社
- （ロ）資本金の額 287,537百万円（平成21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21年3月末現在）
- ・ 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

ロ 販売会社

- （イ）名称 住友生命保険相互会社
- （ロ）資本金の額 369,000百万円（平成21年3月末現在の基金および基金償却積立金の合計額を記載しております。）
- （ハ）事業の内容 保険業法に基づき、保険業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

イ 受託会社

信託契約の受託会社であり、信託財産の保管・管理・計算等を行います。

ロ 販売会社

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

3【資本関係】

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

第3【参考情報】

当計算期間において書類が以下の通り提出されております。

提出年月日	書類名
平成20年4月8日	有価証券届出書の訂正届出書
平成20年12月26日	半期報告書
平成20年12月26日	有価証券届出書の訂正届出書

（参考情報）

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

なお、以下に記載した状況は、監査の対象外となっております。

「国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）」の状況

（１）貸借対照表

対象年月日	(平成21年4月13日現在)
科 目	金額(円)
資産の部	
I 流動資産	
コール・ローン	6,697,945,226
株式	266,124,701,700
派生商品評価勘定	282,868,717
未収入金	4,691,082
未収配当金	2,949,052,736
未収利息	14,680
流動資産合計	276,059,274,141
資産合計	276,059,274,141
負債の部	
I 流動負債	
前受金	283,895,000
未払金	10,415,000
未払解約金	51,135,617
流動負債合計	345,445,617
負債合計	345,445,617
純資産の部	
I 元本等	
1 元本	
元本	254,319,939,520
元本合計	254,319,939,520
2 剰余金	
剰余金	21,393,889,004
剰余金合計	21,393,889,004
元本等合計	275,713,828,524
純資産合計	275,713,828,524
負債・純資産合計	276,059,274,141

（注）「国内株式インデックス・マザーファンド（Ｂ号）」は、毎年11月30日（ただし、休業日の場合は翌営業日）に決算を行います。上記の貸借対照表は平成21年4月13日現在における同マザーファンドの状況です。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

項 目	(平成21年 4 月13日現在)				
1. 担保資産	代用として、担保に供している資産は次の通りであります。 <table> <tr> <th>担保資産</th><th>金額</th></tr> <tr> <td>株式</td><td>10,244,000,000円</td></tr> </table>	担保資産	金額	株式	10,244,000,000円
担保資産	金額				
株式	10,244,000,000円				
2. 受益権総数	平成21年 4 月13日現在における受益権の総数 254,319,939,520口				
3. 1 単位当たり純資産額	1.0841円 (1 万口＝10,841円)				

(デリバティブ取引に関する注記)

I. 取引の状況に関する事項

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

Ⅱ. 取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

株式関連

(平成21年4月13日現在)

(単位：円)

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

(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又は最終相場で評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

なお、() 内は手数料相当額を含んだ場合の金額を表わしています。

4. 株価指数先物取引の取引市場は、東京証券取引所です。

(関連当事者との取引に関する注記)

(自 平成20年3月31日 至 平成21年4月13日)

該当事項はありません。

(その他の注記)

(平成21年4月13日現在)	
本有価証券報告書における開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	164,301,406,709円
同期中における追加設定元本額	103,039,454,046円
同期中における一部解約元本額	13,020,921,235円
平成21年4月13日現在における元本の内訳	
三井住友・日本株式インデックス年金ファンド	5,843,648,760円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	200,776,198円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	1,109,630,927円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	648,705,460円
スミセイ・DCバランスファンド（機動的資産配分型）	2,931,591円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	175,991円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	212,074円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	228,860円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	235,153円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	238,656円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	274,529円
SMAM・国内株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	78,297,630,791円
バランスファンドVA（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	1,454,293,240円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型＜適格機関投資家限定＞	57,685,365,632円
SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	19,967,435,196円
SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	9,071,247,548円
SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	30,175,904,791円
SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	190,021,403円
SMAM・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	610,215,767円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	111,342,622円
SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	2,775,293,405円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型＜適格機関投資家限定＞	124,854,675円
SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	889,305,248円
SMAM・インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞	3,204,273,525円
SMAM・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	5,408,859,280円
SMAM・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	12,082,172,968円
SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	1,462,428,556円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	4,531,390,068円
SMAM・グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	217,963,490円
SMAM・バランスファンドVA20＜適格機関投資家専用＞	1,790,927,994円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	16,461,955,122円
合 計	254,319,939,520円

（３）附属明細表**①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	116,000	181	20,996,000	
日本水産	318,800	260	82,888,000	
マルハニチロホールディングス	508,000	132	67,056,000	
サカタのタネ	49,400	1,305	64,467,000	
ホクト	25,500	1,699	43,324,500	
住石ホールディングス	97,200	102	9,914,400	
日鉄鉱業	76,000	301	22,876,000	
三井松島産業	14,000	119	1,666,000	
国際石油開発帝石	1,258	724,000	910,792,000	
関東天然瓦斯開発	34,000	525	17,850,000	
石油資源開発	39,500	4,120	162,740,000	
ショーボンドホールディングス	24,100	1,921	46,296,100	
ダイセキ環境ソリューション	28	179,000	5,012,000	
間組	127,000	97	12,319,000	
東急建設	100,430	257	25,810,510	
コムシスホールディングス	134,000	838	112,292,000	
ミサワホーム	38,000	285	10,830,000	
高松コンストラクショングループ	20,900	1,304	27,253,600	
東建コーポレーション	10,230	2,445	25,012,350	
ヤマウラ	15,500	167	2,588,500	
大成建設	1,223,000	228	278,844,000	
大林組	771,000	496	382,416,000	
清水建設	783,000	452	353,916,000	
長谷工コーポレーション	1,394,500	73	101,798,500	
松井建設	31,000	385	11,935,000	
鹿島建設	1,132,000	268	303,376,000	
不動テトラ	210,200	81	17,026,200	
鉄建建設	147,000	99	14,553,000	
安藤建設	99,000	125	12,375,000	
太平工業	25,000	249	6,225,000	
西松建設	334,000	104	34,736,000	
三井住友建設	168,900	80	13,512,000	
前田建設工業	173,000	353	61,069,000	
奥村組	262,000	358	93,796,000	
大和小田急建設	7,000	188	1,316,000	
東鉄工業	32,000	457	14,624,000	
イチケン	39,000	107	4,173,000	
戸田建設	298,000	341	101,618,000	
熊谷組	220,000	59	12,980,000	
青木あすなろ建設	22,000	355	7,810,000	

北野建設	63,000	230	14,490,000	
植木組	46,000	131	6,026,000	
三井ホーム	35,000	409	14,315,000	
矢作建設工業	35,000	554	19,390,000	
大東建託	122,600	3,670	449,942,000	
新日本建設	48,800	104	5,075,200	
N I P P Oコーポレーション	55,000	769	42,295,000	
東亜道路工業	31,000	163	5,053,000	
前田道路	78,000	805	62,790,000	
日本道路	96,000	236	22,656,000	
東亜建設工業	248,000	115	28,520,000	
東洋建設	396,000	52	20,592,000	
五洋建設	328,000	130	42,640,000	
大成ロテック	56,000	135	7,560,000	
大林道路	35,000	154	5,390,000	
福田組	50,000	138	6,900,000	
住友林業	190,600	704	134,182,400	
日本基礎技術	42,600	203	8,647,800	
巴コーポレーション	43,700	212	9,264,400	
パナホーム	102,000	598	60,996,000	
大和ハウス工業	685,000	901	617,185,000	
ライト工業	63,700	229	14,587,300	
積水ハウス	773,000	843	651,639,000	
日特建設	106,000	50	5,300,000	
北陸電気工事	15,000	320	4,800,000	
コミュニチュア	23,000	565	12,995,000	
ユアテック	44,000	500	22,000,000	
西部電気工業	22,000	388	8,536,000	
四電工	23,000	477	10,971,000	
中電工	38,900	1,378	53,604,200	
関電工	124,000	662	82,088,000	
大明	37,000	873	32,301,000	
きんでん	162,000	822	133,164,000	
東京エネシス	31,000	708	21,948,000	
トーエネック	37,000	502	18,574,000	
住友電設	21,700	477	10,350,900	
日本電設工業	55,000	897	49,335,000	
協和エクシオ	99,000	757	74,943,000	
新日本空調	21,900	721	15,789,900	
東電通	41,000	167	6,847,000	
日本電話施設	44,000	285	12,540,000	
九電工	49,000	633	31,017,000	
三機工業	67,000	616	41,272,000	
日揮	276,000	1,249	344,724,000	
中外炉工業	98,000	249	24,402,000	
ヤマト	30,000	329	9,870,000	

太平電業	40,000	885	35,400,000	
高砂熱学工業	80,000	654	52,320,000	
日立プラントテクノロジー	77,000	301	23,177,000	
三晃金属工業	35,000	346	12,110,000	
N E C ネットエスアイ	23,200	941	21,831,200	
朝日工業社	32,000	300	9,600,000	
大気社	40,100	1,108	44,430,800	
ダイダン	40,000	417	16,680,000	
日比谷総合設備	40,000	882	35,280,000	
東芝プラントシステム	45,000	952	42,840,000	
東洋エンジニアリング	162,000	319	51,678,000	
千代田化工建設	220,000	616	135,520,000	
新興プラントエック	46,800	638	29,858,400	
日本製粉	171,000	395	67,545,000	
日清製粉グループ本社	247,500	1,060	262,350,000	
日東富士製粉	19,000	291	5,529,000	
昭和産業	121,000	279	33,759,000	
鳥越製粉	21,500	727	15,630,500	
日本農産工業	72,000	211	15,192,000	
協同飼料	107,000	101	10,807,000	
中部飼料	28,000	546	15,288,000	
日本配合飼料	95,000	103	9,785,000	
ユニ・チャーム ペットケア	16,100	2,380	38,318,000	
東洋精糖	64,000	101	6,464,000	
日本甜菜製糖	153,000	221	33,813,000	
三井製糖	108,000	277	29,916,000	
森永製菓	288,000	200	57,600,000	
中村屋	63,000	494	31,122,000	
江崎グリコ	99,000	959	94,941,000	
名糖産業	11,500	1,395	16,042,500	
不二家	76,000	130	9,880,000	
山崎製パン	185,000	1,030	190,550,000	
モロゾフ	42,000	300	12,600,000	
雪印乳業	305,500	259	79,124,500	
森永乳業	235,000	289	67,915,000	
ヤクルト本社	147,900	1,787	264,297,300	
明治ホールディングス	79,559	2,835	225,549,765	
プリマハム	169,000	121	20,449,000	
日本ハム	210,000	1,094	229,740,000	
伊藤ハム	214,000	313	66,982,000	
林兼産業	115,000	85	9,775,000	
丸大食品	116,000	231	26,796,000	
米久	27,500	930	25,575,000	
S F o o d s	13,000	749	9,737,000	
サッポロホールディングス	393,000	455	178,815,000	
アサヒビール	515,500	1,180	608,290,000	

キリンホールディングス	1,124,000	1,130	1,270,120,000	
宝ホールディングス	234,000	523	122,382,000	
オエノンホールディングス	87,000	202	17,574,000	
メルシャン	90,000	184	16,560,000	
養命酒製造	20,000	930	18,600,000	
三国コカ・コーラボトリング	34,300	768	26,342,400	
四国コカ・コーラボトリング	10,400	787	8,184,800	
コカ・コーラウエスト	84,900	1,611	136,773,900	
コカ・コーラ セントラル ジャパン	30,400	1,276	38,790,400	
ダイドードリンコ	13,000	2,595	33,735,000	
伊藤園	76,800	1,231	94,540,800	
キーコーヒー	21,000	1,538	32,298,000	
ジャパンフーズ	3,600	676	2,433,600	
日清オイリオグループ	122,000	408	49,776,000	
不二製油	74,700	992	74,102,400	
J-オイルミルズ	108,000	281	30,348,000	
キッコーマン	241,000	871	209,911,000	
味の素	748,000	722	540,056,000	
キューピー	141,900	1,037	147,150,300	
ハウス食品	99,700	1,392	138,782,400	
カゴメ	105,200	1,446	152,119,200	
焼津水産化学工業	13,300	995	13,233,500	
アリアケジャパン	22,700	1,318	29,918,600	
ニチレイ	310,000	365	113,150,000	
東洋水産	110,000	2,045	224,950,000	
日清食品ホールディングス	87,200	2,785	242,852,000	
永谷園	23,000	821	18,883,000	
フジッコ	28,000	1,065	29,820,000	
ロック・フィールド	13,100	1,231	16,126,100	
日本たばこ産業	6,091	273,200	1,664,061,200	
わらべや日洋	14,800	1,205	17,834,000	
なとり	10,000	749	7,490,000	
ミヨシ油脂	103,000	138	14,214,000	
片倉工業	31,400	801	25,151,400	
ゲンゼ	178,000	322	57,316,000	
川島織物セルコン	112,000	94	10,528,000	
東洋紡績	852,000	142	120,984,000	
ユニチカ	599,000	82	49,118,000	
富士紡ホールディングス	122,000	95	11,590,000	
日清紡ホールディングス	183,000	955	174,765,000	
倉敷紡績	265,000	140	37,100,000	
大和紡績	187,000	221	41,327,000	
シキボウ	174,000	99	17,226,000	
日本毛織	86,000	591	50,826,000	
トーア紡コーポレーション	122,000	61	7,442,000	
ダイドーリミテッド	36,400	524	19,073,600	

御幸ホールディングス	21,000	195	4,095,000	
帝国繊維	27,000	357	9,639,000	
帝人	1,054,000	256	269,824,000	
東レ	1,707,000	442	754,494,000	
三菱レイヨン	645,000	221	142,545,000	
サカイオーベックス	87,000	86	7,482,000	
住江織物	74,000	127	9,398,000	
日本フエルト	13,700	418	5,726,600	
イチカワ	21,000	260	5,460,000	
日本バイリーン	35,000	407	14,245,000	
芦森工業	70,000	108	7,560,000	
アツギ	245,000	135	33,075,000	
ダイニック	60,000	120	7,200,000	
セーレン	65,500	457	29,933,500	
小松精練	41,000	396	16,236,000	
ワコールホールディングス	152,000	1,195	181,640,000	
ホギメディカル	12,600	4,910	61,866,000	
サンエー・インターナショナル	12,300	711	8,745,300	
レナウン	51,900	137	7,110,300	
クラウディア	3,600	975	3,510,000	
三陽商会	127,000	334	42,418,000	
オンワードホールディングス	172,000	628	108,016,000	
東京スタイル	86,000	705	60,630,000	
デサント	69,000	376	25,944,000	
ヤマトインターナショナル	16,100	332	5,345,200	
特種東海ホールディングス	175,000	255	44,625,000	
王子製紙	1,056,000	412	435,072,000	
三菱製紙	374,000	145	54,230,000	
北越製紙	151,000	426	64,326,000	
中越パルプ工業	101,000	265	26,765,000	
大王製紙	109,000	891	97,119,000	
紀州製紙	82,000	82	6,724,000	
日本製紙グループ本社	120,200	2,565	308,313,000	
レンゴー	204,000	539	109,956,000	
トーモク	86,000	190	16,340,000	
ザ・パックス	16,900	1,221	20,634,900	
クラレ	379,000	879	333,141,000	
旭化成	1,598,000	404	645,592,000	
共和レザー	14,900	402	5,989,800	
コープケミカル	43,000	195	8,385,000	
昭和電工	1,336,000	161	215,096,000	
住友化学	1,891,000	390	737,490,000	
日本化成	51,000	152	7,752,000	
住友精化	45,000	279	12,555,000	
日産化学工業	179,000	898	160,742,000	
ラサ工業	115,000	122	14,030,000	

クレハ	166,000	422	70,052,000	
テイカ	42,000	246	10,332,000	
石原産業	422,000	80	33,760,000	
片倉チッカリン	23,000	316	7,268,000	
日本曹達	156,000	341	53,196,000	
東ソー	692,000	260	179,920,000	
トクヤマ	316,000	615	194,340,000	
セントラル硝子	264,000	336	88,704,000	
東亜合成	281,000	246	69,126,000	
ダイソー	100,000	211	21,100,000	
関東電化工業	61,000	324	19,764,000	
電気化学工業	540,000	213	115,020,000	
信越化学工業	427,400	4,820	2,060,068,000	
日本カーバイド工業	68,000	91	6,188,000	
堺化学工業	91,000	293	26,663,000	
エア・ウォーター	182,000	835	151,970,000	
大陽日酸	398,000	704	280,192,000	
日本化学工業	93,000	184	17,112,000	
日本パーカライジング	61,000	932	56,852,000	
高圧ガス工業	34,000	486	16,524,000	
四国化成工業	33,000	310	10,230,000	
戸田工業	44,000	379	16,676,000	
ステラ ケミファ	12,700	1,917	24,345,900	
保土谷化学工業	69,000	172	11,868,000	
日本触媒	170,000	627	106,590,000	
大日精化工業	94,000	228	21,432,000	
カネカ	319,000	536	170,984,000	
三菱瓦斯化学	442,000	494	218,348,000	
三井化学	787,000	340	267,580,000	
J S R	233,700	1,295	302,641,500	
東京応化工業	51,000	1,535	78,285,000	
三菱ケミカルホールディングス	1,488,500	386	574,561,000	
日本合成化学工業	70,000	289	20,230,000	
ダイセル化学工業	333,000	425	141,525,000	
住友ベークライト	261,000	396	103,356,000	
積水化学工業	575,000	514	295,550,000	
日本ゼオン	222,000	304	67,488,000	
アイカ工業	78,800	888	69,974,400	
宇部興産	1,078,000	205	220,990,000	
積水樹脂	35,000	681	23,835,000	
タキロン	63,000	239	15,057,000	
旭有機材工業	86,000	261	22,446,000	
日立化成工業	111,400	1,242	138,358,800	
ニチバン	27,000	279	7,533,000	
リケンテクノス	49,000	172	8,428,000	
大倉工業	67,000	243	16,281,000	

積水化成品工業	69,000	276	19,044,000	
群栄化学工業	70,000	209	14,630,000	
タイガースポリマー	13,400	337	4,515,800	
日本カーリット	21,300	333	7,092,900	
日本化薬	178,000	531	94,518,000	
日本精化	21,500	514	11,051,000	
A D E K A	110,300	640	70,592,000	
日油	231,000	345	79,695,000	
ハリマ化成	25,000	375	9,375,000	
花王	658,000	2,015	1,325,870,000	
第一工業製薬	46,000	186	8,556,000	
三洋化成工業	78,000	470	36,660,000	
大日本塗料	162,000	97	15,714,000	
日本ペイント	282,000	390	109,980,000	
関西ペイント	289,000	558	161,262,000	
中国塗料	75,000	592	44,400,000	
日本特殊塗料	23,000	287	6,601,000	
藤倉化成	29,400	399	11,730,600	
太陽インキ製造	18,300	1,515	27,724,500	
D I C	846,000	165	139,590,000	
サカタインクス	54,000	283	15,282,000	
東洋インキ製造	255,000	234	59,670,000	
富士フイルムホールディングス	626,400	2,615	1,638,036,000	
資生堂	437,000	1,514	661,618,000	
ライオン	297,000	452	134,244,000	
高砂香料工業	93,000	468	43,524,000	
マンダム	25,600	1,696	43,417,600	
ミルボン	10,700	2,120	22,684,000	
ファンケル	43,200	1,118	48,297,600	
コーセー	41,700	1,838	76,644,600	
ドクターシーラボ	156	147,000	22,932,000	
エスター	17,700	901	15,947,700	
コニシ	20,700	742	15,359,400	
長谷川香料	27,400	1,108	30,359,200	
小林製薬	35,600	3,110	110,716,000	
荒川化学工業	20,900	647	13,522,300	
メック	19,300	353	6,812,900	
日本高純度化学	66	223,000	14,718,000	
荏原ユーザイト	3,300	1,500	4,950,000	
アース製薬	19,100	2,485	47,463,500	
イハラケミカル工業	46,000	276	12,696,000	
北興化学工業	29,000	316	9,164,000	
大成ラミック	6,400	1,961	12,550,400	
クミアイ化学工業	70,000	322	22,540,000	
日本農薬	60,000	731	43,860,000	
アキレス	211,000	138	29,118,000	

有沢製作所	36,200	386	13,973,200	
日東電工	225,100	2,185	491,843,500	
スルガ	5,600	948	5,308,800	
アロン化成	14,000	263	3,682,000	
きもと	27,900	317	8,844,300	
シーアイ化成	24,000	381	9,144,000	
藤森工業	19,000	520	9,880,000	
前澤化成工業	16,900	930	15,717,000	
J S P	17,800	563	10,021,400	
エフビコ	13,000	3,640	47,320,000	
天馬	19,500	910	17,745,000	
信越ポリマー	49,500	428	21,186,000	
東リ	67,000	175	11,725,000	
ニフコ	53,200	1,338	71,181,600	
日本バルカー工業	98,000	222	21,756,000	
ユニ・チャーム	52,500	5,870	308,175,000	
協和発酵キリン	351,000	852	299,052,000	
武田薬品工業	901,600	3,540	3,191,664,000	
アステラス製薬	575,600	3,120	1,795,872,000	
大日本住友製薬	180,900	796	143,996,400	
塩野義製薬	374,000	1,687	630,938,000	
田辺三菱製薬	256,000	951	243,456,000	
わかもと製薬	30,000	406	12,180,000	
あすか製薬	28,000	836	23,408,000	
日本新薬	65,000	920	59,800,000	
中外製薬	340,700	1,675	570,672,500	
科研製薬	109,000	806	87,854,000	
エーザイ	315,900	2,915	920,848,500	
ロート製薬	117,000	832	97,344,000	
小野薬品工業	128,900	4,130	532,357,000	
久光製薬	79,400	2,970	235,818,000	
有機合成薬品工業	25,000	295	7,375,000	
持田製薬	105,000	939	98,595,000	
大正製薬	244,000	1,890	461,160,000	
参天製薬	79,300	2,520	199,836,000	
エスエス製薬	66,000	497	32,802,000	
扶桑薬品工業	91,000	262	23,842,000	
日本ケミファ	45,000	287	12,915,000	
ツムラ	75,600	2,650	200,340,000	
キッセイ薬品工業	52,000	1,911	99,372,000	
生化学工業	47,400	978	46,357,200	
栄研化学	17,200	621	10,681,200	
日水製薬	8,700	723	6,290,100	
鳥居薬品	14,700	1,308	19,227,600	
東和薬品	10,600	3,960	41,976,000	
沢井製薬	16,700	4,460	74,482,000	

ゼリア新薬工業	37,000	1,066	39,442,000	
第一三共	755,900	1,712	1,294,100,800	
キョーリン	63,000	1,165	73,395,000	
新日本石油	1,785,000	514	917,490,000	
昭和シェル石油	199,500	910	181,545,000	
コスモ石油	712,000	288	205,056,000	
富士興産	105,000	93	9,765,000	
ニチレキ	34,000	309	10,506,000	
東燃ゼネラル石油	382,000	962	367,484,000	
ユシロ化学工業	13,700	936	12,823,200	
ビービー・カストロール	11,600	229	2,656,400	
新日鉱ホールディングス	1,062,000	465	493,830,000	
AOCホールディングス	61,100	605	36,965,500	
出光興産	30,500	7,910	241,255,000	
横浜ゴム	313,000	451	141,163,000	
東洋ゴム工業	273,000	195	53,235,000	
ブリヂストン	804,400	1,550	1,246,820,000	
住友ゴム工業	221,500	691	153,056,500	
藤倉ゴム工業	15,900	305	4,849,500	
オカモト	104,000	372	38,688,000	
フコク	12,600	470	5,922,000	
ニッタ	23,600	1,153	27,210,800	
東海ゴム工業	47,300	926	43,799,800	
三ツ星ベルト	77,000	412	31,724,000	
バンドー化学	90,000	227	20,430,000	
日東紡績	250,000	187	46,750,000	
旭硝子	1,264,000	602	760,928,000	
日本板硝子	821,000	292	239,732,000	
石塚硝子	40,000	154	6,160,000	
日本山村硝子	116,000	194	22,504,000	
日本電気硝子	417,000	845	352,365,000	
オハラ	12,300	1,028	12,644,400	
住友大阪セメント	492,000	234	115,128,000	
太平洋セメント	1,020,000	191	194,820,000	
デイ・シイ	21,600	328	7,084,800	
日本ヒューム	14,000	270	3,780,000	
日本コンクリート工業	44,000	127	5,588,000	
東海カーボン	224,000	487	109,088,000	
日本カーボン	130,000	251	32,630,000	
東洋炭素	11,300	3,690	41,697,000	
ノリタケカンパニーリミテド	130,000	276	35,880,000	
TOTO	395,000	550	217,250,000	
日本碍子	308,000	1,524	469,392,000	
日本特殊陶業	227,000	953	216,331,000	
MARUWA	6,500	1,026	6,669,000	
品川白煉瓦	64,000	166	10,624,000	

黒崎播磨	66,000	199	13,134,000	
東京窯業	31,000	238	7,378,000	
ニッカトー	9,000	399	3,591,000	
フジミインコーポレーテッド	25,400	1,095	27,813,000	
エーアンドエーマテリアル	60,000	84	5,040,000	
ニチアス	128,000	218	27,904,000	
ニチハ	29,400	627	18,433,800	
新日本製鐵	6,730,000	307	2,066,110,000	
住友金属工業	4,382,000	227	994,714,000	
神戸製鋼所	3,547,000	158	560,426,000	
日新製鋼	983,000	197	193,651,000	
中山製鋼所	143,000	220	31,460,000	
合同製鐵	160,000	309	49,440,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	654,200	2,605	1,704,191,000	
東京製鐵	106,400	1,087	115,656,800	
共英製鋼	20,900	2,105	43,994,500	
大和工業	59,500	2,520	149,940,000	
東京鐵鋼	52,000	295	15,340,000	
大阪製鐵	15,700	1,675	26,297,500	
淀川製鋼所	194,000	453	87,882,000	
東洋鋼鈑	55,000	349	19,195,000	
住友鋼管	15,700	521	8,179,700	
丸一鋼管	70,800	2,135	151,158,000	
モリ工業	49,000	209	10,241,000	
大同特殊鋼	397,000	316	125,452,000	
日本高周波鋼業	110,000	99	10,890,000	
日本金属工業	184,000	147	27,048,000	
日本冶金工業	148,000	309	45,732,000	
山陽特殊製鋼	129,000	333	42,957,000	
愛知製鋼	135,000	340	45,900,000	
日立金属	169,000	810	136,890,000	
日本金属	78,000	135	10,530,000	
大平洋金属	179,000	578	103,462,000	
日本電工	105,000	402	42,210,000	
栗本鐵工所	147,000	73	10,731,000	
日本鑄鉄管	35,000	132	4,620,000	
三菱製鋼	155,000	212	32,860,000	
日亜鋼業	38,000	262	9,956,000	
日本精線	23,000	215	4,945,000	
シンニッタン	23,300	295	6,873,500	
新家工業	59,000	127	7,493,000	
日本輕金属	640,000	91	58,240,000	
大紀アルミニウム工業所	47,000	165	7,755,000	
三井金属鉱業	746,000	195	145,470,000	
東邦亜鉛	136,000	335	45,560,000	
三菱マテリアル	1,555,000	315	489,825,000	

住友金属鉱山	664,000	1,042	691,888,000	
DOWAホールディングス	325,000	411	133,575,000	
古河機械金属	435,000	104	45,240,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	24,700	2,830	69,901,000	
東邦チタニウム	41,100	1,331	54,704,100	
住友軽金属工業	363,000	92	33,396,000	
古河スカイ	130,000	174	22,620,000	
古河電気工業	811,000	322	261,142,000	
住友電気工業	844,800	975	823,680,000	
フジクラ	388,000	378	146,664,000	
三菱電線工業	181,000	94	17,014,000	
昭和電線ホールディングス	325,000	78	25,350,000	
タツタ電線	58,000	211	12,238,000	
日立電線	201,000	286	57,486,000	
沖電線	32,000	148	4,736,000	
カナレ電気	1,800	987	1,776,600	
平河ヒューテック	8,700	610	5,307,000	
リョービ	157,000	240	37,680,000	
アサヒホールディングス	36,400	1,350	49,140,000	
稲葉製作所	13,000	973	12,649,000	
三協・立山ホールディングス	342,000	77	26,334,000	
トーカロ	16,700	1,098	18,336,600	
アルファC o	11,700	552	6,458,400	
SUMCO	138,100	1,490	205,769,000	
東洋製罐	197,700	1,656	327,391,200	
ホッカンホールディングス	63,000	235	14,805,000	
コロナ	12,300	900	11,070,000	
横河ブリッジホールディングス	51,000	813	41,463,000	
駒井鉄工	20,000	214	4,280,000	
三和ホールディングス	260,000	296	76,960,000	
文化シャッター	70,000	343	24,010,000	
東洋シャッター	8,800	587	5,165,600	
住生活グループ	310,600	1,187	368,682,200	
日本ファイルコン	20,600	500	10,300,000	
ノーリツ	43,300	1,272	55,077,600	
長府製作所	27,400	1,793	49,128,200	
リンナイ	49,600	3,460	171,616,000	
ダイニチ工業	15,600	541	8,439,600	
日東精工	36,000	255	9,180,000	
三洋工業	45,000	161	7,245,000	
岡部	52,000	382	19,864,000	
中国工業	57,000	101	5,757,000	
東プレ	54,200	732	39,674,400	
高周波熱錬	38,400	687	26,380,800	
東京製綱	195,000	250	48,750,000	
バイオラックス	11,600	1,168	13,548,800	

日本発條	170,000	432	73,440,000	
中央発條	39,000	256	9,984,000	
三益半導体工業	20,100	1,098	22,069,800	
アタカ大機	20,000	196	3,920,000	
日本製鋼所	368,000	999	367,632,000	
日立ツール	13,700	616	8,439,200	
三浦工業	37,400	2,190	81,906,000	
タクマ	48,000	160	7,680,000	
ツガミ	77,000	171	13,167,000	
オークマ	154,000	431	66,374,000	
東芝機械	140,000	315	44,100,000	
アマダ	399,000	580	231,420,000	
アイダエンジニアリング	64,700	305	19,733,500	
牧野フライス製作所	123,000	339	41,697,000	
オーエスジー	105,900	662	70,105,800	
ダイジェット工業	38,000	170	6,460,000	
旭ダイヤモンド工業	62,000	490	30,380,000	
森精機製作所	110,400	1,052	116,140,800	
ディスコ	23,500	3,320	78,020,000	
日東工器	14,400	1,640	23,616,000	
豊和工業	172,000	61	10,492,000	
大阪機工	96,000	96	9,216,000	
東洋機械金属	29,300	156	4,570,800	
オーエム製作所	17,000	381	6,477,000	
津田駒工業	79,000	120	9,480,000	
島精機製作所	31,000	2,305	71,455,000	
日本スピンドル製造	33,000	154	5,082,000	
日阪製作所	28,000	986	27,608,000	
やまびこ	10,400	1,279	13,301,600	
ベガサスミシン製造	31,300	152	4,757,600	
ナブテスコ	107,000	854	91,378,000	
三井海洋開発	17,900	1,550	27,745,000	
レオン自動機	26,000	219	5,694,000	
SMC	76,500	9,700	742,050,000	
新川	22,900	1,050	24,045,000	
ホソカワミクロン	40,000	344	13,760,000	
ユニオンツール	13,500	2,605	35,167,500	
オイレス工業	28,900	1,239	35,807,100	
サトー	27,500	748	20,570,000	
日本エアーテック	8,300	413	3,427,900	
日精樹脂工業	25,500	250	6,375,000	
ワイエイシイ	14,000	397	5,558,000	
小松製作所	1,139,100	1,286	1,464,882,600	
住友重機械工業	643,000	401	257,843,000	
日立建機	130,900	1,389	181,820,100	
日工	39,000	272	10,608,000	

巴工業	9,500	905	8,597,500	
井関農機	261,000	255	66,555,000	
丸山製作所	65,000	171	11,115,000	
北川鉄工所	122,000	117	14,274,000	
クボタ	1,174,000	613	719,662,000	
荏原実業	6,000	1,019	6,114,000	
三菱化工機	78,000	243	18,954,000	
月島機械	39,000	511	19,929,000	
帝国電機製作所	9,200	1,490	13,708,000	
東京機械製作所	82,000	164	13,448,000	
新東工業	50,300	608	30,582,400	
澁谷工業	14,600	831	12,132,600	
アイチ コーポレーション	39,600	437	17,305,200	
小森コーポレーション	73,300	951	69,708,300	
鶴見製作所	20,000	570	11,400,000	
住友精密工業	45,000	360	16,200,000	
酒井重工業	59,000	148	8,732,000	
荏原製作所	546,000	278	151,788,000	
石井鐵工所	42,000	156	6,552,000	
西島製作所	23,700	1,368	32,421,600	
ダイキン工業	267,700	2,820	754,914,000	
オルガノ	45,000	608	27,360,000	
トーヨーカネツ	159,000	157	24,963,000	
栗田工業	141,600	2,320	328,512,000	
椿本チエイン	128,000	342	43,776,000	
大同工業	48,000	156	7,488,000	
T C M	68,000	135	9,180,000	
日本コンベヤ	102,000	90	9,180,000	
木村化工機	25,100	778	19,527,800	
アネスト岩田	44,000	264	11,616,000	
ダイフク	103,500	652	67,482,000	
加藤製作所	56,000	204	11,424,000	
油研工業	43,000	172	7,396,000	
タダノ	116,000	435	50,460,000	
フジテック	73,000	353	25,769,000	
シーケーディ	70,600	342	24,145,200	
キトー	50	85,900	4,295,000	
平和	62,300	927	57,752,100	
理想科学工業	20,900	900	18,810,000	
SANKYO	66,900	4,590	307,071,000	
日本金銭機械	25,700	895	23,001,500	
マースエンジニアリング	12,400	2,700	33,480,000	
福島工業	7,700	598	4,604,600	
キヤノンファインテック	23,100	1,010	23,331,000	
オーイズミ	11,100	225	2,497,500	
ダイコク電機	10,400	1,175	12,220,000	

