

資産の運用に関する重要な事項

一時払変額個人年金保険（複数勘定型）

特別勘定名	主たる投資対象となる投資信託
年金原資 最低保証型	SMAM・バランスファンドVA安定型（適格機関投資家専用）

年金原資最低保証型

< SMAM・バランスファンドVA安定型（適格機関投資家専用） >

1 ファンドの沿革

平成15年11月21日 信託契約締結、設定、運用開始。
平成27年6月3日 投資対象マザーファンドに「国内債券マザーファンド（B号）」を追加（予定）

2 ファンドの経理状況

当ファンドは、第11期（平成25年5月16日から平成26年5月15日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

平成26年7月8日

三井住友アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士
業務執行社員

鈴木敏夫

当監査法人は、会社の求めに応じて、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に準ずる監査証明を行うため、SMAM・バランスファンドVA安定型（適格機関投資家専用）の平成25年5月16日から平成26年5月15日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、SMAM・バランスファンドVA安定型（適格機関投資家専用）の平成26年5月15日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

【SMAM・バランスファンドVA安定型（適格機関投資家専用）】

（１）貸借対照表

（単位：円）

	第 10 期 （平成 25 年 5 月 15 日現在）	第 11 期 （平成 26 年 5 月 15 日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,165,260,648	2,469,945,376
国債証券	41,551,395,110	25,031,349,500
地方債証券	2,945,272,979	1,128,766,280
特殊債券	3,809,915,520	3,473,150,240
社債券	5,085,626,000	2,735,500,000
親投資信託受益証券	10,382,147,312	7,145,417,175
未収利息	187,168,609	128,381,348
前払費用	11,596,419	-
その他未収収益	234,167	202,568
流動資産合計	65,138,616,764	42,112,712,487
資産合計	65,138,616,764	42,112,712,487
負債の部		
流動負債		
未払解約金	51,543,407	691,353,045
未払受託者報酬	16,593,108	13,970,473
未払委託者報酬	132,744,757	111,763,718
その他未払費用	420,000	432,000
流動負債合計	201,301,272	817,519,236
負債合計	201,301,272	817,519,236
純資産の部		
元本等		
元本	54,344,559,320	34,430,262,818
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	10,592,756,172	6,864,930,433
（分配準備積立金）	9,590,463,643	6,485,819,588
元本等合計	64,937,315,492	41,295,193,251
純資産合計	64,937,315,492	41,295,193,251
負債純資産合計	65,138,616,764	42,112,712,487

(2) 損益及び剰余金計算書

(単位 : 円)

	第 10 期		第 11 期	
	自 平成 24 年 5 月 16 日 至 平成 25 年 5 月 15 日		自 平成 25 年 5 月 16 日 至 平成 26 年 5 月 15 日	
営業収益				
受取利息	686,338,631		698,949,547	
有価証券売買等損益	4,142,147,118		160,998,276	
その他収益	234,167		202,568	
営業収益合計	4,828,719,916		538,153,839	
営業費用				
受託者報酬	33,286,106		30,759,933	
委託者報酬	266,288,649		246,079,351	
その他費用	840,000		852,000	
営業費用合計	300,414,755		277,691,284	
営業利益又は営業損失 ()	4,528,305,161		260,462,555	
経常利益又は経常損失 ()	4,528,305,161		260,462,555	
当期純利益又は当期純損失 ()	4,528,305,161		260,462,555	
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額 ()	70,776,391		106,622,626	
期首剰余金又は期首欠損金 ()	6,483,524,028		10,592,756,172	
剰余金増加額又は欠損金減少額	-		-	
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-		-	
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-		-	
剰余金減少額又は欠損金増加額	348,296,626		3,881,665,668	
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	348,296,626		3,881,665,668	
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-		-	
分配金	-		-	
期末剰余金又は期末欠損金 ()	10,592,756,172		6,864,930,433	

(3) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	第11期	
	自平成25年5月16日 至平成26年5月15日	
有価証券の評価基準及び評価方法	<p>親投資信託受益証券は移動平均法に基づき、国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券は個別法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない) 価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>	

(貸借対照表に関する注記)

