

【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23年12月15日提出

【計算期間】 第10期（自 平成22年10月1日 至 平成23年9月30日）

【ファンド名】 すみしん DCマイセレクション50
（以下「本ファンド」、「当ファンド」または「ファンド」ということ
があります。）

【発行者名】 住信アセットマネジメント株式会社

【代表者の役職氏名】 取締役社長 平田 誠一

【本店の所在の場所】 東京都中央区八重洲2丁目3番1号

【事務連絡者氏名】 投信業務部長 橋詰 廣志

【連絡場所】 東京都中央区八重洲2丁目3番1号

【電話番号】 03-6259-3801

【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】

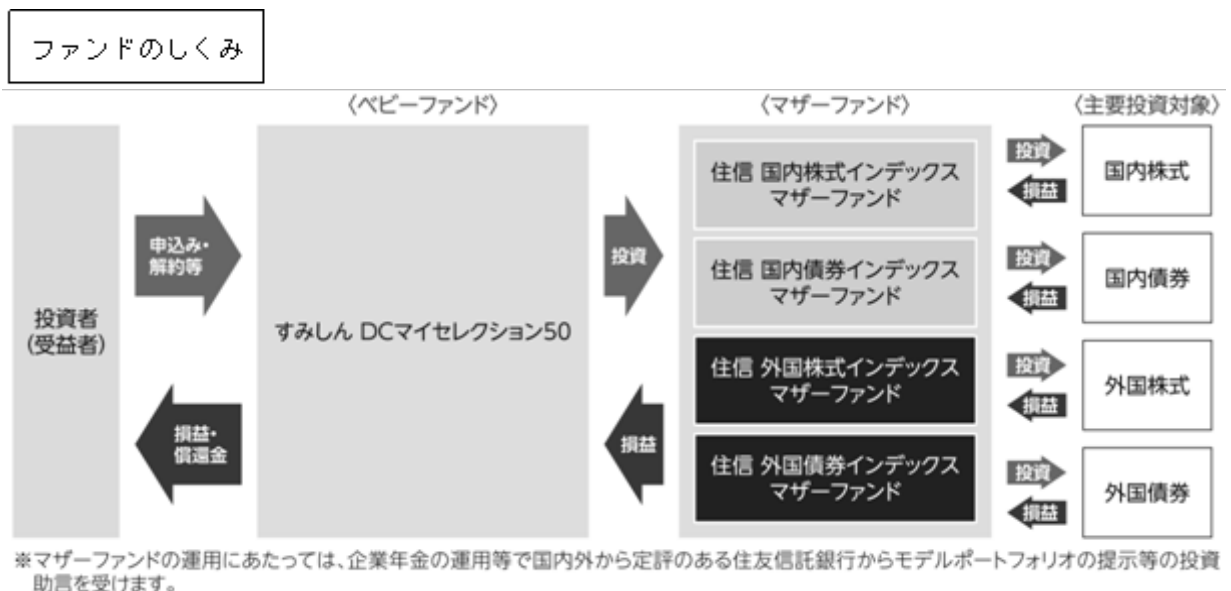
ファンドの目的

国内株式、国内債券、外国株式および外国債券に分散投資し、リスクの低減に努めつつ、信託財産の長期的な成長を目指します。

なお、信託金の限度額は、3,000億円とします。ただし、委託者は、受託者と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

ファンドの特色

- 日本を含む世界の公社債や株式にバランスよく投資を行い、ファミリーファンド方式で運用を行います。原則として、為替ヘッジは行いません。



? ファミリーファンド方式とは

ファミリーファンド方式とは、投資者の皆様からお預かりした資金を、ベビーファンドごとにまとめ、そ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、実質的な運用をマザーファンドで行うしくみです。

- 資産ごとの運用では、各インデックスに連動する投資成果を目指します。

資産	インデックス
国内株式	東証株価指数(TOPIX) ^{*1}
国内債券	ノムラ・ボンド・パフォーマンス・インデックス(総合)(NOMURA-BPI 総合) ^{*2}
外国株式	MSCI コクサイ・インデックス(除く日本、円ベース) ^{*3}
外国債券	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) ^{*4}

* 資産ごとの運用においては、十分な銘柄分散を行い、上記のインデックスに連動する運用収益の獲得を目指します。

1「東証株価指数（TOPIX）」とは、日本国内の株式市場の動向を的確に表すために、株式会社東京証券取引所（以下(株)東京証券取引所といいます。）が公表する株価指数で、東京証券取引所第一部に上場されているすべての銘柄の時価総額で加重平均し、指数化したものです。具体的には、1968年1月4日の東京証券取引所第一部上場全銘柄の時価総額を100として、その後の時価総額を指数化しています。当該指数は、(株)東京証券取引所の知的財産であり、下記の点をご認識ください。

TOPIXの指数値およびTOPIXの商標は、(株)東京証券取引所の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利およびTOPIXの商標に関するすべての権利は(株)東京証券取引所が有しています。

(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。

(株)東京証券取引所は、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの指数の引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。

(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。

本ファンドが主要投資対象とする「住信 国内株式インデックス マザーファンド」は、TOPIXの指数値に連動した投資成果を目標として運用しますが、当該ファンドの基準価額とTOPIXの指数値が著しく乖離することがあります。

本ファンドおよび「住信 国内株式インデックス マザーファンド」は、(株)東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。

(株)東京証券取引所は、「住信 国内株式インデックス マザーファンド」を投資対象とする本ファンドの購入者または公衆に対し、本ファンドおよび「住信 国内株式インデックス マザーファンド」の説明、投資のアドバイスを有する義務はありません。

(株)東京証券取引所は、委託者または「住信 国内株式インデックス マザーファンド」を投資対象とする本ファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

前記の項目に限らず、(株)東京証券取引所は本ファンドおよび「住信 国内株式インデックス マザーファンド」の発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

2「ノムラ・ボンド・パフォーマンス・インデックス（総合）（NOMURA-BPI総合）」とは、野村證券株式会社（野村證券(株)）が、国内で発行された公募利付債券の流通市場全体の動向を的確に表すために開発した経過利子込時価総額加重型の投資収益指数です。

NOMURA-BPI総合は、野村證券(株)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、野村證券(株)が有しています。なお、野村證券(株)は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

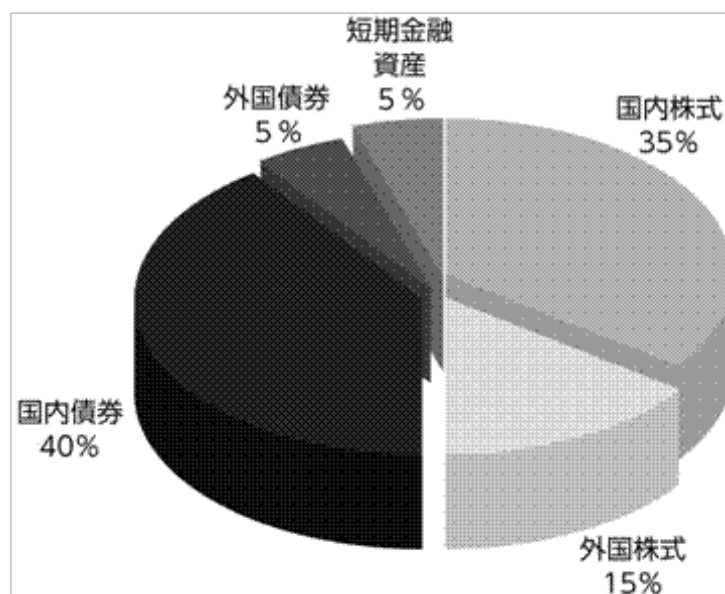
3「MSCIコクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）」とは、MSCI社が開発した株価指数で、日本を除く世界の主要国の株式指数を、各国の株式時価総額をベースに合成したものです。同指数に関する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI社に帰属します。またMSCI社は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

4「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）」とは、シティグループ・グローバル・マーケット・インク（CGMI社）が開発した日本を除く世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均した債券インデックス（円ベースの指数）です。

シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）は、CGMI社の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、CGMI社が有しています。なお、CGMI社は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

3. 期待リターンとリスクのバランスを勘案し、国内株式35%、外国株式15%、国内債券40%、外国債券5%、短期金融資産5%を基準アセットミックスとして運用します。
- 資産ごとの投資比率は、原則として、基準アセットミックスから±5%の範囲内にコントロールします。
- 基準アセットミックスは、投資環境等の変化に応じて、年1回程度見直しを行うことがあります。

基準アセットミックス
(2011年10月31日現在)



分配方針

分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益および売買益等の全額とします。

原則として、毎年9月30日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、収益の分配を行います。

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。市況動向の影響を受けて変動するため、あらかじめ一定の額の分配をお約束するものではありません。

! 主な投資制限

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の60%以下とします。

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。

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30%以下とします。

資金動向および市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに信託財産の規模によっては、前記のような運用ができない場合があります。

[ファンドの商品分類]

本ファンドは、社団法人投資信託協会が定める分類方法において、以下のように分類・区分されます。

本ファンドの商品分類・属性区分に該当しない定義については、社団法人投資信託協会のホームページ (<http://www.toushin.or.jp/>) をご参照ください。

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)
単位型投信	国内	株式 債券
追加型投信	海外	不動産投信 その他資産 ()
	内外	資産複合

(注) 本ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

[分類における定義]

分類項目	該当分類	分類の定義
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	目論見書または投資信託約款において、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	目論見書または投資信託約款において、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。

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 大型株 中小型株	年1回	グローバル (日本を含む)	ファミリーファンド	あり ()
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年2回	日本		
	年4回	北米		
	年6回 (隔月)	欧州		
不動産投信	年12回 (毎月)	中南米	ファンド・オブ・ ファンズ	なし
その他資産 (投資信託証券(資産 複合(株式、債券、短期 金融資産)、(資産配 分固定型)))	日々	アフリカ		
	その他 ()	中近東 (中東)		
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング		

(注) 本ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

〔区分における定義〕

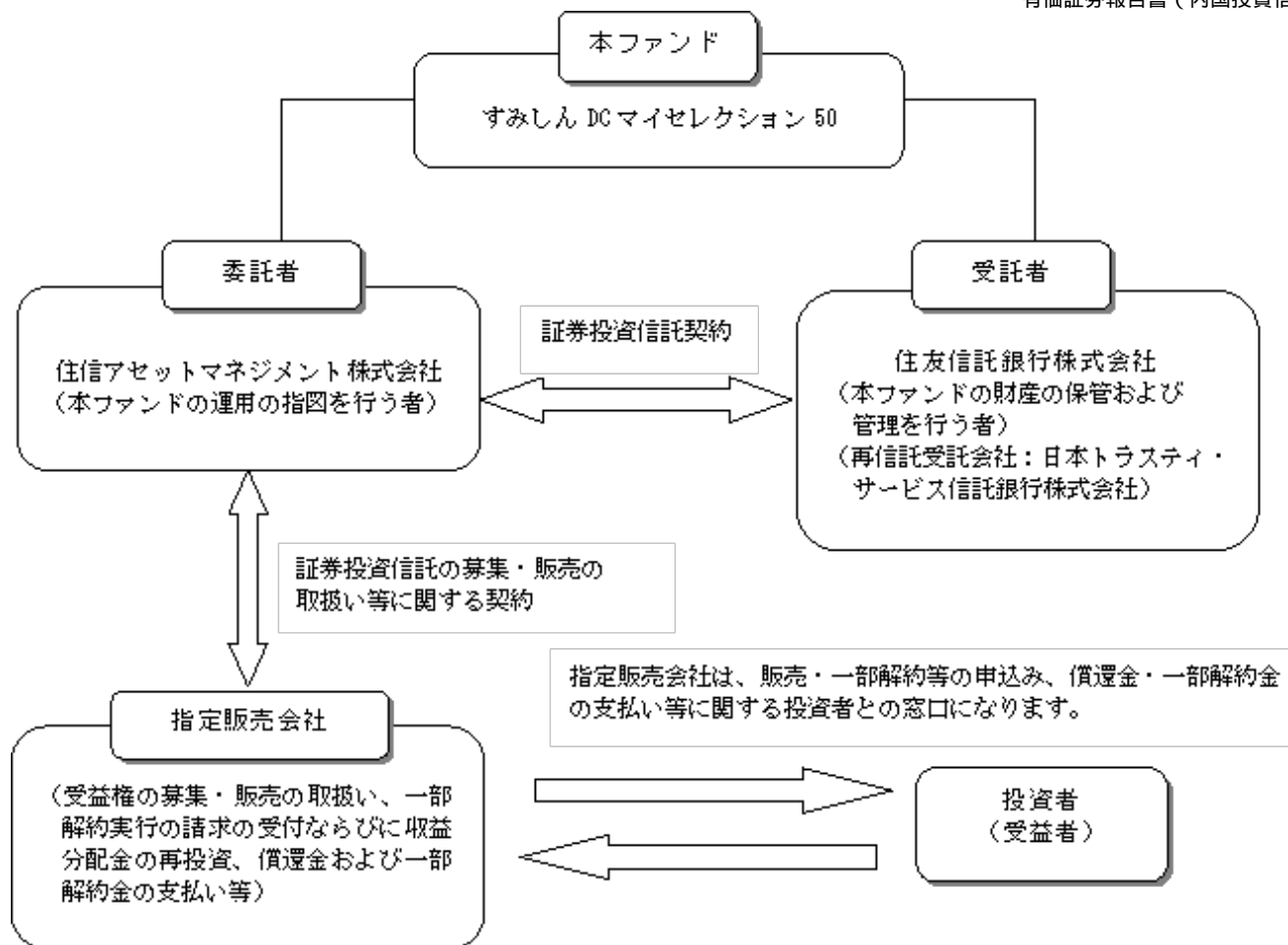
区分項目	該当区分	定義
投資対象資産	その他資産 （投資信託証券（資産複合（株式、債券、短期金融資産）、（資産配分固定型）））	目論見書または投資信託約款において、組入れている資産が主として投資信託証券であり（投資形態がファミリーファンドまたはファンド・オブ・ファンズのものを含みます。）、実質的に複数資産（本ファンドにおいては、株式、債券、短期金融資産）を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいいます。
決算頻度	年1回	目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル （日本を含む）	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界（日本を含みます。）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	目論見書または投資信託約款において、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きます。）を投資対象として投資する旨の記載があるものをいいます。
為替ヘッジ	なし	目論見書または投資信託約款において、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。

(2) 【ファンドの沿革】

平成12年5月30日	本ファンドの主要投資対象である「住信 国内株式インデックス マザーファンド」、「住信 国内債券インデックス マザーファンド」、「住信 外国株式インデックス マザーファンド」および「住信 外国債券インデックス マザーファンド」の投資信託契約締結、設定、運用開始
平成13年10月1日	本ファンドの投資信託契約締結、設定、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

(イ) 本ファンドの関係法人図



(ロ) 委託会社が関係法人と締結している契約等の概要

受託者との投資信託契約

受託者とは、受益者の利殖に資する目的で、投資信託約款の通り投資信託契約を締結しております。

指定販売会社との証券投資信託の募集・販売の取扱い等に関する契約

委託者は、指定販売会社に対し、次の業務を委託し、指定販売会社はこれを引き受けます。

- 1) 受益権の募集・販売の取扱い
- 2) 追加設定の申込受付事務
- 3) 受益者に対する収益分配金の再投資事務
- 4) 受益者に対する一部解約等の事務
- 5) 受益者に対する一部解約金および償還金の支払事務
- 6) 受益者に対する運用報告書の交付
- 7) その他前記の業務に付随する業務