アマノ	73,500	830	61,005,000	
J U K I	149,000	131	19,519,000	
サンデン	149,000	245	36,505,000	
蛇の目ミシン工業	266,000	64	17,024,000	
マックス	41,000	1,068	43,788,000	
グローリー	77,700	1,797	139,626,900	
大和冷機工業	36,000	342	12,312,000	
セガサミーホールディングス	281,500	897	252,505,500	
日本ピストンリング	113,000	104	11,752,000	
リケン	113,000	271	30,623,000	
帝国ピストンリング	32,200	340	10,948,000	
ホシザキ電機	48,800	873	42,602,400	
大豊工業	19,400	566	10,980,400	
日本精工	505,000	475	239,875,000	
NTN	429,000	338	145,002,000	
ジェイテクト	244,600	835	204,241,000	
不二越	246,000	206	50,676,000	
日本トムソン	80,000	405	32,400,000	
THK	153,100	1,441	220,617,100	
ユーシン精機	11,400	1,103	12,574,200	
前澤給装工業	9,400	1,605	15,087,000	
イーグル工業	32,000	375	12,000,000	
日本ビラー工業	30,000	323	9,690,000	
キッツ	110,000	312	34,320,000	
日立工機	83,800	829	69,470,200	
マキタ	149,200	2,330	347,636,000	
日立造船	1,097,500	100	109,750,000	
三菱重工業	4,365,000	345	1,505,925,000	
I H I	1,685,000	133	224,105,000	
イビデン	172,500	2,575	444,187,500	
コニカミノルタホールディングス	648,000	799	517,752,000	
ブラザー工業	296,100	877	259,679,700	
ミネベア	367,000	386	141,662,000	
日立製作所	4,107,000	320	1,314,240,000	
東芝	3,700,000	332	1,228,400,000	
三菱電機	2,286,000	535	1,223,010,000	
富士電機ホールディングス	585,000	148	86,580,000	
東洋電機製造	52,000	422	21,944,000	
安川電機	269,000	504	135,576,000	
シンフォニア テクノロジー	158,000	223	35,234,000	
明電舎	231,000	274	63,294,000	
オリジン電気	39,000	256	9,984,000	
デンヨー	24,700	664	16,400,800	
東芝テック	172,000	297	51,084,000	
芝浦メカトロニクス	47,000	357	16,779,000	
マブチモーター	38,000	4,320	164,160,000	

日本電産	121,600	5,020	610,432,000	
高岳製作所	104,000	228	23,712,000	
ダイヘン	126,000	294	37,044,000	
J V C ・ ケンウッド ・ ホールディングス	958,200	52	49,826,400	
日新電機	49,000	386	18,914,000	
大崎電気工業	39,000	862	33,618,000	
オムロン	291,200	1,357	395,158,400	
日東工業	36,400	791	28,792,400	
I D E C	32,300	568	18,346,400	
エルピーダメモリ	118,300	960	113,568,000	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	396,000	576	228,096,000	
サクサホールディングス	71,000	121	8,591,000	
メルコホールディングス	14,200	1,125	15,975,000	
テクノメディカ	20	220,000	4,400,000	
日本電気	2,473,000	305	754,265,000	
富士通	2,522,000	438	1,104,636,000	
沖電気工業	799,000	88	70,312,000	
岩崎通信機	130,000	99	12,870,000	
電気興業	62,000	524	32,488,000	
サンケン電気	150,000	339	50,850,000	
エプソントヨコム	89,000	284	25,276,000	
ナカヨ通信機	36,000	134	4,824,000	
アイホン	16,700	1,626	27,154,200	
N E C エレクトロニクス	49,500	954	47,223,000	
セイコーエプソン	180,200	1,570	282,914,000	
ワコム	493	139,300	68,674,900	
アルバック	40,200	1,887	75,857,400	
ナナオ	21,000	1,602	33,642,000	
日本信号	62,400	554	34,569,600	
京三製作所	59,000	303	17,877,000	
能美防災	33,000	759	25,047,000	
ホーチキ	24,000	513	12,312,000	
マスプロ電工	17,700	882	15,611,400	
日本無線	102,000	190	19,380,000	
パナソニック	2,613,800	1,330	3,476,354,000	
シャープ	1,184,000	918	1,086,912,000	
アンリツ	123,000	276	33,948,000	
富士通ゼネラル	61,000	231	14,091,000	
日立国際電気	74,000	587	43,438,000	
ソニー	1,299,900	2,555	3,321,244,500	
T D K	128,300	3,940	505,502,000	
帝国通信工業	53,000	199	10,547,000	
三洋電機	2,432,000	148	359,936,000	
宮越商事	8,800	316	2,780,800	
ミツミ電機	86,700	1,629	141,234,300	
タムラ製作所	84,000	205	17,220,000	

アルプス電気	210,400	475	99,940,000	
池上通信機	93,000	92	8,556,000	
日本電波工業	19,800	1,398	27,680,400	
日本トリム	3,550	1,935	6,869,250	
ローランド ディー. ジー.	9,600	1,420	13,632,000	
フォスター電機	25,900	716	18,544,400	
クラリオン	150,000	81	12,150,000	
SMK	77,000	254	19,558,000	
ヨコオ	22,700	431	9,783,700	
東光	128,000	124	15,872,000	
ホシデン	61,300	1,009	61,851,700	
ヒロセ電機	42,600	10,350	440,910,000	
日本航空電子工業	57,000	508	28,956,000	
TOA	28,000	471	13,188,000	
日立マクセル	54,300	806	43,765,800	
ユニデン	82,000	279	22,878,000	
アルパイン	54,800	825	45,210,000	
スミダコーポレーション	19,100	474	9,053,400	
アイコム	13,600	2,165	29,444,000	
船井電機	22,500	3,110	69,975,000	
横河電機	269,900	515	138,998,500	
新電元工業	94,000	166	15,604,000	
山武	62,700	1,721	107,906,700	
日本光電工業	49,400	1,164	57,501,600	
チノー	50,000	228	11,400,000	
共和電業	28,000	266	7,448,000	
日本電子材料	11,100	516	5,727,600	
堀場製作所	36,100	1,745	62,994,500	
アドバンテスト	167,500	1,631	273,192,500	
小野測器	28,000	363	10,164,000	
エスベック	25,700	514	13,209,800	
サンクス	17,700	290	5,133,000	
キーエンス	50,500	17,610	889,305,000	
日置電機	11,700	1,661	19,433,700	
シスメックス	46,600	3,020	140,732,000	
メガチップス	22,800	1,472	33,561,600	
OBARA	17,600	705	12,408,000	
日本電産コパル電子	24,400	530	12,932,000	
ミヤチテクノス	14,800	425	6,290,000	
東京電波	11,200	511	5,723,200	
澤藤電機	18,000	169	3,042,000	
コーセル	31,600	764	24,142,400	
日立メディコ	18,000	750	13,500,000	
新日本無線	22,000	229	5,038,000	
オプテックス	16,200	806	13,057,200	
千代田インテグレ	16,000	986	15,776,000	

東光電気	17,000	215	3,655,000	
スタンレー電気	172,500	1,369	236,152,500	
岩崎電気	94,000	183	17,202,000	
ウシオ電機	138,000	1,329	183,402,000	
岡谷電機産業	14,900	266	3,963,400	
ヘリオス テクノ ホールディング	26,600	185	4,921,000	
日本セラミック	17,400	979	17,034,600	
新神戸電機	25,000	682	17,050,000	
日本デジタル研究所	21,900	894	19,578,600	
古河電池	19,000	898	17,062,000	
双信電機	12,300	292	3,591,600	
図研	16,900	603	10,190,700	
日本電子	94,000	291	27,354,000	
カシオ計算機	235,300	782	184,004,600	
ファナック	236,900	7,120	1,686,728,000	
日本シイエムケイ	52,900	415	21,953,500	
エンプラス	15,500	904	14,012,000	
ローム	126,500	5,370	679,305,000	
浜松ホトニクス	89,000	2,020	179,780,000	
三井ハイテック	33,400	755	25,217,000	
新光電気工業	72,600	986	71,583,600	
京セラ	218,300	6,770	1,477,891,000	
太陽誘電	121,000	734	88,814,000	
村田製作所	274,300	3,750	1,028,625,000	
ユーシン	34,800	334	11,623,200	
双葉電子工業	42,800	1,718	73,530,400	
北陸電気工業	117,000	154	18,018,000	
パナソニック電工	399,000	766	305,634,000	
ニチコン	77,800	888	69,086,400	
日本ケミコン	133,000	248	32,984,000	
K O A	35,900	551	19,780,900	
市光工業	73,000	123	8,979,000	
小糸製作所	123,000	815	100,245,000	
ミツバ	53,000	307	16,271,000	
アロカ	15,700	753	11,822,100	
スター精密	46,200	883	40,794,600	
大日本スクリーン製造	281,000	221	62,101,000	
キヤノン電子	21,800	1,243	27,097,400	
キヤノン	1,421,200	3,190	4,533,628,000	
リコー	793,000	1,294	1,026,142,000	
日本電産サンキョー	73,000	408	29,784,000	
MUTOHホールディングス	36,000	143	5,148,000	
東京エレクトロン	178,800	4,190	749,172,000	
トヨタ紡織	85,400	1,150	98,210,000	
鬼怒川ゴム工業	70,000	133	9,310,000	
ユニプレス	34,800	843	29,336,400	

豊田自動織機	198,600	2,580	512,388,000	
モリタホールディングス	40,000	352	14,080,000	
三桜工業	27,600	419	11,564,400	
デンソー	538,500	2,340	1,260,090,000	
東海理化電機製作所	64,800	1,194	77,371,200	
三井造船	887,000	200	177,400,000	
佐世保重工業	149,000	205	30,545,000	
川崎重工業	2,033,000	212	430,996,000	
日本車輛製造	114,000	356	40,584,000	
日本輸送機	31,000	209	6,479,000	
近畿車輛	43,000	471	20,253,000	
日産自動車	3,096,300	524	1,622,461,200	
いすゞ自動車	1,165,000	165	192,225,000	
トヨタ自動車	3,150,100	3,940	12,411,394,000	※
日野自動車	351,000	282	98,982,000	
三菱自動車工業	5,480,000	150	822,000,000	
エフテック	7,400	562	4,158,800	
武蔵精密工業	24,400	1,315	32,086,000	
トヨタ車体	51,700	1,623	83,909,100	
日産車体	82,000	606	49,692,000	
関東自動車工業	36,000	1,104	39,744,000	
新明和工業	111,000	243	26,973,000	
極東開発工業	49,700	355	17,643,500	
日信工業	44,800	1,237	55,417,600	
トピー工業	221,000	159	35,139,000	
ティラド	79,000	160	12,640,000	
曙ブレーキ工業	68,000	511	34,748,000	
タチエス	33,400	588	19,639,200	
NOK	130,700	1,108	144,815,600	
フタバ産業	55,500	491	27,250,500	
カヤバ工業	172,000	223	38,356,000	
シロキ工業	50,000	206	10,300,000	
大同メタル工業	44,000	433	19,052,000	
プレス工業	105,000	144	15,120,000	
カルソニックカンセイ	160,000	217	34,720,000	
太平洋工業	51,000	293	14,943,000	
ケーヒン	56,300	1,335	75,160,500	
河西工業	38,000	213	8,094,000	
アイシン精機	224,200	1,953	437,862,600	
マツダ	975,000	266	259,350,000	
ダイハツ工業	259,000	880	227,920,000	
愛知機械工業	68,000	192	13,056,000	
今仙電機製作所	18,400	550	10,120,000	
本田技研工業	2,095,300	2,830	5,929,699,000	
スズキ	495,100	1,846	913,954,600	
富士重工業	836,000	405	338,580,000	

ヤマハ発動機	283,800	1,030	292,314,000	
ショーワ	52,500	533	27,982,500	
エクセディ	30,000	1,636	49,080,000	
豊田合成	69,300	1,852	128,343,600	
愛三工業	28,100	524	14,724,400	
ヨロズ	15,900	869	13,817,100	
エフ・シー・シー	36,000	1,271	45,756,000	
シマノ	95,000	3,100	294,500,000	
タカタ	44,700	1,140	50,958,000	
テイ・エス テック	40,000	1,101	44,040,000	
日本電産トーソク	7,400	730	5,402,000	
テルモ	176,400	3,630	640,332,000	
クリエートメディック	6,200	818	5,071,600	
日機装	71,000	562	39,902,000	
島津製作所	270,000	632	170,640,000	
JMS	41,000	362	14,842,000	
モリテックス	9,600	318	3,052,800	
長野計器	15,600	822	12,823,200	
東京計器	91,000	123	11,193,000	
愛知時計電機	26,000	247	6,422,000	
東京精密	47,100	958	45,121,800	
ニコン	427,000	1,366	583,282,000	
トプコン	58,500	459	26,851,500	
オリンパス	269,000	1,927	518,363,000	
理研計器	17,500	517	9,047,500	
タムロン	21,900	1,242	27,199,800	
HOYA	562,700	1,817	1,022,425,900	
ノーリツ銅機	22,400	865	19,376,000	
エー・アンド・デイ	21,700	257	5,576,900	
日本電産コパル	23,100	669	15,453,900	
シチズンホールディングス	316,400	491	155,352,400	
リズム時計工業	130,000	93	12,090,000	
セイコーホールディングス	94,000	218	20,492,000	
ニプロ	58,000	1,506	87,348,000	
SRIスポーツ	168	72,400	12,163,200	
バンダイナムコホールディングス	266,300	999	266,033,700	
共立印刷	22,900	159	3,641,100	
フランスベッドホールディングス	159,000	127	20,193,000	
パイロットコーポレーション	243	114,200	27,750,600	
トッパン・フォームズ	51,200	1,037	53,094,400	
フジシールインターナショナル	28,200	1,350	38,070,000	
タカラトミー	74,600	394	29,392,400	
廣済堂	25,600	182	4,659,200	
タカノ	11,700	625	7,312,500	
プロネクサス	29,900	636	19,016,400	
ホクシン	26,300	139	3,655,700	

ウッドワン	53,000	265	14,045,000	
大建工業	119,000	162	19,278,000	
凸版印刷	744,000	747	555,768,000	
大日本印刷	745,000	987	735,315,000	
図書印刷	48,000	253	12,144,000	
共同印刷	80,000	225	18,000,000	
日本写真印刷	38,200	3,390	129,498,000	
光村印刷	25,000	346	8,650,000	
宝印刷	11,300	838	9,469,400	
コンビ	16,000	698	11,168,000	
アシックス	244,000	694	169,336,000	
ツツミ	9,100	1,638	14,905,800	
ローランド	16,800	1,084	18,211,200	
小松ウオール工業	7,700	1,035	7,969,500	
ヤマハ	195,800	1,017	199,128,600	
河合楽器製作所	106,000	85	9,010,000	
クリナップ	27,800	422	11,731,600	
ビジョン	15,700	2,330	36,581,000	
パラマウントベッド	23,300	1,309	30,499,700	
キングジム	18,000	730	13,140,000	
リンテック	47,200	1,306	61,643,200	
イトーキ	53,900	249	13,421,100	
任天堂	129,400	26,830	3,471,802,000	
三菱鉛筆	22,300	995	22,188,500	
タカラスタANDARD	112,000	577	64,624,000	
コクヨ	127,400	737	93,893,800	
ナカバヤシ	61,000	201	12,261,000	
ダイワ精工	124,000	143	17,732,000	
サンウエーブ工業	38,000	159	6,042,000	
岡村製作所	104,000	496	51,584,000	
美津濃	122,000	402	49,044,000	
アデランスホールディングス	30,400	896	27,238,400	
東京電力	1,544,800	2,385	3,684,348,000	
中部電力	830,100	2,100	1,743,210,000	
関西電力	1,017,200	2,010	2,044,572,000	
中国電力	366,900	2,070	759,483,000	
北陸電力	251,600	2,225	559,810,000	
東北電力	612,200	2,050	1,255,010,000	
四国電力	258,700	2,675	692,022,500	
九州電力	540,900	2,085	1,127,776,500	
北海道電力	229,600	1,907	437,847,200	
沖縄電力	17,600	5,060	89,056,000	
電源開発	178,000	2,855	508,190,000	
東京瓦斯	3,106,000	341	1,059,146,000	
大阪瓦斯	2,629,000	301	791,329,000	
東邦瓦斯	639,000	458	292,662,000	

北海道瓦斯	49,000	252	12,348,000	
西部瓦斯	277,000	248	68,696,000	
静岡瓦斯	78,500	547	42,939,500	
東武鉄道	1,044,000	506	528,264,000	
相模鉄道	337,800	397	134,106,600	
東京急行電鉄	1,346,000	425	572,050,000	
京浜急行電鉄	615,000	700	430,500,000	
小田急電鉄	785,000	784	615,440,000	
京王電鉄	636,000	554	352,344,000	
京成電鉄	393,000	485	190,605,000	
富士急行	69,000	442	30,498,000	
新京成電鉄	33,000	344	11,352,000	
東日本旅客鉄道	456,800	5,170	2,361,656,000	
西日本旅客鉄道	2,284	305,000	696,620,000	
東海旅客鉄道	2,047	572,000	1,170,884,000	
アートコーポレーション	5,900	1,211	7,144,900	
西日本鉄道	316,000	365	115,340,000	
ハマキョウレックス	8,100	1,660	13,446,000	
サカイ引越センター	4,500	2,065	9,292,500	
近畿日本鉄道	2,215,000	408	903,720,000	
阪急阪神ホールディングス	1,644,000	448	736,512,000	
南海電気鉄道	514,000	440	226,160,000	
京阪電気鉄道	551,000	402	221,502,000	
名糖運輸	9,900	807	7,989,300	
名古屋鉄道	857,000	296	253,672,000	
日本通運	1,051,000	363	381,513,000	
ヤマトホールディングス	487,000	1,010	491,870,000	
山九	300,000	286	85,800,000	
丸運	17,400	268	4,663,200	
丸全昭和運輸	76,000	267	20,292,000	
センコー	87,000	285	24,795,000	
トナミホールディングス	60,000	260	15,600,000	
日本梱包運輸倉庫	69,000	853	58,857,000	
日本石油輸送	25,000	187	4,675,000	
福山通運	191,000	376	71,816,000	
セイノーホールディングス	190,000	519	98,610,000	
神奈川中央交通	28,000	534	14,952,000	
日立物流	51,700	972	50,252,400	
日本郵船	1,308,000	454	593,832,000	
商船三井	1,284,000	592	760,128,000	
川崎汽船	581,000	425	246,925,000	
新和海運	98,000	275	26,950,000	
乾汽船	29,400	690	20,286,000	
明治海運	25,600	404	10,342,400	
飯野海運	120,400	504	60,681,600	
太平洋海運	25,000	116	2,900,000	

共栄タンカー	26,000	243	6,318,000	
第一中央汽船	166,000	265	43,990,000	
全日本空輸	2,520,000	368	927,360,000	
日本航空	3,531,000	199	702,669,000	
パスコ	35,000	164	5,740,000	
国際航業ホールディングス	24,000	276	6,624,000	
日新	88,000	201	17,688,000	
三菱倉庫	174,000	1,016	176,784,000	
三井倉庫	108,000	370	39,960,000	
住友倉庫	194,000	368	71,392,000	
澁澤倉庫	75,000	410	30,750,000	
東陽倉庫	42,000	182	7,644,000	
日本トランスシティ	52,000	281	14,612,000	
ケイヒン	51,000	124	6,324,000	
安田倉庫	17,500	720	12,600,000	
東洋埠頭	76,000	135	10,260,000	
宇徳	18,300	285	5,215,500	
上組	289,000	642	185,538,000	
サンリツ	7,800	488	3,806,400	
キムラユニティー	4,400	713	3,137,200	
キューソー流通システム	6,300	933	5,877,900	
郵船航空サービス	19,700	1,185	23,344,500	
近鉄エクスプレス	22,300	1,975	44,042,500	
東海運	18,000	247	4,446,000	
バンテック	119	73,200	8,710,800	
システムプロ	168	42,800	7,190,400	
新日鉄ソリューションズ	16,700	1,113	18,587,100	
コア	6,900	608	4,195,200	
I Tホールディングス	79,900	1,120	89,488,000	
コーエーテクモホールディングス	38,580	700	27,006,000	
ドワンゴ	129	142,100	18,330,900	
ベリサーブ	15	126,200	1,893,000	
マクロミル	148	93,000	13,764,000	
ティーガイア	204	107,000	21,828,000	
GMOペイメントゲートウェイ	55	93,300	5,131,500	
ザッパラス	85	214,000	18,190,000	
インターネットイニシアティブ	156	120,200	18,751,200	
ソネットエンタテインメント	142	192,700	27,363,400	
S R Aホールディングス	10,800	577	6,231,600	
J B I Sホールディングス	29,300	332	9,727,600	
朝日ネット	16,000	253	4,048,000	
パナソニック電工インフォメーションシステムズ	4,300	1,467	6,308,100	
フェイス	1,196	6,770	8,096,920	
野村総合研究所	120,100	1,598	191,919,800	
サイバネットシステム	180	28,430	5,117,400	
シンプレクス・テクノロジー	435	30,600	13,311,000	

クレスコ	8,200	512	4,198,400	
フジ・メディア・ホールディングス	2,523	112,900	284,846,700	
オービック	7,590	13,040	98,973,600	
ティーディーシーソフトウェアエンジニアリング	5,600	697	3,903,200	
ヤフー	18,080	27,030	488,702,400	
トレンドマイクロ	118,000	2,930	345,740,000	
日本オラクル	38,700	3,610	139,707,000	
アルファシステムズ	7,200	1,631	11,743,200	
フューチャーアーキテクト	299	32,900	9,837,100	
シーエーシー	15,100	592	8,939,200	
ソフトバンク・テクノロジー	5,400	576	3,110,400	
トーセ	6,600	593	3,913,800	
オービックビジネスコンサルタント	8,000	3,340	26,720,000	
日立ビジネスソリューション	7,500	559	4,192,500	
伊藤忠テクノソリューションズ	30,600	2,075	63,495,000	
アイティフォー	26,700	348	9,291,600	
東計電算	3,100	1,089	3,375,900	
エクスネット	30	130,400	3,912,000	
大塚商会	19,400	4,090	79,346,000	
サイボウズ	386	17,000	6,562,000	
アグレックス	3,900	743	2,897,700	
電通国際情報サービス	18,200	505	9,191,000	
ウェザーニューズ	7,600	1,176	8,937,600	
C I J	22,800	317	7,227,600	
ネットワンシステムズ	599	124,200	74,395,800	
アルゴグラフィックス	10,200	954	9,730,800	
エイベックス・グループ・ホールディングス	46,700	896	41,843,200	
日本ユニシス	58,900	660	38,874,000	
富士通ビジネスシステム	14,200	1,177	16,713,400	
兼松エレクトロニクス	14,000	674	9,436,000	
東京放送ホールディングス	145,700	1,393	202,960,100	
日本テレビ放送網	23,200	9,290	215,528,000	
テレビ朝日	613	117,600	72,088,800	
テレビ東京	9,300	3,710	34,503,000	
スカパーJ S A Tホールディングス	1,865	37,250	69,471,250	
アイ・ティー・シーネットワーク	50	148,200	7,410,000	
イー・アクセス	1,103	61,500	67,834,500	
NECモバイリング	8,600	1,545	13,287,000	
日本電信電話	1,112,400	3,760	4,182,624,000	
KDD I	3,756	475,000	1,784,100,000	
光通信	31,800	2,235	71,073,000	
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	23,902	135,600	3,241,111,200	
学習研究社	87,000	159	13,833,000	
ゼンリン	35,600	1,089	38,768,400	
昭文社	17,300	466	8,061,800	
角川グループホールディングス	21,400	1,939	41,494,600	

インプレスホールディングス	34,200	109	3,727,800	
アイネット	11,600	495	5,742,000	
松竹	135,000	675	91,125,000	
東宝	172,400	1,397	240,842,800	
東映	104,000	485	50,440,000	
葵プロモーション	13,500	486	6,561,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	1,495	258,700	386,756,500	
D T S	24,000	704	16,896,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	62,000	1,788	110,856,000	
シーイーシー	13,600	617	8,391,200	
日立ソフトウェアエンジニアリング	34,900	1,221	42,612,900	
カプコン	52,200	1,609	83,989,800	
ジャステック	12,100	475	5,747,500	
住商情報システム	25,200	1,115	28,098,000	
日本システムウエア	10,600	298	3,158,800	
日立情報システムズ	19,900	1,662	33,073,800	
アイネス	31,800	488	15,518,400	
TKC	22,600	1,899	42,917,400	
富士ソフト	30,400	1,514	46,025,600	
ソラン	26,700	403	10,760,100	
日本システムディベロップメント	43,200	709	30,628,800	
コナミ	110,000	1,550	170,500,000	
福井コンピュータ	8,400	285	2,394,000	
日商エレクトロニクス	10,600	999	10,589,400	
J B C Cホールディングス	21,500	572	12,298,000	
ソフトバンク	986,900	1,524	1,504,035,600	
ハウスイ	36,000	89	3,204,000	
インターニックス	12,600	321	4,044,600	
高千穂交易	8,300	1,006	8,349,800	
伊藤忠食品	5,700	3,270	18,639,000	
高千穂電気	14,000	700	9,800,000	
J A L U X	5,900	1,314	7,752,600	
トーメンデバイス	2,800	953	2,668,400	
双日	1,508,000	157	236,756,000	
アルフレッサ ホールディングス	48,200	3,530	170,146,000	
横浜冷凍	55,000	572	31,460,000	
神栄	39,000	125	4,875,000	
山下医科器械	2,700	1,051	2,837,700	
ラサ商事	10,000	345	3,450,000	
あい ホールディングス	59,800	292	17,461,600	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	30,300	456	13,816,800	
日本コークス工業	164,500	114	18,753,000	
ミタチ産業	7,200	393	2,829,600	
J F E商事ホールディングス	157,000	318	49,926,000	
グリーンホスピタルサプライ	254	35,200	8,940,800	
協栄産業	35,000	204	7,140,000	

小野建	20,300	753	15,285,900	
佐島電機	21,100	396	8,355,600	
エコートレーディング	5,400	806	4,352,400	
伯東	16,000	603	9,648,000	
中山福	12,500	519	6,487,500	
ナガイレーベン	12,600	1,750	22,050,000	
菱食	23,700	2,080	49,296,000	
松田産業	18,100	1,022	18,498,200	
メディセオ・パルタックホールディングス	260,600	1,001	260,860,600	
アドヴァン	18,800	441	8,290,800	
S P K	5,700	1,062	6,053,400	
アズワン	16,100	1,643	26,452,300	
スズデン	5,600	515	2,884,000	
尾家産業	7,900	868	6,857,200	
シモジマ	15,300	1,187	18,161,100	
ドウシシャ	12,700	1,211	15,379,700	
高速	12,500	517	6,462,500	
黒田電気	35,700	618	22,062,600	
丸文	25,100	286	7,178,600	
ハピネット	6,700	1,151	7,711,700	
トーメンエレクトロニクス	8,200	972	7,970,400	
エクセル	10,800	925	9,990,000	
マルカキカイ	7,700	575	4,427,500	
ガリバーインターナショナル	6,130	1,440	8,827,200	
日本エム・ディ・エム	27,700	169	4,681,300	
進和	12,900	1,263	16,292,700	
ダイトエレクトロン	13,400	439	5,882,600	
シークス	18,600	331	6,156,600	
田中商事	5,100	325	1,657,500	
オーハシテクニカ	14,700	677	9,951,900	
マクニカ	10,700	1,188	12,711,600	
白銅	7,400	570	4,218,000	
伊藤忠商事	1,809,000	575	1,040,175,000	
丸紅	2,115,000	401	848,115,000	
高島	57,000	141	8,037,000	
F & A アクアホールディングス	20,900	946	19,771,400	
長瀬産業	125,000	813	101,625,000	
蝶理	161,000	105	16,905,000	
豊田通商	242,300	1,258	304,813,400	
三共生興	48,500	171	8,293,500	
兼松	520,000	96	49,920,000	
三井物産	2,085,000	1,206	2,514,510,000	
日本紙パルプ商事	122,000	271	33,062,000	
日立ハイテクノロジーズ	84,200	1,451	122,174,200	
カメイ	29,000	451	13,079,000	
東都水産	53,000	115	6,095,000	

スターゼン	76,000	224	17,024,000	
山善	92,300	292	26,951,600	
椿本興業	23,000	205	4,715,000	
住友商事	1,427,700	961	1,372,019,700	
内田洋行	61,000	302	18,422,000	
三菱商事	1,807,700	1,607	2,904,973,900	
第一実業	50,000	246	12,300,000	
キヤノンマーケティングジャパン	91,800	1,437	131,916,600	
西華産業	104,000	210	21,840,000	
佐藤商事	21,400	532	11,384,800	
菱洋エレクトロ	24,900	822	20,467,800	
東京産業	17,500	249	4,357,500	
ユアサ商事	271,000	104	28,184,000	
神鋼商事	55,000	155	8,525,000	
阪和興業	243,000	263	63,909,000	
カナデン	28,000	446	12,488,000	
菱電商事	31,000	427	13,237,000	
フルサト工業	13,800	758	10,460,400	
岩谷産業	269,000	220	59,180,000	
すてきナイスグループ	106,000	157	16,642,000	
昭光通商	91,000	106	9,646,000	
ニチモウ	45,000	145	6,525,000	
極東貿易	35,000	142	4,970,000	
イワキ	33,000	189	6,237,000	
三愛石油	56,000	357	19,992,000	
稲畑産業	67,600	285	19,266,000	
G S I クレオス	81,000	96	7,776,000	
明和産業	23,700	136	3,223,200	
東邦ホールディングス	55,800	988	55,130,400	
サンゲツ	40,900	2,065	84,458,500	
ミツウロコ	37,400	563	21,056,200	
シナネン	56,000	432	24,192,000	
伊藤忠エネクス	62,800	528	33,158,400	
ザ・トーカイ	61,000	362	22,082,000	
サンリオ	67,700	740	50,098,000	
サンワテクノス	14,500	358	5,191,000	
リョーサン	38,500	2,070	79,695,000	
新光商事	25,900	695	18,000,500	
トーヨー	44,000	329	14,476,000	
三信電気	30,700	664	20,384,800	
東陽テクニカ	26,600	885	23,541,000	
モスフードサービス	33,100	1,506	49,848,600	
加賀電子	27,300	854	23,314,200	
ソーダニッカ	23,000	285	6,555,000	
立花エレテック	17,200	626	10,767,200	
太平洋興発	72,000	65	4,680,000	

ヤマタネ	141,000	103	14,523,000	
丸紅建材リース	14,000	128	1,792,000	
トラスコ中山	27,400	1,198	32,825,200	
オートバックスセブン	39,000	2,820	109,980,000	
ユーエスシー	10,400	784	8,153,600	
加藤産業	35,200	1,356	47,731,200	
富士エレクトロニクス	13,200	744	9,820,800	
J Kホールディングス	20,100	547	10,994,700	
ユニダックス	13,500	412	5,562,000	
日伝	9,300	2,740	25,482,000	
北沢産業	30,000	163	4,890,000	
杉本商事	11,900	887	10,555,300	
因幡電機産業	22,800	2,185	49,818,000	
住金物産	121,000	216	26,136,000	
ミスミグループ本社	81,600	1,379	112,526,400	
江守商事	3,400	529	1,798,600	
タキヒヨー	48,000	440	21,120,000	
スズケン	86,100	2,490	214,389,000	
ジェコス	14,900	463	6,898,700	
ローソン	75,900	3,800	288,420,000	
サンエー	9,100	2,685	24,433,500	
キリン堂	10,400	447	4,648,800	
ダイユーエイト	4,700	611	2,871,700	
カワチ薬品	17,200	1,542	26,522,400	
エービーシー・マート	25,800	2,115	54,567,000	
ハードオフコーポレーション	7,400	363	2,686,200	
アスクル	23,700	1,473	34,910,100	
ゲオ	460	56,400	25,944,000	
ポイント	21,950	4,050	88,897,500	
シー・ヴィ・エス・ペイエリア	20,000	128	2,560,000	
くらコーポレーション	61	138,000	8,418,000	
キャンドゥ	102	92,800	9,465,600	
バル	7,050	1,028	7,247,400	
エディオン	100,900	382	38,543,800	
サーラコーポレーション	23,500	528	12,408,000	
パルス	141	70,500	9,940,500	
あみやき亭	38	131,300	4,989,400	
ハニーズ	19,210	493	9,470,530	
アルペン	18,900	1,591	30,069,900	
ビックカメラ	709	25,970	18,412,730	
DCM Japanホールディングス	123,100	509	62,657,900	
ユニバース	2,500	1,107	2,767,500	
J. フロント リテイリング	611,000	407	248,677,000	
ドトール・日レスホールディングス	33,900	1,320	44,748,000	
マツモトキヨシホールディングス	45,400	1,595	72,413,000	
ココカラファイン ホールディングス	13,900	868	12,065,200	

三越伊勢丹ホールディングス	443,600	884	392,142,400	
クリエイイトSDホールディングス	9,100	1,649	15,005,900	
ブックオフコーポレーション	14,100	799	11,265,900	
あさひ	4,500	1,850	8,325,000	
サークルKサンクス	59,100	1,379	81,498,900	
日本調剤	5,210	1,236	6,439,560	
コスモス薬品	10,000	1,305	13,050,000	
セブン&アイ・ホールディングス	966,100	2,105	2,033,640,500	
ツルハホールディングス	18,100	2,510	45,431,000	
サンマルクホールディングス	7,600	2,515	19,114,000	
フェリシモ	7,200	1,639	11,800,800	
トリドール	17	348,000	5,916,000	
はるやま商事	13,800	337	4,650,600	
カッパ・クリエイト	14,900	1,762	26,253,800	
ライトオン	21,900	699	15,308,100	
ジーンズメイト	5,800	482	2,795,600	
良品計画	25,600	3,750	96,000,000	
三城ホールディングス	33,300	898	29,903,400	
コナカ	37,600	242	9,099,200	
ハウス オブ ローゼ	1,600	1,275	2,040,000	
G-7ホールディングス	3,700	344	1,272,800	
イオン北海道	19,200	300	5,760,000	
コジマ	38,500	378	14,553,000	
コーナン商事	29,300	995	29,153,500	
エコス	7,800	667	5,202,600	
ワタミ	31,600	2,010	63,516,000	
マルシェ	2,900	679	1,969,100	
ドン・キホーテ	44,800	1,431	64,108,800	
メガネトップ	14,950	989	14,785,550	
西松屋チェーン	65,000	734	47,710,000	
ゼンショー	82,400	482	39,716,800	
幸楽苑	13,200	1,120	14,784,000	
ユニマットライフ	7,300	827	6,037,100	
ハークスレイ	7,500	786	5,895,000	
サイゼリヤ	28,600	1,028	29,400,800	
ポプラ	8,500	616	5,236,000	
ユナイテッドアローズ	34,600	533	18,441,800	
ハイデイ日高	10,000	967	9,670,000	
京都きもの友禅	13,900	640	8,896,000	
コロワイド	53,500	523	27,980,500	
壺番屋	6,500	2,105	13,682,500	
トップカルチャー	8,100	306	2,478,600	
スギホールディングス	38,900	1,811	70,447,900	
ムトウ	30,500	417	12,718,500	
ファミリーマート	74,500	2,750	204,875,000	
木曽路	25,500	1,840	46,920,000	