項目	第10期 (平成25年5月15日現在)		第11期 (平成26年5月15日現在)	
	1. 当計算期間の末日における受益権の総数	54,344,559,320 口		34,430,262,818 口
2. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額)	1.1949 円 11,949 円	1口当たり純資産額 (10,000口当たりの純資産額)	1.1994 円 11,994 円

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	第10期 自平成24年5月16日 至平成25年5月15日		第11期 自平成25年5月16日 至平成26年5月15日	
	分配金の計算過程	<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(835,105,295円)、費用控除後、繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(337,751,881円)、収益調整金(1,002,292,529円)および分配準備積立金(8,417,606,467円)より、分配対象収益は10,592,756,172円(1万口当たり1,949.16円)ですが、分配を行っておりません。</p>		<p>計算期間末における費用控除後の配当等収益(409,736,227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(379,110,845円)および分配準備積立金(6,076,083,361円)より、分配対象収益は6,864,930,433円(1万口当たり1,993.84円)ですが、分配を行っておりません。</p>

(金融商品に関する注記)

・金融商品の状況に関する事項

項目	第11期	
	自平成25年5月16日 至平成26年5月15日	
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>	
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容 1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券、親投資信託受</p>	

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

・ 金融商品の時価等に関する事項

項目	第 11 期 (平成 26 年 5 月 15 日現在)
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2. 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券、親投資信託受益証券） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

第10期(自平成24年5月16日 至平成25年5月15日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	480,273,250 円
地方債証券	25,080,525 円
特殊債券	42,401,960 円
社債券	30,662,000 円
親投資信託受益証券	4,015,893,972 円
合計	3,437,476,237 円

第11期(自平成25年5月16日 至平成26年5月15日)

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	144,261,500 円
地方債証券	14,053,360 円
特殊債券	36,642,280 円
社債券	30,516,000 円
親投資信託受益証券	123,044,132 円
合計	102,429,008 円

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

第11期(自平成25年5月16日 至平成26年5月15日)

該当事項はありません。

(その他の注記)

項 目	第10期 (平成25年5月15日現在)	第11期 (平成26年5月15日現在)
期首元本額	57,429,693,995 円	54,344,559,320 円
期中追加設定元本額	0 円	0 円
期中一部解約元本額	3,085,134,675 円	19,914,296,502 円

(4) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

該当事項はありません。

(b)株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	第269回利付国債(10年)	2,840,000,000	2,869,280,400	
	第270回利付国債(10年)	4,230,000,000	4,286,301,300	
	第274回利付国債(10年)	2,790,000,000	2,853,081,900	
	第286回利付国債(10年)	4,050,000,000	4,261,896,000	
	第288回利付国債(10年)	4,550,000,000	4,790,695,000	
	第290回利付国債(10年)	3,010,000,000	3,155,894,700	
	第296回利付国債(10年)	2,660,000,000	2,814,200,200	
国債証券 合計		24,130,000,000	25,031,349,500	
地方債証券	平成16年度第5回大阪市公募公債	500,000,000	503,375,000	
	平成16年度第10回神戸市公募公債	618,000,000	625,391,280	
地方債証券 合計		1,118,000,000	1,128,766,280	
特殊債券	第11回首都高速道路債券	300,000,000	302,379,000	
	第198回政府保証首都高速道路債券	800,000,000	810,696,000	
	第6回阪神高速道路債券	500,000,000	505,575,000	
	第8回都市再生債券	400,000,000	406,104,000	
	第4回本州四国連絡橋債券	500,000,000	503,995,000	
	第47回政府保証関西国際空港債券	432,000,000	437,646,240	
	第5回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	500,000,000	506,755,000	
特殊債券 合計		3,432,000,000	3,473,150,240	
社債券	第12回ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポレーション	100,000,000	101,317,000	
	第14回ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポ	300,000,000	307,062,000	
	第16回シティグループ・インク円貨債券	500,000,000	508,455,000	
	第2回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	400,000,000	401,848,000	
	株式会社東京三菱銀行第8回無担保社債	400,000,000	406,964,000	
	第11回株式会社静岡銀行無担保社債	400,000,000	405,252,000	
	第2回三菱信託銀行株式会社無担保社債	300,000,000	300,504,000	
	第4回住友信託銀行株式会社無担保社債	300,000,000	304,098,000	
社債券 合計		2,700,000,000	2,735,500,000	
親投資信託受益証券	国内株式マザーファンド(A号)	6,419,304,103	4,792,652,443	
	外国株式マザーファンド(A号)	1,558,019,159	2,352,764,732	
親投資信託受益証券 合計		7,977,323,262	7,145,417,175	
合計		39,357,323,262	39,514,183,195	