指定販売会社によって引き受ける業務が異なる場合があります。

(ハ) 委託会社等の概況

資本金

平成23年10月31日現在 3億円

会社の沿革

昭和61年11月 1日	住信キャピタルマネジメント株式会社設立
昭和62年 2月20日	投資顧問業の登録
昭和62年 9月 9日	投資一任契約に係る業務の認可
平成 2年10月 1日	住信投資顧問株式会社に商号変更
平成11年 2月15日	住信アセットマネジメント株式会社に商号変更
平成11年 3月25日	証券投資信託委託業の認可

平成19年 9月30日 金融商品取引法施行に伴う金融商品取引業者の登録

（登録番号：関東財務局長（金商）第347号）

大株主の状況（平成23年10月31日現在）

名 称	住 所	持株数	持株比率
住友信託銀行株式会社	大阪府大阪市中央区北浜4-5-33	1,800株	30.0%
すみしん不動産株式会社	東京都中央区八重洲2-3-1	1,500株	25.0%
住信保証株式会社	東京都中央区日本橋本町4-11-5	1,200株	20.0%
住信カード株式会社	東京都中央区日本橋本町4-11-5	1,200株	20.0%
住信情報サービス株式会社	大阪府豊中市新千里西町1-1-3	300株	5.0%
合計		6,000株	100.0%

2【投資方針】

(1)【投資方針】

(イ)基本方針

本ファンドは、確定拠出年金法にもとづく確定拠出年金制度のための専用ファンドとして投資信託財産の長期的な成長をはかることをめざして運用を行います。

(ロ)運用方法

投資対象

「住信 国内株式インデックス マザーファンド」、「住信 国内債券インデックス マザーファンド」、「住信 外国株式インデックス マザーファンド」、「住信 外国債券インデックス マザーファンド」（以下、総称してまたは個々に「マザーファンド」ということがあります。）の受益証券（以下、総称してまたは個々に「マザーファンド受益証券」ということがあります。）を主要投資対象とします。

投資態度

- 1)主として、マザーファンド受益証券への投資を通して、国内株式、国内債券、外国株式および外国債券への分散投資を行い、リスクの低減に努めつつ、投資信託財産の長期的な成長をめざして運用を行います。
- 2)基準ポートフォリオは、国内株式35%、国内債券40%、外国株式15%、外国債券5%および短期金融資産5%の比率で基準配分します。
- 3)各資産につき、上記の基本アロケーションにおける各資産毎の比率に一定の変動幅を設けます。市況動向等に応じて、基本アロケーションは1年に1回程度、若干の見直しを行う場合があります。
- 4)実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。ただし、運用効率の向上をはかるため、為替のエクスポージャーのコントロールを行う場合があります。
- 5)投資信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引ならびに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。また、有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。
- 6)投資信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格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を行うことができます。

- 7) 投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡し取引および為替先渡し取引を行うことができます。

（参考）「住信 国内株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、わが国の株式を中心に投資を行い、東証株価指数（TOPIX）と連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第17項に規定する取引所金融商品市場ならびに金融商品取引法第2条第8項第3号ロに規定する外国金融商品市場および当該市場を開設するものをいいます。以下同じ。）に上場されている株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

原則として東京証券取引所第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、東証株価指数（TOPIX）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

株式への組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

国内外において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができます。

3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は、行いません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の転換社債、ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

（参考）「住信 国内債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、わが国の公社債を中心に投資を行い、NOMURA-BPI総合と連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

NOMURA-BPI総合をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。

投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、スワップ取引および金利先渡取引を行うことができます。

3. 運用制限

同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資は、行いません。

(参考)「住信 外国株式インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、日本を除く世界の主要国の株式市場の動きをとらえることをめざして、MSCIコクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

原則として、MSCIコクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）を構成している国の株式を主要投資対象とします。

(2)投資態度

原則としてMSCIコクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）を構成している国の株式に分散投資を行い、MSCIコクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

株式の組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。

外貨建資産に対する為替ヘッジは、原則として行いません。

運用の効率化をはかるため、株価指数先物取引等を活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

有価証券等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、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、および通貨に係る選択権取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、通貨に係る先物取引、および通貨に係る先物オプション取引と類似の取引を行うことができます。

ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

投資信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに為替変動リスクを回避するため、異なった通

貨を一定の条件のもとに交換する取引を行うことができます。

投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、為替先渡取引を行うことができます。

3. 運用制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の株式への投資は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

（参考）「住信 外国債券インデックス マザーファンド」の概要

1. 基本方針

この投資信託は、日本を除く世界の主要国の公社債を中心に投資を行い、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標として運用を行います。

2. 運用方法

(1)投資対象

日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

運用の効率化をはかるため、債券先物取引等を活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えることがあります。

ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたとき等ならびに投資信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

有価証券等の価格変動リスクを回避するため、国内において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引ならびに外国の市場における有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利に係る先物取引および金利に係るオプション取引と類似の取引を行うことができます。また、投資信託財産の効率的な運用に資するため、国内において行われる通貨に係る先物取引、通貨に係る選択権取引ならびに外国の市場における通貨に係る先物取引、通貨に係る先物オプション取引を行うことができます。

投資信託財産に属する資産の効率的な運用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を行うことができます。

投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことができます。

3. 運用制限

同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。

投資信託証券への投資は、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。

外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

(2)【投資対象】

(イ) 本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。

1. 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、投資信託約款第23条、第24条および第25条に定めるものに限ります。）

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

(ロ) 委託者は、信託金を主として次に掲げる第1号から第4号までの住信アセットマネジメント株式会社を委託者とし、住友信託銀行株式会社を受託者として締結されたマザーファンドの受益証券ならびに第5号から第26号までの有価証券（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. 住信 国内株式インデックス マザーファンド

2. 住信 国内債券インデックス マザーファンド

3. 住信 外国株式インデックス マザーファンド

4. 住信 外国債券インデックス マザーファンド

5. 株券または新株引受権証書

6. 国債証券

7. 地方債証券

8. 特別の法律により法人の発行する債券

9. 社債券（新株引受権証券と社債券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。）

10. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（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。）

11. 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。）

12. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（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。）

13. 資産の流動化に関する法律に規定す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。）

14. コマーシャル・ペーパー

15. 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

16. 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

17. 証券投資信託または外国証券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。）

18. 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。）

19. 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。）

20. 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

価証券に係るものに限ります。）

21. 預託証券（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。）
22. 外国法人が発行する譲渡性預金証券
23. 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。）
24. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
25. 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
26. 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5号の証券または証書、第16号ならびに第21号の証券または証書のうち第5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6号から第10号までの証券および第16号ならびに第21号の証券または証書のうち第6号から第10号までの証券の性質を有するもの、および第18号に記載する証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、第17号の証券および第18号の証券（「投資法人債券」を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

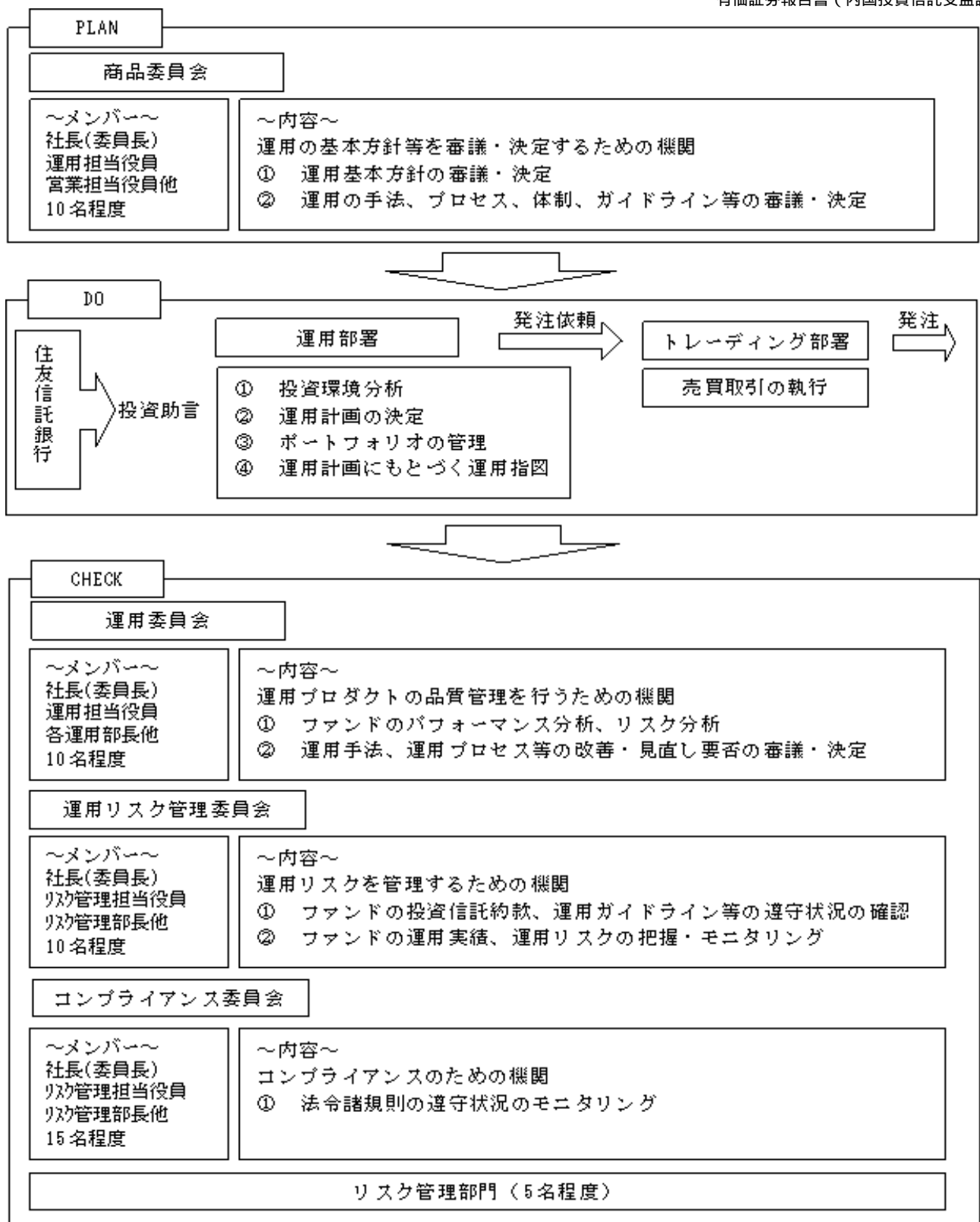
(八) 委託者は、信託金を、前記(ロ)に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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

(二) 前記(ロ)の規定にかかわらず、本ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を前記(八)第1号から第4号に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

(3) 【運用体制】

実質的な運用を行う各マザーファンドの運用体制は、以下の通りであり、そのベビーファンドである本ファンドも同様の運用体制となっております。記載された体制、会議・部署の名称、人員等は、本書提出日現在のものであり、今後変更されることがあります。



(4) 【分配方針】

(イ) 分配方針

毎決算時に、原則として以下の方針にもとづき、収益分配を行います。

分配対象額の範囲

経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

分配対象額についての分配方針

委託者が、基準価額水準等を勘案して分配金額を決定します。

留保益の運用方針

留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断にもとづき、元本部分と同一の運用を行います。

(ロ) 収益の分配

投資信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

- 1) 配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、投資信託財産に係る会計監査費用（消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）を含みます。）、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
- 2) 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、投資信託財産に係る会計監査費用（消費税等を含みます。）、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補填した後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

毎計算期末において、投資信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

(5) 【投資制限】

(イ) 投資信託約款にもとづく投資制限

株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の60%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

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、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

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、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

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、投資信託財産の純資産総額の5%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

外貨建資産への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の30%以下とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

委託者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、取引所に上場され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、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。前文の規定にかかわらず、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されることが確認できるものについては、委託者が投資することを指図することができるものとし、（投資信託約款第19条）

委託者は、投資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、信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社が発行する株券について行うことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとし、（投資信託約款第22条）

1. 投資信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券

2. 株式分割により取得する株券
3. 有償増資により取得する株券
4. 売出しにより取得する株券
5. 投資信託財産に属する転換社債の転換請求および転換社債型新株予約権付社債の新株予約権の行使により取得可能な株券
6. 投資信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、ならびに投資信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前号に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

委託者は、投資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。）ならびに委託者が適当と認める外国の取引所等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扱うものとします。（以下同じ。）委託者は、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委託者が適当と認める外国の取引所等における通貨に係る先物取引および先物オプション取引を行うことを指図することができます。また、委託者は、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委託者が適当と認める外国の取引所等におけるこれらの取引と類似の取引を行うことを指図することができます。（投資信託約款第23条）

委託者は、投資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。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、本ファンドの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。スワップ取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの投資信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。（投資信託約款第24条）

委託者は、投資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を指図することができます。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本ファンドの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可能なものについてはこの限りではありません。金利先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る金利先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産に係るヘッジ対象とする金利商品（以下「ヘッジ対象金利商品」といいます。）の時価総額と、マザーファンドの投資信託財産に係るヘッジ対象金利商品の時価総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額を超えないものとします。また、為替先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額と、マザーファンドの投資信託財産に係る為替先渡取引の想定元本の総額のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額が、投資信託財産の時価総額を超えないものとします。（投資信託約款第25条）

委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。（投資信託約款第26条）

1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、投資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. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、投資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。

委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、投資信託財産の計算においてする投資信託財産に属さない公社債を売付ける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、公社債（投資信託財産により借入れた公社債を含みます。）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、売付けの指図は、当該売付けに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。（投資信託約款第27条）

委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができ、この指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。（投資信託約款第28条）

委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、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。この予約取引の指図は、投資信託財産に係る為替の買予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の買予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額と、投資信託財産に係る為替の売予約とマザーファンドの投資信託財産に係る為替の売予約のうち投資信託財産に属するとみなした額との合計額との差額が、投資信託財産の純資産総額を超えないものとします。（投資信託約款第31条）

委託者は、投資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（一部解約に伴う支払資金の手当のために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。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。また、一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資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投資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投資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、解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。また、収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資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。なお、借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。（投資信託約款第39条）

前記 から における「実質投資割合」とは、本ファンドの投資信託財産の純資産総額に対する、本ファンドの投資信託財産に属する前記 から に掲げる当該各資産の時価総額とマザーファンドの投資信託財産に属する当該各資産の時価総額のうち本ファンドの投資信託財産に属するとみなした額の合計額の割合をいいます。また、「本ファンドの投資信託財産に属するとみなした額」とは、本ファンドの投資信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該各資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。前記 、 および における「投資信託財産に属するとみなした額」も同様です。

（ロ）法律等で規制される取引等

委託者は、「金融商品取引法」および「投資信託及び投資法人に関する法律」等関係法令を遵守し、受益者のため忠実に、また受益者に対し善良な管理者の注意をもって、投資信託財産の運用の指図その他の業務を遂行しなければなりません。関係法令に定める運用上の禁止行為または規制事項のうち後記される利害関係人との取引制限を除く主なものは、以下の通りです。

< 同一の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）

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、投資信託財産として有する同一の法人の発行する株式に係る議決権の総数が、当該法人の総発行株式の数に係る議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数を超えることとなる場合には、かかる株式を取得することを受託会社に指図してはならない。

<デリバティブ取引に係る投資制限>(金融商品取引業等に関する内閣府令)

投資信託財産に関し、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係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者が定めた合理的な方法により算出した額が当該投資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係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てはならない。

3【投資リスク】

(イ)本ファンドのもつ主なリスク

投資信託商品はリスク商品であり、投資元本は保証されていません。また、収益や利回り等も未確定の商品です。したがって、以下に記載する本ファンドのリスク要因を充分にご理解頂いたうえ、本ファンドの受益権への取得申込みを行ってください。なお、本ファンドは、預貯金や保険契約とは異なり、預金保険・貯金保険・保険契約者保護機構による保護の対象ではなく、また、第一種金融商品取引業を行う者以外でご購入頂いた場合は、投資者保護基金の保護の対象ではありません。

本ファンドは値動きのある有価証券等に投資しますので、基準価額は変動します。したがって、投資者の皆様は投資元本は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