千趣会	44,500	636	28,302,000	
タカキュー	25,000	136	3,400,000	
ケーヨー	50,900	465	23,668,500	
上新電機	56,000	543	30,408,000	
日本瓦斯	26,100	1,378	35,965,800	
ベスト電器	80,500	274	22,057,000	
マルエツ	50,000	474	23,700,000	
ロイヤルホールディングス	39,600	1,008	39,916,800	
東天紅	27,000	129	3,483,000	
いなげや	24,000	905	21,720,000	
島忠	58,600	1,748	102,432,800	
チヨダ	35,000	1,306	45,710,000	
ライフコーポレーション	15,000	1,669	25,035,000	
カスミ	46,000	407	18,722,000	
リンガーハット	19,600	1,205	23,618,000	
M r M a x	30,300	418	12,665,400	
テンアライド	15,100	296	4,469,600	
A O K I ホールディングス	26,300	925	24,327,500	
オークワ	34,000	1,074	36,516,000	
コメリ	33,500	1,921	64,353,500	
青山商事	61,900	1,452	89,878,800	
しまむら	25,100	6,210	155,871,000	
C F S コーポレーション	31,000	665	20,615,000	
高島屋	328,000	665	218,120,000	
丸善	138,000	81	11,178,000	
松屋	49,000	1,563	76,587,000	
エイチ・ツー・オー リテイリング	157,000	609	95,613,000	
丸栄	42,000	184	7,728,000	
ニッセンホールディングス	60,800	380	23,104,000	
パルコ	69,400	699	48,510,600	
丸井グループ	313,500	608	190,608,000	
原信ナルスホールディングス	13,800	905	12,489,000	
井筒屋	168,000	56	9,408,000	
ダイエー	115,050	393	45,214,650	
イズミヤ	79,000	462	36,498,000	
イオン	975,100	773	753,752,300	
ユニー	182,000	745	135,590,000	
イズミ	65,400	1,089	71,220,600	
東武ストア	27,000	314	8,478,000	
平和堂	48,200	1,050	50,610,000	
フジ	26,700	1,693	45,203,100	
ヤオコー	13,500	2,735	36,922,500	
ゼビオ	25,800	1,444	37,255,200	
ケーズホールディングス	43,000	1,624	69,832,000	
O l y m p i c	17,400	641	11,153,400	
元氣寿司	5,300	1,193	6,322,900	

ヤマダ電機	117,640	4,870	572,906,800	
アークランドサカモト	18,800	738	13,874,400	
ニトリ	52,350	5,320	278,502,000	
グルメ杵屋	17,000	610	10,370,000	
愛眼	16,900	568	9,599,200	
吉野家ホールディングス	541	108,900	58,914,900	
松屋フーズ	10,200	1,341	13,678,200	
サガミチェーン	29,000	910	26,390,000	
プレナス	30,800	1,367	42,103,600	
ミニストップ	16,900	1,450	24,505,000	
アークス	28,500	1,282	36,537,000	
バロー	47,900	753	36,068,700	
大庄	13,800	1,213	16,739,400	
ファーストリテイリング	56,600	10,130	573,358,000	
サンドラッグ	45,900	1,581	72,567,900	
ヤマザワ	5,300	1,206	6,391,800	
やまや	3,800	576	2,188,800	
ベルーナ	34,750	359	12,475,250	
新生銀行	1,425,000	127	180,975,000	
あおぞら銀行	900,000	107	96,300,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	14,187,300	531	7,533,456,300	
りそなホールディングス	781,500	1,353	1,057,369,500	
中央三井トラスト・ホールディングス	1,236,000	368	454,848,000	
三井住友フィナンシャルグループ	1,021,500	3,040	3,105,360,000	
第四銀行	335,000	388	129,980,000	
北越銀行	283,000	168	47,544,000	
西日本シティ銀行	791,000	202	159,782,000	
札幌北洋ホールディングス	370,500	291	107,815,500	
千葉銀行	955,000	489	466,995,000	
横浜銀行	1,670,000	420	701,400,000	
常陽銀行	938,000	460	431,480,000	
群馬銀行	565,000	510	288,150,000	
武蔵野銀行	37,200	2,825	105,090,000	
千葉興業銀行	47,100	963	45,357,300	
関東つくば銀行	75,200	299	22,484,800	
東京都民銀行	46,900	1,538	72,132,200	
七十七銀行	408,000	529	215,832,000	
青森銀行	152,000	373	56,696,000	
秋田銀行	166,000	347	57,602,000	
山形銀行	145,000	455	65,975,000	
岩手銀行	16,300	4,760	77,588,000	
東邦銀行	187,000	376	70,312,000	
荘内銀行	129,000	178	22,962,000	
東北銀行	129,000	149	19,221,000	
みちのく銀行	125,000	231	28,875,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	1,049,000	313	328,337,000	

静岡銀行	756,000	954	721,224,000	
十六銀行	312,000	352	109,824,000	
スルガ銀行	283,000	843	238,569,000	
八十二銀行	455,000	594	270,270,000	
山梨中央銀行	159,000	506	80,454,000	
大垣共立銀行	277,000	446	123,542,000	
福井銀行	210,000	311	65,310,000	
北國銀行	283,000	353	99,899,000	
清水銀行	8,300	4,080	33,864,000	
滋賀銀行	226,000	536	121,136,000	
南都銀行	242,000	541	130,922,000	
百五銀行	238,000	499	118,762,000	
京都銀行	418,000	834	348,612,000	
三重銀行	111,000	290	32,190,000	
池田銀行	16,300	3,850	62,755,000	
ほくほくフィナンシャルグループ	1,693,000	173	292,889,000	
広島銀行	712,000	377	268,424,000	
山陰合同銀行	145,000	763	110,635,000	
中国銀行	198,000	1,278	253,044,000	
鳥取銀行	87,000	265	23,055,000	
伊予銀行	275,000	983	270,325,000	
百十四銀行	281,000	473	132,913,000	
四国銀行	179,000	373	66,767,000	
阿波銀行	213,000	588	125,244,000	
鹿児島銀行	168,000	673	113,064,000	
大分銀行	133,000	529	70,357,000	
宮崎銀行	127,000	391	49,657,000	
肥後銀行	190,000	561	106,590,000	
佐賀銀行	149,000	307	45,743,000	
十八銀行	158,000	312	49,296,000	
沖縄銀行	19,800	3,010	59,598,000	
琉球銀行	52,500	817	42,892,500	
住友信託銀行	2,299,000	419	963,281,000	
みずほ信託銀行	2,292,000	100	229,200,000	
八千代銀行	15,100	3,040	45,904,000	
みずほフィナンシャルグループ	13,622,300	196	2,669,970,800	
紀陽ホールディングス	963,000	124	119,412,000	
山口フィナンシャルグループ	225,000	974	219,150,000	
長野銀行	96,000	248	23,808,000	
名古屋銀行	235,000	413	97,055,000	
愛知銀行	8,800	6,940	61,072,000	
第三銀行	150,000	291	43,650,000	
中京銀行	115,000	322	37,030,000	
東日本銀行	130,000	260	33,800,000	
愛媛銀行	154,000	251	38,654,000	
トマト銀行	97,000	237	22,989,000	

みなと銀行	261,000	141	36,801,000	
京葉銀行	217,000	389	84,413,000	
関西アーバン銀行	264,000	199	52,536,000	
栃木銀行	131,000	473	61,963,000	
北日本銀行	8,500	2,830	24,055,000	
香川銀行	96,000	409	39,264,000	
徳島銀行	74,000	491	36,334,000	
福島銀行	343,000	53	18,179,000	
大東銀行	194,000	64	12,416,000	
S B I ホールディングス	19,244	12,970	249,594,680	
ジャフコ	37,000	2,240	82,880,000	
大和証券グループ本社	1,604,000	545	874,180,000	
野村ホールディングス	3,398,600	625	2,124,125,000	
新光証券	619,000	260	160,940,000	
みずほインベスターズ証券	559,000	100	55,900,000	
岡三証券グループ	202,000	413	83,426,000	
丸三証券	79,000	572	45,188,000	
東洋証券	95,000	197	18,715,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	279,000	227	63,333,000	
光世証券	68,000	98	6,664,000	
水戸証券	83,000	260	21,580,000	
いちよし証券	56,400	587	33,106,800	
松井証券	184,900	733	135,531,700	
だいこう証券ビジネス	10,800	650	7,020,000	
マネックスグループ	1,279	28,890	36,950,310	
カブドットコム証券	524	109,900	57,587,600	
極東証券	32,900	344	11,317,600	
岩井証券	26,000	701	18,226,000	
三井住友海上グループホールディングス	577,500	2,735	1,579,462,500	
ソニーフィナンシャルホールディングス	862	312,000	268,944,000	
日本興亜損害保険	933,000	580	541,140,000	
損害保険ジャパン	1,127,000	633	713,391,000	
ニッセイ同和損害保険	267,000	452	120,684,000	
あいおい損害保険	633,000	443	280,419,000	
富士火災海上保険	295,000	132	38,940,000	
東京海上ホールディングス	1,041,000	2,885	3,003,285,000	
T & Dホールディングス	350,050	3,350	1,172,667,500	
クレディセゾン	210,800	1,228	258,862,400	
セディナ	97,100	189	18,351,900	
芙蓉総合リース	27,500	1,587	43,642,500	
興銀リース	37,700	1,135	42,789,500	
東京センチュリーリース	68,815	713	49,065,095	
日本証券金融	99,900	566	56,543,400	
大阪証券金融	47,100	192	9,043,200	
ポケットカード	35,200	259	9,116,800	
武富士	142,900	680	97,172,000	

リコーリース	18,400	1,738	31,979,200	
イオンクレジットサービス	110,800	1,108	122,766,400	
アコム	110,210	2,910	320,711,100	
プロミス	105,100	1,699	178,564,900	
ジャックス	162,000	217	35,154,000	
日立キャピタル	61,400	1,217	74,723,800	
オリックス	120,220	5,060	608,313,200	
三菱UFJリース	63,280	2,640	167,059,200	
アサックス	73	62,000	4,526,000	
NECキャピタルソリューション	12,500	756	9,450,000	
日本駐車場開発	3,063	3,550	10,873,650	
昭栄	44,500	673	29,948,500	
東京建物不動産販売	14,000	265	3,710,000	
野村不動産ホールディングス	68,800	1,767	121,569,600	
ヒューリック	68,400	400	27,360,000	
エコナック	99,000	49	4,851,000	
パーク24	148,100	661	97,894,100	
三井不動産	1,075,000	1,319	1,417,925,000	
三菱地所	1,683,000	1,340	2,255,220,000	
平和不動産	178,500	271	48,373,500	
東京建物	372,000	409	152,148,000	
ダイビル	63,900	769	49,139,100	
サンケイビル	39,200	461	18,071,200	
東急不動産	490,000	376	184,240,000	
京阪神不動産	35,000	336	11,760,000	
住友不動産	617,000	1,340	826,780,000	
東宝不動産	27,800	461	12,815,800	
藤和不動産	95,500	56	5,348,000	
有楽土地	44,000	124	5,456,000	
大京	217,000	145	31,465,000	
テーオーシー	98,000	359	35,182,000	
東京楽天地	47,000	389	18,283,000	
レオパレス21	171,500	746	127,939,000	
フジ住宅	34,000	291	9,894,000	
空港施設	26,300	483	12,702,900	
明和地所	15,100	422	6,372,200	
住友不動産販売	11,190	3,990	44,648,100	
ゴールドクレスト	19,600	2,295	44,982,000	
日本エスリード	12,900	409	5,276,100	
東急リバブル	29,900	556	16,624,400	
飯田産業	16,900	357	6,033,300	
日神不動産	15,600	238	3,712,800	
サンヨーハウジング名古屋	109	72,100	7,858,900	
イオンモール	111,000	1,471	163,281,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発	1,518	94,700	143,754,600	
日本空港ビルデング	59,200	1,068	63,225,600	

日本工営	88,000	238	20,944,000	
日本M&Aセンター	45	253,400	11,403,000	
アコーディア・ゴルフ	645	52,300	33,733,500	
パソナグループ	279	46,500	12,973,500	
リンクアンドモチベーション	37	51,000	1,887,000	
テンプホールディングス	30,500	529	16,134,500	
学情	11,800	381	4,495,800	
スタジオアリス	13,100	633	8,292,300	
シミック	460	21,460	9,871,600	
NECフィールディング	20,900	1,074	22,446,600	
総合警備保障	85,400	913	77,970,200	
カカクコム	201	289,800	58,249,800	
ルネサンス	14,200	303	4,302,600	
新日本科学	14,100	396	5,583,600	
ソネット・エムスリー	123	287,300	35,337,900	
ディー・エヌ・エー	337	308,000	103,796,000	
博報堂DYホールディングス	35,560	4,440	157,886,400	
ぐるなび	140	194,200	27,188,000	
一休	204	46,300	9,445,200	
ジャパンベストレスキューシステム	54	40,000	2,160,000	
ジェイコム	35	80,800	2,828,000	
パシフィックゴルフグループインターナショナル	646	42,100	27,196,600	
イーピーエス	72	348,000	25,056,000	
アミューズ	6,600	997	6,580,200	
ドリームインキュベータ	104	52,800	5,491,200	
TAC	15,400	405	6,237,000	
電通	254,300	1,739	442,227,700	
イオンファンタジー	8,600	700	6,020,000	
みらかホールディングス	49,300	2,060	101,558,000	
アルプス技研	13,000	488	6,344,000	
ダイオーズ	2,600	413	1,073,800	
日本空調サービス	4,600	720	3,312,000	
オリエンタルランド	72,200	6,190	446,918,000	
ダスキン	76,000	1,542	117,192,000	
明光ネットワークジャパン	23,600	398	9,392,800	
ファルコバイオシステムズ	15,500	700	10,850,000	
秀英予備校	8,300	316	2,622,800	
田谷	4,000	696	2,784,000	
ラウンドワン	40,100	635	25,463,500	
リゾートトラスト	44,300	949	42,040,700	
ビー・エム・エル	13,700	1,772	24,276,400	
ワタベウェディング	8,100	1,543	12,498,300	
もしもしホットライン	18,550	1,715	31,813,250	
東急コミュニティー	6,000	1,503	9,018,000	
リソー教育	2,960	2,730	8,080,800	
ウェアハウス	5,700	404	2,302,800	

ユー・エス・エス	34,880	4,610	160,796,800	
東京個別指導学院	22,800	128	2,918,400	
カルチュア・コンビニエンス・クラブ	119,200	601	71,639,200	
テー・オー・ダブリュー	5,800	504	2,923,200	
総合メディカル	6,200	1,878	11,643,600	
セントラルスポーツ	7,200	900	6,480,000	
リゾートソリューション	23,000	177	4,071,000	
エイチ・アイ・エス	23,900	1,854	44,310,600	
共立メンテナンス	10,500	1,515	15,907,500	
イチネンホールディングス	25,500	376	9,588,000	
建設技術研究所	13,900	562	7,811,800	
燦ホールディングス	4,500	1,770	7,965,000	
スバル興業	13,000	284	3,692,000	
東京テアトル	94,000	193	18,142,000	
吉本興業	38,700	931	36,029,700	
ホリプロ	7,500	799	5,992,500	
よみうりランド	59,000	294	17,346,000	
東京都競馬	167,000	141	23,547,000	
常磐興産	86,000	156	13,416,000	
カナモト	33,000	357	11,781,000	
東京ドーム	191,000	311	59,401,000	
トランス・コスモス	35,000	532	18,620,000	
乃村工藝社	53,000	244	12,932,000	
藤田観光	75,000	416	31,200,000	
近畿日本ツーリスト	96,000	114	10,944,000	
日本管財	8,800	1,302	11,457,600	
白洋舎	27,000	259	6,993,000	
セコム	248,500	3,670	911,995,000	
セントラル警備保障	10,100	819	8,271,900	
丹青社	31,000	228	7,068,000	
メイテック	44,100	1,301	57,374,100	
アサツー ディ・ケイ	51,900	1,695	87,970,500	
応用地質	28,800	1,066	30,700,800	
船井総合研究所	29,800	481	14,333,800	
進学会	14,500	233	3,378,500	
ベネッセコーポレーション	89,000	3,440	306,160,000	
イオンディライト	19,500	1,266	24,687,000	
ナック	5,500	821	4,515,500	
ニチイ学館	62,800	788	49,486,400	
ダイセキ	38,300	1,595	61,088,500	
合 計	346,064,058		266,124,701,700	

※差入委託証拠金代用有価証券 2,600,000株

(b) 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

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）Ⅱ．取引の時価等に関する事項」に同様の内容が記載されている為、省略しております。

「国内債券パッシブ・マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

対象年月日	(平成21年4月13日現在)
科 目	金額(円)
資産の部	
I 流動資産	
コール・ローン	9,234,585,929
国債証券	193,525,719,470
地方債証券	15,965,830,796
特殊債券	32,370,004,962
社債券	16,892,638,300
未収入金	555,203,000
未収利息	531,318,135
前払費用	194,414,139
流動資産合計	269,269,714,731
資産合計	269,269,714,731
負債の部	
I 流動負債	
未払金	9,098,895,259
未払解約金	292,000
流動負債合計	9,099,187,259
負債合計	9,099,187,259
純資産の部	
I 元本等	
1 元本	
元本	250,471,635,464
元本合計	250,471,635,464
2 剰余金	
剰余金	9,698,892,008
剰余金合計	9,698,892,008
元本等合計	260,170,527,472
純資産合計	260,170,527,472
負債・純資産合計	269,269,714,731

(注) 「国内債券パッシブ・マザーファンド」は、毎年5月25日（ただし、休業日の場合は翌営業日）に決算を行います。上記の貸借対照表は平成21年4月13日現在における同マザーファンドの状況です。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項 目	自 平成20年 3 月31日 至 平成21年 4 月13日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券・地方債証券・特殊債券・社債券（売買目的有価証券） 個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又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。

(貸借対照表に関する注記)

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

(デリバティブ取引に関する注記)

I. 取引の状況に関する事項

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

Ⅱ. 取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

(平成21年4月13日現在)

平成21年4月13日現在、デリバティブ取引は行っておりません。

(関連当事者との取引に関する注記)

(自 平成20年3月31日 至 平成21年4月13日)

該当事項はありません。

(その他の注記)

(平成21年4月13日現在)	
本有価証券報告書における開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	130,768,989,835円
同期中における追加設定元本額	156,314,487,815円
同期中における一部解約元本額	36,611,842,186円
平成21年4月13日現在における元本の内訳	
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	523,647,401円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	1,065,889,891円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	196,056,115円
スミセイ・DCバランスファンド（機動的資産配分型）	8,317,796円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	385,320円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	269,450円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	194,776円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	171,945円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	145,762円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	163,864円
SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	50,747,721,457円
SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	12,979,037,983円
SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	28,752,304,705円
SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	563,128,650円
SMAM・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	794,782,303円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	193,567,294円
SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	395,479,838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＞	121,190,698円
SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	2,303,010,106円
SMAM・インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞	2,961,865,885円
SMAM・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	7,626,803,538円
SMAM・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	20,724,783,605円
SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	1,376,919,029円
三井住友・国内債券インデックスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	6,686,301,430円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	27,503,330,032円
SMAM・グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	888,219,541円
SMAM・バランスファンドVA20＜適格機関投資家専用＞	7,265,135,352円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	76,792,811,698円
合 計	250,471,635,464円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備 考
国債証券	第1回利付国債（40年）	510,000,000	525,871,200	
	第221回利付国債（10年）	2,786,000,000	2,837,763,880	
	第223回利付国債（10年）	7,755,000,000	7,903,353,150	
	第225回利付国債（10年）	8,355,000,000	8,563,290,150	
	第227回利付国債（10年）	9,745,000,000	9,959,195,100	
	第231回利付国債（10年）	5,095,000,000	5,186,149,550	
	第234回利付国債（10年）	5,380,000,000	5,494,271,200	
	第236回利付国債（10年）	4,560,000,000	4,676,827,200	
	第237回利付国債（10年）	4,510,000,000	4,632,040,600	
	第238回利付国債（10年）	2,150,000,000	2,201,987,000	
	第239回利付国債（10年）	4,700,000,000	4,815,714,000	
	第242回利付国債（10年）	3,190,000,000	3,248,313,200	
	第243回利付国債（10年）	3,050,000,000	3,094,987,500	
	第244回利付国債（10年）	5,792,000,000	5,856,407,040	
	第247回利付国債（10年）	5,635,000,000	5,651,116,100	
	第250回利付国債（10年）	4,445,000,000	4,397,305,150	
	第253回利付国債（10年）	5,110,000,000	5,288,287,900	
	第256回利付国債（10年）	5,410,000,000	5,552,607,600	
	第258回利付国債（10年）	5,213,000,000	5,326,382,750	
	第260回利付国債（10年）	2,745,000,000	2,843,572,950	
	第263回利付国債（10年）	2,837,000,000	2,938,280,900	
	第265回利付国債（10年）	2,960,000,000	3,050,191,200	
	第268回利付国債（10年）	2,765,000,000	2,847,120,500	
	第270回利付国債（10年）	2,487,000,000	2,529,652,050	
	第272回利付国債（10年）	3,045,000,000	3,112,933,950	
	第274回利付国債（10年）	3,245,000,000	3,337,158,000	
	第277回利付国債（10年）	3,040,000,000	3,144,880,000	
	第280回利付国債（10年）	2,017,000,000	2,126,462,590	
	第282回利付国債（10年）	3,045,000,000	3,163,968,150	
	第284回利付国債（10年）	3,117,000,000	3,233,388,780	
	第285回利付国債（10年）	3,218,000,000	3,332,013,740	
	第286回利付国債（10年）	2,530,000,000	2,634,210,700	
	第288回利付国債（10年）	2,820,000,000	2,906,799,600	
	第289回利付国債（10年）	2,634,000,000	2,667,794,220	
	第290回利付国債（10年）	2,792,000,000	2,800,878,560	
	第293回利付国債（10年）	2,210,000,000	2,287,460,500	
	第296回利付国債（10年）	2,550,000,000	2,565,886,500	

	第297回利付国債（10年）	3,573,000,000	3,560,851,800	
	第299回利付国債（10年）	1,500,000,000	1,480,470,000	
	第2回利付国債（30年）	130,000,000	135,458,700	
	第4回利付国債（30年）	100,000,000	112,555,000	
	第5回利付国債（30年）	190,000,000	191,278,700	
	第7回利付国債（30年）	149,000,000	151,978,510	
	第10回利付国債（30年）	285,000,000	227,994,300	
	第14回利付国債（30年）	500,000,000	517,345,000	
	第16回利付国債（30年）	765,000,000	806,363,550	
	第19回利付国債（30年）	475,000,000	481,289,000	
	第21回利付国債（30年）	505,000,000	511,337,750	
	第22回利付国債（30年）	585,000,000	615,191,850	
	第23回利付国債（30年）	619,000,000	651,132,290	
	第24回利付国債（30年）	680,000,000	716,121,600	
	第25回利付国債（30年）	570,000,000	576,828,600	
	第26回利付国債（30年）	623,000,000	642,325,460	
	第27回利付国債（30年）	610,000,000	642,006,700	
	第28回利付国債（30年）	696,000,000	732,261,600	
	第29回利付国債（30年）	742,000,000	765,773,680	
	第32回利付国債（20年）	70,000,000	82,007,100	
	第35回利付国債（20年）	170,000,000	195,766,900	
	第37回利付国債（20年）	302,000,000	343,691,100	
	第39回利付国債（20年）	458,000,000	503,603,060	
	第40回利付国債（20年）	390,000,000	418,887,300	
	第42回利付国債（20年）	480,000,000	529,502,400	
	第43回利付国債（20年）	1,170,000,000	1,326,101,400	
	第46回利付国債（20年）	570,000,000	606,759,300	
	第48回利付国債（20年）	555,000,000	607,447,500	
	第50回利付国債（20年）	588,000,000	604,763,880	
	第52回利付国債（20年）	750,000,000	785,625,000	
	第54回利付国債（20年）	685,000,000	724,120,350	
	第56回利付国債（20年）	733,000,000	755,451,790	
	第59回利付国債（20年）	685,000,000	677,848,600	
	第61回利付国債（20年）	725,000,000	652,065,000	
	第64回利付国債（20年）	1,205,000,000	1,211,169,600	
	第65回利付国債（20年）	1,120,000,000	1,123,214,400	
	第70回利付国債（20年）	1,420,000,000	1,509,857,600	
	第74回利付国債（20年）	1,884,000,000	1,922,546,640	
	第78回利付国債（20年）	950,000,000	940,680,500	
	第82回利付国債（20年）	1,150,000,000	1,167,100,500	
	第84回利付国債（20年）	1,050,000,000	1,050,000,000	
	第85回利付国債（20年）	1,060,000,000	1,073,398,400	
	第88回利付国債（20年）	997,000,000	1,035,902,940	
	第90回利付国債（20年）	1,030,000,000	1,053,216,200	
	第92回利付国債（20年）	1,219,000,000	1,227,703,660	
	第93回利付国債（20年）	1,167,000,000	1,156,310,280	

	第 9 5 回利付国債（ 2 0 年）	1,090,000,000	1,127,572,300	
	第 9 7 回利付国債（ 2 0 年）	1,027,000,000	1,046,204,900	
	第 9 9 回利付国債（ 2 0 年）	1,028,000,000	1,031,454,080	
	第 1 0 0 回利付国債（ 2 0 年）	1,137,000,000	1,156,306,260	
	第 1 0 1 回利付国債（ 2 0 年）	1,145,000,000	1,199,639,400	
	第 1 0 2 回利付国債（ 2 0 年）	1,182,000,000	1,238,948,760	
	第 1 0 5 回利付国債（ 2 0 年）	1,090,000,000	1,090,752,100	
	第 1 0 7 回利付国債（ 2 0 年）	1,098,000,000	1,098,757,620	
	第 1 0 9 回利付国債（ 2 0 年）	1,030,000,000	998,255,400	
	国債証券 小計	189,155,000,000	193,525,719,470	
地方債証券	第 1 回東京都公募公債（ 2 0 年）	100,000,000	94,219,000	
	第 5 6 1 回東京都公募公債	200,000,000	202,938,000	
	第 5 6 7 回東京都公募公債	100,000,000	102,150,000	
	第 5 6 8 回東京都公募公債	300,000,000	306,180,000	
	第 5 7 6 回東京都公募公債	100,000,000	101,712,000	
	第 5 7 7 回東京都公募公債	100,000,000	101,730,000	
	第 5 7 9 回東京都公募公債	100,000,000	101,568,000	
	第 5 8 2 回東京都公募公債	100,000,000	102,206,000	
	第 5 8 4 回東京都公募公債	100,000,000	101,963,000	
	第 5 8 8 回東京都公募公債	100,000,000	101,638,000	
	第 5 9 6 回東京都公募公債	100,000,000	99,156,000	
	第 5 9 8 回東京都公募公債	200,000,000	196,406,000	
	第 6 0 2 回東京都公募公債	200,000,000	203,740,000	
	第 6 0 3 回東京都公募公債	200,000,000	204,598,000	
	第 6 0 4 回東京都公募公債	100,000,000	102,291,000	
	第 6 0 8 回東京都公募公債	100,000,000	102,655,000	
	第 6 1 0 回東京都公募公債	100,000,000	103,762,000	
	第 6 1 3 回東京都公募公債	100,000,000	102,386,000	
	第 6 2 8 回東京都公募公債	100,000,000	102,129,000	
	第 6 2 9 回東京都公募公債	100,000,000	101,234,000	
	第 6 4 6 回東京都公募公債	100,000,000	104,181,000	
	第 6 6 0 回東京都公募公債	500,000,000	500,815,000	
	第 6 6 2 回東京都公募公債	100,000,000	100,615,000	
	平成 1 3 年度第 1 回北海道公募公債	113,800,000	115,315,816	
	平成 1 6 年度第 3 回北海道公募公債	100,000,000	101,736,000	
	平成 1 7 年度第 9 回北海道公募公債	100,000,000	100,398,000	
	平成 1 8 年度第 8 回北海道公募公債（ 5 年）	100,000,000	101,672,000	
	平成 1 9 年度第 2 回北海道公募公債	100,000,000	101,692,000	
	平成 2 0 年度第 4 回北海道公募公債	100,000,000	102,068,000	
	第 2 6 回神奈川県公募公債（ 5 年）	100,000,000	101,554,000	
	第 2 7 回神奈川県公募公債（ 5 年）	100,000,000	101,136,000	
	第 1 2 2 回神奈川県公募公債	200,000,000	205,354,000	
	第 1 2 9 回神奈川県公募公債	100,000,000	102,479,000	
	第 1 4 3 回神奈川県公募公債	100,000,000	102,533,000	
	第 1 4 7 回神奈川県公募公債	100,000,000	103,879,000	

第 1 4 9 回神奈川県公募公債	100,000,000	102,546,000	
第 1 5 7 回神奈川県公募公債	115,600,000	115,212,740	
第 3 回大阪府公募公債（ 7 年）	200,000,000	203,008,000	
第 1 8 回大阪府公募公債（ 5 年）	100,000,000	100,330,000	
第 2 6 回大阪府公募公債（ 5 年）	200,000,000	202,458,000	
第 3 1 回大阪府公募公債（ 5 年）	100,000,000	101,966,000	
第 2 6 1 回大阪府公募公債（ 1 0 年）	105,000,000	106,640,100	
第 2 6 2 回大阪府公募公債（ 1 0 年）	100,000,000	101,068,000	
第 2 6 7 回大阪府公募公債（ 1 0 年）	100,000,000	101,834,000	
第 3 0 3 回大阪府公募公債（ 1 0 年）	100,000,000	102,470,000	
第 3 0 6 回大阪府公募公債（ 1 0 年）	200,000,000	202,674,000	
第 3 1 3 回大阪府公募公債（ 1 0 年）	100,000,000	99,883,000	
平成 1 4 年度第 2 回京都府公募公債	300,000,000	301,338,000	
平成 1 9 年度第 1 回京都府公募公債	130,260,000	133,190,850	
平成 1 4 年度第 5 回兵庫県公募公債	100,000,000	99,199,000	
平成 1 5 年度第 4 回兵庫県公募公債	100,000,000	100,043,000	
平成 1 7 年度第 6 回兵庫県公募公債	101,000,000	100,665,690	
平成 1 9 年度第 8 回兵庫県公募公債（ 5 年）	100,000,000	101,003,000	
平成 2 0 年度第 5 回兵庫県公募公債	100,000,000	102,072,000	
平成 1 8 年度第 2 回静岡県公募公債	100,000,000	104,440,000	
平成 1 8 年度第 3 回静岡県公募公債（ 5 年）	100,000,000	102,095,000	
平成 1 9 年度第 7 回静岡県公募公債	100,000,000	102,096,000	
平成 2 0 年度第 7 回静岡県公募公債	100,000,000	100,749,000	
平成 1 2 年度第 1 回愛知県公募公債	100,000,000	101,447,000	
平成 1 4 年度第 2 回愛知県公募公債（ 1 0 年）	110,000,000	111,702,800	
平成 1 7 年度第 2 回愛知県公募公債（ 1 0 年）	100,000,000	100,482,000	
平成 1 9 年度第 3 回愛知県公募公債（ 1 0 年）	100,000,000	103,008,000	
平成 2 0 年度第 1 回広島県公募公債	100,000,000	101,753,000	
平成 1 6 年度第 6 回埼玉県公募公債	100,000,000	101,303,000	
平成 1 7 年度第 6 回埼玉県公募公債	100,000,000	102,015,000	
平成 1 8 年度第 7 回埼玉県公募公債	100,000,000	103,011,000	
平成 1 9 年度第 2 回埼玉県公募公債	100,000,000	103,484,000	
平成 1 8 年度第 1 回福岡県公募公債	100,000,000	104,964,000	
平成 1 9 年度第 2 回福岡県公募公債	100,000,000	104,023,000	
平成 1 2 年度第 1 回千葉県公募公債	400,000,000	406,824,000	
平成 1 6 年度第 9 回千葉県公募公債	100,000,000	101,776,000	
平成 1 8 年度第 1 回千葉県公募公債	200,000,000	208,914,000	
平成 1 8 年度第 4 回千葉県公募公債	100,000,000	102,902,000	
平成 1 4 年度第 1 回新潟県公募公債	240,000,000	241,732,800	
第 1 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	99,079,000	
第 2 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	98,612,000	
第 4 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,557,000	
第 6 回共同発行市場公募地方債	200,000,000	205,340,000	
第 7 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,781,000	
第 2 0 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,929,000	
第 2 1 回共同発行市場公募地方債	300,000,000	304,095,000	