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考情報)

【国内株式マザーファンド(A号)】

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	(平成25年5月15日現在)	(平成26年5月15日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	55,438,546	51,038,182
株式	8,120,612,500	5,890,306,300
未収入金	204,769,997	163,561,458
未収配当金	75,149,912	56,420,063
未収利息	45	27
流動資産合計	8,455,971,000	6,161,326,030
資産合計	8,455,971,000	6,161,326,030
負債の部		
流動負債		
未払金	162,856,952	164,074,159
未払解約金	34,342,327	2,310,543
流動負債合計	197,199,279	166,384,702
負債合計	197,199,279	166,384,702
純資産の部		
元本等		
元本	10,510,162,594	8,030,017,961
剰余金		
剰余金又は欠損金()	2,251,390,873	2,035,076,633
元本等合計	8,258,771,721	5,994,941,328
純資産合計	8,258,771,721	5,994,941,328
負債純資産合計	8,455,971,000	6,161,326,030

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成25年5月16日 至平成26年5月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない) 価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準</p> <p>受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成25年5月15日現在	(平成26年5月15日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	10,510,162,594 口	8,030,017,961 口
2. 「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	元本の欠損 2,251,390,873 円	元本の欠損 2,035,076,633 円
3. 1単位当たり純資産の額	1口当たり純資産額 0.7858 円 (10,000口当たりの純資産額 7,858 円)	1口当たり純資産額 0.7466 円 (10,000口当たりの純資産額 7,466 円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の状況に関する事項

項目	自平成25年5月16日 至平成26年5月15日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式を組入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p> <p>3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等</p> <p>(2) 金融商品に係るリスク 有価証券およびデリバティブ取引等 当ファンドが保有する金融商品にかかる主なリスクとしては、株価変動リス</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成26年5月15日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（株式） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

(自平成25年5月16日 至 平成26年5月15日)

該当事項はありません。

(その他の注記)

(平成26年5月15日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	10,510,162,594 円
同期中における追加設定元本額	1,135,076,621 円
同期中における一部解約元本額	3,615,221,254 円
平成26年5月15日現在における元本の内訳	
三井住友・DCバランスファンド(安定型)	44,264,659 円
三井住友・DCバランスファンド(安定成長型)	180,153,269 円
三井住友・DCバランスファンド(成長型)	119,351,822 円
三井住友・DC国内株式アクティブS	424,614,293 円
S M A M・ニューセンチュリーバランス標準型<適格機関投資家限定>	701,614,998 円
S M A M・バランスファンドVA安定型(適格機関投資家専用)	6,419,304,103 円
S M A M・バランスファンドVA株40型(適格機関投資家専用)	25,778,860 円
S M A M・バランスファンドVA株60型(適格機関投資家専用)	61,476,291 円
S M A M・バランスファンドVA株80型(適格機関投資家専用)	53,459,666 円
合計	8,030,017,961 円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

(単位:円)

銘柄	株数	評価額		備考
		単価	金額	
国際石油開発帝石	19,200	1,449.00	27,820,800	
ショーボンドホールディングス	14,000	4,485.00	62,790,000	
コムシスホールディングス	39,900	1,748.00	69,745,200	
大成建設	181,000	471.00	85,251,000	
清水建設	42,000	603.00	25,326,000	
日揮	15,000	2,871.00	43,065,000	
ヤクルト本社	5,400	4,985.00	26,919,000	
アサヒグループホールディングス	34,100	2,915.00	99,401,500	
日本触媒	64,000	1,248.00	79,872,000	
J S R	12,500	1,659.00	20,737,500	
ダイセル	34,000	881.00	29,954,000	
積水化学工業	42,000	1,125.00	47,250,000	
日立化成	17,900	1,574.00	28,174,600	
花王	3,900	3,843.00	14,987,700	
日東電工	4,500	4,769.00	21,460,500	
アステラス製薬	68,800	1,227.00	84,417,600	
中外製薬	24,500	2,673.00	65,488,500	
参天製薬	6,300	5,220.00	32,886,000	
栄研化学	16,100	1,639.00	26,387,900	