信託財産に生じた利益および損失は、すべて投資者の皆様へ帰属します。

投資信託は預貯金と異なります。

基準価額の変動要因

1)株価変動リスク

株式の価格は、発行者の業績、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や国内外の経済情勢等により変動し、基準価額の変動要因となります。

2)債券価格変動リスク

債券の価格は、一般的に金利低下(上昇)局面では値上がり(値下がり)します。また、発行者の財務状況の変化等およびそれらに関する外部評価の変化や国内外の経済情勢等により変動し、基準価額の変動要因となります。

3)為替変動リスク

為替相場は、各国の経済状況、政治情勢等の様々な要因により変動します。投資先の通貨に対して円高となった場合には、基準価額の下落要因となります。

基準価額の変動要因は、上記に限定されるものではありません。

その他の留意点

1)本ファンドは、ファミリーファンド方式で運用するため、マザーファンドに対し、同じマザーファンドに投資する他のベビーファンドによる追加設定および一部解約等があり、マザーファンドにおいて有価証券の売買等が発生した場合、基準価額に影響を与えることがあります。

2)本ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定(いわゆるクーリング・オフ)の適用はありません。

3)分配金は信託財産から支払われるため、分配金支払い後の信託財産はその相当額が減少することとなり、基準価額が下落する要因となります。

本ファンドは、計算期間中に発生した運用収益(経費控除後の配当等収益や売買益等)を超えて分配を行う場合があります。分配金の水準は必ずしも当該計算期間の収益率を示すものではありません。またこの場合、当期決算日の基準価額は前期決算日の基準価額と比べて下落することになります。

受益者の個別元本の状況によっては、分配金の一部または全部が、実質的に元本の一部払戻しに相当する場合があります。

(ロ)リスクの管理体制

委託者におけるリスクマネジメント体制

- ・委託者では、運用各部から独立した部署によって、ファンドの運用状況や運用ガイドライン、法令等の遵守状況についてモニタリングを行っています（運用を再委託しているファンドも含まれます。）。
- ・モニタリング結果は、原則月1回（必要に応じ随時）開催される運用リスクの管理に関する委員会に報告され、委員会は適切な運用リスク管理に必要な措置を講じることとしています。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

ありません。

(2)【換金（解約）手数料】

ありません。

(3)【信託報酬等】

信託報酬総額	配分		
	委託者	指定販売会社	受託者
純資産総額に対して 年率0.3045% (税抜 0.29%)	純資産総額に対して 年率0.1575% (税抜 0.15%)	純資産総額に対して 年率0.1155% (税抜 0.11%)	純資産総額に対して 年率0.0315% (税抜 0.03%)

「税抜」における「税」とは、消費税等をいいます。以下同じ。

信託報酬は信託期間を通じて毎日計算し、投資信託財産の費用として計上します。

上記により日々計算された信託報酬は、毎計算期間の最初の6ヶ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき、投資信託財産中から支弁するものとします。マザーファンドにおいては、信託報酬はかかりません。

(4)【その他の手数料等】

- (イ) 投資信託財産に関する租税、信託事務の処理に関する諸費用（消費税等を含みます。）ならびに受託者の立替えた立替金の利息等は、受益者の負担とし、投資信託財産中から支弁します。投資信託約款の定めにもとづいて、資金の借入れを行う場合の利息も同様です。負担の水準・計算方法は、個別の費用・税金等により異なり、実費での負担（運用状況等により変動するため、事前に料率、上限額等を示すことができません。）となります。（マザーファンドにおいて負担する場合を含みます。）
- (ロ) 証券取引に伴う売買委託手数料等の手数料（消費税等を含みます。）または税金、先物・オプション取引に要する費用（消費税等を含みます。）、組入資産の保管に要する費用（消費税等を含みます。）等は、受益者の負担とし、投資信託財産中から支弁します。負担の水準・計算方法は、個別の費用・税金等により異なり、実費での負担（運用状況等により変動するため、事前に料率、上限額等を示すことができません。）となります。（マザーファンドにおいて負担する場合を含みます。）
- (ハ) 投資信託財産に係る会計監査費用（消費税等を含みます。）は、毎計算期末または信託終了のとき、投資信託財産中から支弁します。

(5)【課税上の取扱い】

- ・本ファンドは、課税上は、株式投資信託として取り扱われます。なお、配当控除および益金不算入制度の適用はありません。
- ・本ファンドは、確定拠出年金法（平成13年法律第88号）にもとづく確定拠出年金制度専用ファンドです。税法もしくは確定拠出年金法が改正された場合は、下記の内容が変更されることがあります。受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会である場合は、所得税および地方税はかかりません。なお、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。
- ・税金の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

(平成23年10月31日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
住信 国内株式インデックス マザーファンド	日本	10,025,895,445	34.29
住信 国内債券インデックス マザーファンド	日本	11,512,514,998	39.37
住信 外国株式インデックス マザーファンド	日本	4,622,910,635	15.81
住信 外国債券インデックス マザーファンド	日本	1,453,325,550	4.97
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,624,380,558	5.56
合計(純資産総額)		29,239,027,186	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、本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。

(参考情報)

住信 国内株式インデックス マザーファンドの投資状況

(平成23年10月31日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	115,457,168,510	98.18
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,137,047,941	1.82
合計(純資産総額)		117,594,216,451	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、マザー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。

住信 国内債券インデックス マザーファンドの投資状況

(平成23年10月31日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	135,377,859,900	75.88
	ポーランド	99,476,000	0.06
	小計	135,477,335,900	75.93
地方債証券	日本	11,735,460,215	6.58
特殊債券	日本	17,393,903,340	9.75
	スウェーデン	99,564,000	0.06
	小計	17,493,467,340	9.80
社債券	日本	12,223,214,031	6.85
	アメリカ	500,200,000	0.28
	オーストラリア	401,969,000	0.23
	イギリス	195,512,000	0.11
	オランダ	102,015,000	0.06

	小計	13,422,910,031	7.52
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		285,474,800	0.16
合計(純資産総額)		178,414,648,286	100.00

(注1) 国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2) 投資比率とは、マザー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。

住信 外国株式インデックス マザーファンドの投資状況

(平成23年10月31日現在)

資産の種類	国 / 地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	65,453,580,419	50.50
	イギリス	11,657,768,846	8.99
	カナダ	7,085,692,416	5.47
	スイス	5,466,726,372	4.22
	フランス	5,201,786,443	4.01
	ドイツ	4,915,180,935	3.79
	オーストラリア	4,897,372,706	3.78
	オランダ	2,955,794,491	2.28
	スペイン	2,074,367,635	1.60
	スウェーデン	1,769,949,673	1.37
	イタリア	1,412,451,026	1.09
	香港	1,316,341,345	1.02
	シンガポール	937,973,458	0.72
	アイルランド	764,655,275	0.59
	デンマーク	590,870,175	0.46
	アンティル	585,586,711	0.45
	フィンランド	567,561,528	0.44
	バミューダ	541,974,842	0.42
	ベルギー	540,781,423	0.42
	ノルウェー	461,789,599	0.36
	イスラエル	371,893,946	0.29
	ルクセンブルグ	284,946,571	0.22
	ジャージー	176,865,867	0.14
	オーストリア	154,434,656	0.12
	ポルトガル	133,115,099	0.10
	ケイマン島	99,844,944	0.08
	ニュージーランド	72,593,780	0.06
	マン島	49,637,369	0.04
	ギリシャ	47,589,272	0.04
ガーンジー	38,051,848	0.03	
リベリア	24,425,442	0.02	
モーリシャス	20,736,681	0.02	
小計		120,672,340,793	93.10
投資信託受益証券	パナマ	93,876,855	0.07
	オーストラリア	26,031,958	0.02

	シンガポール	20,344,842	0.02
	小計	140,253,655	0.11
投資証券	アメリカ	1,384,538,967	1.07
	オーストラリア	325,104,260	0.25
	フランス	163,420,052	0.13
	イギリス	150,593,142	0.12
	香港	44,135,591	0.03
	シンガポール	32,979,722	0.03
	カナダ	18,138,725	0.01
	オランダ	18,094,389	0.01
	小計	2,137,004,848	1.65
	現金・預金・その他の資産(負債控除後)		6,660,665,184
合計(純資産総額)		129,610,264,480	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、マザー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。

住信 外国債券インデックス マザーファンドの投資状況

(平成23年10月31日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	81,592,761,604	38.74
	ドイツ	21,798,014,989	10.35
	フランス	20,965,850,935	9.96
	イタリア	19,335,550,513	9.18
	イギリス	17,595,443,120	8.36
	スペイン	9,087,205,562	4.32
	カナダ	5,982,845,834	2.84
	オランダ	5,511,578,938	2.62
	ベルギー	5,511,541,524	2.62
	オーストリア	3,741,962,124	1.78
	デンマーク	1,964,308,711	0.93
	メキシコ	1,824,367,480	0.87
	ポーランド	1,649,871,874	0.78
	オーストラリア	1,617,063,663	0.77
	アイルランド	1,520,932,985	0.72
	スウェーデン	1,485,308,154	0.71
	フィンランド	1,340,298,047	0.64
	マレーシア	1,048,754,539	0.50
	スイス	988,310,962	0.47
	シンガポール	861,517,912	0.41
ノルウェー	645,678,968	0.31	

	小計	206,069,168,438	97.85
特殊債券	オーストラリア	1,311,021,434	0.62
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,212,463,111	1.53
合計(純資産総額)		210,592,652,983	100.00

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率とは、マザー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。

(2)【投資資産】(平成23年10月31日現在)

【投資有価証券の主要銘柄】

a. 投資有価証券の主要銘柄

国/地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託 受益証券	住信 国内債券インデックス マザーファンド	9,434,940,992	1.2224	11,534,188,184	1.2202	11,512,514,998	39.37
日本	親投資信託 受益証券	住信 国内株式インデックス マザーファンド	16,734,928,134	0.5968	9,987,612,211	0.5991	10,025,895,445	34.29
日本	親投資信託 受益証券	住信 外国株式インデックス マザーファンド	5,276,090,659	0.7715	4,070,636,069	0.8762	4,622,910,635	15.81
日本	親投資信託 受益証券	住信 外国債券インデックス マザーファンド	835,724,871	1.6944	1,416,063,866	1.7390	1,453,325,550	4.97

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	94.44
合計	94.44

(注)投資比率は、本ファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

c. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(参考情報)

住信 国内株式インデックス マザーファンドの投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a. 投資有価証券の主要銘柄

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,424,400	3,316.61	4,724,179,284	2,644.00	3,766,113,600	3.20
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	8,283,700	372.49	3,085,595,413	345.00	2,857,876,500	2.43
日本	株式	キヤノン	電気機器	688,700	3,818.34	2,629,690,758	3,600.00	2,479,320,000	2.11
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	935,400	3,018.60	2,823,598,440	2,406.00	2,250,572,400	1.91
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	503,900	3,836.06	1,932,992,844	4,030.00	2,030,717,000	1.73
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	827,600	2,333.49	1,931,196,324	2,216.00	1,833,961,600	1.56
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	14,053,600	125.82	1,768,223,952	111.00	1,559,949,600	1.33
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	435,000	3,796.06	1,651,286,100	3,540.00	1,539,900,000	1.31
日本	株式	ファナック	電気機器	115,400	12,287.77	1,418,008,658	12,930.00	1,492,122,000	1.27
日本	株式	三菱商事	卸売業	796,900	2,015.16	1,605,881,004	1,641.00	1,307,712,900	1.11
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	495,800	3,025.92	1,500,251,136	2,588.00	1,283,130,400	1.09
日本	株式	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	情報・通信業	9,016	148,707.34	1,340,745,377	139,300.00	1,255,928,800	1.07
日本	株式	ソニー	電気機器	691,800	2,074.69	1,435,271,837	1,682.00	1,163,607,600	0.99
日本	株式	三井物産	卸売業	944,500	1,358.48	1,283,084,360	1,165.00	1,100,342,500	0.94
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	2,754	317,059.31	873,181,356	395,500.00	1,089,207,000	0.93
日本	株式	小松製作所	機械	550,100	2,403.94	1,322,407,394	1,976.00	1,086,997,600	0.92
日本	株式	日立製作所	電気機器	2,490,000	454.32	1,131,256,800	427.00	1,063,230,000	0.90
日本	株式	三菱地所	不動産業	766,000	1,413.54	1,082,771,640	1,349.00	1,033,334,000	0.88
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	1,400,700	792.08	1,109,466,456	735.00	1,029,514,500	0.88
日本	株式	パナソニック	電気機器	1,266,700	934.08	1,183,199,136	809.00	1,024,760,300	0.87
日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,698	570,704.70	969,056,580	579,000.00	983,142,000	0.84
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	457,800	2,108.77	965,394,906	2,106.00	964,126,800	0.82
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	192,800	4,656.12	897,699,936	4,765.00	918,692,000	0.78
日本	株式	信越化学工業	化学	208,300	4,118.81	857,948,700	4,080.00	849,864,000	0.72
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,109,000	887.58	984,326,220	735.00	815,115,000	0.69
日本	株式	東芝	電気機器	2,334,000	415.90	970,712,740	349.00	814,566,000	0.69
日本	株式	国際石油開発帝石	鉱業	1,510	561,865.18	848,416,430	526,000.00	794,260,000	0.68
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	415,400	2,170.91	901,796,014	1,892.00	785,936,800	0.67
日本	株式	任天堂	その他製品	63,400	18,132.16	1,149,578,944	11,960.00	758,264,000	0.64
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	257,800	3,099.08	798,942,824	2,887.00	744,268,600	0.63

(注1) 国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2) 投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
株式	98.18
合計	98.18

(注) 投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

c. 投資株式の業種別投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.75
		建設業	2.37
		食料品	3.54
		繊維製品	0.92
		パルプ・紙	0.40
		化学	6.00
		医薬品	4.80
		石油・石炭製品	0.86
		ゴム製品	0.79
		ガラス・土石製品	1.17
		鉄鋼	1.89
		非鉄金属	1.18
		金属製品	0.71
		機械	5.02
		電気機器	14.00
		輸送用機器	9.40
		精密機器	1.40
		その他製品	1.67
		電気・ガス業	2.99
		陸運業	3.94
		海運業	0.38
		空運業	0.30
		倉庫・運輸関連業	0.23
		情報・通信業	6.67
		卸売業	5.16
		小売業	4.09
		銀行業	9.02
		証券、商品先物取引業	1.08
		保険業	2.25
その他金融業	0.81		
不動産業	2.37		
サービス業	1.90		
合計		98.18	

(注) 投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	資産の名称	取引所	買建 / 売建	通貨	数量	簿価金額 (現地通貨)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	TOPIX先物	東京証券取引所	買建	円	292	2,180,639,760	2,216,280,000	2,216,280,000	1.88

(注) 評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

住信 国内債券インデックス マザーファンドの投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a. 投資有価証券の主要銘柄