	第 2 2 回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,600,000	
	第 2 3 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,685,000	
	第 2 7 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,458,000	
	第 3 0 回共同発行市場公募地方債	200,000,000	200,478,000	
	第 3 3 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,975,000	
	第 3 5 回共同発行市場公募地方債	200,000,000	203,658,000	
	第 3 6 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,815,000	
	第 3 8 回共同発行市場公募地方債	200,000,000	208,778,000	
	第 4 0 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,043,000	
	第 4 6 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,665,000	
	第 5 5 回共同発行市場公募地方債	200,000,000	204,988,000	
	第 6 2 回共同発行市場公募地方債	200,000,000	202,632,000	
	第 6 5 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,012,000	
	平成 1 2 年度第 5 回大阪市公募公債	100,000,000	101,825,000	
	平成 1 3 年度第 2 回大阪市公募公債	100,000,000	100,871,000	
	平成 1 4 年度第 1 1 回大阪市公募公債	100,000,000	99,006,000	
	平成 1 6 年度第 1 1 回大阪市公募公債	100,000,000	100,075,000	
	平成 1 7 年度第 1 2 回大阪市公募公債（5 年）	100,000,000	100,631,000	
	平成 1 8 年度第 2 回大阪市公募公債	200,000,000	206,828,000	
	平成 1 9 年度第 5 回大阪市公募公債	100,000,000	102,698,000	
	平成 1 9 年度第 1 0 回大阪市公募公債	100,000,000	100,456,000	
	第 3 回名古屋市公募公債（2 0 年）	100,000,000	98,142,000	
	第 1 2 回ひ号名古屋市公募公債	100,000,000	100,397,000	
	第 4 5 5 回名古屋市公募公債（1 0 年）	100,000,000	103,773,000	
	平成 1 8 年度第 3 回京都市公募公債	200,000,000	206,510,000	
	平成 1 5 年度第 1 回神戸市公募公債	100,000,000	98,122,000	
	第 9 回横浜市公募公債（2 0 年）	100,000,000	101,868,000	
	平成 1 7 年度第 4 回横浜市公募公債	200,000,000	203,084,000	
	平成 1 7 年度第 3 回横浜市公募公債	100,000,000	102,148,000	
	平成 1 8 年度第 4 回横浜市公募公債	300,000,000	309,756,000	
	平成 1 8 年度第 1 回横浜市公募公債	100,000,000	103,974,000	
	第 2 2 回横浜市公募公債	100,000,000	102,440,000	
	平成 1 3 年度第 2 回札幌市公募公債	200,000,000	202,966,000	
	平成 1 7 年度第 7 回札幌市公募公債（5 年）	100,000,000	100,311,000	
	第 2 回川崎市 1 5 年公募公債	100,000,000	98,645,000	
	第 4 回川崎市 1 5 年公募公債	100,000,000	102,404,000	
	第 1 9 回川崎市公募公債（5 年）	100,000,000	101,852,000	
	平成 1 5 年度第 2 回北九州市公募公債	100,000,000	102,015,000	
	平成 1 8 年度第 5 回福岡市公募公債（5 年）	100,000,000	101,442,000	
	地方債証券 小計	15,715,660,000	15,965,830,796	
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	100,628,000	
	第 3 回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	200,000,000	203,076,000	
	第 5 回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	101,865,000	
	第 9 回日本政策投資銀行債券	100,000,000	101,798,000	
	第 1 0 回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	101,552,000	

第15回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,220,000	
第24回日本政策投資銀行債券	100,000,000	101,237,000	
第27回日本政策投資銀行債券	100,000,000	102,663,000	
第36回日本政策投資銀行債券	100,000,000	95,086,000	
第51回日本政策投資銀行債券	100,000,000	100,317,000	
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	146,953,440	
第7回道路債券	100,000,000	106,644,000	
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	102,532,000	
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	101,679,000	
第9回道路債券	100,000,000	104,318,000	
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	105,152,000	
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	107,171,400	
第21回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,196,000	
第23回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,181,000	
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	310,629,000	
第26回道路債券	300,000,000	307,143,000	
第27回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,500,000	
第27回道路債券	100,000,000	101,845,000	
第29回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,661,000	
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	102,637,000	
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	159,321,960	
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	312,084,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,541,000	
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	311,724,000	
第40回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,488,000	
第41回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	204,464,000	
第42回道路債券	100,000,000	98,383,000	
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	202,358,000	
第58回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	203,786,000	
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	101,739,000	
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	201,334,000	
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	100,629,000	
第310回政府保証道路債券	100,000,000	102,175,000	
第313回政府保証道路債券	200,000,000	203,720,000	
第325回政府保証道路債券	100,000,000	101,700,000	
第327回政府保証道路債券	150,000,000	153,889,500	
第329回政府保証道路債券	300,000,000	309,207,000	
第335回政府保証道路債券	100,000,000	101,910,000	
第337回政府保証道路債券	100,000,000	101,242,000	
第339回政府保証道路債券	100,000,000	101,697,000	
第340回政府保証道路債券	100,000,000	100,466,000	
第341回政府保証道路債券	100,000,000	101,088,000	
第1回公営企業債券（5年）	500,000,000	503,295,000	
第2回公営企業債券	100,000,000	101,938,000	
第3回公営企業債券（20年）	100,000,000	86,953,000	
第6回公営企業債券	100,000,000	98,661,000	

	第7回公営企業債券	400,000,000	408,268,000	
	第12回公営企業債券	100,000,000	101,636,000	
	第15回公営企業債券	100,000,000	100,027,000	
	第17回公営企業債券	100,000,000	101,366,000	
	第18回公営企業債券（20年）	100,000,000	103,382,000	
	第22回公営企業債券（20年）	100,000,000	99,176,000	
	第30回公営企業債券	100,000,000	102,513,000	
	第788回政府保証公営企業債券	500,000,000	507,210,000	
	第791回政府保証公営企業債券	400,000,000	406,392,000	
	第799回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,972,000	
	第801回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,704,000	
	第806回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,898,000	
	第809回政府保証公営企業債券	202,000,000	206,165,240	
	第810回政府保証公営企業債券	200,000,000	204,194,000	
	第815回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,187,000	
	第818回政府保証公営企業債券	102,000,000	103,890,060	
	第821回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,147,000	
	第823回政府保証公営企業債券	100,000,000	99,992,000	
	第824回政府保証公営企業債券	500,000,000	499,815,000	
	第825回政府保証公営企業債券	200,000,000	199,862,000	
	第826回政府保証公営企業債券	300,000,000	298,455,000	
	第827回政府保証公営企業債券	200,000,000	198,004,000	
	第833回政府保証公営企業債券	200,000,000	205,356,000	
	第834回政府保証公営企業債券	200,000,000	205,364,000	
	第836回政府保証公営企業債券	300,000,000	305,175,000	
	第838回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,593,000	
	第840回政府保証公営企業債券	200,000,000	206,120,000	
	第841回政府保証公営企業債券	100,000,000	104,082,000	
	第844回政府保証公営企業債券	200,000,000	206,032,000	
	第846回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,935,000	
	第847回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,882,000	
	第849回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,368,000	
	第851回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,086,000	
	第852回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,041,000	
	第861回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,558,000	
	第865回政府保証公営企業債券	200,000,000	210,206,000	
	第866回政府保証公営企業債券	200,000,000	210,166,000	
	第875回政府保証公営企業債券	200,000,000	205,266,000	
	第885回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,930,000	
	第886回政府保証公営企業債券	200,000,000	205,426,000	
	第3回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	100,299,000	
	第195回政府保証首都高速道路債券	100,000,000	101,798,000	
	第199回政府保証首都高速道路債券	200,000,000	203,044,000	
	第1回水資源開発債券	300,000,000	304,836,000	
	第9回中小企業債券	200,000,000	201,084,000	
	第23回中小企業債券	100,000,000	101,272,000	

	第 2 4 回中小企業債券	200,000,000	203,418,000	
	第 1 4 2 回政府保証中小企業債券	100,000,000	101,918,000	
	第 1 5 0 回政府保証中小企業債券	271,000,000	276,303,470	
	第 1 5 7 回政府保証中小企業債券	200,000,000	202,772,000	
	第 1 6 5 回政府保証中小企業債券	100,000,000	102,416,000	
	第 1 8 1 回政府保証中小企業債券	300,000,000	302,244,000	
	第 1 8 3 回政府保証中小企業債券	500,000,000	502,440,000	
	第 6 回国際協力銀行債券	100,000,000	100,765,000	
	第 1 5 回国際協力銀行債券	200,000,000	205,224,000	
	第 2 1 回国際協力銀行債券	100,000,000	101,183,000	
	第 2 4 回国際協力銀行債券	100,000,000	101,677,000	
	第 2 7 回国際協力銀行債券	100,000,000	101,268,000	
	第 5 回政府保証都市再生債券	100,000,000	100,899,000	
	第 6 回政府保証都市再生債券	400,000,000	404,532,000	
	第 7 回政府保証都市再生債券	100,000,000	101,144,000	
	第 7 回都市再生債券	200,000,000	200,126,000	
	第 8 回都市再生債券	200,000,000	201,588,000	
	第 9 回政府保証都市再生債券	300,000,000	304,059,000	
	第 1 9 回都市再生債券	100,000,000	102,200,000	
	第 3 回本州四国連絡橋債券	100,000,000	103,606,000	
	第 3 3 8 回東京交通債券	100,000,000	101,963,000	
	第 3 4 2 回東京交通債券	100,000,000	104,618,000	
	第 1 3 回関西国際空港株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	98,088,000	
	第 3 8 回政府保証関西国際空港債券	100,000,000	101,832,000	
	第 1 7 回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	101,901,000	
	第 1 0 5 回政府保証預金保険機構債券	100,000,000	101,158,000	
	第 1 4 3 回政府保証預金保険機構債券	100,000,000	100,554,000	
	第 1 5 3 回政府保証預金保険機構債券	100,000,000	101,143,000	
	第 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	82,620,000	80,813,100	
	第 1 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	125,034,000	119,427,475	
	第 1 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	162,248,000	159,661,766	
	第 2 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	129,382,000	124,254,591	
	第 2 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	83,203,000	82,881,836	
	第 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	44,336,000	43,459,920	
	第 3 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	64,670,000	62,943,957	
	第 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,185,000	89,751,210	
	第 4 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	172,442,000	169,177,672	
	第 4 回一般担保住宅金融支援機構債券	200,000,000	203,756,000	
	第 5 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	67,772,000	65,598,551	
	第 6 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	105,524,000	103,657,280	
	第 6 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	73,610,000	73,360,462	
	第 7 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	74,192,000	73,899,683	
	第 7 回貸付債権担保 S 種住宅金融支援機構債券	89,318,000	87,286,015	
	第 8 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	53,808,000	51,862,840	
	第 8 回貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	75,725,000	75,004,098	
	第 8 回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,186,000	

	第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	76,250,000	75,696,425	
	第9回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	93,026,000	92,280,861	
	第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券	56,172,000	53,207,803	
	第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	77,787,000	76,988,127	
	第12回貸付債権担保住宅金融公庫債券	61,845,000	59,517,772	
	第14回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	100,888,000	
	第28回貸付債権担保住宅金融公庫債券	75,689,000	72,892,291	
	第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券	80,432,000	76,827,842	
	第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	81,375,000	77,657,790	
	第33回貸付債権担保住宅金融公庫債券	81,049,000	77,323,987	
	第35回貸付債権担保住宅金融公庫債券	83,034,000	79,733,398	
	第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	82,119,000	79,351,589	
	第38回貸付債権担保住宅金融公庫債券	83,164,000	80,498,593	
	第40回貸付債権担保住宅金融公庫債券	82,420,000	79,950,696	
	第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	84,445,000	82,671,655	
	第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	167,846,000	167,483,452	
	第43回貸付債権担保住宅金融公庫債券	84,241,000	83,691,748	
	第44回貸付債権担保住宅金融公庫債券	84,800,000	84,306,464	
	第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	89,044,000	86,890,916	
	第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,626,000	88,203,635	
	第2回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	89,880,000	88,805,934	
	第5回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	175,604,000	171,236,728	
	第36回国民生活債券	100,000,000	100,403,000	
	第6回農林漁業金融公庫債券	100,000,000	102,451,000	
	第1回新東京国際空港債券	300,000,000	305,811,000	
	第5回日本学生支援債券	100,000,000	100,318,000	
	第7回日本学生支援債券	300,000,000	305,625,000	
	第5回沖縄振興開発金融公庫債券	100,000,000	100,246,000	
	い第660号商工債券	100,000,000	99,866,000	
	い第664号商工債券	100,000,000	99,826,000	
	い第687号商工債	200,000,000	203,582,000	
	い第661号農林債券	200,000,000	199,524,000	
	い第662号農林債券	100,000,000	99,732,000	
	い第670号農林債券	100,000,000	100,517,000	
	い第671号農林債券	100,000,000	101,315,000	
	い第679号農林債	200,000,000	202,556,000	
	い第681号農林債	100,000,000	101,160,000	
	い第684号農林債	100,000,000	100,976,000	
	い第687号農林債	100,000,000	101,725,000	
	い第690号農林債	300,000,000	301,947,000	
	い第697号農林債	200,000,000	202,484,000	
	い第698号農林債	100,000,000	101,224,000	
	第597回あおぞら債	100,000,000	77,791,000	
	第188回しんきん中金債券	100,000,000	99,783,000	
	第195回しんきん中金債券	50,000,000	50,202,500	
	第197回しんきん中金債券	100,000,000	101,375,000	

	第201回信金中金債（5年）	200,000,000	203,248,000	
	第203回信金中金債（5年）	100,000,000	101,302,000	
	第209回信金中金債（5年）	100,000,000	101,083,000	
	第215回信金中金債（5年）	200,000,000	202,916,000	
	第221回信金中金債（5年）	100,000,000	100,031,000	
	第225回信金中金債（5年）	200,000,000	200,962,000	
	第227回信金中金債（5年）	100,000,000	100,863,000	
	第228回信金中金債（5年）	200,000,000	202,106,000	
	第229回信金中金債（5年）	100,000,000	100,780,000	
	第230回信金中金債（5年）	100,000,000	100,046,000	
	第231回信金中金債（5年）	100,000,000	100,484,000	
	い第676号みずほコーポレート銀行債券	100,000,000	100,223,000	
	第88号商工債（3年）	100,000,000	100,422,000	
	第90号商工債（3年）	1,000,000,000	1,007,140,000	
	第96号商工債（3年）	100,000,000	100,202,000	
	第99号商工債（3年）	500,000,000	501,320,000	
	第100号商工債（3年）	300,000,000	301,677,000	
	第101号商工債（3年）	100,000,000	100,681,000	
	第110号商工債（3年）	200,000,000	200,978,000	
	第1回政府保証東日本高速道路債券	137,000,000	140,619,540	
	第3回政府保証東日本高速道路債券	100,000,000	105,069,000	
	第1回中日本高速道路株式会社社債	100,000,000	101,583,000	
	第3回政府保証中日本高速道路債券	163,000,000	167,084,780	
	第10回政府保証中日本高速道路債券	100,000,000	103,566,000	
	第12回政府保証中日本高速道路債券	103,000,000	106,601,910	
	第14回政府保証中日本高速道路債券	100,000,000	104,050,000	
	第21回政府保証中日本高速道路債券	200,000,000	203,694,000	
	第5回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	200,000,000	200,054,000	
	特殊債券 小計	32,050,917,000	32,370,004,962	
社債券	第1回メリルリンチ・アンド・カンパニー・インク	100,000,000	59,131,000	
	第13回メリルリンチ・アンド・カンパニー・インク	100,000,000	91,406,000	
	第7回ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポレーション	200,000,000	166,768,000	
	第8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	99,093,000	
	第3回ジェイ・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニー	100,000,000	79,722,000	
	第4回ジェイ・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニー	100,000,000	98,185,000	
	第8回HSBCファイナンス	100,000,000	94,297,000	
	第8回ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク	100,000,000	92,565,000	
	第11回シティグループ・インク円貨社債（2003）	100,000,000	76,444,000	
	第14回シティグループ・インク円貨債券	100,000,000	90,542,000	
	第17回シティグループ・インク円貨債券	100,000,000	55,716,000	
	第7回ザ・ベアー・スターンズ・カンパニーズ・インク	200,000,000	194,660,000	

	第3回バンク・オブ・アメリカ・コーポレーション	100,000,000	84,646,000	
	第6回バンク・オブ・アメリカ・コーポレーション	100,000,000	82,039,000	
	第19回味の素株式会社無担保社債	100,000,000	100,027,000	
	第4回日本たばこ産業株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	203,768,000	
	第23回王子製紙株式会社無担保社債	100,000,000	100,224,000	
	第6回株式会社日本製紙グループ本社無担保社債	100,000,000	99,161,000	
	第24回住友化学工業株式会社無担保社債	100,000,000	99,504,000	
	第31回住友化学株式会社無担保社債	100,000,000	99,774,000	
	第38回住友化学株式会社無担保社債	100,000,000	97,213,000	
	第22回三井化学株式会社無担保社債	200,000,000	203,078,000	
	第26回新日本石油株式会社無担保社債	100,000,000	102,443,000	
	第30回新日本製鐵株式会社無担保社債	100,000,000	109,305,000	
	第52回住友金属工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,600,000	
	第46回株式会社神戸製鋼所無担保社債	100,000,000	97,553,000	
	第11回ジェイエフイーホールディングス株式会社	100,000,000	99,123,000	
	第11回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	99,472,000	
	第15回株式会社豊田自動織機無担保社債	100,000,000	99,885,000	
	第12回株式会社日立製作所無担保社債	100,000,000	96,671,000	
	第24回富士通株式会社無担保社債	100,000,000	100,016,000	
	第9回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	101,590,000	
	第12回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	101,009,000	
	第18回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	100,189,000	
	第20回三菱重工業株式会社無担保社債	100,000,000	100,869,000	
	第44回日産自動車株式会社無担保社債	300,000,000	292,590,000	
	第3回凸版印刷株式会社無担保社債	100,000,000	100,420,000	
	第63回丸紅株式会社無担保社債	100,000,000	98,480,000	
	第61回三井物産株式会社無担保社債	100,000,000	99,621,000	
	第23回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	100,480,000	
	第25回住友商事株式会社無担保社債	100,000,000	99,851,000	
	第67回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	98,672,000	
	第32回株式会社クレディセゾン無担保社債	100,000,000	92,584,000	
	第6回株式会社三菱東京フィナンシャル・グループ 無担保社債	100,000,000	99,946,000	
	第9回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	104,991,000	
	第19回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	200,000,000	203,264,000	
	第72回株式会社東京三菱銀行無担保社債	100,000,000	101,292,000	
	第84回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	101,221,000	
	第92回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	200,000,000	202,798,000	
	第100回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	200,000,000	201,544,000	
	第11回株式会社静岡銀行無担保社債	100,000,000	98,251,000	
	第8回住友信託銀行株式会社無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	81,092,000	
	第4回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	100,838,000	
	第29回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	99,997,000	
	第36回株式会社三井住友銀行無担保社債	200,000,000	202,940,000	
	第39回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	100,928,000	
	第42回株式会社三井住友銀行無担保社債	200,000,000	199,826,000	

第9回株式会社みずほ銀行無担保社債（劣後特約付）	100,000,000	84,978,000	
第32回NTTファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	101,680,000	
第9回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	100,000,000	95,341,000	
第8回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	100,503,000	
第17回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	95,695,000	
第21回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	100,000,000	101,752,000	
第43回アコム株式会社無担保社債	100,000,000	95,118,000	
第17回プロミス株式会社無担保社債	100,000,000	86,441,000	
第18回日立キャピタル株式会社無担保社債	100,000,000	100,903,000	
第111回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	85,237,000	
第115回オリックス株式会社無担保社債	100,000,000	83,496,000	
第6回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	100,000,000	96,733,000	
第2回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	99,397,000	
第28回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	99,519,000	
第66回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	97,614,000	
第87回三菱地所株式会社無担保社債	100,000,000	97,789,000	
第58回住友不動産株式会社無担保社債	100,000,000	95,225,000	
第63回東京急行電鉄株式会社無担保社債	100,000,000	99,104,000	
第7回東日本旅客鉄道株式会社社債	200,000,000	227,354,000	
第9回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	112,153,000	
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	200,000,000	208,750,000	
第5回西日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	111,496,000	
第3回東海旅客鉄道株式会社普通社債	100,000,000	109,914,000	
第19回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	101,335,000	
第21回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	102,219,000	
第28回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	103,082,000	
第43回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	101,767,000	
第48回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	102,276,000	
第51回日本電信電話株式会社電信電話債券	300,000,000	313,953,000	
第53回日本電信電話株式会社電信電話債券	100,000,000	99,468,000	
第6回KDDI株式会社無担保社債	100,000,000	100,695,000	
第7回株式会社エヌ・ティ・ティ・ドコモ無担保社債	100,000,000	101,444,000	
第15回株式会社エヌ・ティ・ティ・ドコモ無担保社債	100,000,000	101,999,000	
第425回東京電力株式会社社債	100,000,000	119,790,000	
第478回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	101,888,000	
第480回 東京電力	100,000,000	101,656,000	
第485回東京電力株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	203,022,000	
第506回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	98,827,000	
第514回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	102,084,000	
第515回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	101,197,000	
第516回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,981,000	
第522回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	104,627,000	
第526回東京電力株式会社社債（一般担保付）	300,000,000	305,979,000	
第528回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	101,953,000	
第532回東京電力株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	202,692,000	
第538回東京電力株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	200,678,000	

	第545回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	101,710,000	
	第546回東京電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	101,884,000	
	第547回東京電力株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	202,460,000	
	第550回東京電力株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	200,702,000	
	第408回中部電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	115,219,000	
	第455回中部電力株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	203,468,000	
	第469回中部電力株式会社社債	100,000,000	100,980,000	
	第474回中部電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	102,258,000	
	第475回中部電力株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	209,032,000	
	第432回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	101,805,000	
	第433回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	100,633,000	
	第449回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	105,437,000	
	第451回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	103,136,000	
	第453回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	102,957,000	
	第466回関西電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	102,052,000	
	第340回中国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	98,589,000	
	第349回中国電力株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	204,636,000	
	第273回北陸電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	102,019,000	
	第279回北陸電力株式会社社債（一般担保付）	30,000,000	30,462,300	
	第286回北陸電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	102,788,000	
	第372回東北電力株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	241,514,000	
	第376回東北電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	115,082,000	
	第408回東北電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	101,986,000	
	第431回東北電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	103,762,000	
	第253回四国電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	86,670,000	
	第346回九州電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	102,925,000	
	第372回九州電力株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	198,134,000	
	第380回九州電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	103,002,000	
	第384回九州電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	99,565,000	
	第268回北海道電力株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	103,686,000	
	第295回北海道電力株式会社社債（一般担保付）	200,000,000	205,450,000	
	第14回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,382,000	
	第21回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	100,609,000	
	第23回電源開発株式会社無担保社債	100,000,000	101,377,000	
	第17回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	108,147,000	
	第25回東京瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	102,277,000	
	第22回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	102,141,000	
	第30回東邦瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	104,443,000	
	第20回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	100,000,000	100,141,000	
	社債券 小計	16,930,000,000	16,892,638,300	
	合 計		258,754,193,528	

「外国株式インデックス・マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

対象年月日	(平成21年4月13日現在)
科 目	金額(円)
資産の部	
I 流動資産	
預金	851,207,129
コール・ローン	3,157,465,457
株式	186,642,921,701
新株予約権証券	929,758
投資証券	2,580,155,655
派生商品評価勘定	395,260,271
未収入金	612,372,133
未収配当金	385,580,452
未収利息	6,920
差入委託証拠金	2,713,082,036
流動資産合計	197,338,981,512
資産合計	197,338,981,512
負債の部	
I 流動負債	
派生商品評価勘定	3,365,895
未払解約金	80,668,763
流動負債合計	84,034,658
負債合計	84,034,658
純資産の部	
I 元本等	
1 元本	
元本	198,715,843,917
元本合計	198,715,843,917
2 剰余金	
欠損金	1,460,897,063
剰余金合計	△1,460,897,063
元本等合計	197,254,946,854
純資産合計	197,254,946,854
負債・純資産合計	197,338,981,512

(注) 「外国株式インデックス・マザーファンド」は、毎年11月30日（ただし、休業日の場合は翌営業日）に決算を行います。上記の貸借対照表は平成21年4月13日現在における同マザーファンドの状況です。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項 目	自 平成20年 3 月31日 至 平成21年 4 月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式・新株予約権証券・投資証券（売買目的有価証券） 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、取引所または店頭市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準じる価額）、または金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 なお売買停止措置がとられている銘柄について、必要であると判断された場合は、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	(1)先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物売買相場の仲値によっております。
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、その金額が確定しているものについては当該金額、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条及び第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21年 4 月13日現在)
1. 受益権総数	平成21年 4 月13日現在における受益権の総数 198,715,843,917口
2. 元本の欠損	「投資信託財産の計算に関する規則」第55条の 6 第10号に規定する額 1,460,897,063円
3. 1 単位当たり純資産額	0.9926円 (1 万口=9,926円)

(デリバティブ取引に関する注記)

I. 取引の状況に関する事項

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

Ⅱ. 取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

株式関連

(平成21年4月13日現在)

(単位：円)

区 分	種 類	契 約 額 等		時 価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買 建				
	S P 5 0 0	4,404,538,210	—	4,663,398,012	258,859,802
		(43,887,387.5米ドル)	(一)	(46,466,700米ドル)	(2,579,312.5米ドル)
	D J E U R	1,768,910,396	—	1,890,526,176	121,615,780
		(13,413,030ユーロ)	(一)	(14,335,200ユーロ)	(922,170ユーロ)
	F T S E	836,493,824	—	847,912,618	11,418,794
		(5,698,575英ポンド)	(一)	(5,776,365英ポンド)	(77,790英ポンド)
買建 合計		7,009,942,430	—	7,401,836,806	391,894,376

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については以下のように評価しております。

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

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

(関連当事者との取引に関する注記)

(自 平成20年3月31日 至 平成21年4月13日)

該当事項はありません。

(その他の注記)

(平成21年4月13日現在)	
本有価証券報告書における開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	117,363,450,080円
同期中における追加設定元本額	105,512,827,570円
同期中における一部解約元本額	24,160,433,733円
平成21年4月13日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国株式インデックスファンドS	1,060,854,885円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	113,870,438円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	533,043,164円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	295,264,607円
スミセイ・DCバランスファンド（機動的資産配分型）	1,553,482円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	101,221円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	153,629円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	190,722円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	201,120円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	218,631円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	289,215円
SMAM・外国株式パッシブ・ファンド（適格機関投資家専用）	52,420,343,293円
バランスファンドVA（安定運用型）＜適格機関投資家限定＞	804,698,790円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型＜適格機関投資家限定＞	31,738,792,568円
SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	14,552,224,171円
SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	8,900,649,410円
SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	33,757,290,311円
SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	109,887,684円
SMAM・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	464,438,955円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	95,341,820円
SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	3,494,284,782円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型＜適格機関投資家限定＞	210,009,010円
SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	683,120,070円
SMAM・インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞	3,659,763,222円
SMAM・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	5,991,688,387円
SMAM・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	10,123,484,519円
SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	1,671,443,826円
三井住友・外国株式インデックスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	1,877,343,318円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	5,030,172,564円
SMAM・グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	715,676,387円
SMAM・バランスファンドVA20＜適格機関投資家専用＞	1,976,618,052円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	18,432,831,664円
合 計	198,715,843,917円

(3) 附属明細表**① 有価証券明細表****(a) 株式**

銘 柄	株 数	評価額 単価	評価額 金額	備 考
米ドル				
ALPHA NATURAL RESOURCES INC	10,000	18.46	184,600.00	
ANADARKO PETROLEUM CORP	62,014	43.18	2,677,764.52	
APACHE CORPORATION	45,401	68.92	3,129,036.92	
BAKER HUGHES INC	42,913	30.97	1,329,015.61	
BJ SERVICES CO	36,717	11.16	409,761.72	
CABOT OIL & GAS CORPORATION	13,620	28.54	388,714.80	
CAMERON INTERNATIONAL CORP	30,612	24.33	744,789.96	
CHESAPEAKE ENERGY CORPORATION	78,615	20.70	1,627,330.50	
CHEVRON CORPORATION	275,867	69.23	19,098,272.41	
CIMAREX ENERGY CO	10,500	23.70	248,850.00	
CONOCOPHILLIPS	192,096	40.40	7,760,678.40	
CONSOL ENERGY INC	25,262	27.05	683,337.10	
DENBURY RESOURCES INC	35,754	17.13	612,466.02	
DEVON ENERGY CORPORATION	56,944	48.91	2,785,131.04	
DIAMOND OFFSHORE DRILLING,INC.	9,626	71.39	687,200.14	
ENSCO INTERNATIONAL INC	18,625	29.28	545,340.00	
EOG RESOURCES INC	33,838	61.35	2,075,961.30	
EXXON MOBIL CORPORATION	690,462	69.84	48,221,866.08	
FMC TECHNOLOGIES INC	17,615	35.60	627,094.00	
FOREST OIL CORPORATION	9,500	15.28	145,160.00	
HALLIBURTON CO	120,881	17.12	2,069,482.72	
HELMERICH & PAYNE INC	15,800	28.97	457,726.00	
HESS CORPORATION	39,797	58.44	2,325,736.68	
KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	9,799	41.14	403,130.86	
MARATHON OIL CORP	95,640	29.27	2,799,382.80	
MCDERMOTT INTERNATIONAL,INC,	32,555	15.76	513,066.80	
MURPHY OIL CORPORATION	24,237	48.03	1,164,103.11	
NABORS INDUSTRIES LTD	39,784	12.44	494,912.96	
NATIONAL-OILWELL VARCO INC.	56,353	33.45	1,885,007.85	
NEWFIELD EXPLORATION CO	17,087	26.59	454,343.33	
NOBLE CORPORATION	36,518	26.13	954,215.34	
NOBLE ENERGY INC	23,161	61.30	1,419,769.30	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	109,827	58.53	6,428,174.31	
PATTERSON-UTI ENERGY INC	19,600	11.88	232,848.00	
PEABODY ENERGY CORP	36,933	28.39	1,048,527.87	
PETROHAWK ENERGY CORP	38,022	21.41	814,051.02	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	16,315	18.88	308,027.20	
PLAINS EXPLORATION & PRODUCTION COMPANY	14,600	20.09	293,314.00	
PRIDE INTERNATIONAL INC	22,700	22.21	504,167.00	

RANGE RESOURCES CORPORATION	21,571	42.72	921,513.12	
ROWAN COMPANIES INC	15,145	13.65	206,729.25	
SCHLUMBERGER LTD	162,372	44.16	7,170,347.52	
SMITH INTERNATIONAL INC	28,972	24.14	699,384.08	
SOUTHWESTERN ENERGY COMPANY	47,861	31.21	1,493,741.81	
SUNOCO INC	14,794	29.03	429,469.82	
TRANSOCEAN LTD	43,376	66.82	2,898,384.32	
ULTRA PETROLEUM CORP	20,948	40.24	842,947.52	
VALERO ENERGY CORP	69,495	21.00	1,459,395.00	
WEATHERFORD INTL LTD	95,445	12.99	1,239,830.55	
XTO ENERGY INC	74,793	33.21	2,483,875.53	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	28,305	60.08	1,700,564.40	
ALCOA INC	130,495	8.85	1,154,880.75	
ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	10,880	28.30	307,904.00	
ARCH COAL INC	18,977	15.28	289,968.56	
BALL CORPORATION	12,403	43.23	536,181.69	
CELANESE CORPORATION	16,623	17.59	292,398.57	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	7,800	73.03	569,634.00	
CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	16,070	20.59	330,881.30	
DOW CHEMICAL	124,784	10.94	1,365,136.96	
DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	122,458	26.48	3,242,687.84	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	11,527	31.02	357,567.54	
ECOLAB INC	32,297	36.97	1,194,020.09	
FREEPORT-MCMORAN COPPER-B	51,331	44.10	2,263,697.10	
INTERNATIONAL PAPER CO	52,075	7.82	407,226.50	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	9,392	32.84	308,433.28	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	5,793	88.03	509,957.79	
MEADWESTVACO CORP	22,315	13.16	293,665.40	
MONSANTO CO	74,447	82.80	6,164,211.60	
MOSAIC CO/THE	21,143	44.57	942,343.51	
NEWMONT MINING CORP	64,333	41.78	2,687,832.74	
NUCOR CORP	43,006	42.76	1,838,936.56	
OWENS-ILLINOIS INC	21,239	17.45	370,620.55	
PACTIV CORPORATION	16,483	17.08	281,529.64	
PENTAIR INC	14,450	24.10	348,245.00	
PPG INDUSTRIES INC	21,823	44.97	981,380.31	
PRAXAIR INC	41,824	69.31	2,898,821.44	
SEALED AIR CORP	21,338	15.08	321,777.04	
SIGMA-ALDRICH	17,656	40.70	718,599.20	
UNITED STATES STEEL CORPORATION	16,209	26.11	423,216.99	
VULCAN MATERIALS CO	15,253	47.06	717,806.18	
WEYERHAEUSER CO	27,980	31.51	881,649.80	
3M COMPANY	89,309	53.13	4,744,987.17	
AGCO CORP	13,700	23.30	319,210.00	
AMETEK INC	13,660	33.88	462,800.80	
BOEING CO	94,316	39.15	3,692,471.40	