大塚ホールディングス	27,800	3,000.00	83,400,000	
JXホールディングス	116,300	521.00	60,592,300	
東洋ゴム工業	25,000	835.00	20,875,000	
ブリヂストン	28,900	3,544.00	102,421,600	
旭硝子	38,000	559.00	21,242,000	
日本碍子	45,000	1,943.00	87,435,000	
日本特殊陶業	37,000	2,593.00	95,941,000	
新日鐵住金	190,000	280.00	53,200,000	
日立金属	53,000	1,457.00	77,221,000	
住友電気工業	59,300	1,365.00	80,944,500	
ディスコ	7,400	6,070.00	44,918,000	
S M C	5,100	24,745.00	126,199,500	
椿本チエイン	83,000	764.00	63,412,000	
日本精工	50,000	1,149.00	57,450,000	
三菱重工業	44,000	580.00	25,520,000	
日立製作所	87,000	703.00	61,161,000	
三菱電機	93,000	1,191.00	110,763,000	
富士電機	134,000	451.00	60,434,000	
日本電産	11,000	5,676.00	62,436,000	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	71,000	576.00	40,896,000	
日本電気	272,000	288.00	78,336,000	
パナソニック	50,900	1,087.00	55,328,300	
キーエンス	2,500	38,620.00	96,550,000	
ファナック	5,600	17,235.00	96,516,000	
浜松ホトニクス	14,500	4,640.00	67,280,000	
村田製作所	6,600	8,709.00	57,479,400	
リコー	50,600	1,152.00	58,291,200	
デンソー	29,700	4,451.00	132,194,700	
日産自動車	32,200	915.00	29,463,000	
トヨタ自動車	48,800	5,635.00	274,988,000	
本田技研工業	24,500	3,389.00	83,030,500	
富士重工業	31,400	2,531.00	79,473,400	
ヤマハ発動機	26,900	1,655.00	44,519,500	
日機装	50,500	1,180.00	59,590,000	
トプコン	21,500	1,887.00	40,570,500	
アシックス	38,400	2,043.00	78,451,200	
東京瓦斯	128,000	567.00	72,576,000	
東日本旅客鉄道	3,900	7,672.00	29,920,800	
東海旅客鉄道	9,800	12,730.00	124,754,000	

山九	43,000	423.00	18,189,000	
日立物流	11,600	1,619.00	18,780,400	
日本航空	11,400	5,170.00	58,938,000	
上組	25,000	929.00	23,225,000	
新日鉄住金ソリューションズ	4,900	2,463.00	12,068,700	
ヤフー	135,100	431.00	58,228,100	
伊藤忠テクノソリューションズ	6,600	4,235.00	27,951,000	
大塚商会	2,300	12,440.00	28,612,000	
日本電信電話	17,200	5,908.00	101,617,600	
KADOKAWA	5,500	3,470.00	19,085,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	15,300	3,840.00	58,752,000	
SCSK	8,900	2,630.00	23,407,000	
コナミ	20,400	2,356.00	48,062,400	
シップヘルスケアホールディングス	8,500	3,325.00	28,262,500	
伊藤忠商事	56,000	1,197.00	67,032,000	
セブン&アイ・ホールディングス	26,300	3,950.00	103,885,000	
ドンキホーテホールディングス	9,800	5,720.00	56,056,000	
サンドラッグ	15,800	4,275.00	67,545,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	403,100	580.00	233,798,000	
三井住友フィナンシャルグループ	39,000	4,059.00	158,301,000	
セブン銀行	114,000	375.00	42,750,000	
みずほフィナンシャルグループ	614,600	204.00	125,378,400	
ジャフコ	2,600	3,865.00	10,049,000	
第一生命保険	39,600	1,483.00	58,726,800	
東京海上ホールディングス	40,700	3,049.00	124,094,300	
オリックス	58,900	1,632.00	96,124,800	
パーク24	23,900	1,892.00	45,218,800	
三井不動産	41,000	3,382.00	138,662,000	
住友不動産	9,000	4,374.00	39,366,000	
総合警備保障	14,800	2,406.00	35,608,800	
電通	5,200	3,860.00	20,072,000	
オリエンタルランド	5,900	15,705.00	92,659,500	
ユー・エス・エス	14,700	1,562.00	22,961,400	
セコム	6,400	6,114.00	39,129,600	
合 計	4,556,200		5,890,306,300	