国/ 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
日本	国債証券	第87回利付国債 (5年)	2,140,000,000	100.77	2,156,478,000	100.86	2,158,596,600	0.5	2014/12/20	1.21
日本	国債証券	第305回利付国債 (10年)	1,960,000,000	102.94	2,017,758,600	104.05	2,039,438,800	1.3	2019/12/20	1.14
日本	国債証券	第285回利付国債 (10年)	1,860,000,000	106.78	1,986,108,000	106.75	1,985,605,800	1.7	2017/03/20	1.11
日本	国債証券	第312回利付国債 (10年)	1,830,000,000	100.99	1,848,117,000	102.18	1,869,985,500	1.2	2020/12/20	1.05
日本	国債証券	第89回利付国債 (5年)	1,760,000,000	100.27	1,764,910,400	100.46	1,768,201,600	0.4	2015/06/20	0.99
日本	国債証券	第306回利付国債 (10年)	1,680,000,000	103.53	1,739,407,000	104.62	1,757,716,800	1.4	2020/03/20	0.99
日本	国債証券	第288回利付国債 (10年)	1,640,000,000	106.89	1,752,996,000	107.00	1,754,849,200	1.7	2017/09/20	0.98
日本	国債証券	第296回利付国債 (10年)	1,620,000,000	105.39	1,707,449,800	106.01	1,717,410,600	1.5	2018/09/20	0.96
日本	国債証券	第69回利付国債 (5年)	1,690,000,000	101.14	1,709,333,600	100.87	1,704,821,300	0.9	2012/12/20	0.96
日本	国債証券	第85回利付国債 (5年)	1,670,000,000	101.46	1,694,408,200	101.44	1,694,114,800	0.7	2014/09/20	0.95
日本	国債証券	第284回利付国債 (10年)	1,570,000,000	106.67	1,674,811,100	106.55	1,672,929,200	1.7	2016/12/20	0.94
日本	国債証券	第309回利付国債 (10年)	1,620,000,000	100.94	1,635,365,400	101.88	1,650,553,200	1.1	2020/06/20	0.93
日本	国債証券	第289回利付国債 (10年)	1,550,000,000	105.63	1,637,265,000	105.91	1,641,636,000	1.5	2017/12/20	0.92
日本	国債証券	第310回利付国債 (10年)	1,620,000,000	99.53	1,612,392,400	100.78	1,632,636,000	1.0	2020/09/20	0.92
日本	国債証券	第70回利付国債 (5年)	1,610,000,000	101.13	1,628,303,700	100.92	1,624,876,400	0.8	2013/03/20	0.91
日本	国債証券	第264回利付国債 (10年)	1,550,000,000	104.05	1,612,925,000	103.73	1,607,861,500	1.5	2014/09/20	0.90
日本	国債証券	第88回利付国債 (5年)	1,590,000,000	100.73	1,601,622,900	100.85	1,603,546,800	0.5	2015/03/20	0.90

日本	国債証券	第84回利付国債 (5年)	1,530,000,000	101.43	1,551,879,000	101.35	1,550,777,400	0.7	2014/06/20	0.87
日本	国債証券	第97回利付国債 (5年)	1,470,000,000	100.13	1,471,931,200	100.18	1,472,660,700	0.4	2016/06/20	0.83
日本	国債証券	第313回利付国債 (10年)	1,350,000,000	101.78	1,374,078,000	102.83	1,388,272,500	1.3	2021/03/20	0.78
日本	国債証券	第280回利付国債 (10年)	1,250,000,000	107.33	1,341,668,600	107.05	1,338,175,000	1.9	2016/06/20	0.75
日本	国債証券	第269回利付国債 (10年)	1,250,000,000	103.73	1,296,680,000	103.54	1,294,325,000	1.3	2015/03/20	0.73
日本	国債証券	第273回利付国債 (10年)	1,220,000,000	104.89	1,279,658,000	104.63	1,276,583,600	1.5	2015/09/20	0.72
日本	国債証券	第92回利付国債 (5年)	1,260,000,000	99.76	1,257,051,600	100.01	1,260,239,400	0.3	2015/09/20	0.71
日本	国債証券	第282回利付国債 (10年)	1,160,000,000	106.48	1,235,182,700	106.34	1,233,602,000	1.7	2016/09/20	0.69
日本	国債証券	第303回利付国債 (10年)	1,140,000,000	103.98	1,185,394,800	104.99	1,196,886,000	1.4	2019/09/20	0.67
日本	国債証券	第315回利付国債 (10年)	1,170,000,000	101.00	1,181,733,100	101.71	1,190,018,700	1.2	2021/06/20	0.67
日本	国債証券	第81回利付国債 (5年)	1,140,000,000	101.63	1,158,641,400	101.50	1,157,100,000	0.8	2014/03/20	0.65
日本	国債証券	第256回利付国債 (10年)	1,110,000,000	103.05	1,143,855,000	102.64	1,139,403,900	1.4	2013/12/20	0.64
日本	国債証券	第300回利付国債 (10年)	1,010,000,000	105.09	1,061,409,000	105.98	1,070,398,000	1.5	2019/03/20	0.60

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	75.93
地方債証券	6.58
特殊債券	9.80
社債券	7.52
合計	99.84

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

c. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

住信 外国株式インデックス マザーファンドの投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a. 投資有価証券の主要銘柄

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	投資 比率 (%)
アメリカ	株式	EXXON MOBIL	エネルギー	359,954	6,372.27	2,293,726,834	6,335.06	2,280,333,786	1.76
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	67,573	26,644.03	1,800,417,376	31,484.86	2,127,526,613	1.64
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービ ス	88,504	13,064.59	1,156,268,835	14,574.23	1,289,878,315	1.00
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	146,890	7,994.32	1,174,286,722	8,524.50	1,252,165,273	0.97
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	253,191	4,850.98	1,228,226,114	4,618.93	1,169,472,138	0.90
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービ ス	554,572	1,939.10	1,075,372,179	2,097.69	1,163,322,911	0.90
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	774,951	1,489.59	1,154,361,399	1,341.18	1,039,354,594	0.80
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・パーソナル 用品	203,963	5,119.63	1,044,215,754	5,032.75	1,026,496,317	0.79
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	200,298	5,178.29	1,037,201,950	5,100.39	1,021,599,919	0.79
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	432,727	2,413.78	1,044,508,309	2,312.28	1,000,588,151	0.77
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	1,309,834	778.75	1,020,036,855	708.20	927,634,707	0.72
アメリカ	株式	PFIZER	医薬品・バイオテクノ ロジー・ライフサイエ ンス	577,344	1,612.14	930,761,719	1,541.00	889,689,990	0.69
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービ ス	18,486	40,872.73	755,573,418	46,660.88	862,573,120	0.67
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	290,361	3,291.83	955,820,534	2,852.64	828,297,580	0.64
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	3,746,655	211.53	792,537,940	218.36	818,130,975	0.63
イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	1,379,063	570.06	786,154,334	585.30	807,176,826	0.62
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	150,550	5,190.06	781,364,900	5,359.30	806,843,744	0.62
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービ ス	295,822	2,581.43	763,645,360	2,619.39	774,875,407	0.60
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	367,156	2,171.51	797,283,115	2,105.46	773,035,943	0.60
スイス	株式	NOVARTIS	医薬品・バイオテクノ ロジー・ライフサイエ ンス	170,532	4,786.00	816,166,221	4,519.98	770,802,508	0.59
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装 置	387,423	1,722.08	667,174,239	1,942.19	752,451,013	0.58
オースト ラリア	株式	BHP BILLITON LTD	素材	234,665	3,619.34	849,332,512	3,204.69	752,029,212	0.58
オランダ	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	262,697	2,666.62	700,513,304	2,818.79	740,490,303	0.57
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	129,950	5,472.23	711,117,295	5,607.32	728,672,533	0.56
スイス	株式	ROCHE HOLDING GENUSS	医薬品・バイオテクノ ロジー・ライフサイエ ンス	51,337	13,209.58	678,140,258	13,051.74	670,037,433	0.52

イギリス	株式	GLAXOSMITHKLINE	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	377,015	1,648.89	621,659,959	1,733.87	653,696,958	0.50
フランス	株式	TOTAL SA	エネルギー	155,107	4,279.42	663,768,884	4,210.12	653,019,276	0.50
アメリカ	株式	WAL-MART STORES	食品・生活必需品小売り	139,559	4,236.28	591,211,499	4,443.41	620,118,205	0.48
アメリカ	株式	MERCK & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	225,540	2,790.87	629,453,076	2,729.80	615,679,655	0.48
アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	電気通信サービス	206,724	2,843.50	587,819,945	2,925.73	604,819,125	0.47

(注1)国/地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
株式	93.10
投資信託受益証券	0.11
投資証券	1.65
合計	94.86

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

c. 投資株式の業種別投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
株式	外国	エネルギー	12.01
		素材	7.34
		資本財	6.98
		商業・専門サービス	0.76
		運輸	1.68
		自動車・自動車部品	1.31
		耐久消費財・アパレル	1.23
		消費者サービス	1.53
		メディア	2.35
		小売	2.55
		食品・生活必需品小売り	2.24
		食品・飲料・タバコ	6.44
		家庭用品・パーソナル用品	1.65
		ヘルスケア機器・サービス	2.64
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.15
		銀行	7.06
		各種金融	4.54
保険	3.86		
不動産	0.57		

	ソフトウェア・サービス	5.58
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.23
	電気通信サービス	4.12
	公益事業	3.70
	半導体・半導体製造装置	1.59
合計		93.10

(注)投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該業種の時価の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

資産の種類	資産の名称	取引所	買建 / 売建	通貨	数量	簿価金額 (現地通貨)	評価金額 (現地通貨)	評価金額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数 先物取引	S&P 500 FUTU	シカゴ商業取引所	買建	アメリカドル	80	23,029,815	25,618,000	1,991,799,500	1.54
	S&P/TSE 60	モントリオール取引所	買建	カナダドル	18	2,395,253	2,571,840	201,169,324	0.16
	DJ EURO STOXX	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	買建	ユーロ	222	4,749,951	5,452,320	598,174,027	0.46
	SPI 200 FUTU	シドニー先物取引所	買建	オーストラリアドル	26	2,600,958	2,826,850	234,147,985	0.18
	FTSE 100	ロンドン国際金融先物オプション取引所	買建	イギリスポンド	54	2,766,205	3,060,720	383,447,001	0.30
	SWISS MKT IX	ユーレックス・チューリッヒ取引所	買建	スイスフラン	27	1,497,536	1,581,120	142,221,744	0.11

(注) 評価にあたっては、知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

住信 外国債券インデックス マザーファンドの投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a. 投資有価証券の主要銘柄

国 / 地域	種類	銘柄名	数量	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
アメリカ	国債証券	T 1.75% 07/31/15	27,000,000	7,907.41	2,135,002,851	8,067.47	2,178,217,886	1.750	2015/07/31	1.03
アメリカ	国債証券	T 1.375% 01/15/13	23,000,000	7,902.71	1,817,623,347	7,885.09	1,813,571,834	1.375	2013/01/15	0.86
アメリカ	国債証券	T 1.75% 01/31/14	22,600,000	8,029.08	1,814,573,662	8,017.66	1,811,992,302	1.750	2014/01/31	0.86
アメリカ	国債証券	T 3.375% 07/31/13	21,000,000	8,250.97	1,732,705,761	8,196.39	1,721,243,726	3.375	2013/07/31	0.82
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/21	18,000,000	8,822.14	1,587,985,772	8,705.87	1,567,057,320	3.625	2021/02/15	0.74
アメリカ	国債証券	T 2.625% 08/15/20	18,400,000	7,563.61	1,391,705,562	8,089.94	1,488,550,472	2.625	2020/08/15	0.71
アメリカ	国債証券	T 2.625% 11/15/20	17,500,000	7,522.91	1,316,510,992	8,063.22	1,411,063,790	2.625	2020/11/15	0.67
アメリカ	国債証券	T 4.25% 11/15/40	15,000,000	7,767.59	1,165,139,716	9,054.83	1,358,225,688	4.250	2040/11/15	0.64
アメリカ	国債証券	T 2.75% 05/31/17	16,000,000	8,075.97	1,292,156,409	8,373.91	1,339,826,875	2.750	2017/05/31	0.64
アメリカ	国債証券	T 0.625% 02/28/13	16,700,000	7,806.28	1,303,649,134	7,817.97	1,305,601,796	0.625	2013/02/28	0.62

アメリカ	国債証券	T 1.875% 06/30/15	15,900,000	7,956.01	1,265,005,862	8,105.74	1,288,812,849	1.875	2015/06/30	0.61
フランス	国債証券	FRTR 3.25% 04/25/16	11,100,000	11,374.90	1,262,614,210	11,556.85	1,282,810,505	3.250	2016/04/25	0.61
アメリカ	国債証券	T 1.125% 12/15/12	16,200,000	7,870.51	1,275,023,722	7,856.09	1,272,686,715	1.125	2012/12/15	0.60
アメリカ	国債証券	T 2.875% 01/31/13	15,800,000	8,103.15	1,280,299,189	8,034.97	1,269,526,296	2.875	2013/01/31	0.60
アメリカ	国債証券	T 0.5% 10/15/13	16,200,000	7,760.42	1,257,188,343	7,806.88	1,264,716,119	0.500	2013/10/15	0.60
アメリカ	国債証券	T 2% 11/30/13	15,000,000	8,039.61	1,205,942,308	8,045.30	1,206,795,415	2.000	2013/11/30	0.57
アメリカ	国債証券	T 2.375% 02/28/15	14,500,000	8,127.91	1,178,547,261	8,232.69	1,193,740,397	2.375	2015/02/28	0.57
アメリカ	国債証券	T 0.75% 12/15/13	15,000,000	7,796.86	1,169,530,078	7,844.85	1,176,728,033	0.750	2013/12/15	0.56
アメリカ	国債証券	T 2.75% 11/30/16	14,000,000	8,124.26	1,137,397,466	8,386.97	1,174,176,858	2.750	2016/11/30	0.56
アメリカ	国債証券	T 2.25% 01/31/15	14,000,000	8,095.11	1,133,315,591	8,196.24	1,147,474,592	2.250	2015/01/31	0.54
アメリカ	国債証券	T 2.125% 02/29/16	14,000,000	8,244.81	1,154,274,005	8,177.11	1,144,795,859	2.125	2016/02/29	0.54
アメリカ	国債証券	T 0.75% 09/15/13	14,200,000	7,814.21	1,109,618,439	7,842.87	1,113,688,841	0.750	2013/09/15	0.53
イタリア	国債証券	BTPS 4.75% 02/01/13	10,100,000	11,329.75	1,144,304,921	10,990.19	1,110,010,124	4.750	2013/02/01	0.53
アメリカ	国債証券	T 4.25% 08/15/15	12,500,000	8,704.35	1,088,044,433	8,795.77	1,099,471,555	4.250	2015/08/15	0.52
アメリカ	国債証券	T 4.0% 02/15/15	12,700,000	8,594.41	1,091,490,342	8,636.93	1,096,890,322	4.000	2015/02/15	0.52
スペイン	国債証券	SPGB 4.4% 01/31/15	9,900,000	10,922.43	1,081,320,959	11,049.99	1,093,949,128	4.400	2015/01/31	0.52
アメリカ	国債証券	T 3.875% 08/15/40	12,300,000	7,285.95	896,172,157	8,497.83	1,045,233,339	3.875	2040/08/15	0.50
アメリカ	国債証券	T 4.25% 08/15/14	12,000,000	8,658.67	1,039,041,203	8,593.50	1,031,220,118	4.250	2014/08/15	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.375% 08/31/14	12,500,000	8,136.71	1,017,089,968	8,190.47	1,023,809,570	2.375	2014/08/31	0.49
アメリカ	国債証券	T 3.625% 02/15/20	11,300,000	8,265.49	934,000,729	8,745.05	988,190,962	3.625	2020/02/15	0.47

(注1) 国 / 地域は、発行体の所在地によって記載しております。

(注2) 投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該銘柄の時価の比率です。

b. 投資有価証券の種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.85
特殊債券	0.62
合計	98.47