CATERPILLAR INC	81,640	32.52	2,654,932.80	
COOPER INDUSTRIES LTD-CL A	24,252	28.47	690,454.44	
COVIDIEN LIMITED	68,875	31.93	2,199,178.75	
CUMMINS INC	26,488	30.02	795,169.76	
DANAHER CORP	34,697	56.58	1,963,156.26	
DEERE & CO	58,224	37.47	2,181,653.28	
DOVER CORP	26,274	32.35	849,963.90	
EATON CORP	21,376	43.83	936,910.08	
EMERSON ELECTRIC CO	103,988	32.00	3,327,616.00	
FASTENAL COMPANY	17,134	38.43	658,459.62	
FIRST SOLAR,INC.	5,340	142.05	758,547.00	
FLOWERVE CORPORATION	7,569	65.00	491,985.00	
FLUOR CORP	25,136	39.89	1,002,675.04	
FOSTER WHEELER AG	17,596	20.68	363,885.28	
GENERAL DYNAMICS CORP	44,766	44.94	2,011,784.04	
GENERAL ELECTRIC CO	1,427,843	11.33	16,177,461.19	
GENUINE PARTS CO	23,084	32.10	740,996.40	
GOODRICH CORPORATION	17,557	41.13	722,119.41	
HARSCO CORP	11,500	26.19	301,185.00	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	93,322	31.04	2,896,714.88	
ILLINOIS TOOL WORKS	56,660	32.54	1,843,716.40	
INGERSOLL-RAND CO-CL A	43,366	16.62	720,742.92	
ITT CORPORATION	23,966	40.41	968,466.06	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	17,290	44.00	760,760.00	
JOY GLOBAL INC	15,259	25.07	382,543.13	
KBR,INC.	23,685	15.13	358,354.05	
L-3 COMMUNICATIONS HLDGS INC	16,610	71.58	1,188,943.80	
LOCKHEED MARTIN CORPORATION	46,137	73.32	3,382,764.84	
MASCO CORP	46,766	8.11	379,272.26	
NORTHROP GRUMMAN CORP	41,538	44.74	1,858,410.12	
PACCAR INC	47,976	31.93	1,531,873.68	
PALL CORPORATION	17,076	24.02	410,165.52	
PARKER HANNIFIN CORPORATIOM	20,759	39.13	812,299.67	
PRECISION CASTPARTS CORP	18,440	63.13	1,164,117.20	
QUANTA SERVICES INC	26,759	21.99	588,430.41	
RAYTHEON COMPANY	55,881	42.49	2,374,383.69	
ROCKWELL AUTOMATION INC	18,398	28.83	530,414.34	
ROCKWELL COLLINS INC.	21,064	35.16	740,610.24	
ROPER INDUSTRIES INC	11,900	46.38	551,922.00	
SPX CORP	7,068	53.63	379,056.84	
SUNPOWER CORPORATION-CLASS A	4,971	26.04	129,444.84	
SUNPOWER CORPORATION-CLASS B	5,766	23.27	134,174.82	
TEREX CORP	12,232	12.01	146,906.32	
TEXTRON INC	29,518	13.56	400,264.08	
TYCO ELECTRONICS LTD	60,329	13.42	809,615.18	
TYCO INTERNATIONAL LTD	63,370	21.49	1,361,821.30	

UNITED TECHNOLOGIES CORP	122,547	47.29	5,795,247.63	
WW GRAINGER INC	9,110	77.00	701,470.00	
APOLLO GROUP INC-CL A	18,023	61.51	1,108,594.73	
DEVRY INC	8,500	41.72	354,620.00	
DST SYSTEMS INC	4,929	36.48	179,809.92	
DUN & BRADSTREET CORP	7,601	80.48	611,728.48	
EQUIFAX INC	17,342	26.90	466,499.80	
EXPEDIA INC	23,583	10.42	245,734.86	
FTI CONSULTING INC	6,380	48.48	309,302.40	
H&R BLOCK INC	45,392	15.58	707,207.36	
ITT EDUCATIONAL SERVICES INC	5,050	100.88	509,444.00	
MANPOWER INC	11,192	35.15	393,398.80	
MCKESSON CORP	37,867	35.27	1,335,569.09	
MOODY'S CORP	27,616	24.49	676,315.84	
PAYCHEX INC	43,844	27.01	1,184,226.44	
PITNEY BOWES INC	28,973	24.62	713,315.26	
REPUBLIC SERVICES INC	50,094	19.44	973,827.36	
ROBERT HALF INTL INC	21,891	20.52	449,203.32	
RR DONNELLEY & SONS CO	25,498	9.31	237,386.38	
SAIC INC	25,000	17.71	442,750.00	
STERICYCLE,INC.	11,700	49.70	581,490.00	
WASTE MANAGEMENT INC	66,424	26.25	1,743,630.00	
BURLINGTON NORTHERN SANTA FE	46,425	66.16	3,071,478.00	
C.H.ROBINSON WORLDWIDE,INC.	22,260	48.25	1,074,045.00	
CSX CORP	52,556	29.75	1,563,541.00	
EXPEDITORS INTL WASH INC	29,878	31.88	952,510.64	
FEDEX CORP	39,920	50.92	2,032,726.40	
J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	11,100	26.96	299,256.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	50,047	37.35	1,869,255.45	
SOUTHWEST AIRLINES	24,000	7.38	177,120.00	
UNION PACIFIC CORP	68,660	46.30	3,178,958.00	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	91,920	53.49	4,916,800.80	
BORGWARNER INC	17,000	25.88	439,960.00	
FORD MOTOR COMPANY	265,639	4.24	1,126,309.36	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	27,934	8.50	237,439.00	
JOHNSON CONTROLS INC	84,583	16.68	1,410,844.44	
BLACK & DECKER CORP	7,352	33.53	246,512.56	
COACH INC	44,945	18.86	847,662.70	
D.R.HORTON INC	39,548	10.64	420,790.72	
EASTMAN KODAK CO	36,815	4.31	158,672.65	
GARMIN LTD	14,316	22.21	317,958.36	
HASBRO INC	17,474	26.86	469,351.64	
LEGGETT & PLATT INC	19,715	14.23	280,544.45	
MOHAWK INDUSTRIES INC	7,483	32.72	244,843.76	
NIKE INC -CL B	50,132	53.27	2,670,531.64	
POLO RALPH LAUREN CORPORATION	7,198	48.73	350,758.54	

STANLEY WORKS/THE	9,481	31.86	302,064.66	
TOLL BROTHERS INC	16,839	18.28	307,816.92	
VF CORP	11,705	66.06	773,232.30	
CARNIVAL CORP	59,088	25.60	1,512,652.80	
DARDEN RESTAURANTS INC	18,640	37.04	690,425.60	
HARLEY-DAVIDSON INC	31,686	18.02	570,981.72	
INTL GAME TECHNOLOGY	46,060	11.55	531,993.00	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	40,778	19.19	782,529.82	
MCDONALD'S CORPORATION	151,358	56.67	8,577,457.86	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	21,871	10.08	220,459.68	
STARWOOD HOTELS & RESORTS	24,064	15.32	368,660.48	
TIM HORTONS INC	25,107	26.82	673,369.74	
WYNN RESORTS LTD	10,721	30.27	324,524.67	
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	32,320	16.58	535,865.60	
CBS CORP-CL B	80,093	5.36	429,298.48	
COMCAST CORP-CL A	265,529	14.62	3,882,033.98	
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	110,189	13.81	1,521,710.09	
DIRECTV GROUP INC/THE	70,979	24.26	1,721,950.54	
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-A	17,230	17.95	309,278.50	
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC-C	20,430	16.27	332,396.10	
DISH NETWORK CORP.	28,364	13.68	388,019.52	
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	68,125	5.20	354,250.00	
LIBERTY GLOBAL INC-A	18,940	17.28	327,283.20	
LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	19,763	16.88	333,599.44	
LIBERTY MEDIA CORP-ENTERTAINMENT	68,985	22.11	1,525,258.35	
LIBERTY MEDIA-INTERACTIVE A	68,507	3.74	256,216.18	
MCGRAW-HILL COMPANIES INC	43,623	24.60	1,073,125.80	
NEWS CORP-CL A	252,622	7.82	1,975,504.04	
NEWS CORPORATION-CLASS B	58,031	8.73	506,610.63	
OMNICOM GROUP	41,669	27.64	1,151,731.16	
SCRIPPS NETWORKS INTERACTIVE	10,800	25.92	279,936.00	
THE WALT DISNEY CO.	239,029	19.88	4,751,896.52	
TIME WARNER CABLE,INC.	49,300	27.72	1,366,596.00	
TIME WARNER INC	162,350	22.24	3,610,664.00	
VIACOM INC-CLASS B	71,102	18.94	1,346,671.88	
VIRGIN MEDIA INC	39,577	6.49	256,854.73	
WASHINGTON POST CO B	777	388.85	302,136.45	
ABERCROMBIE & FITCH CO -CL A	11,471	24.76	284,021.96	
ADVANCE AUTO PARTS	13,538	42.29	572,522.02	
AMERICAN EAGLE OUTFITTERS INC	27,500	13.98	384,450.00	
AUTOZONE INC	5,738	161.72	927,949.36	
BED BATH & BEYOND INC	34,449	31.09	1,071,019.41	
BEST BUY COMPANY INC	47,326	41.09	1,944,625.34	
CARMAX INC	33,022	12.23	403,859.06	
COSTCO WHOLESALE CORP	58,504	46.90	2,743,837.60	
DOLLAR TREE INC	13,200	44.09	581,988.00	

FAMILY DOLLAR STORES	18,636	34.33	639,773.88	
GAMESTOP CORP-CL A	21,647	32.42	701,795.74	
GAP INC/THE	67,817	15.09	1,023,358.53	
HOME DEPOT INC	230,266	25.90	5,963,889.40	
J.C.PENNEY CO INC (HLDG CO)	27,597	25.42	701,515.74	
KOHL'S CORP	40,157	45.40	1,823,127.80	
LIMITED BRANDS	45,193	10.67	482,209.31	
LOWE'S COMPANIES INC	198,625	20.32	4,036,060.00	
MACY'S INC	55,648	11.88	661,098.24	
NORDSTROM INC	24,535	21.91	537,561.85	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	18,100	37.88	685,628.00	
PETSMART INC	18,691	22.88	427,650.08	
PRICELINE.COM INC	5,512	89.96	495,859.52	
ROSS STORES INC	18,536	39.68	735,508.48	
SEARS HOLDINGS CORP	8,710	52.49	457,187.90	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	13,092	53.55	701,076.60	
STAPLES INC	96,926	21.03	2,038,353.78	
STARBUCKS CORP	98,857	12.00	1,186,284.00	
TARGET CORP	97,158	39.89	3,875,632.62	
TIFFANY & CO	18,807	24.22	455,505.54	
TJX COMPANIES INC	56,531	27.58	1,559,124.98	
URBAN OUTFITTERS,INC.	16,000	17.34	277,440.00	
WAL-MART STORES INC	320,440	50.66	16,233,490.40	
WALGREEN CO	134,206	28.98	3,889,289.88	
YUM! BRANDS INC	62,804	30.28	1,901,705.12	
CVS CAREMARK CORPORATION	194,753	30.09	5,860,117.77	
KROGER CO	85,469	20.25	1,730,747.25	
PEPSI BOTTLING GROUP,INC.	18,300	24.78	453,474.00	
SAFEWAY INC	58,149	20.20	1,174,609.80	
WHOLE FOODS MARKET INC	21,000	18.36	385,560.00	
ALTRIA GROUP INC	279,656	16.31	4,561,189.36	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	77,692	25.85	2,008,338.20	
BROWN-FORMAN CORPORATION	10,115	41.50	419,772.50	
BUNGE LIMITED	17,038	57.12	973,210.56	
CAMPBELL SOUP CO	29,879	26.12	780,439.48	
COCA-COLA CO/THE	282,787	44.99	12,722,587.13	
COCA-COLA ENTERPRISES INC	41,604	14.55	605,338.20	
CONAGRA FOODS INC	61,924	17.65	1,092,958.60	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	27,523	11.18	307,707.14	
DEAN FOODS CO	20,679	19.62	405,721.98	
DR.PEPPER SNAPPLE GROUP,INC	33,537	19.47	652,965.39	
GENERAL MILLS INC	44,857	50.84	2,280,529.88	
HANSEN NATURAL CORPORATION	9,300	37.07	344,751.00	
HJ HEINZ CO	43,619	33.95	1,480,865.05	
HORMEL FOODS CORPORATION	10,000	31.71	317,100.00	
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	16,500	38.81	640,365.00	

KELLOGG CO	35,378	39.55	1,399,199.90	
KRAFT FOODS INC-A	199,811	22.35	4,465,775.85	
LORILLARD INC	22,180	63.28	1,403,550.40	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	16,630	28.96	481,604.80	
MOLSON COORS BREWING COMPANY	20,425	35.47	724,474.75	
PEPSICO INC	210,718	52.10	10,978,407.80	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC.	274,852	37.71	10,364,668.92	
RALCORP HOLDINGS INC	7,300	52.92	386,316.00	
REYNOLDS AMERICAN INC	22,612	39.15	885,259.80	
SARA LEE CORP	92,711	8.70	806,585.70	
SUPERVALU INC	30,030	14.10	423,423.00	
SYSCO CORP	80,885	23.02	1,861,972.70	
THE HERSHEY COMPANY	20,710	36.58	757,571.80	
TYSON FOODS INC-CL A	42,500	10.99	467,075.00	
AVERY DENNISON CORP	12,662	26.21	331,871.02	
AVON PRODUCTS INC	57,913	22.08	1,278,719.04	
CHURCH & DWIGHT CO INC	9,500	53.53	508,535.00	
CLOROX COMPANY	18,761	54.08	1,014,594.88	
COLGATE-PALMOLIVE CO	68,435	59.80	4,092,413.00	
ENERGIZER HOLDINGS INC	7,917	54.65	432,664.05	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	16,015	26.70	427,600.50	
FORTUNE BRANDS INC	20,702	35.81	741,338.62	
KIMBERLY-CLARK CORP	56,260	48.20	2,711,732.00	
MATTEL INC	48,282	13.35	644,564.70	
NEWELL RUBBERMAID INC	41,444	7.57	313,731.08	
PROCTER & GAMBLE CO	399,970	49.19	19,674,524.30	
PULTE HOMES INC	32,951	10.11	333,134.61	
WHIRLPOOL CORP	8,624	35.32	304,599.68	
AETNA INC	61,702	25.81	1,592,528.62	
AMERISOURCEBERGEN CORP	21,909	33.08	724,749.72	
BARD(C.R.) INC	13,280	77.12	1,024,153.60	
BAXTER INTERNATIONAL INC	84,155	49.23	4,142,950.65	
BECTON DICKINSON & CO	32,832	67.24	2,207,623.68	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	182,922	9.00	1,646,298.00	
COVANCE INC	8,200	39.37	322,834.00	
COVENTRY HEALTH CARE INC	19,813	14.85	294,223.05	
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	21,609	27.09	585,387.81	
EXPRESS SCRIPTS INC	28,392	49.17	1,396,034.64	
HEALTH NET INC	15,000	14.94	224,100.00	
HENRY SCHEIN INC	12,350	40.51	500,298.50	
HOLOGIC INC	33,980	14.05	477,419.00	
HOSPIRA INC	21,933	32.15	705,145.95	
HUMANA INC.	22,343	28.88	645,265.84	
INTUITIVE SURGICAL INC	5,329	112.24	598,126.96	
LABORATORY CRP OF AMR HLDGS	14,656	59.70	874,963.20	
MEDCO HEALTH SOLUTIONS INC	67,722	42.04	2,847,032.88	

MEDTRONIC INC	153,011	31.04	4,749,461.44	
MILLIPORE CORPORATION	7,786	59.54	463,578.44	
OMNICARE INC	15,800	25.47	402,426.00	
PATTERSON COS INC	13,032	19.87	258,945.84	
PHARMACEUTICAL PRODUCT DEVELOPMENT INC	14,900	23.75	353,875.00	
QUEST DIAGNOSTICS	22,699	48.52	1,101,355.48	
ST JUDE MEDICAL INC	46,620	34.64	1,614,916.80	
STRYKER CORP	37,636	34.75	1,307,851.00	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	56,626	37.14	2,103,089.64	
UNITEDHEALTH GROUP INC	164,352	23.86	3,921,438.72	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	16,407	33.38	547,665.66	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	21,908	26.87	588,667.96	
WELLPOINT INC	68,910	40.34	2,779,829.40	
ZIMMER HOLDINGS INC	29,777	38.78	1,154,752.06	
ABBOTT LABORATORIES	210,594	44.03	9,272,453.82	
ALLERGAN INC	41,143	47.47	1,953,058.21	
AMGEN INC	143,737	47.86	6,879,252.82	
AMYLIN PHARMACEUTICALS INC	20,400	9.66	197,064.00	
BIOGEN IDEC INC	39,497	52.96	2,091,761.12	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	268,454	20.18	5,417,401.72	
CARDINAL HEALTH INC	48,490	32.96	1,598,230.40	
CELGENE CORP	62,072	40.80	2,532,537.60	
CEPHALON INC	8,963	66.56	596,577.28	
CHARLES RIVER LABORATORIES INC	9,360	29.21	273,405.60	
ELI LILLY & CO	138,795	32.64	4,530,268.80	
FOREST LABORATORIES,INC.	42,162	21.55	908,591.10	
GENZYME CORP - GENL DIVISION	36,610	56.38	2,064,071.80	
GILEAD SCIENCES INC	123,687	47.63	5,891,211.81	
ILLUMINA INC	17,100	35.00	598,500.00	
JOHNSON & JOHNSON	376,776	51.41	19,370,054.16	
LIFE TECHNOLOGIES CORPORATION	24,415	33.51	818,146.65	
MERCK & CO. INC.	287,181	26.30	7,552,860.30	
MYLAN INC	39,600	14.21	562,716.00	
PERRIGO CO	9,500	24.34	231,230.00	
PFIZER INC	915,297	13.55	12,402,274.35	
SCHERING-PLOUGH CORP	220,562	23.32	5,143,505.84	
WARNER CHILCOTT LIMITED	15,000	10.56	158,400.00	
WYETH	180,678	42.42	7,664,360.76	
ASSOCIATED BANC-CORP	15,819	17.17	271,612.23	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP(THE)	156,101	29.65	4,628,394.65	
BB & T CORPORATION	74,863	20.31	1,520,467.53	
COMERICA INC	19,650	19.57	384,550.50	
FIFTH THIRD BANCORP	63,238	3.58	226,392.04	
HUDSON CITY BANCORP INC	62,769	12.90	809,720.10	
KEYCORP	70,150	8.25	578,737.50	
M & T BANK CORP	10,268	54.56	560,222.08	

MARSHALL & ILSLEY CORPORATION	28,252	7.22	203,979.44	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	41,900	11.68	489,392.00	
NORTHERN TRUST CORP	27,905	64.12	1,789,268.60	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	46,800	18.29	855,972.00	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	58,220	38.48	2,240,305.60	
REGIONS FINANCIAL CORPORATION	103,470	4.31	445,955.70	
STATE STREET CORP	58,567	36.32	2,127,153.44	
SUNTRUST BANKS INC	47,103	14.14	666,036.42	
TFS FINANCIAL CORP	18,000	12.44	223,920.00	
US BANCORP	238,777	17.64	4,212,026.28	
WELLS FARGO & COMPANY	536,138	19.61	10,513,666.18	
ZIONS BANCORPORATION	17,445	12.36	215,620.20	
AMERICAN EXPRESS COMPANY	141,677	18.83	2,667,777.91	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	29,151	24.18	704,871.18	
BANK OF AMERICA CORP	868,574	9.55	8,294,881.70	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	51,086	17.46	891,961.56	
CITIGROUP INC	737,562	3.04	2,242,188.48	
CME GROUP INC.	8,370	257.90	2,158,623.00	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	59,381	8.19	486,330.39	
FRANKLIN RESOURCES INC	22,385	61.72	1,381,602.20	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	54,039	124.33	6,718,668.87	
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	7,938	89.12	707,434.56	
INVESCO LIMITED	52,839	16.50	871,843.50	
JPMORGAN CHASE & CO	506,826	32.75	16,598,551.50	
LEGG MASON INC	18,603	19.43	361,456.29	
LEUCADIA NATIONAL CORPORATION	24,256	18.94	459,408.64	
MASTERCARD INC-CL A	11,984	172.46	2,066,760.64	
MORGAN STANLEY	129,631	25.35	3,286,145.85	
NASDAQ STOCK MARKET INC	19,080	21.99	419,569.20	
NYSE EURONEXT	20,229	21.51	435,125.79	
SCHWAB (CHARLES) CORP	133,512	16.97	2,265,698.64	
SEI INVESTMENTS COMPANY	17,624	14.25	251,142.00	
SLM CORPORATION	63,561	6.69	425,223.09	
T ROWE PRICE GROUP INC	34,662	33.65	1,166,376.30	
TD AMERITRADE HOLDING CORPORATION	31,800	15.86	504,348.00	
VISA INC	61,094	58.79	3,591,716.26	
WESTERN UNION COMPANY	99,346	14.41	1,431,575.86	
ACE LIMITED	45,448	45.53	2,069,247.44	
AFLAC INC	64,818	24.95	1,617,209.10	
ALLSTATE CORP	70,601	23.03	1,625,941.03	
AON CORP	32,839	39.02	1,281,377.78	
ARCH CAPITAL GROUP LTD.	6,000	59.15	354,900.00	
ASSURANT INC	17,489	26.03	455,238.67	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	19,003	26.28	499,398.84	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	1,493	3,051.00	4,555,143.00	
CHUBB CORP	48,213	42.86	2,066,409.18	

CIGNA CORP	37,811	20.45	773,234.95	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	20,633	25.84	533,156.72	
EVEREST RE GROUP LTD	8,453	74.76	631,946.28	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL INC-CL A	29,661	22.83	677,160.63	
FIRST AMERICAN CORPORATION	11,000	28.63	314,930.00	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	45,086	10.80	486,928.80	
LINCOLN NATIONAL CORP	33,578	10.40	349,211.20	
LOEWS CORPORATION	46,510	24.55	1,141,820.50	
MARSH & MCLENNAN COS	69,756	20.42	1,424,417.52	
METLIFE INC	107,663	27.02	2,909,054.26	
OLD REPUBLIC INTL CORP	32,961	11.30	372,459.30	
PARTNERRE LTD	7,718	68.05	525,209.90	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	32,200	14.47	465,934.00	
PROGRESSIVE CORP	89,331	14.73	1,315,845.63	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	57,164	27.50	1,572,010.00	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	7,863	50.81	399,519.03	
TORCHMARK CORPORATION	10,639	31.42	334,277.38	
TRAVELERS COS INC(THE)	79,374	42.84	3,400,382.16	
UNUM GROUP	44,570	14.67	653,841.90	
W.R.BERKLEY CORPORATION	19,543	24.86	485,838.98	
WHITE MOUNTAINS INSURANCE GROUP LTD.	1,050	190.05	199,552.50	
WILLIS GROUP HOLDINGS LTD	24,198	22.88	553,650.24	
ACCENTURE LTD-CL A	83,243	27.71	2,306,663.53	
ACTIVISION BLIZZARD INC	81,020	10.69	866,103.80	
ADOBE SYSTEMS INC	73,916	24.87	1,838,290.92	
AFFILIATED COMPUTER SVCS A	12,582	50.83	639,543.06	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	8,350	43.82	365,897.00	
AUTODESK INC	31,434	19.30	606,676.20	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	68,776	36.20	2,489,691.20	
BMC SOFTWARE INC	25,378	33.63	853,462.14	
CA INC	55,813	18.08	1,009,099.04	
CITRIX SYSTEMS INC	24,598	25.64	630,692.72	
COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORPORATION	39,145	23.62	924,604.90	
COMPUTER SCIENCES CORP	20,862	39.08	815,286.96	
ELECTRONIC ARTS INC	43,581	19.69	858,109.89	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	27,162	19.56	531,288.72	
FISERV INC	21,776	36.50	794,824.00	
IMS HEALTH INC	27,048	13.73	371,369.04	
INTUIT INC	42,922	26.64	1,143,442.08	
IRON MOUNTAIN INC	26,022	25.83	672,148.26	
MCAFFEE INC	20,812	35.46	737,993.52	
MICROSOFT CORP	1,086,502	19.65	21,349,764.30	
ORACLE CORPORATION	559,829	19.11	10,698,332.19	
SALESFORCE.COM,INC.	14,075	37.40	526,405.00	
SYMANTEC CORPORATION	113,113	17.13	1,937,625.69	
SYNOPSYS INC	20,984	21.83	458,080.72	

TERADATA CORP	25,777	16.45	424,031.65	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	25,519	14.15	361,093.85	
ADVANCED MICRO DEVICES	75,085	3.75	281,568.75	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	47,758	17.00	811,886.00	
AMPHENOL CORPORATION -CL A	23,044	30.32	698,694.08	
ANALOG DEVICES	39,105	20.76	811,819.80	
APPLE INC	120,739	119.57	14,436,762.23	
APPLIED MATERIALS INC	181,929	11.45	2,083,087.05	
ARROW ELECTRONICS INC	15,990	19.81	316,761.90	
AVNET INC	20,900	18.82	393,338.00	
BECKMAN COULTER INC	9,141	53.80	491,785.80	
BROADCOM CORP-CL A	60,322	23.17	1,397,660.74	
CISCO SYSTEMS INC	794,555	17.82	14,158,970.10	
CORNING INC	210,602	15.10	3,180,090.20	
DAVITA INC	13,548	45.24	612,911.52	
DELL INC	238,552	10.76	2,566,819.52	
DOLBY LABORATORIES INC-CL A	7,300	35.56	259,588.00	
EMC CORP/MASS	277,003	13.25	3,670,289.75	
FLEXTRONICS INTL LTD	107,331	3.57	383,171.67	
FLIR SYSTEMS INC	16,840	22.03	370,985.20	
HARRIS CORP	19,350	31.17	603,139.50	
HEWLETT-PACKARD CO	332,257	34.43	11,439,608.51	
INTEL CORP	755,022	15.98	12,065,251.56	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	182,357	101.70	18,545,706.90	
KLA-TENCOR CORPORATION	22,124	23.69	524,117.56	
LAM RESEARCH CORP	15,964	25.56	408,039.84	
LEXMARK INTERNATIONAL INC	9,896	17.58	173,971.68	
LINEAR TECHNOLOGY CORP	30,858	22.73	701,402.34	
LSI CORPORATION	76,857	3.81	292,825.17	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	74,574	10.47	780,789.78	
MDU RESOURCES GROUP INC	26,500	17.16	454,740.00	
MEMC ELECTRONIC MATERIALS	31,806	18.94	602,405.64	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	26,408	23.14	611,081.12	
MICRON TECHNOLOGY INC	104,041	4.45	462,982.45	
MOTOROLA INC	306,079	4.90	1,499,787.10	
NETAPP INC	43,944	16.96	745,290.24	
NVIDIA CORP	72,794	12.04	876,439.76	
QUALCOMM INC	224,686	41.65	9,358,171.90	
SANDISK CORP	31,300	14.48	453,224.00	
SEAGATE TECHNOLOGY	62,068	6.65	412,752.20	
SUN MICROSYSTEMS INC	100,082	6.68	668,547.76	
TEXAS INSTRUMENTS INC	175,841	17.24	3,031,498.84	
WATERS CORP	12,691	40.00	507,640.00	
WESTERN DIGITAL CORP	29,623	22.11	654,964.53	
XEROX CORP	121,982	5.46	666,021.72	
XILINX INC	37,653	20.40	768,121.20	

AKAMAI TECHNOLOGIES	22,906	20.20	462,701.20	
AMAZON.COM INC	46,632	79.77	3,719,834.64	
AMERICAN TOWER CORPORATION -CL A	53,709	32.82	1,762,729.38	
AT&T INC	799,951	26.10	20,878,721.10	
CENTURYTEL INC	15,000	27.67	415,050.00	
CINTAS CORP	19,413	25.93	503,379.09	
CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP	37,422	25.11	939,666.42	
EBAY INC	147,531	15.02	2,215,915.62	
EMBARQ CORPORATION	18,839	37.30	702,694.70	
GOOGLE INC-CL A	32,525	372.50	12,115,562.50	
JUNIPER NETWORKS INC	71,273	18.34	1,307,146.82	
METROPCS COMMUNICATIONS INC.	30,500	17.22	525,210.00	
NII HOLDINGS INC	24,479	15.04	368,164.16	
QWEST COMMUNICATIONS INTL	217,888	3.83	834,511.04	
SPRINT NEXTEL CORP	375,823	4.29	1,612,280.67	
TELEPHONE AND DATA SYSTEMS	8,500	27.70	235,450.00	
VERISIGN INC	28,418	20.85	592,515.30	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	385,620	32.10	12,378,402.00	
WINDSTREAM CORPORATION	57,500	8.48	487,600.00	
YAHOO! INC	178,410	13.47	2,403,182.70	
AES CORPORATION	87,366	6.76	590,594.16	
ALLEGHENY ENERGY INC	23,312	24.88	580,002.56	
ALLIANT ENERGY CORP	13,848	25.09	347,446.32	
AMEREN CORPORATION	28,424	22.91	651,193.84	
AMERICAN ELECTRIC POWER	63,550	26.40	1,677,720.00	
AQUA AMERICA INC	18,000	19.04	342,720.00	
CENTERPOINT ENERGY INC	45,209	10.23	462,488.07	
CONSOLIDATED EDISON INC	37,147	38.89	1,444,646.83	
CONSTELLATION ENERGY GROUP	26,423	23.20	613,013.60	
DOMINION RESOURCES INC/VA	78,725	30.48	2,399,538.00	
DTE ENERGY COMPANY	21,773	28.87	628,586.51	
DUKE ENERGY CORP	171,569	13.96	2,395,103.24	
EDISON INTERNATIONAL	42,253	28.82	1,217,731.46	
EL PASO CORPORATION	93,320	7.04	656,972.80	
ENERGEN CORPORATION	10,300	31.77	327,231.00	
ENTERGY CORP	25,779	65.84	1,697,289.36	
EQT CORPORATION	17,980	33.72	606,285.60	
EXELON CORP	89,406	47.81	4,274,500.86	
FIRSTENERGY CORP	41,244	40.21	1,658,421.24	
FPL GROUP INC	52,660	52.32	2,755,171.20	
INTEGRYS ENERGY GROUP,INC.	9,500	26.00	247,000.00	
MIRANT CORP	25,045	13.15	329,341.75	
NISOURCE INC	36,492	10.39	379,151.88	
NORTHEAST UTILITIES	21,500	21.50	462,250.00	
NRG ENERGY INC	31,625	19.41	613,841.25	
NSTAR	14,500	31.19	452,255.00	

ONEOK INC	13,000	24.22	314,860.00	
P G & E CORPORATION	50,374	38.44	1,936,376.56	
PEPCO HOLDINGS INC	27,534	12.41	341,696.94	
PINNACLE WEST CAPITAL CORPORATION	12,844	27.96	359,118.24	
PPL CORPORATION	50,644	28.91	1,464,118.04	
PROGRESS ENERGY INC	37,076	35.19	1,304,704.44	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	68,748	30.18	2,074,814.64	
QUESTAR CORP	22,911	32.00	733,152.00	
RELIANT ENERGY INC	41,285	4.60	189,911.00	
SCANA CORP	14,463	30.88	446,617.44	
SEMPRA ENERGY	31,361	46.13	1,446,682.93	
SOUTHERN CO	105,018	30.89	3,244,006.02	
SPECTRA ENERGY CORPORATION	82,063	14.91	1,223,559.33	
WILLIAMS COS INC	81,753	12.87	1,052,161.11	
WISCONSIN ENERGY CORP	16,216	40.69	659,829.04	
XCEL ENERGY INC	64,712	18.45	1,193,936.40	
ALTERA CORPORATION	40,070	17.75	711,242.50	
NATIONAL SEMICONDUCTOR CORP	33,592	12.60	423,259.20	
米ドル 小計	39,373,155		1,056,125,236.47	
(邦貨換算額)			(105,992,728,732)	(単位：円)
カナダドル				
ADDAX PETROLEUM CORPORATION	10,500	32.27	338,835.00	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	72,875	54.71	3,986,991.25	
ENCANA CORP	101,548	55.28	5,613,573.44	
ENSIGN ENERGY SERVICES INC	20,400	12.85	262,140.00	
HUSKY ENERGY INC	36,242	28.05	1,016,588.10	
IMPERIAL OIL LTD	40,864	45.90	1,875,657.60	
NEXEN INC	63,008	23.98	1,510,931.84	
NIKO RESOURCES LTD	6,400	63.65	407,360.00	
PETRO-CANADA	67,080	39.63	2,658,380.40	
PROGRESS ENERGY RESOURCES CORP	20,000	9.74	194,800.00	
SUNCOR ENERGY INC	126,474	32.00	4,047,168.00	
TALISMAN ENERGY INC	136,032	15.30	2,081,289.60	
TRICAN WELL SERVICE LTD	9,884	7.56	74,723.04	
AGNICO-EAGLE MINES	20,450	60.35	1,234,157.50	
AGRIUM INC	22,083	47.20	1,042,317.60	
BARRICK GOLD CORP	118,239	34.87	4,122,993.93	
CAMECO CORP	55,757	21.95	1,223,866.15	
ELDORADO GOLD CORPORATION	52,500	9.19	482,475.00	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	10,100	41.16	415,716.00	
GERDAU AMERISTEEL CORP	30,000	4.90	147,000.00	
GOLDCORP INC	98,799	36.15	3,571,583.85	
IAMGOLD CORP	52,000	9.46	491,920.00	
INMET MINING CORPORATION	5,622	36.83	207,058.26	
KINROSS GOLD CORP	91,795	18.25	1,675,258.75	

PAN AMERICAN SILVER CORP	11,472	19.67	225,654.24	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	40,888	104.99	4,292,831.12	
SHERRITT INTERNATIONAL CORPORATION	53,500	3.23	172,805.00	
SILVER WHEATON CORPORATION	41,000	9.58	392,780.00	
SINO-FOREST CORPORATION-CL A	22,471	9.31	209,205.01	
TECK COMINCO LIMITED-CL B	71,117	9.94	706,902.98	
YAMANA GOLD INC	90,670	9.88	895,819.60	
BOMBARDIER INC 'B'	184,659	3.62	668,465.58	
CAE INC	37,214	7.94	295,479.16	
FINNING INTERNATIONAL INC	26,250	13.21	346,762.50	
SNC-LAVALIN GROUP INC	20,381	35.82	730,047.42	
GROUPE AEROPLAN INC	28,000	7.85	219,800.00	
RITCHIE BROS. AUCTIONEERS	14,200	26.14	371,188.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	63,544	49.44	3,141,615.36	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	22,286	39.22	874,056.92	
MAGNA INTERNATIONAL INC-CL A	15,656	40.08	627,492.48	
ASTRAL MEDIA INC	5,500	27.34	150,370.00	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	49,106	19.39	952,165.34	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	11,958	48.00	573,984.00	
METRO INC -A	13,800	38.35	529,230.00	
SHOPPERS DRUG MART CORP	29,420	43.05	1,266,531.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC-B	21,900	12.52	274,188.00	
LOBLAW COMPANIES LTD	16,433	30.77	505,643.41	
SAPUTO INC	17,840	21.30	379,992.00	
WESTON (GEORGE) LTD	7,700	56.10	431,970.00	
MDS INC	9,480	6.70	63,516.00	
BIOVAIL CORP	20,693	13.42	277,700.06	
BANK OF MONTREAL	73,179	36.00	2,634,444.00	
BANK OF NOVA SCOTIA	134,551	32.46	4,367,525.46	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	51,309	50.05	2,568,015.45	
NATIONAL BANK OF CANADA	22,661	42.46	962,186.06	
ROYAL BANK OF CANADA	181,632	39.58	7,188,994.56	
TORONTO-DOMINION BANK	110,003	46.75	5,142,640.25	
BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	65,193	19.36	1,262,136.48	
CI FINANCIAL CORP	20,000	14.60	292,000.00	
IGM FINANCIAL INC	17,101	35.82	612,557.82	
TMX GROUP INC	9,221	36.64	337,857.44	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	2,350	314.99	740,226.50	
GREAT-WEST LIFECO INC	39,904	18.22	727,050.88	
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANCE AND FINANCIAL	13,000	22.49	292,370.00	
ING CANADA INC	10,700	34.00	363,800.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	202,045	18.50	3,737,832.50	
POWER CORP OF CANADA	45,760	21.26	972,857.60	
POWER FINANCIAL CORP	33,686	21.51	724,585.86	
SUN LIFE FINANCIAL INC	75,883	26.80	2,033,664.40	