(b) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【外国株式マザーファンド（A号）】

（1）貸借対照表

（単位：円）

（平成25年5月15日現在）（平成26年5月15日現在）

資産の部		
流動資産		
預金	134,877,941	152,805,885
コール・ローン	104,819,773	30,038,086
株式	4,439,317,094	3,514,809,596
投資証券	329,547	-
未収入金	189,067,992	6,400,412
未収配当金	10,990,703	9,846,616
未収利息	86	16
流動資産合計	4,879,403,136	3,713,900,611
資産合計	4,879,403,136	3,713,900,611
負債の部		
流動負債		
未払金	316,891,576	131,530,970
未払解約金	2,120,138	1,489,745
流動負債合計	319,011,714	133,020,715
負債合計	319,011,714	133,020,715
純資産の部		
元本等		
元本	3,500,486,049	2,371,244,507
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	1,059,905,373	1,209,635,389
元本等合計	4,560,391,422	3,580,879,896
純資産合計	4,560,391,422	3,580,879,896
負債純資産合計	4,879,403,136	3,713,900,611

(2) 注記表

(重要な会計方針の注記)

項目	自平成25年5月16日 至平成26年5月15日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法に基づき、以下の通り、原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等の最終相場に基づいて評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 金融商品取引所等に上場されていない有価証券は、原則として金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない) 価格情報会社の提供する価額または業界団体が公表する売買参考統計値等で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 直近の最終相場等によって時価評価することが適当ではないと委託者が判断した場合には、委託者としての忠実義務に基づき合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p>
2. デリバティブの評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、わが国における対顧客先物相場の仲値によっております。</p>
3. 収益及び費用の計上基準	<p>受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。なお、配当金額が未確定の場合は、入金日基準で計上しております。</p>
4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条に基づいて処理しております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

項目	平成25年5月15日現在	(平成26年5月15日現在)
1. 当計算期間の末日における受益権の総数	3,500,486,049口	2,371,244,507口
2. 1単位当たり純資産の額	<p>1口当たり純資産額 1.3028円 (10,000口当たりの純資産額 13,028円)</p>	<p>1口当たり純資産額 1.5101円 (10,000口当たりの純資産額 15,101円)</p>

(金融商品に関する注記)

・金融商品の状況に関する事項

項目	自平成25年5月16日 至平成26年5月15日
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、当ファンドの信託約款に従い、有価証券等の金融商品に対して、投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>(1) 金融商品の内容</p> <p>1) 有価証券 当ファンドが投資対象とする有価証券は、信託約款で定められており、当計算期間については、株式を組入れております。</p> <p>2) デリバティブ取引 当ファンドが行うことのできるデリバティブ取引は、信託約款に基づいております。デリバティブ取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資すること、ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクの回避を目的としております。</p>

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

・金融商品の時価等に関する事項

項目	(平成26年5月15日現在)
1.貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品は、原則として、すべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。
2.時価の算定方法	<p>(1) 有価証券（株式） 「重要な会計方針の注記」に記載しております。</p> <p>(2) 派生商品評価勘定（デリバティブ取引） デリバティブ取引については、「デリバティブ取引に関する注記」に記載しております。</p> <p>(3) コール・ローン、未収入金、未払金等の金銭債権および金銭債務等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

(自平成25年5月16日 至 平成26年5月15日)

該当事項はありません。

(その他の注記)