(注) 投資比率は、マザーファンドの純資産総額に対する当該有価証券の時価の比率です。

c. 投資株式の業種別投資比率

該当事項はありません。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

	純資産総額(円)	1口当たりの純資産額(円)
--	----------	---------------

第1期計算期間末 (平成14年 9月30日)	(分配付) 4,124,106 (分配落) 4,124,106	(分配付) 0.9588 (分配落) 0.9588
第2期計算期間末 (平成15年 9月30日)	(分配付) 189,469,449 (分配落) 189,469,449	(分配付) 1.0148 (分配落) 1.0148
第3期計算期間末 (平成16年 9月30日)	(分配付) 2,537,120,012 (分配落) 2,537,120,012	(分配付) 1.0839 (分配落) 1.0839
第4期計算期間末 (平成17年 9月30日)	(分配付) 7,195,918,445 (分配落) 7,195,918,445	(分配付) 1.2287 (分配落) 1.2287
第5期計算期間末 (平成18年10月 2日)	(分配付) 14,839,980,149 (分配落) 14,839,980,149	(分配付) 1.3402 (分配落) 1.3402
第6期計算期間末 (平成19年10月 1日)	(分配付) 21,751,220,154 (分配落) 21,751,220,154	(分配付) 1.3991 (分配落) 1.3991
第7期計算期間末 (平成20年 9月30日)	(分配付) 22,004,719,337 (分配落) 22,004,719,337	(分配付) 1.1653 (分配落) 1.1653
第8期計算期間末 (平成21年 9月30日)	(分配付) 24,136,002,365 (分配落) 24,136,002,365	(分配付) 1.1103 (分配落) 1.1103
第9期計算期間末 (平成22年 9月30日)	(分配付) 26,182,854,131 (分配落) 26,182,854,131	(分配付) 1.1002 (分配落) 1.1002
第10期計算期間末 (平成23年 9月30日)	(分配付) 28,473,019,736 (分配落) 28,473,019,736	(分配付) 1.0654 (分配落) 1.0654
平成22年10月末日	26,073,958,875	1.0885
11月末日	26,543,984,370	1.1100
12月末日	27,559,466,240	1.1339
平成23年 1月末日	28,104,031,922	1.1418
2月末日	28,691,612,642	1.1655
3月末日	28,630,075,062	1.1454
4月末日	28,463,956,970	1.1441
5月末日	28,527,876,595	1.1314
6月末日	28,973,965,607	1.1339
7月末日	29,484,510,251	1.1228
8月末日	28,422,288,102	1.0764
9月末日	28,473,019,736	1.0654
10月末日	29,239,027,186	1.0876

【分配の推移】

期 間	1口当たりの分配金(円)
第1期計算期間(平成13年10月 1日～平成14年 9月30日)	0.0000
第2期計算期間(平成14年10月 1日～平成15年 9月30日)	0.0000
第3期計算期間(平成15年10月 1日～平成16年 9月30日)	0.0000
第4期計算期間(平成16年10月 1日～平成17年 9月30日)	0.0000
第5期計算期間(平成17年10月 1日～平成18年10月 2日)	0.0000

第6期計算期間(平成18年10月3日～平成19年10月1日)	0.0000
第7期計算期間(平成19年10月2日～平成20年9月30日)	0.0000
第8期計算期間(平成20年10月1日～平成21年9月30日)	0.0000
第9期計算期間(平成21年10月1日～平成22年9月30日)	0.0000
第10期計算期間(平成22年10月1日～平成23年9月30日)	0.0000

【収益率の推移】

期 間	収益率(%)
第1期計算期間(平成13年10月1日～平成14年9月30日)	4.1
第2期計算期間(平成14年10月1日～平成15年9月30日)	5.8
第3期計算期間(平成15年10月1日～平成16年9月30日)	6.8
第4期計算期間(平成16年10月1日～平成17年9月30日)	13.4
第5期計算期間(平成17年10月1日～平成18年10月2日)	9.1
第6期計算期間(平成18年10月3日～平成19年10月1日)	4.4
第7期計算期間(平成19年10月2日～平成20年9月30日)	16.7
第8期計算期間(平成20年10月1日～平成21年9月30日)	4.7
第9期計算期間(平成21年10月1日～平成22年9月30日)	0.9
第10期計算期間(平成22年10月1日～平成23年9月30日)	3.2

(注1)収益率とは、各計算期間末の基準価額(分配付)から前計算期間末の基準価額(分配落)を控除した額を前計算期間末の基準価額(分配落)で除して得た数に100を乗じて得た数字です。

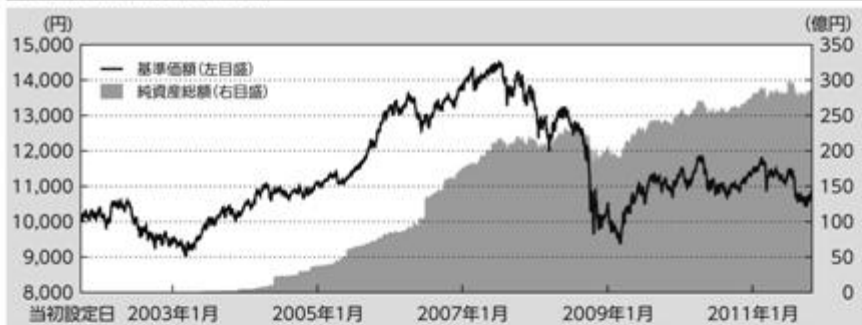
(注2)小数第2位を四捨五入しております。

(参考情報)

当初設定日：2001年10月1日

作成基準日：2011年10月31日

基準価額・純資産の推移



※上記グラフは当初設定日から作成基準日までを表示しております。

基準価額 10,876円

純資産総額 292億円

〈基準価額の騰落率〉

1ヶ月	2.08%
3ヶ月	-3.14%
6ヶ月	-4.94%
1年	-0.08%
3年	4.59%
5年	-19.14%
設定来	8.76%

※上記は作成基準日からの期間です。

分配の推移(1万口当たり、税引前)

設定来分配金合計額:0円

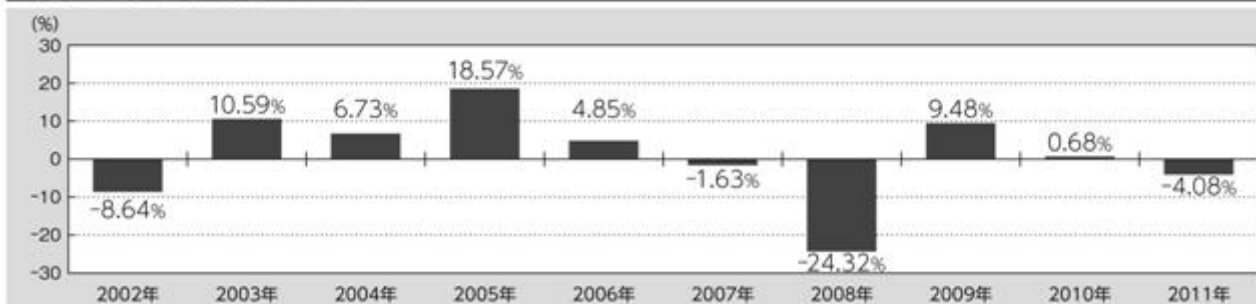
決算期	2007年10月	2008年9月	2009年9月	2010年9月	2011年9月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円

※分配金額は株価、金利、為替などの変動の影響を受けて変動し、分配対象額が少額の場合、分配を行わないことがあります。

主要な資産の状況

マザーファンド	投資比率	上位相入銘柄	国/地域	種類	業種	利率	償還期限	実質投資比率
住信 国内債券 インデックス マザーファンド	39.4%	第87回利付国債(5年)	日本	国債証券	-	0.5%	2014/12/20	0.5%
		第305回利付国債(10年)	日本	国債証券	-	1.3%	2019/12/20	0.5%
		第285回利付国債(10年)	日本	国債証券	-	1.7%	2017/3/20	0.4%
住信 国内株式 インデックス マザーファンド	34.3%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.1%
		三菱UFJフィナンシャルグループ	日本	株式	銀行業	-	-	0.8%
		キヤノン	日本	株式	電気機器	-	-	0.7%
住信 外国株式 インデックス マザーファンド	15.8%	EXXON MOBIL	米国	株式	エネルギー	-	-	0.3%
		APPLE INC	米国	株式	テクノロジーハードウェアおよび機器	-	-	0.3%
		INTL BUSINESS MACHINES CORP	米国	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.2%
住信 外国債券 インデックス マザーファンド	5.0%	T 1.75% 07/31/15	米国	国債証券	-	1.750%	2015/7/31	0.1%
		T 1.375% 01/15/13	米国	国債証券	-	1.375%	2013/1/15	0.0%
		T 1.75% 01/31/14	米国	国債証券	-	1.750%	2014/1/31	0.0%

年間収益率の推移(暦年ベース)



※2011年は年初から作成基準日までの収益率です。

※ファンドには、ベンチマークはありません。

記載された運用実績は過去のものであり、将来の運用成果を約束するものではありません。

最新の運用の内容等は、委託者のホームページでご確認いただけます。

(4) 【設定及び解約の実績】

期 間	設定口数(口)	解約口数(口)	受益権総口数(口)
第1期計算期間 (平成13年10月1日～平成14年9月30日)	4,301,544		4,301,544
第2期計算期間 (平成14年10月1日～平成15年9月30日)	182,586,956	186,374	186,702,126

第3期計算期間 (平成15年10月 1日～平成16年 9月30日)	2,187,517,735	33,558,244	2,340,661,617
第4期計算期間 (平成16年10月 1日～平成17年 9月30日)	3,855,445,843	339,542,424	5,856,565,036
第5期計算期間 (平成17年10月 1日～平成18年10月 2日)	6,070,648,194	854,529,212	11,072,684,018
第6期計算期間 (平成18年10月 3日～平成19年10月 1日)	5,674,532,592	1,200,249,010	15,546,967,600
第7期計算期間 (平成19年10月 2日～平成20年 9月30日)	4,840,693,182	1,503,609,790	18,884,050,992
第8期計算期間 (平成20年10月 1日～平成21年 9月30日)	4,254,062,772	1,400,523,502	21,737,590,262
第9期計算期間 (平成21年10月 1日～平成22年 9月30日)	3,441,853,681	1,381,887,329	23,797,556,614
第10期計算期間 (平成22年10月 1日～平成23年 9月30日)	4,609,846,864	1,681,231,757	26,726,171,721

(注)当該計算期間中において、本邦外における設定または解約の実績はありません。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

本ファンドの受益権の取得申込者は、指定販売会社に、取得申込みと同時にまたはあらかじめ、自己のために開設された本ファンドの受益権の振替を行うための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行われます。なお、指定販売会社は、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係る口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託者は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行うものとし、振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。受託者は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行います。

(イ) 申込手続

本ファンドの受益権の取得申込者は、指定販売会社に取引口座を開設のうえ、申込みを行います。

取得申込みは、申込期間における毎営業日に、指定販売会社の営業所等で受け付けます。

取得申込みの受付は、原則として、指定販売会社の営業日の午後3時までとし、当該受付時間を過ぎた場合は、翌営業日の受付になります。

本ファンドの受益権の販売価額は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

申込代金の払込みについては、指定販売会社が指定する期日までに申込みの指定販売会社に支払うものとし、

本ファンドは、収益の分配がなされた場合、分配金を無手数料で再投資する「自動けいぞく投資専用」ファンドです。このため申込みの際、受益権の取得申込者は、指定販売会社との間で別に定める「自動けいぞく投資約款」にしたがって、「分配金自動けいぞく投資に関する契約」を締結します。指定販売会社によっては、「自動けいぞく投資約款」、「分配金自動けいぞく投資に関する契約」について、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとし、また、指定販売会社によっては、定時定額で購入する「自動購入サービス」を利用することもできます。当該サービスを利用する場合には指定販売会社との間で「自動購入サービス」に関する取り決め（指定販売会社によっては、当該契約について、同

様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。)を行うものとします。

取引所における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、指定販売会社は、受益権の取得申込みの受付を中止すること、およびすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことができます。

- (口) 申込単位
1円以上1円単位
- (八) 申込手数料
ありません。

2【換金(解約)手続等】

(イ) 受益権の買取請求

本ファンドにおいては、指定販売会社による受益権の買取は行っておりません。ご換金は解約請求制のみとなります。

(ロ) 受益権のご解約の請求

ご解約の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係るこの投資信託契約の一部解約を委託者が行うのと引換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたが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。

受益者は、自己に帰属する受益権につき、委託者に1口単位をもってご解約の請求をすることができます。ご解約の請求の受付は、原則として、指定販売会社の営業日の午後3時までとし、当該受付時間を過ぎた場合は、翌営業日の受付になります。

受益者が前記のご解約の請求をするときは、指定販売会社に対し、受益権をもって行うものとします。

委託者は、前記のご解約の請求を受け付けた場合には、この投資信託契約の一部を解約します。

ご解約の価額は、解約請求受付日の翌営業日の基準価額(解約価額)とします。信託財産留保金の控除はありません。

「信託財産留保金」(「信託財産留保額」ということがあります。)とは、償還時まで投資を続ける投資者との公平性の確保やファンド残高の安定的な推移を図るため、信託期間満了前の解約に対し解約者から頂く一定の金額をいい、投資信託財産に繰り入れられます。

確定拠出年金法にもとづく確定拠出年金制度専用ファンドである本ファンドは、ご解約による換金時および償還時の差益が非課税であるため、ご解約のお受取金額は、ご解約価額となります。

解約代金は、原則として、解約請求受付日より起算して5営業日目から指定販売会社の営業所等において支払います。

委託者は、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、前記によるご解約の請求の受付を中止すること、およびすでに受け付けたご解約の請求の受付を取り消すことができます。

前記により、ご解約の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日のご解約の請求を撤回できます。ただし、受益者がそのご解約の請求を撤回しない場合には、当該受益権のご解約の価額は、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ご解約の請求を受け付けたものとして、前記の規定に準じて計算された価額とします。

解約価額に関する投資者の皆様による照会方法等については、指定販売会社にお問い合わせください。指定販売会社については、委託者にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、以下の通りです。

<お問い合わせ先>

住信アセットマネジメント株式会社

ホームページ：http://www.sumishinam.co.jp/

フリーダイヤル：0120-417434

（受付時間は営業日の午前9時～午後5時とします。）

（八）換金制限

本ファンドの規模および商品性格などにもとづき、運用上の支障をきたさないようにするため、大口の換金には受付時間および金額の制限を行う場合があります。詳細については、指定販売会社にお問い合わせください。指定販売会社については、委託者にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、前記「（ロ）受益権のご解約の請求」に記載されている先と同じです。

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

（イ）基準価額の算出方法

基準価額とは、投資信託財産に属する有価証券（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）、金融商品等のすべての資産を時価評価して得た投資信託財産の資産総額から負債総額を控除した純資産総額を、本ファンドの基準価額計算日における受益権総口数で除した1口当たり純資産価額をいいます。なお、投資信託財産に属する有価証券等の資産の時価評価は、原則として、法令および社団法人投資信託協会規則にしたがって評価します。

[主要な投資対象の評価方法]

本ファンドの主要な投資対象であるマザーファンド受益証券の評価方法

原則として、本ファンドの基準価額計算日の基準価額で評価します。

マザーファンドの主要な投資対象の評価方法

1) 株式

原則として、本ファンドの基準価額計算日（外国で取引されているものについては、原則として、基準価額計算日の前日）の当該取引所における最終相場で評価します。

2) 公社債

原則として、計算時において知り得る直近の日（外国で取引されているものについては、原則として、本ファンドの基準価額計算日の前日）の次のいずれかから入手した価額で評価します。

(a) 日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）

(b) 価格情報会社の提供する価額

(c) 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）

外貨建資産の円換算については、原則として、わが国における本ファンドの基準価額計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算し、為替予約の評価は、原則として、わが国における本ファンドの基準価額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

基準価額は、委託者の営業日において日々算出されます。

（ハ）基準価額に関する投資者による照会方法等

基準価額は、委託者および指定販売会社で入手できます。

投資者の皆様による照会方法等については、委託者または指定販売会社にお問い合わせください。指定販売会社については、委託者にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、前記「2換金（解約）手続等（ロ）受益権のご解約の請求」に記載されている先と同じです。