BROOKFIELD PROPERTIES CORP	29,363	7.93	232,848.59	
CGI GROUP INC - CL A	33,587	10.40	349,304.80	
ONEX CORPORATION	12,723	17.23	219,217.29	
RESEARCH IN MOTION	69,351	78.94	5,474,567.94	
BCE INC	34,720	25.60	888,832.00	
MANITOBA TELECOM SVCS INC	2,500	31.77	79,425.00	
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	68,800	27.00	1,857,600.00	
TELUS CORPORATION	4,400	31.58	138,952.00	
TELUS CORPORATION -NON VOTE	23,297	30.44	709,160.68	
THOMSON REUTERS CORP	31,828	33.78	1,075,149.84	
CANADIAN UTILITIES LIMITED	10,300	34.85	358,955.00	
ENBRIDGE INC	47,629	36.56	1,741,316.24	
FORTIS INC	23,750	22.22	527,725.00	
TRANSALTA CORP	27,068	18.74	507,254.32	
TRANSCANADA CORP	84,777	30.00	2,543,310.00	
カナダドル 小計	3,828,061		109,923,344.45	
(邦貨換算額)			(8,989,531,109)	(単位：円)
ユーロ				
COMPAGNIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE-VERITA	19,750	9.68	191,278.75	
ENI SPA	353,083	14.74	5,207,342.23	
FORTUM OYJ	58,981	13.14	775,010.34	
FUGRO NV-CVA	9,145	24.35	222,726.47	
GALP ENERGIA SGPS S.A	25,500	9.47	241,510.50	
HELLENIC PETROLEUM SA	19,935	6.98	139,146.30	
NESTE OIL OYJ	19,185	9.87	189,355.95	
OMV AG	21,989	26.45	581,609.05	
REPSOL YPF SA	99,090	14.47	1,433,832.30	
SAIPEM	36,120	13.95	504,119.97	
SARAS S.P.A.	48,000	2.13	102,537.60	
TECHNIP S.A.	14,359	27.81	399,395.58	
TOTAL SA	289,646	37.06	10,734,280.76	
ACERINOX SA	21,236	10.87	230,835.32	
AIR LIQUIDE	33,370	66.78	2,228,615.45	
AKZO NOBEL	30,566	32.83	1,003,481.78	
ARCELOR MITTAL	116,969	19.25	2,252,238.09	
BASF SE	125,508	26.75	3,357,339.00	
BAYER AG	103,563	37.60	3,893,968.80	
CIMPOR-CIMENTOS DE PORTUGAL	29,700	4.19	124,650.90	
CRH PLC	94,380	16.94	1,598,797.20	
ERAMET	750	174.12	130,590.00	
IMERYS SA	4,165	30.63	127,594.77	
ITALCEMENTI S.P.A.	32,000	4.23	135,469.76	
K+S AG	20,720	42.46	879,771.20	
KONINKLIJKE DSM NV	20,281	21.05	426,915.05	
LAFARGE - RTS	17,532	6.80	119,217.60	

LAFARGE SA	25,532	34.92	891,577.44	
OUTOKUMPU OYJ	17,429	10.00	174,290.00	
RAUTARUUKKI OYJ	9,973	13.86	138,225.78	
SALZGITTER AG	5,090	48.37	246,203.30	
SOLVAY SA	8,645	65.07	562,573.37	
STORA ENSO OYJ-R SHS	74,712	3.37	251,779.44	
TENARIS S.A.	64,069	8.37	536,527.90	
THYSSENKRUPP AG	50,158	15.92	798,515.36	
TITAN CEMENT CO. S.A.	9,191	17.00	156,247.00	
UMICORE	15,450	15.55	240,247.50	
UPM-KYMMENE OYJ	73,976	5.30	392,072.80	
VOESTALPINE AG	14,253	13.20	188,139.60	
WACKER CHEMIE AG	2,150	65.91	141,706.50	
ACCIONA S.A.	3,830	85.25	326,507.50	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	25,035	35.20	881,232.00	
ALSTOM RGPT	29,013	43.79	1,270,479.27	
BOSKALIS WESTMINSTER NV	6,200	17.72	109,864.00	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	50,123	24.45	1,225,507.35	
EIFFAGE SA	4,500	36.95	166,275.00	
EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	44,280	9.33	413,353.80	
FINMECCANICA SPA	53,189	9.65	513,703.08	
FOMENTO DE CONSTRUC Y CONTRA	5,502	25.20	138,650.40	
GAMESA CORP TECNOLOGICA SA	24,421	11.80	288,167.80	
GEA GROUP AG	24,000	9.40	225,600.00	
GRUPO FERROVIAL	7,753	21.54	166,999.62	
HOCHTIEF AG	6,287	32.12	201,938.44	
KONE OYJ-B	19,050	17.37	330,898.50	
LEGRAND SA	13,000	13.90	180,765.00	
LINDE AG	18,857	58.38	1,100,871.66	
MAN AG	14,743	38.23	563,624.89	
METSO OYJ	18,471	9.38	173,257.98	
PIRELLI & C.	366,874	0.23	87,572.82	
PRYSMIAN SPA	14,400	8.81	126,873.79	
Q-CELLS SE	7,200	16.15	116,280.00	
SCHNEIDER ELECTRIC SA	30,077	53.27	1,602,352.17	
SIEMENS AG-REG	117,791	45.95	5,412,496.45	
SOLARWORLD AG	12,784	17.25	220,524.00	
STRABAG SE-BR	6,600	14.00	92,400.00	
THALES SA	12,475	30.20	376,807.37	
VALLOUREC	7,760	79.51	617,036.40	
VINCI S.A.	56,963	31.09	1,770,979.67	
WARTSILA OYJ-B SHARES	11,871	19.20	227,923.20	
WIENERBERGER AG	16,619	7.00	116,333.00	
ZARDOYA OTIS SA	19,900	14.10	280,590.00	
ZODIAC AEROSPACE	5,672	20.42	115,850.60	
BRISA	44,718	5.36	239,688.48	

BUREAU VERITAS SA	6,000	30.87	185,250.00	
LOTTOMATICA SPA	10,024	13.64	136,805.84	
RANDSTAD HOLDING NV	14,898	13.74	204,698.52	
SBM OFFSHORE NV	17,967	10.47	188,114.49	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	38,500	11.90	458,150.00	
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	38,410	12.35	474,363.50	
AEROPORTS DE PARIS (ADP)	3,900	43.90	171,210.00	
AIR FRANCE-KLM	20,927	8.50	178,046.91	
ATLANTIA SPA	36,144	12.41	448,865.83	
CINTRA CONCESIONES DE INFRAESTRUCTURAS	34,956	3.97	138,775.32	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	29,079	9.51	276,541.29	
DEUTSCHE POST AG-REG	118,548	8.88	1,052,706.24	
FRAPORT AG	5,000	27.93	139,650.00	
IBERIA LINEAS AER DE ESPANA	63,493	1.64	104,128.52	
RYANAIR HOLDINGS PLC	1,656	3.07	5,083.92	
SOCIETE DES AUTOROUTES PARIS-RHIN-RHONE	3,000	50.75	152,250.00	
TNT NV	50,042	14.03	702,089.26	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	46,066	25.97	1,196,334.02	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE(BMW)AG-PFD	7,041	15.90	111,951.90	
DAIMLER AG	122,423	24.35	2,981,000.05	
FIAT SPA	98,416	6.78	667,456.32	
MICHELIN (CGDE)-B	19,645	35.55	698,379.75	
NOKIAN RENKAAT OYJ	13,197	10.14	133,817.58	
PEUGEOT SA	19,055	18.50	352,517.50	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE PREF	11,715	46.95	550,019.25	
RENAULT SA	25,175	22.66	570,465.50	
VALEO	12,000	13.39	160,680.00	
VOLKSWAGEN AG	12,038	236.30	2,844,579.40	
VOLKSWAGEN AG PFD	13,995	57.65	806,811.75	
ADIDAS AG	27,124	27.62	749,164.88	
CHRISTIAN DIOR SA	7,600	46.00	349,600.00	
HERMES INTERNATIONAL	7,463	90.65	676,520.95	
LVMH MOET HENNESSY LOUI V SA	33,258	51.95	1,727,753.10	
PHILIPS ELECTRONICS NV	131,845	12.22	1,611,805.12	
PUMA AG	906	137.37	124,457.22	
ACCOR SA	25,667	31.00	795,677.00	
OPAP SA	29,706	20.52	609,567.12	
SODEXO	12,486	36.23	452,367.78	
TUI AG	24,365	5.27	128,525.37	
GESTEVISION TELECINCO SA	16,400	6.82	111,848.00	
LAGARDERE S.C.A.	15,971	23.19	370,367.49	
M6-METROPOLE TELEVISION	8,000	13.22	105,760.00	
MEDIASET SPA	106,834	3.69	395,076.40	
PAGESJAUNES SA	16,662	7.00	116,634.00	
PUBLICIS GROUPE	17,900	20.97	375,363.00	
REED ELSEVIER NV	86,896	7.81	679,266.03	

SANOMA OYJ	13,500	8.86	119,610.00	
SES	37,996	13.92	528,904.32	
TELEVISION FRANCAISE (T.F.1)	16,976	7.34	124,739.64	
VIVENDI SA	158,877	20.61	3,275,249.35	
WOLTERS KLUWER-CVA	34,842	12.48	435,002.37	
ZON MULTIMEDIA SERVICOS DE TEL	28,057	4.15	116,436.55	
BULGARI SPA	29,433	3.46	101,973.57	
INDITEX	29,693	32.75	972,445.75	
METRO AG	16,029	29.88	478,946.52	
PPR	10,896	57.98	631,750.08	
CARREFOUR SA	86,016	30.04	2,584,350.72	
KONINKLIJKE AHOLD NV	164,397	8.12	1,335,725.62	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	97,794	20.75	2,029,714.47	
CASINO GUICHARD PERRACHON	5,605	47.23	264,724.15	
COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	20,329	11.82	240,288.78	
COLRUYT NV	2,119	165.50	350,694.50	
DELHAIZE GROUP	14,028	48.11	674,887.08	
GROUPE DANONE	59,160	37.15	2,197,794.00	
HEINEKEN HOLDING NV	13,339	19.13	255,241.76	
HEINEKEN NV	34,600	22.63	782,998.00	
JERONIMO MARTINS SGPS S.A.	24,500	3.90	95,550.00	
KERRY GROUP PLC-A	23,198	14.30	331,916.98	
KESKO OYJ-B SHS	9,834	16.28	160,097.52	
PARMALAT SPA	234,000	1.60	376,445.16	
PERNOD-RICARD SA	22,921	40.81	935,406.01	
SUEDZUCKER AG	8,500	14.72	125,120.00	
UNILEVER NV-CVA	220,220	14.96	3,294,491.20	
BEIERSDORF AG	11,540	33.94	391,667.60	
BIC	3,400	38.67	131,478.00	
HENKEL AG & CO KGAA	15,900	18.45	293,355.00	
HENKEL AG & CO KGAA	25,978	20.38	529,431.64	
L'OREAL	32,690	53.66	1,754,145.40	
BIOMERIEUX	1,750	54.57	95,497.50	
ESSILOR INTERNATIONAL	27,203	31.41	854,446.23	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG AND CO.KGAA	26,540	28.25	749,755.00	
FRESENIUS SE	3,400	28.58	97,172.00	
FRESENIUS SE-PFD	11,800	33.86	399,548.00	
GRIFOLS S.A.	18,700	11.80	220,660.00	
LUXOTTICA GROUP SPA	17,330	12.55	217,567.23	
CELESIO AG	10,604	14.87	157,681.48	
ELAN CORPORATION PLC	75,566	4.37	330,223.42	
IPSEN	3,300	25.00	82,500.00	
MERCK KGAA	8,641	64.23	555,011.43	
ORION OYJ	11,098	10.76	119,414.48	
QIAGEN N.V.	25,000	12.20	305,000.00	
SANOFI-AVENTIS	142,736	41.75	5,959,228.00	

UCB SA	13,297	22.07	293,464.79	
ALPHA BANK A.E.	47,321	6.50	307,586.50	
ANGLO IRISH BANK CORPORATION PLC	96,000	0.00	96.00	
BANCA CARIGE S.P.A	104,000	2.62	272,489.36	
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	350,814	1.09	385,509.50	
BANCA POPOLARE DI MILANO	59,060	3.88	229,563.26	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	484,140	7.78	3,766,609.20	
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-R	338,402	0.63	214,885.27	
BANCO DE SABADELL SA	122,244	4.13	504,867.72	
BANCO DE VALENCIA SA	29,200	6.90	201,480.00	
BANCO ESPIRITO SANTO,S.A(BES)	72,900	3.70	269,730.00	
BANCO POPOLARE SPA	78,182	4.33	338,936.17	
BANCO POPULAR ESPANOL	112,611	5.85	658,774.35	
BANCO SANTANDER SA	1,109,341	6.52	7,232,903.32	
BANK OF PIRAEUS	47,100	6.08	286,368.00	
BANKINTER,S.A.	33,500	9.03	302,505.00	
BNP PARIBAS	111,234	35.34	3,931,565.73	
COMMERZBANK AG	97,810	4.40	430,853.05	
CREDIT AGRICOLE SA	123,690	9.80	1,212,162.00	
DEUTSCHE BANK AG -REG	72,626	37.01	2,687,888.26	
DEUTSCHE POSTBANK AG	12,150	13.60	165,240.00	
DEXIA	85,098	2.79	238,104.20	
EFG EUROBANK ERGASIAS	42,812	5.40	231,184.80	
ERSTE GROUP BANK AG	26,113	15.37	401,356.81	
INTESA SANPAOLO	1,035,906	2.17	2,251,862.82	
INTESA SANPAOLO-RNC	134,503	1.49	201,337.54	
KBC GROUPE SA	27,851	13.90	387,128.90	
NATIONAL BANK OF GREECE S,A.	65,839	14.02	923,062.78	
NATIXIS	132,000	1.58	208,692.00	
RAIFFEISEN INTERNATIONAL BANK-HOLDING AG	8,070	26.58	214,500.60	
SOCIETE GENERALE	63,139	35.20	2,222,808.49	
UNICREDIT SPA	1,637,895	1.65	2,711,289.48	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	85,394	9.20	786,288.31	
CNP-CIE NATL A PORTEFEUILLE	7,000	35.67	249,690.00	
CRITERIA CAIXACORP SA	117,507	2.64	310,218.48	
DEUTSCHE BOERSE AG	26,847	47.49	1,274,964.03	
EURAZEO	2,600	24.95	64,870.00	
EXOR SPA	10,997	9.42	103,627.37	
FORTIS	98,000	1.42	139,552.00	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	13,245	53.84	713,177.02	
ING GROEP NV-CVA	275,484	6.19	1,705,796.92	
MARFIN INVESTMENT GROUP S.A	84,000	2.88	241,920.00	
MEDIOBANCA SPA	66,065	6.83	451,495.47	
POHJOLA BANK PLC	17,903	4.54	81,279.62	
POHJOLA BANK PLC-RIGHTS	17,903	1.04	18,619.12	
SAMPO OYJ-A SHS	55,254	11.75	649,234.50	

AEGON NV	200,500	3.32	665,860.50	
ALLEANZA ASSICURAZIONI	53,118	4.37	232,447.02	
ALLIANZ SE-REG	61,594	69.70	4,293,101.80	
ASSICURAZIONI GENERALI	142,761	13.39	1,912,357.83	
AXA	210,050	10.84	2,276,942.00	
CNP ASSURANCES	4,801	52.71	253,084.71	
FONDIARIA SAI S.P.A.	8,700	9.20	80,086.54	
HANNOVER RUECKVERSICHERUNGS AG	8,600	25.92	222,912.00	
MAPFRE SA	93,649	1.88	176,060.12	
MEDIOLANUM SPA	26,000	2.68	69,767.10	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	27,964	99.00	2,768,436.00	
SCOR SE	23,458	16.40	384,711.20	
UNIPOL GRUPPO FINANZIARIA SPA-PFD	237,000	0.47	111,816.60	
VIENNA INSURANCE GROUP	4,200	25.95	108,990.00	
ATOS ORIGIN	8,431	23.09	194,713.94	
CAP GEMINI SA	18,904	25.50	482,146.52	
DASSAULT SYSTEMES SA	8,053	29.86	240,502.84	
INDRA SISTEMAS SA	12,028	14.68	176,571.04	
SAP AG	116,720	29.10	3,396,552.00	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	13,500	6.05	81,675.00	
ALCATEL-LUCENT	331,916	1.61	535,048.59	
ASML HOLDING NV	60,765	14.45	878,054.25	
NEOPOST SA	4,418	62.51	276,191.27	
NOKIA OYJ	515,328	10.34	5,328,491.52	
SAFRAN SA	28,877	8.06	232,748.62	
STMICROELECTRONICS NV	90,162	4.62	416,548.44	
BELGACOM SA	23,931	24.05	575,540.55	
BOUYGUES	33,831	30.64	1,036,750.99	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	385,342	9.46	3,645,335.32	
ELISA CORP - A SHARES	17,422	9.78	170,387.16	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	13,600	15.50	210,800.00	
FRANCE TELECOM SA	249,020	16.87	4,200,967.40	
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	37,849	12.20	461,757.80	
ILIAD SA	1,800	74.56	134,217.00	
KONINKLIJKE KPN NV	236,575	9.55	2,259,291.25	
MOBISTAR SA	3,864	47.04	181,781.88	
PORTUGAL TELECOM SGPS SA-REG	87,352	6.25	545,950.00	
TELECOM ITALIA SPA	1,405,401	1.03	1,455,658.13	
TELECOM ITALIA-RNC	763,811	0.78	596,849.55	
TELEFONICA S.A.	574,872	15.16	8,715,059.52	
TELEKOM AUSTRIA AG	46,626	11.31	527,340.06	
A2A S.P.A.	165,000	1.17	193,073.10	
ACEA SPA	15,000	8.72	130,949.40	
E.ON AG	258,082	23.05	5,948,790.10	
EDP RENOVAVEIS SA	29,000	6.06	176,001.00	
EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA	247,124	2.77	686,510.47	

ELECTRICITE DE FRANCE(EDF)	27,699	31.38	869,333.11	
ENAGAS	23,800	11.16	265,608.00	
ENEL SPA	585,727	3.84	2,251,247.58	
GAS NATURAL SDG SA	29,946	11.00	329,406.00	
GDF SUEZ	148,842	23.82	3,545,416.44	
IBERDROLA RENOVABLES	117,000	3.14	367,380.00	
IBERDROLA SA	475,795	5.70	2,712,031.50	
OEST ELEKTRIZATSWIRTSCHAFTS AG-CL A	10,020	28.52	285,770.40	
PUBLIC POWER CORP	12,906	15.20	196,171.20	
RED ELECTRICA CORPORATION S.A.	15,100	30.15	455,265.00	
RWE AG	60,050	56.45	3,389,822.50	
RWE AG-NON VTG PFD	5,954	51.00	303,654.00	
SNAM RETE GAS	112,283	3.79	425,652.50	
TERNA SPA	160,846	2.32	373,416.85	
UNION FENOSA SA	49,442	18.00	889,956.00	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	48,930	17.61	861,657.30	
ユーロ 小計	22,932,923		238,812,078.83	
(邦貨換算額)			(31,494,536,956)	(単位：円)
英ポンド				
BG GROUP PLC	455,591	10.55	4,806,485.05	
BP PLC	2,542,452	4.46	11,339,335.92	
CAIRN ENERGY PLC	18,700	21.70	405,790.00	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	481,573	14.62	7,040,597.26	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	365,864	14.14	5,173,316.96	
TULLOW OIL PLC	107,000	7.77	831,925.00	
ANGLO AMERICAN PLC	178,524	13.96	2,492,195.04	
ANTOFAGASTA PLC	57,470	5.57	320,107.90	
BHP BILLITON PLC	299,258	14.08	4,213,552.64	
EURASIAN NATURAL RESOURCES CORPORATION	48,500	5.21	252,927.50	
JOHNSON MATTHEY PLC	29,201	12.32	359,756.32	
LONMIN PLC	16,436	14.38	236,349.68	
REXAM PLC	94,549	2.88	272,773.86	
RIO TINTO PLC	135,248	23.61	3,193,205.28	
VEDANTA RESOURCES PLC	24,600	8.73	214,881.00	
XSTRATA PLC	257,408	5.72	1,473,660.80	
AMEC PLC	44,835	5.70	255,783.67	
BAE SYSTEMS PLC	477,135	3.37	1,607,944.95	
BALFOUR BEATTY PLC	57,839	3.56	205,906.84	
COBHAM PLC	157,074	1.82	286,660.05	
IMI PLC	45,000	3.12	140,737.50	
INVENSYS PLC	113,258	1.68	190,273.44	
MEGGITT PLC	83,624	1.54	128,780.96	
ROLLS-ROYCE GROUP PLC	244,493	3.23	791,546.08	
SMITHS GROUP PLC	53,766	6.71	360,769.86	
TOMKINS PLC	127,922	1.50	192,522.61	

BUNZL PLC	46,008	5.35	246,142.80	
CAPITA GROUP PLC	81,599	6.35	518,561.64	
COMPASS GROUP PLC	244,678	3.26	799,485.36	
G4S PLC	176,927	1.94	344,653.79	
HAYS PLC	226,793	0.74	169,527.76	
SERCO GROUP PLC	62,528	3.62	226,507.68	
BRITISH AIRWAYS PLC	74,750	1.60	120,272.75	
FIRSTGROUP PLC	63,315	3.04	192,635.88	
STAGECOACH GROUP PLC	87,142	1.31	114,591.73	
BURBERRY GROUP PLC	52,937	3.30	174,692.10	
CARNIVAL PLC	22,567	17.64	398,081.88	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	32,789	5.89	193,127.21	
LADBROKES PLC	83,524	1.96	164,124.66	
THOMAS COOK GROUP PLC	47,000	2.62	123,492.50	
TUI TRAVEL PLC	80,000	2.54	203,400.00	
BRITISH SKY BROADCASTING PLC	160,055	4.25	681,434.16	
DAILY MAIL&GENERAL TST-A NV	44,024	2.66	117,213.90	
ITV PLC	383,675	0.28	109,347.37	
PEARSON PLC	111,753	6.87	768,301.87	
REED ELSEVIER PLC	145,648	4.75	692,556.24	
THOMSON REUTERS PLC	26,480	16.52	437,449.60	
UNITED BUSINESS MEDIA LTD	33,734	4.51	152,140.34	
WPP PLC	153,867	4.17	642,394.72	
CARPHONE WAREHOUSE GROUP	52,000	1.37	71,500.00	
EXPERIAN PLC	139,594	4.80	670,051.20	
HOME RETAIL GROUP	126,094	2.65	334,149.10	
KINGFISHER PLC	300,840	1.64	493,377.60	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	215,199	3.17	682,718.82	
NEXT PLC	26,144	13.99	365,754.56	
WHITBREAD PLC	25,356	8.30	210,454.80	
WOLSELEY PLC	39,432	10.76	424,288.32	
WOLSELEY PLC-NIL PAID-RTS	20,750	6.75	140,062.50	
TESCO PLC	1,067,082	3.31	3,537,376.83	
WILLIAM MORRISON SUPERMARKETS PLC	327,292	2.50	818,230.00	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	50,400	6.28	316,764.00	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	257,526	15.70	4,043,158.20	
CADBURY PLC	184,301	5.17	952,836.17	
DIAGEO PLC	339,210	7.72	2,620,397.25	
IMPERIAL TOBACCO GROUP PLC	137,770	14.77	2,034,862.90	
SABMILLER PLC	122,185	10.55	1,289,051.75	
SAINSBURY (J) PLC	139,638	3.10	432,877.80	
TATE & LYLE PLC	52,649	2.78	146,495.84	
UNILEVER PLC	173,831	13.02	2,263,279.62	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	81,563	25.40	2,071,700.20	
THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	13,000	10.19	132,470.00	
SMITH & NEPHEW PLC	120,783	4.73	571,907.50	

ASTRAZENECA PLC	196,411	23.15	4,546,914.65	
GLAXOSMITHKLINE PLC	705,443	10.14	7,153,192.02	
SHIRE PLC	73,500	8.26	607,110.00	
BARCLAYS PLC	1,136,827	1.77	2,017,867.92	
HSBC HOLDINGS PLC	2,325,703	4.74	11,023,832.22	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	1,325,614	0.79	1,053,863.13	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	2,382,954	0.29	691,056.66	
STANDARD CHARTERED PLC	256,743	9.86	2,531,485.98	
ICAP PLC	71,416	3.43	245,135.42	
INVESTEC PLC	61,000	3.11	189,862.50	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	17,402	5.79	100,757.58	
MAN GROUP PLC	245,945	2.37	584,119.37	
SCHRODERS PLC	17,000	8.45	143,735.00	
ADMIRAL GROUP PLC	26,000	8.93	232,180.00	
AVIVA PLC	360,473	2.34	843,506.82	
FRIENDS PROVIDENT PLC	286,019	0.64	185,626.33	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	855,491	0.48	417,479.60	
OLD MUTUAL PLC	677,324	0.63	428,746.09	
PRUDENTIAL PLC	346,153	3.39	1,175,189.43	
RSA INSURANCE GROUP PLC	465,885	1.30	608,911.69	
STANDARD LIFE PLC	312,048	1.73	541,091.23	
AUTONOMY CORP PLC	30,000	13.37	401,100.00	
LOGICA PLC	200,800	0.66	133,030.00	
SAGE GROUP PLC (THE)	172,063	1.66	287,173.14	
BT GROUP PLC	1,065,323	0.81	862,911.63	
CABLE & WIRELESS PLC	353,018	1.40	495,284.25	
VODAFONE GROUP PLC	7,121,098	1.22	8,748,268.89	
CENTRICA PLC	692,835	2.28	1,583,127.97	
DRAX GROUP PLC	48,200	5.27	254,255.00	
INTERNATIONAL POWER PLC	199,053	2.27	452,845.57	
NATIONAL GRID PLC	330,117	5.24	1,729,813.08	
SCOTTISH & SOUTHERN ENERGY	124,008	10.49	1,300,843.92	
SEVERN TRENT PLC	33,294	10.27	341,929.38	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	91,891	4.99	458,536.09	
英ポンド 小計	35,578,803		131,372,469.63	
(邦貨換算額)			(19,284,164,816)	(単位：円)
スイスフラン				
GIVAUDAN-REG	950	677.00	643,150.00	
HOLCIM LTD-REG	25,352	47.74	1,210,304.48	
LONZA GROUP AG-REG	6,552	108.30	709,581.60	
SYNGENTA AG	13,141	226.80	2,980,378.80	
ABB LTD	296,578	17.00	5,041,826.00	
GEBERIT AG-REG	5,850	113.10	661,635.00	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	5,970	54.90	327,753.00	
SULZER AG	3,890	65.65	255,378.50	

ADECCO SA-REG	16,434	39.30	645,856.20	
SGS SA	681	1,225.00	834,225.00	
KUEHNE&NAGEL INTL AG-REG	7,185	71.85	516,242.25	
CIE FINANCIERE RICHEMONT SA-BR A	73,177	20.90	1,529,399.30	
THE SWATCH GROUP AG-B	5,109	159.90	816,929.10	
ARYATA AG	11,300	31.95	361,035.00	
LINDT & SPRUENGLI AG	118	1,689.00	199,302.00	
LINDT & SPRUENGLI AG-REG	14	20,450.00	286,300.00	
NESTLE SA-REGISTERED	520,050	39.54	20,562,777.00	
NOVEL BIO CARE HOLDING AG	15,545	18.98	295,044.10	
SONOVA HOLDING AG	5,642	72.00	406,224.00	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,250	175.00	218,750.00	
SYNTHES INC	8,270	126.70	1,047,809.00	
ACTELION LTD	13,416	50.45	676,837.20	
NOVARTIS AG-REG SHS	322,806	42.50	13,719,255.00	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	95,381	151.40	14,440,683.40	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	145,360	38.02	5,526,587.20	
UBS AG-REGISTERED	398,431	11.50	4,581,956.50	
JULIUS BAER HOLDING AG-REG	28,873	36.00	1,039,428.00	
PARGESA HOLDING SA-BR	4,000	64.20	256,800.00	
BALOISE HOLDING AG	7,000	79.00	553,000.00	
SWISS LIFE HOLDING AG	3,970	86.80	344,596.00	
SWISS RE-REG	46,500	24.58	1,142,970.00	
ZURICH FINANCIAL SERVICES AG	19,368	190.20	3,683,793.60	
LOGITECH INTERNATIONAL-REG	26,382	13.76	363,016.32	
SWISSCOM AG-REG	3,247	311.00	1,009,817.00	
BKW FMB ENERGIE AG	2,420	82.50	199,650.00	
スイスフラン 小計	2,140,212		87,088,290.55	
(邦貨換算額)			(7,542,716,844)	(単位：円)
スウェーデンクローナ				
LUNDIN PETROLEUM AB	27,802	49.20	1,367,858.40	
HOLMEN AB-B SHARES	9,033	157.00	1,418,181.00	
SSAB SVENSKT STAL AB-SER A	33,942	74.50	2,528,679.00	
SVENSKA CELLULOSEA AB-B SHS	77,762	70.00	5,443,340.00	
ALFA LAVAL AB	47,952	68.00	3,260,736.00	
ASSA ABLOY AB-B	41,466	83.50	3,462,411.00	
ATLAS COPCO AB-A SHS	87,532	67.25	5,886,527.00	
ATLAS COPCO AB-B SHS	48,196	61.25	2,952,005.00	
SANDVIK AB	139,821	51.50	7,200,781.50	
SCANIA AB-B SHS	46,532	81.00	3,769,092.00	
SKANSKA AB-B SHS	51,790	75.00	3,884,250.00	
SKF AB-B SHARES	54,148	82.50	4,467,210.00	
VOLVO AB-A SHS	55,800	48.80	2,723,040.00	
VOLVO AB-B SHS	151,700	48.40	7,342,280.00	
SECURITAS AB-B SHS	46,657	64.50	3,009,376.50	

MODERN TIMES GROUP-B SHS	8,076	155.50	1,255,818.00	
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	69,132	341.00	23,574,012.00	
SWEDISH MATCH AB	33,871	121.50	4,115,326.50	
ELECTROLUX AB-SER B	32,483	76.00	2,468,708.00	
HUSQVARNA AB-B SHS	57,983	35.20	2,041,001.60	
GETINGE AB-B SHS	28,138	82.50	2,321,385.00	
NORDEA BANK AB	436,120	49.40	21,544,328.00	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A	210,923	30.70	6,475,336.10	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	61,008	138.50	8,449,608.00	
SWEDBANK AB - A SHARES	57,060	35.90	2,048,454.00	
INVESTOR AB-B SHS	60,549	112.25	6,796,625.25	
ERICSSON LM-B SHS	402,923	74.80	30,138,640.40	
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	9,800	340.00	3,332,000.00	
TELE2 AB -B SHS	37,473	76.25	2,857,316.25	
TELIASONERA AB	305,571	38.10	11,642,255.10	
スウェーデンクローナ 小計	2,731,243		187,776,581.60	
(邦貨換算額)			(2,277,729,934)	(単位：円)
ノルウェークローネ				
AKER SOLUTIONS ASA	22,350	35.00	782,250.00	
NORSK HYDRO ASA	104,797	25.20	2,640,884.40	
SEADRILL LID	39,895	66.00	2,633,070.00	
STATOILHYDRO ASA	174,364	113.80	19,842,623.20	
YARA INTERNATIONAL ASA	24,530	142.00	3,483,260.00	
FRONTLINE LTD	5,000	117.00	585,000.00	
ORKLA ASA	118,350	43.60	5,160,060.00	
DNB NOR ASA	102,719	31.30	3,215,104.70	
TELENOR ASA	110,592	37.10	4,102,963.20	
RENEWABLE ENERGY CORP AS	18,670	49.70	927,899.00	
ノルウェークローネ 小計	721,267		43,373,114.50	
(邦貨換算額)			(653,632,835)	(単位：円)
デンマーククローネ				
FLS INDUSTRIES A/S-B SHS	6,550	158.50	1,038,175.00	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	26,342	278.50	7,336,247.00	
A P MOLLER - MAERSK A/S	150	26,300.00	3,945,000.00	
A P MOLLER-MAERSK A/S-A	78	26,200.00	2,043,600.00	
DSV A/S	24,480	45.20	1,106,496.00	
CARLSBERG AS-B	9,736	252.50	2,458,340.00	
DANISCO A/S	6,188	163.75	1,013,285.00	
COLOPLAST-B	4,472	356.50	1,594,268.00	
NOVO NORDISK A/S-B	61,383	246.25	15,115,563.75	
NOVOZYMES A/S-B SHARES	6,163	382.00	2,354,266.00	
DANSKE BANK A/S	64,098	53.00	3,397,194.00	
JYSKE BANK-REG	5,496	136.50	750,204.00	
TOPDANMARK AS	1,934	551.00	1,065,634.00	