(平成26年5月15日現在)	
開示対象ファンドの	
期首における当該親投資信託の元本額	3,500,486,049 円
同期中における追加設定元本額	306,483,886 円
同期中における一部解約元本額	1,435,725,428 円
平成26年5月15日現在における元本の内訳	
三井住友・DCバランスファンド(安定型)	13,861,086 円
三井住友・DCバランスファンド(安定成長型)	52,364,856 円
三井住友・DCバランスファンド(成長型)	36,393,615 円
三井住友・DC外国株式アクティブ	477,957,207 円
S M A M・ニューセンチュリーバランス標準型<適格機関投資家限定>	187,837,269 円
S M A M・バランスファンドVA安定型(適格機関投資家専用)	1,558,019,159 円
S M A M・バランスファンドVA株40型(適格機関投資家専用)	7,581,593 円
S M A M・バランスファンドVA株60型(適格機関投資家専用)	21,433,183 円
S M A M・バランスファンドVA株80型(適格機関投資家専用)	15,796,539 円
合計	2,371,244,507 円

(3) 附属明細表

有価証券明細表

(a) 株式

通貨	銘柄	株数	評価額		備考
			単価	金額	
米ドル	CHEVRON CORPORATION	5,106	126.42	645,500.52	
	CONOCOPHILLIPS	6,506	78.53	510,916.18	
	NATIONAL-OILWELL VARCO INC.	5,170	81.03	418,925.10	
	SCHLUMBERGER LTD	3,441	100.74	346,646.34	
	WHITING PETROLEUM CORP	3,133	72.09	225,857.97	
	AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	293	119.70	35,072.10	
	CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	708	248.00	175,584.00	
	DOW CHEMICAL	3,200	50.20	160,640.00	
	DU PONT (E.I.) DE NEMOURS	2,038	67.72	138,013.36	
	FREEMONT-MCMORAN COPPER-B	2,135	35.50	75,792.50	
	INTERNATIONAL PAPER CO	684	47.09	32,209.56	
	MONSANTO CO	920	117.00	107,640.00	
	NUCOR CORP	1,042	52.95	55,173.90	
	DANAHER CORP	4,512	75.21	339,347.52	
	DOVER CORP	2,674	86.38	230,980.12	
	EATON CORP PLC	5,170	72.74	376,065.80	
	GENERAL ELECTRIC CO	20,951	26.76	560,648.76	
	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	5,136	92.74	476,312.64	
	FEDEX CORP	2,661	139.33	370,757.13	
	GENERAL MOTORS CO	4,815	34.94	168,236.10	

WHIRLPOOL CORP	2,765	144.53	399,625.45	
MCDONALD'S CORPORATION	3,874	103.03	399,138.22	
COMCAST CORP-CL A	6,477	49.83	322,748.91	
THE WALT DISNEY CO.	6,290	80.92	508,986.80	
AMAZON.COM INC	985	297.62	293,155.70	
GAP INC/THE	9,319	41.24	384,315.56	
MACY'S INC	6,496	57.83	375,663.68	
TJX COMPANIES INC	3,436	59.13	203,170.68	
BROWN-FORMAN CORPORATION	4,066	91.35	371,429.10	
COCA-COLA CO/THE	13,285	40.89	543,223.65	
HORMEL FOODS CORPORATION	5,055	48.80	246,684.00	
MONSTER BEVERAGE CORPORATION	4,276	70.33	300,731.08	
ABBOTT LABORATORIES	5,518	39.93	220,333.74	
UNITEDHEALTH GROUP INC	3,149	77.17	243,008.33	
ABBVIE INC	6,215	52.87	328,587.05	
AMGEN INC	2,374	112.07	266,054.18	
BIOGEN IDEC INC	649	296.50	192,428.50	
GILEAD SCIENCES INC	5,350	80.97	433,189.50	
JOHNSON & JOHNSON	2,310	100.87	233,009.70	
MYLAN INC	7,585	47.46	359,984.10	
PFIZER INC	8,685	29.10	252,733.50	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	2,923	116.49	340,500.27	
BANK OF AMERICA CORP	11,139	14.84	165,302.76	
CITIGROUP INC	7,218	47.12	340,112.16	
FIFTH THIRD BANCORP	17,285	20.47	353,823.95	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	5,275	83.29	439,354.75	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	835	190.46	159,034.10	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	1,724	159.45	274,891.80	
ACE LIMITED	3,754	102.70	385,535.80	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	6,409	53.39	342,176.51	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	4,454	82.44	367,187.76	
TORCHMARK CORPORATION	3,139	80.60	253,003.40	
FACEBOOK INC-A	6,370	59.23	377,295.10	
GOOGLE INC-CL A	708	534.41	378,362.28	
MICROSOFT CORP	8,230	40.24	331,175.20	
ORACLE CORPORATION	10,936	41.88	457,999.68	
VISA INC	2,155	209.86	452,248.30	
APPLE INC	984	593.87	584,368.08	
CISCO SYSTEMS INC	11,523	22.81	262,839.63	