なお、基準価額は、翌日の日本経済新聞に掲載されます。ただし、表示は1万口当たりに換算した価額で行われます。

（2）【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

平成13年10月1日から投資信託約款第4条の規定による信託終了の日までとします。（原則無期限）

(4) 【計算期間】

原則として、毎年10月1日から翌年9月30日までとします。なお、当該計算期間終了の該当日が休業日のとき、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されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、投資信託約款第4条に定める信託期間の終了日とします。

(5) 【その他】**(イ) 信託の終了**

- (a) 委託者は、投資信託約款に定める信託終了前にこの投資信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- (b) 委託者は、投資信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が5億口を下回ることとなった場合には、受託者と合意のうえ、この投資信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、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。
- (c) 委託者は、前記(a)および(b)の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面をこの投資信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- (d) 前記(c)の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- (e) 前記(d)の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、前記(a)および(b)の投資信託契約の解約をしません。
- (f) 委託者は、この投資信託契約の解約をしないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの投資信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- (g) 前記(d)から(f)までの規定は、投資信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前記(d)の一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

委託者は、監督官庁よりこの投資信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、投資信託契約を解約し信託を終了させます。

委託者が、監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この投資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、この投資信託契約に関する委託者の業務を他の委託者に引き継ぐことを命じたときは、後記「(ロ) 投資信託約款の変更(d)」に該当する場合を除き、この信託はその委託者と受託者との間において存続します。

受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を請求することができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの投資信託契約を解約し信託を終了させます。

(ロ) 投資信託約款の変更

- (a) 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この投資信託約款を変更することができるものとし、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

- (b)委託者は、前記(a)の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの投資信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。
- (c)前記(b)の公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託者に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。
- (d)前記(c)の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、前記(a)の投資信託約款の変更をしません。
- (e)委託者は、当該投資信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの投資信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この投資信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

委託者は、監督官庁の命令にもとづいてこの投資信託約款を変更しようとするときは、前記 に記載されている手続きにしたがいます。

(八) 指定販売会社との証券投資信託の募集・販売の取扱い等に関する契約の更改等に関する手続

指定販売会社との証券投資信託の募集・販売の取扱い等に関する契約の有効期間は、契約締結の日から1年間とします。ただし、契約満了日の3ヶ月前までに別段の意思表示のないときは、同一条件にて自動的に1年間更新され、以後も同様とします。期間の途中において必要あるときは、契約の一部を変更することができます。

(二) 運用報告書

委託者は、計算期間の末日ごとおよび償還時に、期間中の運用経過のほか投資信託財産の内容、有価証券売買状況などを記載した運用報告書を作成し、原則として当該投資信託財産に係る知られたる受益者に対して交付します。

(ホ) 信託事務処理の再信託

受託者は、本ファンドに係る信託事務の処理の一部について日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託に係る契約書類にもとづいて所定の事務を行います。

(ヘ) 公告

委託者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。

4【受益者の権利等】

本ファンドの受益者が有する主な権利は、以下の通りです。なお、本ファンドの受益権の1口当たり投資信託財産持分は、すべて均等かつ同一であり、取得申込日の前後等により受益者間で1口当たり持分の差異が生じることはありません。

(イ) 収益分配金請求権

本ファンドの収益分配金は、自動的に本ファンドの受益権に再投資されます。受託者が委託者の指定する預金口座等に払い込むことにより、原則として、毎計算期間終了日の翌営業日に、収益分配金が指定販売会社に支払われます。この場合、指定販売会社は、受益者に対して遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売付を行います。この場合の受益権の価額は、各計算期間終了日の基準価額とします。

分配金は、無手数料で再投資されますが、再投資により増加した受益権は、振替機関等の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、原則として、償還日から起算して5営業日目までに受益者に支払います。償還金の支払い

は、指定販売会社の営業所等において行われます。

受益者が、信託終了による償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、受託者から交付を受けた金銭は、委託者に帰属するものとします。

(八) 換金(解約)請求権

受益者は、自己に帰属する受益権について、ご解約の請求をすることにより換金する権利を有します。

(二) 反対者の買取請求権

投資信託契約の解約、または投資信託約款の変更のうち、その内容が重大な変更を行う場合において、一定の期間内に委託者に対して異議を述べた受益者は、受託者に対し、自己に帰属する受益権を、投資信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。

(ホ) 帳簿閲覧・謄写請求権

受益者は、委託者に対し、当該受益者に係る投資信託財産に関する書類の閲覧または謄写の請求をすることができます。

なお、受益者には、議決権、受益者集会の権利はありません。

第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)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9期計算期間(平成21年10月1日から平成22年9月30日まで)及び第10期計算期間(平成22年10月1日から平成23年9月30日まで)の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

すみしん DCマイセレクション50

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第9期 (平成22年9月30日現在)	第10期 (平成23年9月30日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,392,122,486	1,588,819,117
親投資信託受益証券	24,846,580,012	26,940,321,101
未収利息	3,636	1,975
流動資産合計	26,238,706,134	28,529,142,193
資産合計	26,238,706,134	28,529,142,193
負債の部		
流動負債		
未払解約金	14,793,214	11,098,750
未払受託者報酬	4,109,238	4,505,559
未払委託者報酬	35,613,346	39,048,128
その他未払費用	1,336,205	1,470,020
流動負債合計	55,852,003	56,122,457
負債合計	55,852,003	56,122,457
純資産の部		
元本等		
元本	23,797,556,614	26,726,171,721
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	2,385,297,517	1,746,848,015
(分配準備積立金)	1,607,641,090	1,502,507,306
元本等合計	26,182,854,131	28,473,019,736
純資産合計	26,182,854,131	28,473,019,736
負債純資産合計	26,238,706,134	28,529,142,193

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第9期 (自 平成21年10月1日 至 平成22年9月30日)	第10期 (自 平成22年10月1日 至 平成23年9月30日)
営業収益		
受取利息	946,007	788,483
有価証券売買等損益	164,085,514	913,048,911
営業収益合計	163,139,507	912,260,428
営業費用		
受託者報酬	8,017,936	8,820,798
委託者報酬	69,488,673	76,446,831
その他費用	1,336,205	1,470,020
営業費用合計	78,842,814	86,737,649
営業利益又は営業損失（ ）	241,982,321	998,998,077
経常利益又は経常損失（ ）	241,982,321	998,998,077
当期純利益又は当期純損失（ ）	241,982,321	998,998,077
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（ ）	6,913,161	32,248,145
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	2,398,412,103	2,385,297,517
剰余金増加額又は欠損金減少額	388,748,298	564,777,058
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	388,748,298	564,777,058
剰余金減少額又は欠損金増加額	152,967,402	171,980,338
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	152,967,402	171,980,338
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,385,297,517	1,746,848,015

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	第9期 (自 平成21年10月 1日 至 平成22年 9月30日)	第10期 (自 平成22年10月 1日 至 平成23年 9月30日)
資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法により親投資信託受益証券 の基準価額で評価しております。	親投資信託受益証券 同左

(貸借対照表に関する注記)

	第9期 (平成22年 9月30日現在)	第10期 (平成23年 9月30日現在)
1. 期首元本額	21,737,590,262円	23,797,556,614円
期中追加設定元本額	3,441,853,681円	4,609,846,864円
期中一部解約元本額	1,381,887,329円	1,681,231,757円
2. 計算期間末日における受益権の総数	23,797,556,614口	26,726,171,721口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

	第9期 (自 平成21年10月 1日 至 平成22年 9月30日)	第10期 (自 平成22年10月 1日 至 平成23年 9月30日)
分配金の計算過程	計算期間末における経費控除後の配当等収益(0円)、経費控除後繰越欠損補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(5,402,740,456円)及び分配準備積立金(1,607,641,090円)により、分配対象収益は7,010,381,546円(1万円当たり2,945円84銭)ですが、分配は見送りとさせていただきます。	計算期間末における経費控除後の配当等収益(0円)、経費控除後繰越欠損補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(6,370,629,124円)及び分配準備積立金(1,502,507,306円)により、分配対象収益は7,873,136,430円(1万円当たり2,945円85銭)ですが、分配は見送りとさせていただきます。

(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9期 (自 平成21年10月 1日 至 平成22年 9月30日)	第10期 (自 平成22年10月 1日 至 平成23年 9月30日)
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、金融商品に対する取組方針は投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。	同左

2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>当ファンドは、確定拠出年金法（平成13年法律第88号）に基づく確定拠出年金制度のための専用ファンドとして投資信託財産の長期的な成長をはかることをめざして運用を行います。なお、当ファンドには、以下のリスクがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ 価格変動リスク ・ 為替変動リスク 	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用各部から独立した部署によって、ファンドの運用状況や運用ガイドライン、法令等の遵守状況についてモニタリングを行っております（運用を再委託しているファンドも含まれます。）。 モニタリング結果は、原則月1回（必要に応じ随時）開催される運用リスクの管理に関する委員会に報告され、委員会は適切な運用リスク管理に必要な措置を講じることとしております。</p>	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価額がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>	同左

金融商品の時価に関する事項

項目	第9期 （平成22年 9月30日現在）	第10期 （平成23年 9月30日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>a. 親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>b. コールローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>a. 親投資信託受益証券 同左</p> <p>b. コールローン等の金銭債権及び金銭債務 同左</p>

(追加情報)

第9期 (自 平成21年10月 1日 至 平成22年 9月30日)	第10期 (自 平成22年10月 1日 至 平成23年 9月30日)
当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 平成20年3月10日)及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日)を適用しております。	

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	第9期 (平成22年 9月30日現在)	第10期 (平成23年 9月30日現在)
	当計算期間の損益に含まれた 評価差額(円)	当計算期間の損益に含まれた 評価差額(円)
親投資信託受益証券	193,848,301	1,023,256,064
合計	193,848,301	1,023,256,064

(注) 当計算期間の損益に含まれた評価差額は、決算日現在の評価換え額です。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

第9期 (平成22年 9月30日現在)	第10期 (平成23年 9月30日現在)
該当事項はありません。	同左

(関連当事者との取引に関する注記)

第9期 (自 平成21年10月 1日 至 平成22年 9月30日)	第10期 (自 平成22年10月 1日 至 平成23年 9月30日)
当計算期間中に利害関係人との間で、一般の取引条件と同様のもの以外の取引は行っておりません。また、当ファンドの関連当事者である受託会社及び投資信託委託業者と財務諸表上で開示している報酬等の給付以外の取引は行っておりません。	同左

(1口当たり情報)

第9期 (平成22年 9月30日現在)	第10期 (平成23年 9月30日現在)
1口当たり純資産額 = 1.1002円	1口当たり純資産額 = 1.0654円

(4)【附属明細表】(平成23年9月30日現在)

1)有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	総口数（口）	評価額（円）
親投資信託 受益証券	住信 外国株式インデックス マザーファンド	5,248,146,429	4,048,944,969
	住信 外国債券インデックス マザーファンド	831,468,056	1,408,839,474
	住信 国内株式インデックス マザーファンド	16,650,446,738	9,941,981,747
	住信 国内債券インデックス マザーファンド	9,439,354,582	11,540,554,911
合計		32,169,415,805	26,940,321,101

2)信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

3)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。

[次へ](#)

「住信 国内債券インデックス マザーファンド」の状況

(1)貸借対照表

(単位：円)

	(平成22年 9月30日現在)	(平成23年 9月30日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,087,290,386	1,750,149,902
国債証券	121,949,865,900	134,739,015,100
地方債証券	10,476,574,653	11,981,252,701
特殊債券	17,007,527,750	17,452,686,312
社債券	13,942,323,080	13,746,701,679
未収入金		314,303,800
未収利息	349,903,899	367,984,024
前払費用	10,169,870	12,122,715
流動資産合計	164,823,655,538	180,364,216,233
資産合計	164,823,655,538	180,364,216,233
負債の部		
流動負債		
未払金	1,103,171,000	712,420,200
未払解約金	24,209,941	53,721,698
流動負債合計	1,127,380,941	766,141,898
負債合計	1,127,380,941	766,141,898
純資産の部		
元本等		
元本	134,702,024,810	146,902,519,359
剰余金		
剰余金又は欠損金()	28,994,249,787	32,695,554,976
元本等合計	163,696,274,597	179,598,074,335
純資産合計	163,696,274,597	179,598,074,335
負債純資産合計	164,823,655,538	180,364,216,233

(注) 「住信 国内債券インデックス マザーファンド」の計算期間は、原則として毎年5月30日から翌年5月29日までであり、「すみしん DCマイセレクション50」の計算期間とは異なっております。上記の表は、平成22年9月30日及び平成23年9月30日現在の同マザーファンドの貸借対照表です。

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	(自 平成21年10月 1日 至 平成22年 9月30日)	(自 平成22年10月 1日 至 平成23年 9月30日)

資産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 移動平均法（買付約定後、最初の利払日までは個別法）に基づき、原則として時価評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者等の提示する価格、価格情報会社の提供する価格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。	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 同左
---------------	---	---------------------------

(貸借対照表に関する注記)

	(平成22年 9月30日現在)	(平成23年 9月30日現在)
1. 期首元本額	126,462,206,194円	134,702,024,810円
期中追加設定元本額	25,524,327,066円	31,996,378,412円
期中一部解約元本額	17,284,508,450円	19,795,883,863円
期末元本額	134,702,024,810円	146,902,519,359円
元本額の内訳		
住信 エマージング株式オープン	10,940,920円	10,940,920円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	321,804,503円	446,083,447円
SBI資産設計オープン（分配型）	17,932,042円	17,507,386円
STAM 国内債券インデックス・オープン	1,368,832,717円	1,794,563,944円
世界経済インデックスファンド	26,291,324円	54,817,141円
住信 国内バランス30	509,962,775円	
住信 国内バランス60	90,350,753円	
すみしん マイセレクション25	263,079,910円	206,670,439円
すみしん マイセレクション50	231,498,803円	189,368,888円
すみしん マイセレクション75	52,694,764円	46,073,823円
すみしん DCマイセレクション25	6,200,339,300円	7,340,374,754円
すみしん DCマイセレクション50	8,657,412,418円	9,439,354,582円
すみしん DCマイセレクション75	2,353,586,626円	2,380,453,952円
すみしん DC日本債券インデックス・オープン	326,887,806円	351,939,331円
すみしん DC日本債券インデックス・オープンS	26,465,749,473円	31,795,974,873円
すみしん DC日本債券インデックス・オープンP	6,895,990,906円	10,791,848,134円
すみしん DCマイセレクションS25	524,846,940円	1,875,225,087円
すみしん DCマイセレクションS50	980,677,778円	2,236,683,112円
すみしん DCマイセレクションS75	200,461,384円	388,699,642円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2015	34,637,670円	46,457,755円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2025	95,773,695円	337,051,614円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2035	41,662,199円	143,636,918円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2045	8,180,675円	23,559,346円
STAM 日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	6,800,155,651円	5,882,554,118円