TRYGVESTA AS	4,168	280.00	1,167,040.00	
デンマーククローネ 小計	221,238		44,385,312.75	
(邦貨換算額)			(785,620,035)	(単位：円)
オーストラリアドル				
ORIGIN ENERGY LIMITED	118,081	15.43	1,821,989.83	
SANTOS LTD	83,311	16.60	1,382,962.60	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	69,356	38.69	2,683,383.64	
WORLEY PARSONS LIMITED	21,500	18.54	398,610.00	
ALUMINA LTD	207,977	1.37	285,968.37	
AMCOR LIMITED	105,727	4.73	500,088.71	
BHP BILLITON LTD	455,330	32.45	14,775,458.50	
BLUESCOPE STEEL LTD	112,327	2.73	306,652.71	
BORAL LIMITED	83,596	3.85	321,844.60	
CSR LIMITED	172,940	1.26	217,904.40	
FORTESCUE METALS GROUP LIMITED	168,000	2.39	401,520.00	
INCITEC PIVOT LTD	220,000	2.18	479,600.00	
JAMES HARDIE INDUSTRIES NV	64,003	4.83	309,134.49	
NEWCREST MINING LIMITED	66,778	29.10	1,943,239.80	
NUFARM LTD	17,775	11.80	209,745.00	
ONESTEEL LIMITED	102,695	2.56	262,899.20	
ORICA LIMITED	51,923	15.84	822,460.32	
OZ MINERALS LIMITED	316,524	0.57	180,418.68	
RIO TINTO LIMITED	40,581	53.80	2,183,257.80	
SIMS METAL MANAGEMENT LTD	19,395	18.43	357,449.85	
LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	18,821	20.78	391,100.38	
WESFARMERS LIMITED	134,484	19.00	2,555,196.00	
WESFARMERS LIMITED-PPP	18,854	19.07	359,545.78	
BRAMBLES LIMITED	203,032	5.09	1,033,432.88	
COMPUTERSHARE LIMITED	62,429	8.90	555,618.10	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	124,138	1.96	243,310.48	
TOLL HOLDINGS LIMITED	92,920	6.24	579,820.80	
BILLABONG INTERNATIONAL LTD	22,611	8.55	193,324.05	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	49,007	3.79	185,736.53	
CROWN LTD	60,958	6.35	387,083.30	
TABCORP HOLDINGS LIMITED	83,545	6.86	573,118.70	
TATTS GROUP LTD	172,000	2.70	464,400.00	
FAIRFAX MEDIA LTD	301,729	1.08	325,867.32	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	54,432	2.65	144,244.80	
COCA-COLA AMATIL LIMITED	80,322	8.27	664,262.94	
FOSTER'S GROUP LTD	269,347	5.09	1,370,976.23	
GOODMAN FIELDER LIMITED	160,000	1.05	168,800.00	
LION NATHAN LIMITED	39,609	7.96	315,287.64	
METCASH LTD	105,000	4.16	436,800.00	
WOOLWORTHS LIMITED	165,798	25.60	4,244,428.80	
COCHLEAR LIMITED	7,283	50.37	366,844.71	

CSL LIMITED	81,414	31.70	2,580,823.80	
SONIC HEALTHCARE LTD	49,926	11.15	556,674.90	
AUST AND NZ BANKING GROUP LT	277,714	16.62	4,615,606.68	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK	34,500	6.98	240,810.00	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL	199,793	35.60	7,112,630.80	
MACQUARIE GROUP LTD	40,032	28.89	1,156,524.48	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	253,857	21.85	5,546,775.45	
SUNCORP-METWAY LIMITED	190,481	6.27	1,194,315.87	
WESTPAC BANKING CORPORATION	379,377	20.00	7,587,540.00	
ASX LTD	23,210	30.77	714,171.70	
PERPETUAL LIMITED	6,300	29.00	182,700.00	
AMP LIMITED	282,661	5.24	1,481,143.64	
AXA ASIA PACIFIC HOLDINGS LTD	115,340	3.80	438,292.00	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LT	277,006	3.33	922,429.98	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	134,384	19.12	2,569,422.08	
LEND LEASE CORP LIMITED	57,172	6.29	359,611.88	
TELSTRA CORPORATION LIMITED	585,187	3.26	1,907,709.62	
AGL ENERGY LIMITED	66,869	15.20	1,016,408.80	
オーストラリアドル 小計	7,779,361		85,587,379.62	
(邦貨換算額)			(6,201,661,527)	(単位：円)
ニュージーランドドル				
FLETCHER BUILDING LTD	61,957	6.20	384,133.40	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	130,557	1.66	216,724.62	
SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP	50,890	2.75	139,947.50	
TELECOM CORP OF NEW ZEALAND	254,909	2.36	601,585.24	
CONTACT ENERGY LIMITED	34,256	5.75	196,972.00	
ニュージーランドドル 小計	532,569		1,539,362.76	
(邦貨換算額)			(90,314,413)	(単位：円)
香港ドル				
MONGOLIA ENERGY CORPORATION LTD.	300,000	2.28	684,000.00	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	63,000	30.75	1,937,250.00	
KINGBOARD CHEMICALS HOLNINGS	88,000	21.20	1,865,600.00	
HOPEWELL HIGHWAY INFRASTRUCTURE LTD	9,400	4.29	40,326.00	
HOPEWELL HOLDINGS LTD	94,000	20.65	1,941,100.00	
HUTCHISON WHAMPOA LTD	294,000	41.35	12,156,900.00	
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	197,000	9.26	1,824,220.00	
HONG KONG AIRCRAFT ENGINEERG	12,000	70.40	844,800.00	
MTR CORPORATION	181,500	19.54	3,546,510.00	
NWS HOLDINGS LTD	135,000	12.42	1,676,700.00	
ORIENT OVERSEAS INTL LTD	31,000	24.50	759,500.00	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	82,000	17.74	1,454,680.00	
SHANGRI-LA ASIA LTD.	146,000	10.00	1,460,000.00	
TELEVISION BROADCASTS LTD	40,000	29.35	1,174,000.00	
ESPRIT HOLDINGS LTD	153,000	39.45	6,035,850.00	

LI & FUNG LTD	329,600	19.62	6,466,752.00	
LIFESTYLE INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED	60,000	7.33	439,800.00	
BANK OF EAST ASIA	214,200	18.04	3,864,168.00	
BANK OF EAST ASIA-NEW	21,420	18.04	386,416.80	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	509,500	9.52	4,850,440.00	
HANG SENG BANK LTD	102,000	83.25	8,491,500.00	
WING HANG BANK LIMITED	28,000	42.00	1,176,000.00	
HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LIMITED	140,500	83.35	11,710,675.00	
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	113,500	57.95	6,577,325.00	
WHARF HOLDINGS LTD	178,000	21.60	3,844,800.00	
CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	188,000	74.40	13,987,200.00	
CHINESE ESTATES HOLDINGS LIMITED	86,000	9.79	841,940.00	
HANG LUNG GROUP LTD	116,000	27.90	3,236,400.00	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	284,000	20.10	5,708,400.00	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	143,000	33.65	4,811,950.00	
HYSAN DEVELOPMENT CO	65,000	13.98	908,700.00	
KERRY PROPERTIES LTD	79,500	22.95	1,824,525.00	
NEW WORLD DEVELOPMENT	383,000	9.23	3,535,090.00	
SINO LAND CO	190,000	9.05	1,719,500.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	192,000	79.90	15,340,800.00	
WHEELOK&COMPANY LTD	130,000	16.02	2,082,600.00	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	25,500	30.40	775,200.00	
FOXCONN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	260,000	3.54	920,400.00	
HUTCHISON TELECOMMUNICATIONS INTL LTD	201,000	2.38	478,380.00	
CLP HOLDINGS LTD	278,600	52.70	14,682,220.00	
HONG KONG & CHINA GAS	531,969	13.52	7,192,220.88	
HONGKONG ELECTRIC HOLDINGS	191,500	45.90	8,789,850.00	
香港ドル 小計	6,867,689		172,044,688.68	
(邦貨換算額)			(2,227,978,718)	(単位：円)
シンガポールドル				
KEPPEL CORP LTD	185,000	5.50	1,017,500.00	
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	140,820	2.67	375,989.40	
SINGAPORE TECHNOLOGIES ENG	176,000	2.57	452,320.00	
NOBLE GROUP LTD	253,200	1.24	313,968.00	
COMFORTDELGRO CORP LTD	248,000	1.35	334,800.00	
SINGAPORE AIRLINES LTD	75,266	11.46	862,548.36	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	207,250	2.80	580,300.00	
CYCLE & CARRIAGE LTD	22,000	13.22	290,840.00	
OLAM INTERNATIONAL LTD	168,000	1.60	268,800.00	
FRASER & NEAVE LTD	150,000	2.53	379,500.00	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	821,600	0.32	267,020.00	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	109,000	3.28	357,520.00	
PARKWAY HOLDINGS LTD	142,000	1.20	170,400.00	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	226,000	8.91	2,013,660.00	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	350,000	5.46	1,911,000.00	

UNITED OVERSEAS BANK LTD	166,000	10.50	1,743,000.00	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	124,000	5.90	731,600.00	
CAPITALAND LTD	348,000	2.66	925,680.00	
CITY DEVELOPMENTS LTD	78,000	5.65	440,700.00	
GENTING INTERNATIONAL PLC	350,000	0.58	203,000.00	
SEMBCORP MARINE LTD	125,400	2.15	269,610.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,078,015	2.55	2,748,938.25	
シンガポールドル 小計	5,543,551		16,658,694.01	
(邦貨換算額)			(1,102,305,782)	(単位：円)
合 計	128,250,072		186,642,921,701	単位：円
(外貨建有価証券邦貨換算額合計)			(186,642,921,701)	(単位：円)

(注)

1. 合計金額欄の（ ）内は、外貨建有価証券に係るもので、内書きであります。
2. 米ドル表示の株式については、563銘柄、信託財産純資産総額に対する比率53.7%、
合計に対する比率56.8%です。
カナダドル表示の株式については、84銘柄、信託財産純資産総額に対する比率4.6%、
合計に対する比率4.8%です。
ユーロ表示の株式については、273銘柄、信託財産純資産総額に対する比率16.0%、
合計に対する比率16.9%です。
英ポンド表示の株式については、106銘柄、信託財産純資産総額に対する比率9.8%、
合計に対する比率10.3%です。
スイスフラン表示の株式については、35銘柄、信託財産純資産総額に対する比率3.8%、
合計に対する比率4.0%です。
スウェーデンクローナ表示の株式については、30銘柄、信託財産純資産総額に対する比率1.2%、
合計に対する比率1.2%です。
ノルウェークローネ表示の株式については、10銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.3%、
合計に対する比率0.4%です。
デンマーククローネ表示の株式については、14銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.4%、
合計に対する比率0.4%です。
オーストラリアドル表示の株式については、59銘柄、信託財産純資産総額に対する比率3.1%、
合計に対する比率3.3%です。
ニュージーランドドル表示の株式については、5銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.0%、
合計に対する比率0.0%です。
香港ドル表示の株式については、42銘柄、信託財産純資産総額に対する比率1.1%、
合計に対する比率1.2%です。
シンガポールドル表示の株式については、22銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.6%、
合計に対する比率0.6%です。

(b) 株式以外の有価証券

種類	銘 柄	口数	評価額	備考
新株予約権証券	スイスフラン			
	GIVAUDAN-CW09	950.00	10,735.00	
	スイスフラン 小計	950.00	10,735.00	
	(邦貨換算額)		(929,758)	(単位：円)
	合 計		929,758	単位：円
	(外貨建有価証券邦貨換算額合計)		(929,758)	(単位：円)

(注)

1. 合計金額欄の（ ）内は、外貨建有価証券に係るもので、内書きであります。
2. スイスフラン表示の新株予約権証券については、1銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.0%、合計に対する比率100.0%です。

種類	銘 柄	口数	評価額	備考
投資証券	米ドル			
	AMB PROPERTY CORP	14,450	268,047.50	
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	73,500	1,067,955.00	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,257	624,763.50	
	BOSTON PROPERTIES INC	16,559	729,920.72	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	6,593	178,736.23	
	DUKE REALTY CORP	24,373	200,833.52	
	EQUITY RESIDENTIAL	38,606	877,900.44	
	FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST	8,904	508,329.36	
	HCP, INC.	36,257	767,560.69	
	HEALTH CARE REIT INC	14,300	504,933.00	
	HOST HOTELS AND RESORTS INC	72,193	397,061.50	
	KIMCO REALTY CORPORATION	30,032	308,728.96	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	12,247	269,923.88	
	MACERICH COMPANY/THE	13,204	159,504.32	
	PLUM CREEK TIMBER COMPANY	23,907	764,545.86	
	PROLOGIS	32,552	256,184.24	
	PUBLIC STORAGE	17,329	1,126,904.87	
	REGENCY CENTERS CORP	9,600	352,224.00	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	34,211	1,470,730.89	
	UDR INC	20,147	196,836.19	
	VENTAS INS	19,279	518,990.68	
	VORNADO REALTY TRUST	18,693	779,685.03	
	米ドル 小計	548,193	12,330,300.38	
	(邦貨換算額)		(1,237,468,946)	(単位：円)
	カナダドル			
	ARC ENERGY TRUST UNITS	18,000	276,300.00	
	CANADIAN OIL SANDS TRUST	32,359	924,496.63	
	CRESCENT POINT ENERGY TRUST	8,000	220,400.00	
	ENERPLUS RESOURCES FUND	21,390	488,761.50	
	HARVEST ENERGY TRUST-UNITS	21,700	113,708.00	

	PENN WEST ENERGY TRUST	50,167	652,171.00	
	PROVIDENT ENERGY TRUST-UNITS	34,000	172,720.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	18,000	236,700.00	
	YELLOW PAGES INCOME FUND	31,500	184,275.00	
	カナダドル 小計	235,116	3,269,532.13	
	(邦貨換算額)		(267,382,337)	(単位：円)
	ユーロ			
	CORIO NV	5,378	191,833.26	
	GECINA SA	2,300	88,377.50	
	ICADE	3,020	195,892.30	
	KLEPIERRE	11,732	197,097.60	
	UNIBAIL-RODAMCO	11,131	1,281,400.72	
	ユーロ 小計	33,561	1,954,601.38	
	(邦貨換算額)		(257,772,829)	(単位：円)
	英ポンド			
	BRITISH LAND CO PLC	118,005	530,137.46	
	HAMMERSON PLC	101,497	306,267.19	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	106,627	601,909.41	
	LIBERTY INTERNATIONAL PLC	37,855	174,133.00	
	SEGRO PLC	804,342	176,955.24	
	英ポンド 小計	1,168,326	1,789,402.30	
	(邦貨換算額)		(262,666,363)	(単位：円)
	オーストラリアドル			
	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	236,612	385,677.56	
	DEXUS PROPERTY GROUP	464,804	364,871.14	
	GOODMAN GROUP	283,274	111,893.23	
	GPT GROUP	647,473	301,074.94	
	MACQUARIE AIRPORTS	107,000	190,995.00	
	MACQUARIE INFRASTRUCTURE GROUP	319,311	426,280.18	
	MIRVAC GROUP	182,710	182,710.00	
	STOCKLAND	196,614	676,352.16	
	TRANSURBAN GROUP	158,123	675,185.21	
	WESTFIELD GROUP	273,893	2,895,049.01	
	オーストラリアドル 小計	2,869,814	6,210,088.43	
	(邦貨換算額)		(449,983,007)	(単位：円)
	香港ドル			
	LINK REIT	300,500	4,543,560.00	
	香港ドル 小計	300,500	4,543,560.00	
	(邦貨換算額)		(58,839,102)	(単位：円)
	シンガポールドル			
	ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	193,000	275,990.00	

	CAPITAMALL TRUST	328,000	419,840.00	
	シンガポールドル 小計	521,000	695,830.00	
	(邦貨換算額)		(46,043,071)	(単位：円)
	合 計		2,580,155,655	単位：円
	(外貨建有価証券邦貨換算額合計)		(2,580,155,655)	(単位：円)

（注）

1. 合計金額欄の（ ）内は、外貨建有価証券に係るもので、内書きであります。
2. 米ドル表示の投資証券については、22銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.6%、
合計に対する比率47.9%です。
カナダドル表示の投資証券については、9銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.1%、
合計に対する比率10.4%です。
ユーロ表示の投資証券については、5銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.1%、
合計に対する比率10.0%です。
英ポンド表示の投資証券については、5銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.1%、
合計に対する比率10.2%です。
オーストラリアドル表示の投資証券については、10銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.2%、
合計に対する比率17.4%です。
香港ドル表示の投資証券については、1銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.0%、
合計に対する比率2.3%です。
シンガポールドル表示の投資証券については、2銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.0%、
合計に対する比率1.8%です。

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）Ⅱ．取引の時価等に関する事項」に同様の内容が記載されている為、省略しております。

「外国債券パッシブ・マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

対象年月日	(平成21年4月13日現在)
科 目	金額(円)
資産の部	
I 流動資産	
預金	1,494,876,901
コール・ローン	3,616,698,083
国債証券	180,362,126,568
派生商品評価勘定	10,326,374
未収利息	2,541,676,027
前払費用	288,409,382
流動資産合計	188,314,113,335
資産合計	188,314,113,335
負債の部	
I 流動負債	
派生商品評価勘定	13,392,678
未払金	2,810,894,436
未払解約金	1,060,280
流動負債合計	2,825,347,394
負債合計	2,825,347,394
純資産の部	
I 元本等	
1 元本	
元本	151,497,648,151
元本合計	151,497,648,151
2 剰余金	
剰余金	33,991,117,790
剰余金合計	33,991,117,790
元本等合計	185,488,765,941
純資産合計	185,488,765,941
負債・純資産合計	188,314,113,335

(注) 「外国債券パッシブ・マザーファンド」は、毎年12月17日（ただし、休業日の場合は翌営業日）に決算を行います。上記の貸借対照表は平成21年4月13日現在における同マザーファンドの状況です。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項 目	自 平成20年 3 月31日 至 平成21年 4 月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券（売買目的有価証券） 個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によっております。
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条及び第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21年 4 月13日現在)
1. 受益権総数	平成21年 4 月13日現在における受益権の総数 151,497,648,151口
2. 1 単位当たり純資産額	1.2244円 (1 万口＝12,244円)

(デリバティブ取引に関する注記)

I. 取引の状況に関する事項

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

Ⅱ. 取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

通貨関連

(平成21年4月13日現在)

(単位：円)

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

(注) 時価の算定方法

為替予約取引の時価の算定方法について

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

①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。

②計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっています。

- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いています。
- ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い受渡日として、発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

(関連当事者との取引に関する注記)

(自 平成20年3月31日 至 平成21年4月13日)

該当事項はありません。

(その他の注記)

(平成21年4月13日現在)	
本有価証券報告書における開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	111,795,928,812円
同期中における追加設定元本額	52,002,033,881円
同期中における一部解約元本額	12,300,314,542円
平成21年4月13日現在における元本の内訳	
三井住友・DC外国債券インデックスファンドS	866,485,152円
三井住友・DC年金バランス30（債券重点型）	82,557,642円
三井住友・DC年金バランス50（標準型）	262,991,608円
三井住友・DC年金バランス70（株式重点型）	113,765,061円
スミセイ・DCバランスファンド（機動的資産配分型）	2,030,928円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	147,665円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	137,243円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	130,101円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	127,491円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	121,885円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	101,777円
SMAM・年金外国債券パッシブファンド＜適格機関投資家限定＞	4,984,299,610円
SMAM・バランスファンドVA安定成長型＜適格機関投資家限定＞	11,648,080,707円
SMAM・バランスファンドVA25＜適格機関投資家専用＞	38,546,560,264円
SMAM・バランスファンドVA37.5＜適格機関投資家専用＞	12,192,238,544円
SMAM・バランスファンドVA50＜適格機関投資家専用＞	25,160,342,234円
SMAM・バランスファンドVL30＜適格機関投資家限定＞	80,874,418円
SMAM・バランスファンドVL50＜適格機関投資家限定＞	173,316,548円
世界6資産バランスファンドVA＜適格機関投資家限定＞	47,621,477円
SMAM・バランスファンドVA75＜適格機関投資家専用＞	1,360,620,059円
SMAM・バランスファンドVL国際分散型＜適格機関投資家限定＞	156,719,301円
SMAM・インデックス・バランスVA25＜適格機関投資家専用＞	1,749,532,102円
SMAM・インデックス・バランスVA50＜適格機関投資家専用＞	2,655,496,228円
SMAM・バランスファンドVA40＜適格機関投資家専用＞	6,784,211,837円
SMAM・バランスファンドVA35＜適格機関投資家専用＞	15,016,165,635円
SMAM・バランスVA株40T＜適格機関投資家限定＞	1,235,687,906円
三井住友・外国債券パッシブファンドVA＜適格機関投資家限定＞	2,597,281,566円
三井住友・外国債券インデックスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	994,467,103円
三井住友・5資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	3,804,983,386円
SMAM・グローバルバランス40VA＜適格機関投資家限定＞	369,303,957円
SMAM・バランスファンドVA20＜適格機関投資家専用＞	6,156,154,325円
三井住友・7資産バランスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	14,455,094,391円
合 計	151,497,648,151円

（３）附属明細表**①有価証券明細表****（a）株式**

該当事項はありません。

（b）株式以外の有価証券

種類	銘 柄	券面総額	評価額	備 考
国債証券	米ドル			
	US T 0.875% 10/12/31	8,000,000.00	7,991,875.04	
	US T 0.875% 11/01/31	8,500,000.00	8,491,367.23	
	US T 0.875% 11/03/31	2,000,000.00	1,996,875.00	
	US T 1.125% 11/12/15	6,000,000.00	5,990,625.00	
	US T 1.125% 12/01/15	6,000,000.00	5,975,156.28	
	US T 1.25% 10/11/30	6,500,000.00	6,536,054.72	
	US T 1.375% 12/03/15	7,000,000.00	7,010,390.66	
	US T 1.375% 12/2/15	6,000,000.00	6,015,000.00	
	US T 1.5% 10/10/31	6,000,000.00	6,058,125.00	
	US T 1.5% 13/12/31	6,000,000.00	5,935,781.28	
	US T 1.75% 10/03/31	5,000,000.00	5,054,296.90	
	US T 1.75% 11/11/15	5,000,000.00	5,071,484.40	
	US T 1.75% 14/01/31	6,500,000.00	6,471,562.50	
	US T 1.75% 14/03/31	6,000,000.00	5,956,406.28	
	US T 1.875% 14/02/28	4,000,000.00	4,013,437.52	
	US T 11.25% 15/02/15	2,000,000.00	2,986,875.00	
	US T 2% 10/02/28	4,000,000.00	4,048,437.52	
	US T 2% 10/09/30	6,000,000.00	6,105,468.78	
	US T 2% 13/11/30	5,000,000.00	5,044,140.65	
	US T 2.125% 10/01/31	4,700,000.00	4,758,750.00	
	US T 2.125% 10/04/30	5,000,000.00	5,076,953.15	
	US T 2.375% 10/08/31	6,500,000.00	6,642,187.50	
	US T 2.5% 13/03/31	3,500,000.00	3,623,320.33	
	US T 2.625% 10/05/31	5,500,000.00	5,617,304.71	
	US T 2.625% 16/02/29	5,000,000.00	5,055,859.40	
	US T 2.75% 10/07/31	6,000,000.00	6,154,687.50	
	US T 2.75% 13/02/28	2,700,000.00	2,820,234.37	
	US T 2.75% 13/10/31	5,500,000.00	5,735,898.46	
	US T 2.75% 19/02/15	8,000,000.00	7,877,500.00	
	US T 2.875% 10/06/30	6,000,000.00	6,154,218.78	
	US T 2.875% 13/01/31	3,000,000.00	3,147,656.25	
	US T 3.125% 13/04/30	3,500,000.00	3,711,093.75	
	US T 3.125% 13/08/31	4,500,000.00	4,767,890.62	
	US T 3.125% 13/09/30	5,500,000.00	5,829,570.34	
	US T 3.375% 12/11/30	2,000,000.00	2,134,375.00	
	US T 3.375% 13/06/30	4,000,000.00	4,283,125.00	
	US T 3.375% 13/07/31	4,000,000.00	4,277,500.00	
	US T 3.5% 10/02/15	2,700,000.00	2,765,812.50	

	US T 3.5% 13/05/31	4,000,000.00	4,297,500.00	
	US T 3.5% 18/02/15	6,500,000.00	6,856,484.37	
	US T 3.5% 39/02/15	5,000,000.00	4,855,468.75	
	US T 3.625 12/12/31	2,500,000.00	2,690,039.07	
	US T 3.625% 10/06/15	2,700,000.00	2,793,023.45	
	US T 3.625% 13/05/15	3,650,000.00	3,942,000.00	
	US T 3.75% 18/11/15	11,000,000.00	11,759,687.50	
	US T 3.875 10/09/15	2,300,000.00	2,402,421.87	
	US T 3.875% 10/05/15	3,300,000.00	3,414,984.37	
	US T 3.875% 10/07/15	2,000,000.00	2,080,312.50	
	US T 3.875% 12/10/31	3,000,000.00	3,241,640.64	
	US T 3.875% 13/02/15	3,800,000.00	4,131,312.50	
	US T 3.875% 18/05/15	5,000,000.00	5,414,843.75	
	US T 4% 10/03/15	2,600,000.00	2,680,031.25	
	US T 4% 12/11/15	3,000,000.00	3,260,859.39	
	US T 4% 14/02/15	5,000,000.00	5,514,843.75	
	US T 4% 18/08/15	6,000,000.00	6,580,312.50	
	US T 4% 2010/04/15	3,000,000.00	3,101,484.39	
	US T 4% 2015/02/15	6,700,000.00	7,403,500.00	
	US T 4.125 15/05/15	6,200,000.00	6,896,046.90	
	US T 4.125% 10/08/15	2,000,000.00	2,091,875.00	
	US T 4.125% 12/08/31	2,500,000.00	2,716,406.25	
	US T 4.25% 10/10/15	3,000,000.00	3,157,968.75	
	US T 4.25% 11/01/15	2,000,000.00	2,120,156.26	
	US T 4.25% 12/09/30	3,000,000.00	3,281,250.00	
	US T 4.25% 13/08/15	6,000,000.00	6,653,437.50	
	US T 4.25% 13/11/15	5,400,000.00	5,988,515.65	
	US T 4.25% 14/08/15	4,400,000.00	4,929,375.00	
	US T 4.25% 14/11/15	4,100,000.00	4,605,453.12	
	US T 4.25% 15/08/15	6,100,000.00	6,839,625.00	
	US T 4.25% 17/11/15	4,000,000.00	4,459,375.00	
	US T 4.375% 10/12/15	2,000,000.00	2,116,406.26	
	US T 4.375% 12/08/15	3,700,000.00	4,057,281.25	
	US T 4.375% 38/02/15	3,200,000.00	3,529,500.00	
	US T 4.5 11/09/30	3,000,000.00	3,243,750.00	
	US T 4.5 15/11/15	4,800,000.00	5,497,500.00	
	US T 4.5% 10/11/15	2,600,000.00	2,751,734.38	
	US T 4.5% 100515	2,000,000.00	2,082,500.00	
	US T 4.5% 11/02/28	2,800,000.00	2,986,156.26	
	US T 4.5% 11/11/30	2,300,000.00	2,496,398.44	
	US T 4.5% 12/03/31	3,500,000.00	3,819,921.87	
	US T 4.5% 12/04/30	3,000,000.00	3,281,015.64	
	US T 4.5% 160215	4,400,000.00	4,991,250.00	
	US T 4.5% 17/05/15	4,000,000.00	4,528,750.00	
	US T 4.5% 36/02/15	4,500,000.00	5,116,640.62	
	US T 4.5% 38/05/15	3,500,000.00	4,023,906.25	

	US T 4.625% 11/08/31	3,600,000.00	3,900,093.76	
	US T 4.625% 11/10/31	2,800,000.00	3,045,000.00	
	US T 4.625% 11/12/31	2,500,000.00	2,730,468.75	
	US T 4.625% 12/02/29	2,500,000.00	2,736,523.45	
	US T 4.625% 12/07/31	3,000,000.00	3,304,453.14	
	US T 4.625% 16/11/15	4,200,000.00	4,801,781.25	
	US T 4.625% 17/02/15	4,000,000.00	4,569,375.00	
	US T 4.75% 10/02/15	3,000,000.00	3,104,296.89	
	US T 4.75% 11/03/31	3,000,000.00	3,224,765.64	
	US T 4.75% 12/01/31	3,000,000.00	3,293,671.89	
	US T 4.75% 12/05/31	3,500,000.00	3,856,015.62	
	US T 4.75% 14/05/15	4,900,000.00	5,583,703.12	
	US T 4.75% 17/08/15	4,000,000.00	4,600,625.00	
	US T 4.75% 37/02/15	3,000,000.00	3,549,843.75	
	US T 4.875% 11/04/30	3,000,000.00	3,238,125.00	
	US T 4.875% 11/05/31	3,000,000.00	3,247,734.39	
	US T 4.875% 11/07/31	3,000,000.00	3,263,906.25	
	US T 4.875% 12/02/15	4,820,000.00	5,311,790.62	
	US T 4.875% 12/06/30	3,500,000.00	3,875,429.70	
	US T 4.875% 16/08/15	3,900,000.00	4,523,390.62	
	US T 5% 11/02/15	4,300,000.00	4,625,187.50	
	US T 5% 11/08/15	4,900,000.00	5,357,078.12	
	US T 5% 37/05/15	3,000,000.00	3,630,468.75	
	US T 5.125% 11/06/30	2,800,000.00	3,055,062.50	
	US T 5.125% 16/05/15	4,700,000.00	5,520,296.87	
	US T 5.25% 28/11/15	2,000,000.00	2,379,687.50	
	US T 5.25% 29/02/15	2,000,000.00	2,386,875.00	
	US T 5.375% 31/02/15	3,020,000.00	3,747,631.25	
	US T 5.5% 28/08/15	2,000,000.00	2,444,062.50	
	US T 5.75% 10/08/15	3,180,000.00	3,395,146.87	
	US T 6% 26/02/15	2,000,000.00	2,554,687.50	
	US T 6.125% 27/11/15	4,000,000.00	5,201,250.00	
	US T 6.125% 29/08/15	2,420,000.00	3,195,156.25	
	US T 6.25% 23/08/15	3,500,000.00	4,471,250.00	
	US T 6.25% 30/05/15	3,000,000.00	4,039,921.89	
	US T 6.375% 27/08/15	1,000,000.00	1,333,281.25	
	US T 6.5% 10/02/15	3,300,000.00	3,463,710.95	
	US T 6.5% 26/11/15	2,000,000.00	2,690,937.50	
	US T 6.625% 27/02/15	2,000,000.00	2,725,937.50	
	US T 6.75% 26/08/15	1,000,000.00	1,378,593.75	
	US T 6.875% 25/08/15	2,000,000.00	2,782,500.00	
	US T 7.125% 23/02/15	2,400,000.00	3,281,250.00	
	US T 7.25% 16/05/15	3,000,000.00	3,886,406.25	
	US T 7.25% 22/08/15	1,500,000.00	2,059,687.50	
	US T 7.5% 16/11/15	3,400,000.00	4,485,343.75	
	US T 7.5% 24/11/15	2,000,000.00	2,920,937.50	

	US T 7.625% 22/11/15	1,000,000.00	1,418,906.25	
	US T 7.625% 25/02/15	2,000,000.00	2,963,125.00	
	US T 7.875% 21/02/15	2,000,000.00	2,835,000.00	
	US T 8% 21/11/15	4,800,000.00	6,924,000.00	
	US T 8.125% 19/08/15	3,300,000.00	4,725,703.12	
	US T 8.125% 21/05/15	2,000,000.00	2,893,125.00	
	US T 8.125% 21/08/15	1,000,000.00	1,450,000.00	
	US T 8.75% 17/05/15	3,000,000.00	4,255,781.25	
	US T 8.75% 20/08/15	3,000,000.00	4,481,250.00	
	US T 8.75% 2020/05/15	1,000,000.00	1,492,187.50	
	US T 8.875% 17/08/15	2,000,000.00	2,869,062.50	
	US T 8.875% 190215	2,100,000.00	3,125,390.62	
	US T 9.0% 18/11/15	1,000,000.00	1,488,906.25	
	US T 9.125% 18/05/15	1,000,000.00	1,487,343.75	
	US T-BOND 8.5% 20/02/15	2,000,000.00	2,928,125.00	
	米ドル 小計	541,990,000.00	599,981,491.40	
	(邦貨換算額)		(60,214,142,476)	(単位：円)
	カナダドル			
	CAN 1.25% 11/06/01	2,000,000.00	2,005,400.00	
	CAN 2.75% 10/12/01	2,000,000.00	2,058,000.00	
	CAN 3% 14/06/01	2,000,000.00	2,110,000.00	
	CAN 3.5% 13/06/01	3,500,000.00	3,746,505.00	
	CAN 3.75% 10/06/01	1,000,000.00	1,034,150.00	
	CAN 3.75% 11/09/01	2,000,000.00	2,117,680.00	
	CAN 3.75% 12/06/01	2,000,000.00	2,141,460.00	
	CAN 3.75% 19/06/01	2,000,000.00	2,140,400.00	
	CAN 4% 10/09/01	1,600,000.00	1,669,584.00	
	CAN 4% 16/06/01	2,000,000.00	2,215,800.00	
	CAN 4% 17/06/01	2,000,000.00	2,206,380.00	
	CAN 4.25% 18/06/01	2,500,000.00	2,795,000.00	
	CAN 4.5% 15/06/01	2,000,000.00	2,275,500.00	
	CAN 5% 14/06/01	2,500,000.00	2,880,675.00	
	CAN 5% 37/06/01	3,000,000.00	3,709,500.00	
	CAN 5.25% 12/06/01	1,620,000.00	1,808,276.40	
	CAN 5.25% 13/06/01	2,000,000.00	2,279,420.00	
	CAN 5.5% 10/06/01	1,000,000.00	1,053,840.00	
	CAN 5.75% 29/06/01	2,800,000.00	3,602,956.00	
	CAN 5.75% 33/06/01	3,000,000.00	3,964,200.00	
	CAN 6% 11/06/01	1,600,000.00	1,763,696.00	
	CAN 8% 23/06/01	980,000.00	1,476,967.80	
	CAN 8% 27/06/01	1,000,000.00	1,563,490.00	
	CAN 9% 25/06/01	1,480,000.00	2,452,271.20	
	カナダドル 小計	47,580,000.00	55,071,151.40	
	(邦貨換算額)		(4,503,718,761)	(単位：円)