	QUALCOMM INC	3,225	80.41	259,322.25	
	SEAGATE TECHNOLOGY	4,928	51.25	252,560.00	
	VERIZON COMMUNICATIONS INC	6,297	48.01	302,318.97	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	7,054	52.36	369,347.44	
	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	3,875	38.24	148,180.00	
	XCEL ENERGY INC	10,688	30.85	329,724.80	
	LINEAR TECHNOLOGY CORP	6,815	44.72	304,766.80	
米ドル 小計		336,397		20,559,952.82 (2,093,619,995)	
カナダドル	ENBRIDGE INC	7,660	51.90	397,554.00	
	ENCANA CORP	7,560	24.84	187,790.40	
	YAMANA GOLD INC	9,490	8.22	78,007.80	
	LOBLAW COMPANIES LTD	9,070	47.46	430,462.20	
	BANK OF NOVA SCOTIA	6,904	66.97	462,360.88	
カナダドル 小計		40,684		1,556,175.28 (145,580,197)	
ユーロ	TOTAL SA	7,289	51.91	378,371.99	
	AIR LIQUIDE	601	106.05	63,736.05	
	BASF SE	2,275	83.69	190,394.75	
	GEA GROUP AG	7,020	32.35	227,097.00	
	SCHNEIDER ELECTRIC SA	4,475	68.01	304,344.75	
	DEUTSCHE POST AG-REG	8,489	27.65	234,720.85	
	INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP	19,426	4.76	92,467.76	
	LVMH MOET HENNESSY LOUI V SA	1,435	142.40	204,344.00	
	UNILEVER NV-CVA	9,020	31.53	284,445.70	
	BAYER AG	2,639	103.50	273,136.50	
	BNP PARIBAS	5,305	52.88	280,528.40	
	INTESA SANPAOLO	55,662	2.34	130,583.05	
	KBC GROUPE SA	4,873	44.95	219,065.71	
	AXA SA	12,078	17.56	212,089.68	
	AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	5,447	31.97	174,167.82	
	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	6,462	12.86	83,101.32	
	GDF SUEZ	3,597	19.51	70,177.47	
	TERNA SPA	29,356	3.98	116,836.88	
	ユーロ 小計		185,449		3,539,609.68 (494,518,868)
英ポンド	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	13,428	25.62	344,092.50	
	ANGLO AMERICAN PLC	3,460	16.41	56,795.90	
	GLENCORE XSTRATA PLC	15,406	3.27	50,439.24	

	RIO TINTO PLC	2,141	33.74	72,237.34	
	WEIR GROUP PLC/THE	3,879	26.95	104,539.05	
	GKN PLC	32,909	3.84	126,633.83	
	TUI TRAVEL PLC	41,582	4.32	179,883.73	
	WPP PLC	10,950	12.43	136,108.50	
	MARKS & SPENCER GROUP PLC	42,708	4.64	198,549.49	
	TATE & LYLE PLC	26,647	6.89	183,731.06	
	GLAXOSMITHKLINE PLC	10,430	16.23	169,331.05	
	SHIRE PLC	5,106	33.41	170,591.46	
	BARCLAYS PLC	41,205	2.51	103,548.16	
	ABERDEEN ASSET MGMT PLC	12,073	4.29	51,865.60	
	PRUDENTIAL PLC	13,398	14.10	188,911.80	
	VODAFONE GROUP PLC	29,571	2.22	65,677.19	
	NATIONAL GRID PLC	11,775	8.61	101,382.75	
	英ボンド 小計	316,668		2,304,318.65 (393,646,754)	
スイスフラン	ARYZTA AG	3,887	82.70	321,454.90	
	BARRY CALLEBAUT AG-REG	166	1,213.00	201,358.00	
	ACTELION LTD	2,180	85.55	186,499.00	
	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1,475	262.70	387,482.50	
	スイスフラン 小計	7,708		1,096,794.40 (125,561,022)	
スウェーデン クローナ	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB-A	22,747	88.05	2,002,873.35	
	スウェーデンクローナ 小計	22,747		2,002,873.35 (31,104,623)	
ノルウェーク ローネ	SEADRILL LID	5,096	211.20	1,076,275.20	
	ノルウェークローネ 小計	5,096		1,076,275.20 (18,501,170)	
デンマークク ローネ	COLOPLAST-B	1,675	476.20	797,635.00	
	デンマーククローネ 小計	1,675		797,635.00 (14,931,727)	
オーストラリ アドル	BHP BILLITON LTD	8,630	38.30	330,529.00	
	BRAMBLES LIMITED	8,766	9.70	85,030.20	
	WOOLWORTHS LIMITED	2,746	36.91	101,354.86	
	CSL LIMITED	1,395	70.19	97,915.05	
	AUST AND NZ BANKING GROUP LT	5,723	33.15	189,717.45	
	WESTPAC BANKING CORPORATION	7,333	34.20	250,788.60	