住信 国内バランス60VA1 (適格機関投資家専用)	86,189,049円	69,799,024円
すみしん マイセレクション50VA1 (適格機関投資家専用)	617,595,311円	528,637,042円
すみしん マイセレクション75VA1 (適格機関投資家専用)	79,905,729円	65,143,106円
住信 国内バランス30VA2 (適格機関投資家専用)	15,015,202円	12,787,670円
住信 国内バランス60VA2 (適格機関投資家専用)	15,590,336円	13,825,926円
すみしん マイセレクション50VA2 (適格機関投資家専用)	3,436,291円	2,359,816円
すみしん バランス30VA1 (適格機関投資家専用)	2,177,633,990円	2,063,407,376円
すみしん バランス50VA1 (適格機関投資家専用)	3,277,162,918円	3,100,311,077円
すみしん バランス25VA2(適格機関投資家専用)	10,410,377,425円	9,578,270,582円
すみしん バランス50VA2(適格機関投資家専用)	884,783,973円	824,341,756円
すみしん バランスA(25)VA1 (適格機関投資家専用)	16,955,722,368円	15,499,888,764円
すみしん バランスB(37.5)VA1 (適格機関投資家専用)	1,844,028,210円	1,640,226,169円
すみしん バランスC(50)VA1 (適格機関投資家専用)	6,583,436,435円	5,654,375,225円
すみしん 世界バランスVA1 (適格機関投資家専用)	3,793,665,867円	3,629,458,996円
すみしん 世界バランスVA2 (適格機関投資家専用)	5,421,120,590円	5,151,924,501円
すみしん バランスD(35)VA1 (適格機関投資家専用)	2,926,880,800円	2,486,024,330円
すみしん グローバルバランスファンドVA35 (適格機関投資家専用)	2,140,226,545円	2,039,406,146円
すみしん バランスE(25)VA1 (適格機関投資家専用)	3,471,788,084円	3,027,747,898円
すみしん バランスF(25)VA1 (適格機関投資家専用)	2,560,975,682円	3,642,793,865円
すみしん 国内バランス25VA1 (適格機関投資家専用)	320,593,626円	296,116,309円
住信 グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,137,156,435円	1,952,365,138円
住信 日本債券ファンド・シリーズ1	6,498,988,912円	9,823,469,437円
2. 計算期間末日における受益権の総数	134,702,024,810口	146,902,519,359口

(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21年10月1日 至平成22年9月30日）	（自平成22年10月1日 至平成23年9月30日）
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、金融商品に対する取組方針は投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。	同左
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドは、わが国の公社債を中心に投資を行い、ノムラ・ボンド・パフォーマンス・インデックス(総合)と連動する投資成果を目標として運用を行います。 なお、当ファンドには、以下のリスクがあります。 ・価格変動リスク	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用各部から独立した部署によって、ファンドの運用状況や運用ガイドライン、法令等の遵守状況についてモニタリングを行っております（運用を再委託しているファンドも含まれます。）。 モニタリング結果は、原則月1回（必要に応じ随時）開催される運用リスクの管理に関する委員会に報告され、委員会は適切な運用リスク管理に必要な措置を講じることとしております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価額がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

金融商品の時価に関する事項

項目	（平成22年9月30日現在）	（平成23年9月30日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左

2.時価の算定方法	<p>a. 国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>b. コールローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>a. 国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 同左</p> <p>b. コールローン等の金銭債権及び金銭債務 同左</p>
-----------	---	--

(追加情報)

(自 平成21年10月 1日 至 平成22年 9月30日)	(自 平成22年10月 1日 至 平成23年 9月30日)
当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 平成20年3月10日)及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日)を適用しております。	

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	(平成22年 9月30日現在)	(平成23年 9月30日現在)
	当計算期間の損益に含まれた 評価差額(円)	当計算期間の損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	2,163,525,200	1,096,199,200
地方債証券	158,851,075	77,380,066
特殊債券	230,565,771	92,879,520
社債券	156,980,140	71,412,109
合 計	2,709,922,186	1,195,046,677

(注) 当計算期間の損益に含まれた評価差額は、当親投資信託の計算期間開始日から本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日までの期間に対応する金額であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(平成22年 9月30日現在)	(平成23年 9月30日現在)
該当事項はありません。	同左

(関連当事者との取引に関する注記)

(自 平成21年10月 1日 至 平成22年 9月30日)	(自 平成22年10月 1日 至 平成23年 9月30日)
----------------------------------	----------------------------------

本報告書における開示対象ファンドの計算期間中に利害関係人との間で、一般の取引条件と同様のもの以外の取引は行っておりません。 また、当ファンドの関連当事者である受託会社及び投資信託委託業者と財務諸表上で開示している報酬等の給付以外の取引は行っておりません。	同左
--	----

(1口当たり情報)

(平成22年 9月30日現在)	(平成23年 9月30日現在)
1口当たり純資産額 = 1.2152円	1口当たり純資産額 = 1.2226円

(3)附属明細表（平成23年9月30日現在）

1)有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額（円）	評価額（円）	備考
国債証券	第100回利付国債（20年）	400,000,000	434,940,000	
	第101回利付国債（20年）	160,000,000	178,768,000	
	第102回利付国債（20年）	140,000,000	156,310,000	
	第103回利付国債（20年）	280,000,000	308,481,600	
	第104回利付国債（20年）	260,000,000	278,790,200	
	第105回利付国債（20年）	570,000,000	610,458,600	
	第106回利付国債（20年）	270,000,000	293,368,500	
	第107回利付国債（20年）	190,000,000	203,366,500	
	第108回利付国債（20年）	490,000,000	509,487,300	
	第109回利付国債（20年）	200,000,000	207,618,000	
	第10回利付国債（30年）	120,000,000	105,286,800	
	第110回利付国債（20年）	580,000,000	619,567,600	
	第111回利付国債（20年）	200,000,000	216,408,000	
	第112回利付国債（20年）	500,000,000	533,390,000	
	第113回利付国債（20年）	960,000,000	1,022,678,400	
	第114回利付国債（20年）	380,000,000	404,506,200	
	第115回利付国債（20年）	550,000,000	594,016,500	
	第116回利付国債（20年）	480,000,000	517,713,600	
	第117回利付国債（20年）	600,000,000	638,196,000	
	第118回利付国債（20年）	700,000,000	732,921,000	
	第119回利付国債（20年）	180,000,000	182,683,800	
	第11回利付国債（30年）	90,000,000	88,456,500	
第121回利付国債（20年）	940,000,000	968,341,000		

第122回利付国債(20年)	120,000,000	121,633,200	
第123回利付国債(20年)	460,000,000	488,763,800	
第124回利付国債(20年)	280,000,000	293,011,600	
第125回利付国債(20年)	380,000,000	410,175,800	
第126回利付国債(20年)	230,000,000	240,614,500	
第127回利付国債(20年)	330,000,000	339,645,900	
第128回利付国債(20年)	470,000,000	483,517,200	
第129回利付国債(20年)	470,000,000	475,531,900	
第12回利付国債(30年)	120,000,000	126,460,800	
第13回利付国債(30年)	90,000,000	93,150,900	
第14回利付国債(30年)	260,000,000	288,405,000	
第15回利付国債(30年)	190,000,000	214,198,400	
第16回利付国債(30年)	170,000,000	191,824,600	
第17回利付国債(30年)	130,000,000	144,064,700	
第18回利付国債(30年)	240,000,000	261,513,600	
第19回利付国債(30年)	180,000,000	196,093,800	
第1回利付国債(30年)	40,000,000	47,057,200	
第1回利付国債(40年)	150,000,000	164,382,000	
第20回利付国債(30年)	290,000,000	326,989,500	
第21回利付国債(30年)	130,000,000	141,436,100	
第22回利付国債(20年)	120,000,000	129,016,800	
第22回利付国債(30年)	220,000,000	248,256,800	
第23回利付国債(20年)	40,000,000	44,192,400	
第23回利付国債(30年)	150,000,000	169,113,000	
第244回利付国債(10年)	540,000,000	545,761,800	
第245回利付国債(10年)	940,000,000	948,901,800	
第246回利付国債(10年)	550,000,000	554,510,000	
第247回利付国債(10年)	290,000,000	292,862,300	
第248回利付国債(10年)	490,000,000	494,125,800	
第249回利付国債(10年)	300,000,000	302,091,000	
第24回利付国債(20年)	20,000,000	22,225,600	
第24回利付国債(30年)	210,000,000	236,741,400	
第250回利付国債(10年)	490,000,000	493,126,200	
第251回利付国債(10年)	660,000,000	668,705,400	
第252回利付国債(10年)	510,000,000	517,599,000	
第253回利付国債(10年)	680,000,000	699,529,600	
第254回利付国債(10年)	550,000,000	563,645,500	
第255回利付国債(10年)	240,000,000	246,422,400	
第256回利付国債(10年)	1,240,000,000	1,274,248,800	
第257回利付国債(10年)	660,000,000	676,777,200	
第258回利付国債(10年)	210,000,000	215,852,700	

第259回利付国債(10年)	1,040,000,000	1,074,070,400	
第25回利付国債(20年)	60,000,000	65,796,000	
第25回利付国債(30年)	210,000,000	228,207,000	
第260回利付国債(10年)	540,000,000	560,730,600	
第261回利付国債(10年)	510,000,000	532,322,700	
第262回利付国債(10年)	480,000,000	502,305,600	
第263回利付国債(10年)	410,000,000	426,945,300	
第264回利付国債(10年)	1,550,000,000	1,609,504,500	
第265回利付国債(10年)	470,000,000	489,161,900	
第266回利付国債(10年)	370,000,000	383,908,300	
第267回利付国債(10年)	450,000,000	465,480,000	
第268回利付国債(10年)	560,000,000	584,175,200	
第269回利付国債(10年)	1,150,000,000	1,191,756,500	
第26回利付国債(20年)	20,000,000	22,534,200	
第26回利付国債(30年)	360,000,000	398,746,800	
第270回利付国債(10年)	840,000,000	871,752,000	
第271回利付国債(10年)	730,000,000	754,914,900	
第272回利付国債(10年)	130,000,000	135,647,200	
第273回利付国債(10年)	1,220,000,000	1,277,767,000	
第274回利付国債(10年)	530,000,000	556,081,300	
第275回利付国債(10年)	280,000,000	292,616,800	
第276回利付国債(10年)	480,000,000	505,612,800	
第277回利付国債(10年)	270,000,000	285,052,500	
第278回利付国債(10年)	760,000,000	809,225,200	
第279回利付国債(10年)	440,000,000	472,362,000	
第27回利付国債(20年)	50,000,000	57,072,500	
第27回利付国債(30年)	460,000,000	518,801,800	
第280回利付国債(10年)	1,250,000,000	1,340,025,000	
第281回利付国債(10年)	550,000,000	592,157,500	
第282回利付国債(10年)	1,160,000,000	1,235,423,200	
第283回利付国債(10年)	680,000,000	727,348,400	
第284回利付国債(10年)	1,750,000,000	1,867,005,000	
第285回利付国債(10年)	1,960,000,000	2,094,887,200	
第286回利付国債(10年)	1,090,000,000	1,172,523,900	
第287回利付国債(10年)	500,000,000	540,635,000	
第288回利付国債(10年)	1,740,000,000	1,864,584,000	
第289回利付国債(10年)	1,550,000,000	1,643,821,500	
第28回利付国債(20年)	20,000,000	23,269,800	
第28回利付国債(30年)	300,000,000	338,544,000	
第290回利付国債(10年)	870,000,000	917,519,400	
第291回利付国債(10年)	420,000,000	440,319,600	

第292回利付国債(10年)	420,000,000	450,949,800	
第293回利付国債(10年)	710,000,000	767,652,000	
第294回利付国債(10年)	510,000,000	548,112,300	
第295回利付国債(10年)	500,000,000	530,720,000	
第296回利付国債(10年)	1,580,000,000	1,677,217,400	
第297回利付国債(10年)	840,000,000	886,426,800	
第297回利付国債(2年)	700,000,000	699,923,000	
第298回利付国債(10年)	860,000,000	900,970,400	
第298回利付国債(2年)	500,000,000	499,915,000	
第299回利付国債(10年)	620,000,000	649,115,200	
第29回利付国債(20年)	60,000,000	69,215,400	
第29回利付国債(30年)	560,000,000	620,984,000	
第2回利付国債(30年)	160,000,000	177,924,800	
第2回利付国債(40年)	300,000,000	311,844,000	
第300回利付国債(10年)	1,010,000,000	1,072,175,600	
第300回利付国債(2年)	700,000,000	700,756,000	
第301回利付国債(10年)	610,000,000	646,862,300	
第301回利付国債(2年)	1,050,000,000	1,051,207,500	
第302回利付国債(10年)	600,000,000	631,866,000	
第302回利付国債(2年)	520,000,000	520,598,000	
第303回利付国債(10年)	1,140,000,000	1,198,345,200	
第303回利付国債(2年)	540,000,000	540,653,400	
第304回利付国債(10年)	590,000,000	615,753,500	
第304回利付国債(2年)	600,000,000	600,720,000	
第305回利付国債(10年)	1,960,000,000	2,040,967,600	
第305回利付国債(2年)	280,000,000	280,352,800	
第306回利付国債(10年)	1,680,000,000	1,759,128,000	
第306回利付国債(2年)	480,000,000	480,590,400	
第307回利付国債(2年)	700,000,000	700,903,000	
第308回利付国債(10年)	500,000,000	518,450,000	
第308回利付国債(2年)	420,000,000	419,752,200	
第309回利付国債(10年)	1,540,000,000	1,571,200,400	
第30回利付国債(20年)	80,000,000	90,720,000	
第30回利付国債(30年)	440,000,000	477,787,200	
第310回利付国債(10年)	1,620,000,000	1,634,094,000	
第311回利付国債(10年)	460,000,000	456,182,000	
第312回利付国債(10年)	1,930,000,000	1,975,026,900	
第313回利付国債(10年)	1,350,000,000	1,390,986,000	
第314回利付国債(10年)	650,000,000	657,884,500	
第315回利付国債(10年)	1,170,000,000	1,191,223,800	
第316回利付国債(10年)	800,000,000	807,432,000	

第3 1 回利付国債(20年)	80,000,000	91,200,000	
第3 1 回利付国債(30年)	500,000,000	531,755,000	
第3 2 回利付国債(20年)	50,000,000	57,439,500	
第3 2 回利付国債(30年)	690,000,000	748,574,100	
第3 3 回利付国債(20年)	140,000,000	163,622,200	
第3 3 回利付国債(30年)	680,000,000	692,049,600	
第3 4 回利付国債(20年)	50,000,000	58,289,500	
第3 4 回利付国債(30年)	750,000,000	797,002,500	
第3 5 回利付国債(20年)	10,000,000	11,551,100	
第3 6 回利付国債(20年)	70,000,000	80,428,600	
第3 7 回利付国債(20年)	70,000,000	80,835,300	
第3 8 回利付国債(20年)	20,000,000	22,722,800	
第3 9 回利付国債(20年)	500,000,000	565,125,000	
第3 回利付国債(30年)	120,000,000	131,391,600	
第3 回利付国債(40年)	340,000,000	351,719,800	
第4 0 回利付国債(20年)	100,000,000	111,616,000	
第4 1 回利付国債(20年)	330,000,000	349,941,900	
第4 2 回利付国債(20年)	80,000,000	91,319,200	
第4 3 回利付国債(20年)	140,000,000	163,465,400	
第4 4 回利付国債(20年)	170,000,000	193,038,400	
第4 5 回利付国債(20年)	290,000,000	327,392,600	
第4 6 回利付国債(20年)	170,000,000	188,921,000	
第4 7 回利付国債(20年)	90,000,000	100,116,900	
第4 8 回利付国債(20年)	130,000,000	147,942,600	
第4 9 回利付国債(20年)	140,000,000	154,309,400	
第4 回利付国債(30年)	110,000,000	131,422,500	
第4 回利付国債(40年)	200,000,000	206,094,000	
第5 0 回利付国債(20年)	220,000,000	238,554,800	
第5 1 回利付国債(20年)	100,000,000	109,236,000	
第5 2 回利付国債(20年)	110,000,000	121,235,400	
第5 3 回利付国債(20年)	80,000,000	88,150,400	
第5 4 回利付国債(20年)	200,000,000	222,332,000	
第5 5 回利付国債(20年)	140,000,000	152,891,200	
第5 6 回利付国債(20年)	150,000,000	163,714,500	
第5 7 回利付国債(20年)	240,000,000	259,384,800	
第5 8 回利付国債(20年)	200,000,000	215,964,000	
第5 9 回利付国債(20年)	200,000,000	211,446,000	
第5 回利付国債(30年)	50,000,000	53,916,000	
第6 0 回利付国債(20年)	350,000,000	358,865,500	
第6 1 回利付国債(20年)	220,000,000	215,677,000	
第6 2 回利付国債(20年)	220,000,000	209,888,800	