	ユーロ			
	BGB 3% 10/03/28	1,500,000.00	1,525,500.00	
	BGB 3.25% 16/09/28	2,500,000.00	2,423,500.00	
	BGB 3.5% 11/03/28	2,500,000.00	2,575,750.00	
	BGB 3.75% 15/09/28	2,300,000.00	2,316,560.00	
	BGB 4% 13/03/28	1,800,000.00	1,873,080.00	
	BGB 4% 14/03/28	2,200,000.00	2,273,040.00	
	BGB 4% 17/03/28	2,500,000.00	2,538,500.00	
	BGB 4% 18/03/28	1,500,000.00	1,506,900.00	
	BGB 4% 19/03/28	1,000,000.00	996,100.00	
	BGB 4% 2022/03/28	2,000,000.00	1,943,000.00	
	BGB 4.25% 13/09/28	3,000,000.00	3,145,800.00	
	BGB 4.25% 14/09/28	2,500,000.00	2,613,500.00	
	BGB 5% 11/09/28	2,200,000.00	2,346,960.00	
	BGB 5% 12/09/28	1,700,000.00	1,832,430.00	
	BGB 5% 35/03/28	3,000,000.00	3,142,500.00	
	BGB 5.5% 17/09/28	1,740,000.00	1,942,188.00	
	BGB 5.5% 28/03/28	3,000,000.00	3,333,000.00	
	BGB 5.75% 10/09/28	3,000,000.00	3,176,100.00	
	BGB 8% 12/12/24	1,600,000.00	1,884,960.00	
	BGB 8% 15/03/28	1,000,000.00	1,242,000.00	
	BKO 4.75% 10/06/11	3,000,000.00	3,123,000.00	
	BTAN 2.5% 10/07/12	3,600,000.00	3,649,320.00	
	BTNS 2.5% 14/01/12	2,500,000.00	2,460,250.00	
	BTNS 3.0% 11/01/12	4,500,000.00	4,603,500.00	
	BTNS 3.5% 11/07/12	4,200,000.00	4,363,380.00	
	BTNS 3.75% 10/09/12	2,500,000.00	2,583,750.00	
	BTNS 3.75% 12/01/12	3,000,000.00	3,141,300.00	
	BTNS 3.75% 13/01/12	4,000,000.00	4,171,200.00	
	BTNS 4.5% 12/07/12	2,500,000.00	2,672,250.00	
	BTNS 4.5% 13/07/12	2,500,000.00	2,688,250.00	
	BTPS 2.75% 10/06/15	3,500,000.00	3,550,925.00	
	BTPS 3% 12/03/01	1,500,000.00	1,518,150.00	
	BTPS 3.5% 11/03/15	3,000,000.00	3,088,500.00	
	BTPS 3.75% 11/02/01	4,000,000.00	4,125,960.00	
	BTPS 3.75% 11/09/15	3,500,000.00	3,619,350.00	
	BTPS 3.75% 13/12/15	2,000,000.00	2,038,000.00	
	BTPS 3.75% 15/08/01	5,200,000.00	5,279,560.00	
	BTPS 3.75% 16/08/01	5,000,000.00	5,028,000.00	
	BTPS 3.75% 21/08/01	4,300,000.00	3,970,620.00	
	BTPS 4% 12/04/15	3,500,000.00	3,640,700.00	
	BTPS 4% 17/02/01	5,000,000.00	5,075,000.00	
	BTPS 4% 37/02/01	4,500,000.00	3,748,050.00	
	BTPS 4.25 12/10/15	3,500,000.00	3,663,100.00	
	BTPS 4.25 13/08/01	5,310,000.00	5,548,950.00	
	BTPS 4.25 19/02/01	4,400,000.00	4,406,600.00	

	BTPS 4.25% 11/09/01	3,500,000.00	3,659,250.00	
	BTPS 4.25% 13/04/15	3,500,000.00	3,652,950.00	
	BTPS 4.25% 14/08/01	4,900,000.00	5,108,250.00	
	BTPS 4.25% 15/02/01	4,000,000.00	4,164,400.00	
	BTPS 4.5% 10/08/01	3,200,000.00	3,318,336.00	
	BTPS 4.5% 18/02/01	4,000,000.00	4,141,600.00	
	BTPS 4.5% 18/08/01	4,000,000.00	4,086,400.00	
	BTPS 4.5% 19/03/01	4,000,000.00	4,032,800.00	
	BTPS 4.5% 20/02/01	4,500,000.00	4,513,500.00	
	BTPS 4.75% 13/02/01	4,300,000.00	4,579,070.00	
	BTPS 4.75% 23/08/01	2,000,000.00	1,975,000.00	
	BTPS 5% 12/02/01	5,900,000.00	6,304,150.00	
	BTPS 5% 34/08/01	3,970,000.00	3,838,990.00	
	BTPS 5% 39/08/01	3,000,000.00	2,876,400.00	
	BTPS 5.25 17/08/01	4,000,000.00	4,383,600.00	
	BTPS 5.25% 11/08/01	4,000,000.00	4,265,200.00	
	BTPS 5.25% 29/11/01	5,200,000.00	5,214,040.00	
	BTPS 5.5% 10/11/01	4,700,000.00	4,963,529.00	
	BTPS 5.75% 33/02/01	2,700,000.00	2,822,850.00	
	BTPS 6% 31/05/01	5,900,000.00	6,324,800.00	
	BTPS 6.5% 27/11/01	4,960,000.00	5,677,712.00	
	BTPS 7.25% 26/11/01	2,000,000.00	2,483,200.00	
	BTPS 9.00% 23/11/01	2,000,000.00	2,845,000.00	
	BUNDESUBL 3.25% 10/04/09	3,000,000.00	3,067,800.00	
	BUNDESSCHATZ 1.25%110311	2,000,000.00	1,993,200.00	
	BUNDESSCHATZ 2.25%101210	3,000,000.00	3,042,600.00	
	BUNDESSCHATZANW 4%100910	3,000,000.00	3,112,950.00	
	DBR 3.25% 15/07/04	4,500,000.00	4,619,475.00	
	DBR 3.5% 160104	4,700,000.00	4,872,255.00	
	DBR 3.75% 13/07/04	4,800,000.00	5,070,720.00	
	DBR 3.75% 15/01/04	5,000,000.00	5,282,500.00	
	DBR 3.75% 17/01/04	4,000,000.00	4,183,200.00	
	DBR 3.75% 19/01/04	5,000,000.00	5,203,000.00	
	DBR 4% 18/01/04	4,000,000.00	4,254,400.00	
	DBR 4% 37/01/04	4,200,000.00	4,103,400.00	
	DBR 4.00% 16/07/04	4,900,000.00	5,209,680.00	
	DBR 4.25% 14/01/04	4,700,000.00	5,073,180.00	
	DBR 4.25% 14/07/04	5,000,000.00	5,417,500.00	
	DBR 4.25% 17/07/04	4,000,000.00	4,318,800.00	
	DBR 4.25% 18/07/04	4,200,000.00	4,550,280.00	
	DBR 4.25% 39/07/04	2,500,000.00	2,573,750.00	
	DBR 4.5% 13/01/04	4,700,000.00	5,079,760.00	
	DBR 4.75% 28/07/04	2,000,000.00	2,140,600.00	
	DBR 4.75% 34/07/04	4,100,000.00	4,392,330.00	
	DBR 4.75% 40/07/04	1,000,000.00	1,113,200.00	
	DBR 5% 11/07/04	4,900,000.00	5,264,315.00	

	DBR 5% 12/01/04	5,000,000.00	5,426,500.00	
	DBR 5% 12/07/04	5,220,000.00	5,699,196.00	
	DBR 5.25% 10/07/04	4,000,000.00	4,192,000.00	
	DBR 5.25% 11/01/04	4,600,000.00	4,899,460.00	
	DBR 5.5% 31/01/04	3,300,000.00	3,833,610.00	
	DBR 5.625% 28/01/04	2,980,000.00	3,494,050.00	
	DBR 6% 16/06/20	890,000.00	1,047,975.00	
	DBR 6.25% 24/01/04	1,700,000.00	2,125,340.00	
	DBR 6.25% 300104	2,200,000.00	2,763,200.00	
	DBR 6.5% 27/07/04	2,000,000.00	2,562,000.00	
	FINNISH GO 3.875% 170915	1,000,000.00	1,010,000.00	
	FRANCE 3.75% 17/04/25	4,000,000.00	4,060,000.00	
	FRANCE O.A.T.3.5% 150425	3,600,000.00	3,686,400.00	
	FRANCE O.A.T.5% 12/04/25	3,200,000.00	3,464,320.00	
	FRANCE OAT4% 141025	3,000,000.00	3,156,600.00	
	FRTR 3.0% 15/10/25	5,000,000.00	4,952,500.00	
	FRTR 3.25% 16/04/25	3,700,000.00	3,689,640.00	
	FRTR 3.75% 21/04/25	4,200,000.00	4,100,880.00	
	FRTR 4% 13/04/25	3,700,000.00	3,896,470.00	
	FRTR 4% 13/10/25	4,060,000.00	4,275,586.00	
	FRTR 4% 14/04/25	4,300,000.00	4,531,770.00	
	FRTR 4% 18/04/25	4,000,000.00	4,100,800.00	
	FRTR 4% 38/10/25	4,500,000.00	4,259,700.00	
	FRTR 4% 55/04/25	3,170,000.00	2,969,656.00	
	FRTR 4.25% 17/10/25	3,500,000.00	3,663,100.00	
	FRTR 4.25% 18/10/25	4,000,000.00	4,169,200.00	
	FRTR 4.25% 19/04/25	3,900,000.00	4,055,220.00	
	FRTR 4.25% 23/10/25	3,000,000.00	3,022,200.00	
	FRTR 4.75% 12/10/25	3,800,000.00	4,097,920.00	
	FRTR 4.75% 35/04/25	3,600,000.00	3,804,120.00	
	FRTR 5% 11/10/25	3,000,000.00	3,228,900.00	
	FRTR 5% 16/10/25	4,200,000.00	4,632,600.00	
	FRTR 5.5% 10/04/25	3,200,000.00	3,340,800.00	
	FRTR 5.5% 10/10/25	3,270,000.00	3,463,911.00	
	FRTR 5.5% 29/04/25	3,000,000.00	3,433,200.00	
	FRTR 5.75% 32/10/25	3,700,000.00	4,414,100.00	
	FRTR 6.00% 25/10/25	1,500,000.00	1,809,450.00	
	FRTR 6.5% 11/04/25	4,000,000.00	4,380,400.00	
	FRTR 8.5% 12/12/26	1,000,000.00	1,210,400.00	
	FRTR 8.5% 19/10/25	1,550,000.00	2,166,900.00	
	FRTR 8.5% 23/04/25	2,200,000.00	3,218,380.00	
	GGB 3.1% 10/04/20	1,500,000.00	1,488,300.00	
	GGB 3.6% 16/07/20	1,000,000.00	917,800.00	
	GGB 3.7% 15/07/20	2,000,000.00	1,880,400.00	
	GGB 4% 13/08/20	1,000,000.00	982,600.00	
	GGB 4.3% 17/07/20	2,000,000.00	1,859,400.00	

	GGB 4.5% 14/05/20	2,000,000.00	1,980,000.00	
	GGB 4.5% 37/09/20	2,050,000.00	1,647,995.00	
	GGB 4.6% 13/05/20	2,000,000.00	2,025,800.00	
	GGB 4.7% 24/03/20	2,200,000.00	1,926,320.00	
	GGB 5.25% 12/05/18	2,800,000.00	2,920,400.00	
	GGB 5.5% 14/08/20	1,500,000.00	1,550,925.00	
	GGB 5.9% 22/10/22	1,730,000.00	1,778,094.00	
	GGB 6.5% 14/01/11	1,300,000.00	1,391,000.00	
	GGB 6.5% 19/10/22	1,540,000.00	1,658,118.00	
	HELLENIC REP 3.8%110320	2,000,000.00	2,029,200.00	
	HELLENIC REP 3.9% 110820	1,500,000.00	1,519,350.00	
	HELLENIC REP 4.1% 120820	1,500,000.00	1,499,550.00	
	HELLENIC REP 4.6% 180720	2,000,000.00	1,876,200.00	
	HELLENIC REP 4.6% 400920	1,000,000.00	799,700.00	
	HELLENIC REP 5.35%110518	1,600,000.00	1,648,000.00	
	HELLENIC REP 6% 10/5/19	1,700,000.00	1,735,700.00	
	HELLENIC REP 6%190719	1,500,000.00	1,527,000.00	
	IRISH 4% 11/11/11	1,000,000.00	1,024,000.00	
	IRISH 4% 14/01/15	1,500,000.00	1,470,000.00	
	IRISH 4.4% 19/06/18	1,500,000.00	1,377,750.00	
	IRISH 4.5% 18/10/18	1,000,000.00	953,000.00	
	IRISH 4.5% 20/04/18	1,490,000.00	1,348,599.00	
	IRISH 4.6% 16/04/18	1,800,000.00	1,768,680.00	
	IRISH 5% 13/04/18	1,000,000.00	1,027,500.00	
	NETHERLANDS 2.5% 120115	1,000,000.00	1,011,000.00	
	NETHERLANDS 3.25% 150715	2,100,000.00	2,108,400.00	
	NETHERLANDS 3.75% 140715	2,400,000.00	2,490,240.00	
	NETHERLANDS 3.75% 230115	2,000,000.00	1,914,400.00	
	NETHERLANDS 4% 11/01/15	2,500,000.00	2,602,500.00	
	NETHERLANDS 4% 16/07/15	2,300,000.00	2,376,590.00	
	NETHERLANDS 4% 18/07/15	2,500,000.00	2,539,000.00	
	NETHERLANDS 4% 19/07/15	1,500,000.00	1,511,400.00	
	NETHERLANDS 4.25% 130715	2,400,000.00	2,546,400.00	
	NETHERLANDS 4.5% 170715	2,600,000.00	2,752,880.00	
	NETHERLANDS 5% 12/07/15	3,000,000.00	3,242,700.00	
	NETHERLANDS 5.5% 100715	1,100,000.00	1,154,450.00	
	NETHERLANDS 5.5% 280115	2,000,000.00	2,286,000.00	
	NETHERLANDS 7.5% 230115	1,000,000.00	1,343,000.00	
	NETHERLANDS GOVT4%370115	2,000,000.00	1,917,000.00	
	NETHERLANDS GOVT5%110715	3,000,000.00	3,208,500.00	
	OBL 2.25% 14/04/11	1,500,000.00	1,487,850.00	
	OBL 2.5% 10/10/08	3,000,000.00	3,050,400.00	
	OBL 3.5% 11/04/08	3,500,000.00	3,633,350.00	
	OBL 3.5% 11/10/14	3,500,000.00	3,661,700.00	
	OBL 3.5% 13/04/12	3,500,000.00	3,663,625.00	
	OBL 4% 12/04/13	3,000,000.00	3,187,200.00	

	OBL 4% 13/10/11	3,000,000.00	3,202,200.00	
	OBL 4.25% 12/10/12	3,000,000.00	3,219,300.00	
	PGB 3.2% 11/04/15	1,000,000.00	1,017,800.00	
	PGB 3.35% 15/10/15	1,000,000.00	970,000.00	
	PGB 3.85% 21/04/15	1,000,000.00	926,600.00	
	PGB 4.10% 37/04/15	1,000,000.00	894,000.00	
	PGB 4.2% 16/10/15	1,000,000.00	1,009,500.00	
	PGB 4.35% 17/10/16	1,400,000.00	1,404,900.00	
	PGB 4.375% 14/06/16	1,000,000.00	1,033,800.00	
	PGB 4.45% 18/06/15	1,000,000.00	1,000,600.00	
	PGB 4.75% 19/06/14	1,000,000.00	1,007,000.00	
	PGB 4.95% 23/10/25	1,000,000.00	1,011,800.00	
	PGB 5% 12/06/15	1,500,000.00	1,595,100.00	
	PGB 5.15% 11/06/15	1,000,000.00	1,057,500.00	
	PGB 5.45% 13/09/23	2,000,000.00	2,164,400.00	
	PGB 5.85% 10/05/20	1,500,000.00	1,567,650.00	
	RAGB 3.4% 14/10/20	1,000,000.00	1,009,200.00	
	RAGB 3.5% 15/07/15	1,200,000.00	1,200,000.00	
	RAGB 3.5% 21/09/15	2,000,000.00	1,847,000.00	
	RAGB 3.8% 13/10/20	2,000,000.00	2,053,000.00	
	RAGB 3.9% 20/07/15	2,500,000.00	2,425,000.00	
	RAGB 4% 16/09/15	2,000,000.00	2,051,000.00	
	RAGB 4.15% 37/03/15	1,000,000.00	896,500.00	
	RAGB 4.3% 14/07/15	2,400,000.00	2,504,400.00	
	RAGB 4.3% 17/09/15	1,500,000.00	1,529,250.00	
	RAGB 4.35% 19/03/15	1,200,000.00	1,206,600.00	
	RAGB 4.65% 18/01/15	2,000,000.00	2,085,000.00	
	RAGB 5% 12/07/15	2,000,000.00	2,138,000.00	
	RAGB 5.25% 11/01/04	2,000,000.00	2,113,000.00	
	RAGB 6.25% 27/07/15	1,000,000.00	1,166,700.00	
	RFGB 2.75% 10/09/15	1,000,000.00	1,017,000.00	
	RFGB 3.125% 14/09/15	1,500,000.00	1,500,450.00	
	RFGB 4.25% 12/09/15	1,000,000.00	1,059,800.00	
	RFGB 4.25% 15/07/04	1,300,000.00	1,366,820.00	
	RFGB 4.375% 19/07/04	1,000,000.00	1,036,000.00	
	RFGB 5.375% 13/07/04	1,500,000.00	1,650,150.00	
	RFGB 5.75% 11/02/23	1,000,000.00	1,076,400.00	
	SPGB 2.75% 12/04/30	1,000,000.00	1,011,100.00	
	SPGB 3.15% 16/01/31	2,800,000.00	2,708,440.00	
	SPGB 3.25% 10/07/30	3,500,000.00	3,579,800.00	
	SPGB 3.8% 17/01/31	2,000,000.00	1,990,000.00	
	SPGB 3.9% 12/10/31	2,000,000.00	2,077,000.00	
	SPGB 4.1% 11/04/30	3,500,000.00	3,644,550.00	
	SPGB 4.1% 18/07/30	3,000,000.00	3,023,700.00	
	SPGB 4.2% 13/07/30	2,500,000.00	2,609,500.00	
	SPGB 4.2% 37/01/31	2,250,000.00	2,059,425.00	

	SPGB 4.25% 14/01/31	1,500,000.00	1,576,050.00	
	SPGB 4.4% 15/01/31	2,800,000.00	2,898,000.00	
	SPGB 4.6% 19/07/30	1,500,000.00	1,545,750.00	
	SPGB 4.75% 14/07/30	2,500,000.00	2,683,000.00	
	SPGB 4.8% 24/01/31	1,000,000.00	1,020,000.00	
	SPGB 4.9% 40/07/30	3,000,000.00	3,103,500.00	
	SPGB 5% 12/07/30	3,100,000.00	3,334,980.00	
	SPGB 5.35% 11/10/31	2,600,000.00	2,805,400.00	
	SPGB 5.4% 11/07/30	3,500,000.00	3,761,450.00	
	SPGB 5.5% 17/07/30	3,280,000.00	3,658,184.00	
	SPGB 5.75% 32/07/30	2,700,000.00	3,039,390.00	
	SPGB 6% 29/01/31	2,900,000.00	3,331,810.00	
	SPGB 6.15% 13/01/31	2,600,000.00	2,914,340.00	
	ユーロ 小計	656,360,000.00	685,556,164.00	
	(邦貨換算額)		(90,411,146,908)	(単位：円)
	英ポンド			
	UKT 2.25% 14/03/07	1,000,000.00	977,340.00	
	UKT 3.25% 11/12/07	3,400,000.00	3,515,804.00	
	UKT 4% 16/09/07	4,800,000.00	5,176,800.00	
	UKT 4% 22/03/07	1,000,000.00	1,024,200.00	
	UKT 4.25 110307	4,400,000.00	4,640,152.00	
	UKT 4.25% 27/12/07	3,800,000.00	3,825,878.00	
	UKT 4.25% 32/06/07	4,300,000.00	4,296,775.00	
	UKT 4.25% 36/03/07	3,800,000.00	3,711,270.00	
	UKT 4.25% 46/12/07	3,900,000.00	3,791,775.00	
	UKT 4.25% 49/12/07	2,500,000.00	2,421,725.00	
	UKT 4.25% 55/12/07	4,000,000.00	3,849,200.00	
	UKT 4.5% 13/03/07	4,700,000.00	5,052,500.00	
	UKT 4.5% 19/03/07	3,200,000.00	3,515,200.00	
	UKT 4.5% 42/12/07	3,500,000.00	3,525,550.00	
	UKT 4.75% 10/06/07	3,800,000.00	3,963,400.00	
	UKT 4.75% 15/09/07	4,400,000.00	4,919,200.00	
	UKT 4.75% 20/03/07	3,200,000.00	3,568,000.00	
	UKT 4.75% 30/12/07	3,800,000.00	4,048,520.00	
	UKT 4.75% 38/12/07	4,500,000.00	4,803,345.00	
	UKT 5% 12/03/07	5,560,000.00	5,996,460.00	
	UKT 5% 14/09/07	3,500,000.00	3,942,750.00	
	UKT 5% 18/03/07	4,200,000.00	4,809,042.00	
	UKT 5% 25/03/07	4,400,000.00	4,844,400.00	
	UKT 5.25% 12/06/07	3,500,000.00	3,813,705.00	
	UKT 6.0% 281207	3,000,000.00	3,745,500.00	
	UKT 6.25% 10/11/25	1,280,000.00	1,384,832.00	
	UKT 8% 13/09/27	1,500,000.00	1,838,325.00	
	UKT 8% 15/12/07	1,900,000.00	2,505,340.00	
	UKT 8% 21/06/07	4,620,000.00	6,675,900.00	

	UKT 8.75% 17/08/25	2,300,000.00	3,266,000.00	
	UKT 9% 11/07/12	1,600,000.00	1,856,000.00	
	英ポンド 小計	105,360,000.00	115,304,888.00	
	（邦貨換算額）		(16,925,604,509)	（単位：円）
	スイスフラン			
	SWITZERLAND 2.5% 160312	2,000,000.00	2,084,400.00	
	SWITZERLAND 2.75%120610	2,500,000.00	2,644,500.00	
	SWITZERLAND 3% 180108	1,000,000.00	1,072,700.00	
	SWITZERLAND 3% 19/05/12	1,000,000.00	1,065,000.00	
	SWITZERLAND 3.5% 10/8/7	1,000,000.00	1,039,500.00	
	SWITZERLAND 4% 11/06/10	2,000,000.00	2,145,600.00	
	SWITZERLAND 4% 13/02/11	1,000,000.00	1,106,800.00	
	SWITZERLAND 4% 280408	900,000.00	1,059,750.00	
	SWITZERLAND 4%230211	1,000,000.00	1,165,000.00	
	SWITZERLAND 4.25% 140106	800,000.00	903,840.00	
	SWITZERLAND 4.25% 170605	1,000,000.00	1,165,800.00	
	スイスフラン 小計	14,200,000.00	15,452,890.00	
	（邦貨換算額）		(1,338,374,802)	（単位：円）
	スウェーデンクローナ			
	SGB 3% 16/07/12	7,000,000.00	7,042,000.00	
	SGB 3.5% 39/03/30	10,000,000.00	9,168,300.00	
	SGB 3.75% 17/08/12	13,200,000.00	13,860,000.00	
	SGB 4.25% 19/03/12	10,000,000.00	10,786,800.00	
	SGB 4.5% 15/08/12	6,000,000.00	6,614,400.00	
	SGB 5% 20/12/01	10,000,000.00	11,446,000.00	
	SGB 5.25% 110315	11,640,000.00	12,547,920.00	
	SGB 5.5% 12/10/08	11,000,000.00	12,302,400.00	
	SGB 6.75% 14/05/05	12,100,000.00	14,499,430.00	
	スウェーデンクローナ 小計	90,940,000.00	98,267,250.00	
	（邦貨換算額）		(1,191,981,742)	（単位：円）
	ノルウェークローネ			
	NORWAY GOV 4.25% 170519	6,000,000.00	6,181,800.00	
	NORWAY GOV 5% 150515	5,000,000.00	5,417,500.00	
	NORWAY GOV 6% 110516	8,000,000.00	8,625,600.00	
	NORWAY GOV 6.5% 130515	11,000,000.00	12,509,200.00	
	ノルウェークローネ 小計	30,000,000.00	32,734,100.00	
	（邦貨換算額）		(493,302,887)	（単位：円）
	デンマーククローネ			
	DGB 4% 10/11/15	11,000,000.00	11,338,800.00	
	DGB 4% 15/11/15	11,000,000.00	11,377,300.00	
	DGB 4% 17/11/15	10,000,000.00	10,298,000.00	
	DGB 4.5% 39/11/15	18,000,000.00	18,570,600.00	

	DGB 5% 13/11/15	11,820,000.00	12,779,784.00	
	DGB 6% 11/11/15	13,000,000.00	14,211,600.00	
	DGB 7% 24/11/10	5,080,000.00	6,592,824.00	
	デンマーククローネ 小計	79,900,000.00	85,168,908.00	
	(邦貨換算額)		(1,507,489,671)	(単位：円)
	ポーランドズロチ			
	POLGB 4.25% 11/05/24	5,000,000.00	4,892,500.00	
	POLGB 4.75% 12/04/25	7,000,000.00	6,858,600.00	
	POLGB 5.00% 13/10/24	4,500,000.00	4,326,750.00	
	POLGB 5.25% 13/04/25	5,000,000.00	4,875,000.00	
	POLGB 5.25% 17/10/25	5,000,000.00	4,761,500.00	
	POLGB 5.5% 19/10/25	3,000,000.00	2,868,000.00	
	POLGB 5.75% 22/09/23	5,200,000.00	4,979,000.00	
	POLGB 6.0% 10/11/24	6,000,000.00	6,030,000.00	
	POLGB 6.25% 15/10/24	4,500,000.00	4,594,500.00	
	ポーランドズロチ 小計	45,200,000.00	44,185,850.00	
	(邦貨換算額)		(1,348,110,283)	(単位：円)
	オーストラリアドル			
	ACGB 5.25% 10/08/15	1,800,000.00	1,855,787.40	
	ACGB 5.25% 19/03/15	1,000,000.00	1,052,544.00	
	ACGB 5.75% 11/06/15	1,000,000.00	1,051,055.00	
	ACGB 5.75% 12/04/15	1,000,000.00	1,057,000.00	
	ACGB 6% 17/02/15	1,300,000.00	1,436,783.40	
	ACGB 6.25% 15/04/15	1,000,000.00	1,103,796.00	
	ACGB 6.5% 13/05/15	2,540,000.00	2,787,335.04	
	オーストラリアドル 小計	9,640,000.00	10,344,300.84	
	(邦貨換算額)		(749,548,038)	(単位：円)
	シンガポールドル			
	SIGB 2.25% 13/07/01	1,000,000.00	1,049,026.00	
	SIGB 3.25% 20/09/01	1,000,000.00	1,095,188.00	
	SIGB 3.5% 12/07/01	1,000,000.00	1,088,105.00	
	SIGB 3.5% 27/03/01	1,000,000.00	1,078,023.00	
	SIGB 3.625 140701	2,500,000.00	2,787,432.50	
	SIGB 3.625% 11/07/01	1,000,000.00	1,067,667.00	
	SIGB 3.75% 160901	1,000,000.00	1,134,903.00	
	SIGB 4% 18/09/01	1,200,000.00	1,404,309.60	
	SIGB 4.625 100701	1,170,000.00	1,230,677.37	
	シンガポールドル 小計	10,870,000.00	11,935,331.47	
	(邦貨換算額)		(789,760,883)	(単位：円)
	マレーシアリングgit			
	MALAYSIAN 3.502 27/05/31	4,000,000.00	3,558,868.00	
	MALAYSIAN 3.702 13/02/25	3,000,000.00	3,011,937.00	

	MALAYSIAN 3.718 12/06/15	8,000,000.00	8,132,408.00	
	MALAYSIAN 3.814%17/02/15	2,000,000.00	1,948,006.00	
	MALAYSIAN 3.869 10/04/13	7,000,000.00	7,129,549.00	
	MALAYSIAN 4.24 18/02/07	5,000,000.00	5,138,815.00	
	MALAYSIAN 4.262 16/09/15	3,000,000.00	3,091,422.00	
	マレーシアリングット 小計	32,000,000.00	32,011,005.00	
	(邦貨換算額)		(888,945,608)	(単位：円)
	合 計		180,362,126,568	単位：円
	(外貨建有価証券邦貨換算額合計)		(180,362,126,568)	(単位：円)

(注)

1. 合計金額欄の（ ）内は、外貨建有価証券に係るもので、内書きであります。
2. 米ドル表示の債券については、145銘柄、信託財産純資産総額に対する比率32.5%、合計に対する比率33.4%です。
カナダドル表示の債券については、24銘柄、信託財産純資産総額に対する比率2.4%、合計に対する比率2.5%です。
ユーロ表示の債券については、242銘柄、信託財産純資産総額に対する比率48.7%、合計に対する比率50.1%です。
英ポンド表示の債券については、31銘柄、信託財産純資産総額に対する比率9.1%、合計に対する比率9.4%です。
スイスフラン表示の債券については、11銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.7%、合計に対する比率0.7%です。
スウェーデンクローナ表示の債券については、9銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.6%、合計に対する比率0.7%です。
ノルウェークローネ表示の債券については、4銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.3%、合計に対する比率0.3%です。
デンマーククローネ表示の債券については、7銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.8%、合計に対する比率0.8%です。
ポーランドズロチ表示の債券については、9銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.7%、合計に対する比率0.7%です。
オーストラリアドル表示の債券については、7銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.4%、合計に対する比率0.4%です。
シンガポールドル表示の債券については、9銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.4%、合計に対する比率0.4%です。
マレーシアリングット表示の債券については、7銘柄、信託財産純資産総額に対する比率0.5%、合計に対する比率0.5%です。

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）Ⅱ．取引の時価等に関する事項」に同様の内容が記載されている為、省略しております。

「マネーインカム・マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

期 別	第 1 期 (平成21年 4 月13日現在)
科 目	金額(円)
資産の部	
I 流動資産	
コール・ローン	1,040,036
国債証券	20,936,100
未収利息	50,972
前払費用	33,288
流動資産合計	22,060,396
資産合計	22,060,396
負債の部	
I 流動負債	
未払解約金	35,000
流動負債合計	35,000
負債合計	35,000
純資産の部	
I 元本等	
1 元本	
元本	21,902,962
元本合計	21,902,962
2 剰余金	
期末剰余金	122,434
剰余金合計	122,434
元本等合計	22,025,396
純資産合計	22,025,396
負債・純資産合計	22,060,396

(注) 「マネーインカム・マザーファンド」は、毎年4月13日（ただし、休業日の場合は翌営業日）に決算を行います。上記の貸借対照表は平成21年4月13日現在における同マザーファンドの状況です。

（２）注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

項 目	第 1 期 自 平成20年 3 月31日 至 平成21年 4 月13日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券（売買目的有価証券） 個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間の取扱い 当計算期間は、設定日の平成20年 3 月31日から平成21年 4 月13日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

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

(デリバティブ取引に関する注記)

I. 取引の状況に関する事項

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

II. 取引の時価等に関する事項

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益の状況

第 1 期（平成21年 4 月13日現在）

第 1 期末現在、デリバティブ取引は行っておりません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第 1 期（自 平成20年 3 月31日 至 平成21年 4 月13日）

該当事項はありません。

(その他の注記)

第1期 (平成21年4月13日現在)	
本有価証券報告書における開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	20,170,000円
同期中における追加設定元本額	1,839,827円
同期中における一部解約元本額	106,865円
期末における元本の内訳	
スミセイ・DCバランスファンド（機動的資産配分型）	822,236円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2020	17,508円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2025	16,012円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2030	16,012円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2035	15,015円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040	15,015円
スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2045	16,801円
三井住友・ロシア株式オープン	999,001円
SMAM・マネーインカムファンド＜適格機関投資家限定＞	19,985,362円
合 計	21,902,962円

(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211回利付国債（10年）	10,150,000	10,178,927	
	第214回利付国債（10年）	3,550,000	3,573,536	
	第216回利付国債（10年）	3,550,000	3,584,186	
	第219回利付国債（10年）	3,550,000	3,599,451	
	国債証券 小計	20,800,000	20,936,100	
合 計			20,936,100	

独立監査人の監査報告書

平成21年6月11日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あずさ監査法人

指 定 社 員 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20年3月31日から平成21年4月13日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、スミセイ・DCターゲットイヤーファンド2040の平成21年4月13日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

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

[委託会社の監査報告書（前期）へ](#)

[委託会社の監査報告書（当期）へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成21年6月26日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あずさ監査法人

指 定 社 員 公認会計士 鈴木 敏 夫 印
業務執行社員

指 定 社 員 公認会計士 辰 巳 幸 久 印
業務執行社員

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

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

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

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

以 上

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

独立監査人の監査報告書

平成20年 6 月23日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

あずさ監査法人

指 定 社 員 公認会計士 三 浦 孝 昭 印
業務執行社員

指 定 社 員 公認会計士 橋 本 克 己 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三井住友アセットマネジメント株式会社の平成19年4月1日から平成20年3月31日までの第23期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三井住友アセットマネジメント株式会社の平成20年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

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