	MACQUARIE GROUP LTD	1,752	59.16	103,648.32	
	SUNCORP GROUP LTD	6,253	13.40	83,790.20	
	TELSTRA CORPORATION LIMITED	18,968	5.28	100,151.04	
	オーストラリアドル 小計	61,566		1,342,924.72 (128,128,447)	
香港ドル	SANDS CHINA LTD	10,000	57.55	575,500.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	13,500	22.40	302,400.00	
	AIA GROUP LTD	21,800	38.00	828,400.00	
	CHEUNG KONG HOLDINGS LTD	7,000	133.30	933,100.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	5,000	100.70	503,500.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	9,000	53.20	478,800.00	
	香港ドル 小計	66,300		3,621,700.00 (47,589,138)	
シンガポールドル	KEPPEL CORP LTD	9,100	10.70	97,370.00	
	UNITED OVERSEAS BANK LTD	6,000	22.30	133,800.00	
	M1 LTD	10,000	3.42	34,200.00	
	シンガポールドル 小計	25,100		265,370.00 (21,627,655)	
	合 計	1,069,390		3,514,809,596 (3,514,809,596)	

(注) 金額欄の()内は、外貨建有価証券にかかるもので、内書きであります。

通貨	銘柄数	組入株式時価比率	合計金額に対する比率
米ドル	株式 66 銘柄	58.5%	59.6%
カナダドル	株式 5 銘柄	4.1%	4.1%
ユーロ	株式 18 銘柄	13.8%	14.1%
英ポンド	株式 17 銘柄	11.0%	11.2%
スイスフラン	株式 4 銘柄	3.5%	3.6%
スウェーデンクローナ	株式 1 銘柄	0.9%	0.9%
ノルウェークローネ	株式 1 銘柄	0.5%	0.5%
デンマーククローネ	株式 1 銘柄	0.4%	0.4%
オーストラリアドル	株式 9 銘柄	3.6%	3.6%
香港ドル	株式 6 銘柄	1.3%	1.4%
シンガポールドル	株式 3 銘柄	0.6%	0.6%

(b) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

3 ファンドの現況

【純資産額計算書】

平成 27 年 2 月 27 日現在

資産総額	11,357,759,942円
負債総額	842,578,467円
純資産総額 (-)	10,515,181,475円
発行済口数	8,403,382,780口
1口当たり純資産額 (/)	1.2513円
(1万口当たり純資産額)	(12,513円)

4 設定及び解約の実績

	設定口数 (口)	解約口数 (口)
第 2 期	56,837,182,225	0
第 3 期	1,838,792,354	4,191,100,525
第 4 期	0	4,760,581,732
第 5 期	0	4,496,085,754
第 6 期	0	3,109,105,783
第 7 期	0	4,204,052,863
第 8 期	0	4,446,376,929
第 9 期	0	4,062,969,200
第 10 期	0	3,085,134,675
第 11 期	0	19,914,296,502
第 12 期 (中間期)	0	18,028,995,821

(注) 本邦外における設定および解約の実績はありません。