第63回利付国債(20年)	200,000,000	212,864,000	
第64回利付国債(20年)	320,000,000	343,964,800	
第65回利付国債(20年)	270,000,000	289,969,200	
第66回利付国債(20年)	180,000,000	191,295,000	
第67回利付国債(20年)	150,000,000	160,854,000	
第68回利付国債(20年)	140,000,000	155,001,000	
第68回利付国債(5年)	260,000,000	263,088,800	
第69回利付国債(20年)	220,000,000	240,930,800	
第69回利付国債(5年)	1,690,000,000	1,706,004,300	
第6回利付国債(30年)	90,000,000	100,122,300	
第70回利付国債(20年)	230,000,000	259,998,900	
第70回利付国債(5年)	1,610,000,000	1,625,890,700	
第71回利付国債(20年)	220,000,000	243,584,000	
第71回利付国債(5年)	820,000,000	834,046,600	
第72回利付国債(20年)	540,000,000	590,857,200	
第72回利付国債(5年)	630,000,000	644,748,300	
第73回利付国債(20年)	190,000,000	205,222,800	
第73回利付国債(5年)	670,000,000	683,406,700	
第74回利付国債(20年)	150,000,000	163,896,000	
第74回利付国債(5年)	640,000,000	649,536,000	
第75回利付国債(20年)	130,000,000	141,827,400	
第75回利付国債(5年)	440,000,000	448,294,000	
第76回利付国債(20年)	240,000,000	255,902,400	
第76回利付国債(5年)	820,000,000	837,138,000	
第77回利付国債(20年)	160,000,000	172,627,200	
第77回利付国債(5年)	440,000,000	447,475,600	
第78回利付国債(20年)	200,000,000	212,846,000	
第78回利付国債(5年)	390,000,000	396,477,900	
第79回利付国債(20年)	140,000,000	150,787,000	
第79回利付国債(5年)	170,000,000	172,075,700	
第7回利付国債(30年)	190,000,000	208,040,500	
第80回利付国債(20年)	220,000,000	239,637,200	
第80回利付国債(5年)	380,000,000	385,475,800	
第81回利付国債(20年)	90,000,000	96,813,900	
第81回利付国債(5年)	1,140,000,000	1,157,829,600	
第82回利付国債(20年)	540,000,000	587,914,200	
第82回利付国債(5年)	390,000,000	397,055,100	
第83回利付国債(20年)	240,000,000	260,990,400	
第83回利付国債(5年)	220,000,000	224,265,800	
第84回利付国債(20年)	460,000,000	494,168,800	
第84回利付国債(5年)	1,530,000,000	1,551,420,000	

第85回利付国債(20年)	230,000,000	249,805,300	
第85回利付国債(5年)	1,670,000,000	1,694,799,500	
第86回利付国債(20年)	170,000,000	189,189,600	
第86回利付国債(5年)	80,000,000	80,964,800	
第87回利付国債(20年)	350,000,000	384,583,500	
第87回利付国債(5年)	2,140,000,000	2,159,431,200	
第88回利付国債(20年)	470,000,000	522,221,700	
第88回利付国債(5年)	1,590,000,000	1,604,151,000	
第89回利付国債(20年)	280,000,000	307,316,800	
第89回利付国債(5年)	1,760,000,000	1,768,712,000	
第8回利付国債(30年)	50,000,000	50,308,000	
第90回利付国債(20年)	480,000,000	526,516,800	
第91回利付国債(20年)	290,000,000	321,882,600	
第91回利付国債(5年)	400,000,000	401,720,000	
第92回利付国債(20年)	760,000,000	821,552,400	
第92回利付国債(5年)	1,260,000,000	1,260,491,400	
第93回利付国債(20年)	250,000,000	266,517,500	
第93回利付国債(5年)	820,000,000	826,297,600	
第94回利付国債(20年)	440,000,000	475,208,800	
第94回利付国債(5年)	1,010,000,000	1,021,948,300	
第95回利付国債(20年)	430,000,000	475,541,300	
第95回利付国債(5年)	520,000,000	526,047,600	
第96回利付国債(20年)	280,000,000	301,546,000	
第96回利付国債(5年)	900,000,000	906,516,000	
第97回利付国債(20年)	510,000,000	555,966,300	
第97回利付国債(5年)	1,470,000,000	1,473,395,700	
第98回利付国債(20年)	230,000,000	247,450,100	
第99回利付国債(20年)	640,000,000	687,372,800	
第9回ポーランド共和国円貨債券(2009)	100,000,000	100,090,000	
第9回利付国債(30年)	70,000,000	65,450,700	
小計	128,930,000,000	134,739,015,100	

地方債証券	第1 1 3 回福岡北九州高速道路債券	100,000,000	108,481,000	
	第1 1 回東京都公募公債(30年)	100,000,000	102,456,000	
	第1 2 4 回神奈川県公募公債	10,000,000	10,274,000	
	第1 2 回す号名古屋市公募公債	100,000,000	105,713,000	
	第1 4 4 回神奈川県公募公債	100,000,000	107,042,000	
	第1 4 回共同発行市場公募地方債	100,200,000	103,520,628	
	第1 5 0 回神奈川県公募公債	100,000,000	106,675,000	
	第1 5 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,694,000	
	第1 6 7 回神奈川県公募公債	140,000,000	147,719,600	
	第1 6 回神奈川県公募公債(20年)	100,000,000	104,527,000	
	第1 7 回東京都公募公債(20年)	100,000,000	105,478,000	
	第1 9 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,044,000	
	第1 9 回東京都公募公債(20年)	100,000,000	105,777,000	
	第1 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	100,796,000	
	第2 1 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	103,557,000	
	第2 3 回東京都公募公債(20年)	100,000,000	105,238,000	
	第2 5 2 回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	100,748,000	
	第2 6 2 回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	102,582,000	
	第2 7 1 回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	103,852,000	
	第2 8 4 回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	104,742,000	
	第2 8 回1号宮城県公募公債	116,000,000	116,914,080	
	第2 9 1 回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	107,075,000	
	第2 9 回共同発行市場公募地方債	200,000,000	208,068,000	
	第3 0 7 回大阪府公募公債(10年)	100,000,000	107,247,000	
	第3 3 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,086,000	
	第3 5 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,232,000	
	第3 8 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,278,000	
	第3 回共同発行市場公募地方債	20,000,000	20,107,000	
	第3 回東京都公募公債(20年)	100,000,000	110,354,000	
	第4 0 回共同発行市場公募地方債	120,000,000	129,536,400	
	第4 1 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,569,000	
	第4 6 回共同発行市場公募地方債	136,500,000	146,000,400	
	第4 7 回大阪府公募公債(5年)	100,000,000	102,249,000	
	第4 回神奈川県公募公債(30年)	100,000,000	111,500,000	
	第5 2 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	107,854,000	
	第5 5 回共同発行市場公募地方債	158,400,000	170,596,800	
	第5 6 回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,963,000	
	第5 9 1 回東京都公募公債	108,000,000	109,140,480	
	第5 9 3 回東京都公募公債	143,000,000	144,172,600	
	第5 回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	108,614,000	
第5 回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	108,866,000		

第602回東京都公募公債	20,000,000	20,497,800	
第608回東京都公募公債	100,000,000	103,351,000	
第611回東京都公募公債	40,000,000	41,730,400	
第618回東京都公募公債	100,000,000	103,748,000	
第622回東京都公募公債	100,000,000	103,489,000	
第633回東京都公募公債	129,000,000	137,968,080	
第639回東京都公募公債	50,000,000	53,433,500	
第650回東京都公募公債	140,000,000	150,788,400	
第674回東京都公募公債	100,000,000	104,541,000	
第67回共同発行市場公募地方債	165,700,000	175,129,987	
第691回東京都公募公債	100,000,000	102,200,000	
第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	106,859,000	
第72回大阪府公募公債(5年)	100,000,000	100,647,000	
第75回共同発行市場公募地方債	200,000,000	213,170,000	
第77回共同発行市場公募地方債	110,000,000	116,304,100	
第78回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,506,000	
第81回川崎市公募公債	100,000,000	106,100,000	
第82回川崎市公募公債	100,000,000	105,435,000	
第89回共同発行市場公募地方債	150,300,000	151,407,711	
第93回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,159,000	
第94回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,003,000	
第95回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,274,000	
第9回東京都公募公債(30年)	100,000,000	106,544,000	
第9回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	105,000,000	
平成14年度第1回広島市公募公債	10,000,000	10,096,400	
平成14年度第2回愛知県公募公債	120,000,000	121,407,600	
平成14年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	100,868,000	
平成14年度第8回札幌市公募公債	28,300,000	28,487,063	
平成15年度第1回愛知県公募公債	100,000,000	102,477,000	
平成15年度第5回札幌市公募公債	72,580,000	74,580,304	
平成15年度第5回北海道公募公債	50,000,000	51,162,000	
平成15年度第6回福岡市公募公債	124,600,000	127,762,348	
平成15年度第6回兵庫県公募公債	10,000,000	10,265,400	
平成16年度第1回広島県公募公債	100,000,000	103,319,000	
平成16年度第1回新潟県公募公債	100,000,000	103,767,000	
平成16年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	103,688,000	
平成16年度第4回静岡県公募公債	150,000,000	156,066,000	
平成16年度第4回兵庫県公募公債	200,000,000	206,882,000	
平成16年度第8回千葉県公募公債	100,000,000	103,353,000	
平成17年度第10回大阪市公募公債	100,000,000	104,416,000	
平成17年度第13回神戸市公募公債	100,000,000	105,112,000	

平成17年度第13回兵庫県公募公債	200,000,000	210,966,000	
平成17年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	103,397,000	
平成17年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	104,969,000	
平成17年度第3回埼玉県公募公債	100,000,000	103,593,000	
平成17年度第6回札幌市公募公債	100,000,000	104,637,000	
平成18年度第1回鹿児島県公募公債	100,000,000	107,181,000	
平成18年度第1回北海道公募公債	100,000,000	105,932,000	
平成18年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	107,300,000	
平成18年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	107,009,000	
平成19年度第2回静岡県公募公債	100,000,000	107,955,000	
平成19年度第7回大阪市公募公債	100,000,000	107,005,000	
平成19年度第8回北海道公募公債（5年）	100,000,000	101,249,000	
平成19年度第9回兵庫県公募公債	100,000,000	107,303,000	
平成20年度第14回北海道公募公債	100,000,000	106,839,000	
平成20年度第4回静岡県公募公債	100,000,000	106,713,000	
平成20年度第6回愛知県公募公債（10年）	100,000,000	107,189,000	
平成21年度第12回千葉県公募公債	100,000,000	104,544,000	
平成21年度第1回横浜市公募公債	200,000,000	212,390,000	
平成21年度第2回千葉県公募公債	100,000,000	106,122,000	
平成21年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	105,813,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債（20年）	100,000,000	107,893,000	
平成21年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	105,725,000	
平成21年度第9回千葉県公募公債	100,000,000	103,580,000	
平成22年度第11回埼玉県公募公債	193,000,000	197,388,820	
平成22年度第1回広島県公募公債	100,000,000	103,687,000	
平成22年度第5回大阪市公募公債	100,000,000	101,396,000	
平成22年度第8回千葉県公募公債	120,000,000	120,100,800	
平成23年度第1回福岡県公募公債（20年）	100,000,000	103,042,000	
小計	11,435,580,000	11,981,252,701	

特殊債券	い第690号農林債	100,000,000	101,207,000	
	い第694号農林債	100,000,000	101,318,000	
	い第695号農林債	100,000,000	101,383,000	
	い第696号商工債	100,000,000	101,903,000	
	い第704号商工債	100,000,000	102,484,000	
	い第705号商工債	100,000,000	102,682,000	
	い第707号農林債	250,000,000	256,640,000	
	い第710号農林債	100,000,000	101,898,000	
	い第715号農林債	100,000,000	101,071,000	
	い第718号商工債	100,000,000	100,964,000	
	い第721号商工債	150,000,000	150,829,500	
	い第722号商工債	100,000,000	100,345,000	
	い第723号農林債	200,000,000	200,908,000	
	い第726号商工債	100,000,000	100,064,000	
	第10回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,498,000	
	第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	70,375,000	73,444,053	
	第10回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,047,000	
	第110回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,324,000	
	第115回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	100,576,000	
	第119号商工債（3年）	100,000,000	100,258,000	
	第11回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,329,000	
	第11回日本政策投資銀行債券	100,000,000	107,400,000	
	第122回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	99,410,000	
	第125回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,182,000	
	第12回政府保証国民生活債券	179,000,000	184,246,490	
	第134回政府保証阪神高速道路債券	100,000,000	100,566,000	
	第135回政府保証阪神高速道路債券	20,000,000	20,503,800	
	第13回政府保証日本政策投資銀行債券	106,000,000	114,132,320	
	第13回日本政策投資銀行債券	100,000,000	103,161,000	
	第145回政府保証阪神高速道路債券	100,000,000	103,868,000	
	第14回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	109,670,000	
	第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	71,380,000	74,110,285	
	第15回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	71,882,000	74,505,693	
第171回政府保証中小企業債券	12,000,000	12,122,040		
第176回政府保証中小企業債券	20,000,000	20,555,800		

第17回公営企業債券	100,000,000	104,626,000	
第182回政府保証中小企業債券	10,000,000	10,373,300	
第18回株式会社日本政策金融公庫社債 （一般担保付）	100,000,000	104,662,000	
第18回政府保証地方公共団体金融機構 債券	101,000,000	100,448,540	
第190回政府保証首都高速道路債券	100,000,000	102,915,000	
第193回政府保証首都高速道路債券	104,000,000	107,888,560	
第19回政府保証地方公共団体金融機構 債券	100,000,000	101,989,000	
第1回公営企業債券（5年）	200,000,000	202,252,000	
第1回政府保証地方公営企業等金融機構 債券	202,000,000	215,259,280	
第1回政府保証地方公共団体金融機構 債券	100,000,000	105,732,000	
第1回政府保証東日本高速道路債券	100,000,000	105,101,000	
第1回政府保証日本高速道路保有・債務 返済機構債	100,000,000	104,778,000	
第1回政府保証日本政策金融公庫債券	100,000,000	102,512,000	
第1回政府保証農林漁業金融公庫債券	12,000,000	12,148,440	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機 構債券	52,210,000	54,814,234	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構 債券	68,020,000	71,314,208	
第1回中日本高速道路株式会社社債（一 般担保付）	100,000,000	103,037,000	
第200回政府保証首都高速道路債券	100,000,000	103,773,000	
第21回道路債券	100,000,000	110,530,000	
第222回信金中金債（5年）	200,000,000	203,806,000	
第224回信金中金債（5年）	100,000,000	102,182,000	
第226回信金中金債（5年）	100,000,000	102,179,000	
第228回信金中金債（5年）	100,000,000	102,546,000	
第22回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	109,938,000	
第233回信金中金債（5年）	100,000,000	102,709,000	
第237回信金中金債（5年）	100,000,000	101,988,000	
第23回政府保証日本高速道路保有・債 務返済機構債券	100,000,000	106,514,000	
第24回鉄道建設・運輸施設整備支援機 構債券	100,000,000	101,172,000	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構 債券	79,314,000	84,137,084	
第25回鉄道建設・運輸施設整備支援機 構債券	100,000,000	106,394,000	
第28回公営企業債券	100,000,000	107,713,000	

第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	85,346,000	88,939,066	
第2回政府保証成田国際空港債券	147,000,000	154,810,110	
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,932,000	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	53,769,000	56,807,486	
第30回公営企業債券	100,000,000	108,532,000	
第30回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,668,000	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	86,423,000	89,889,426	
第30回中小企業債券	40,000,000	40,467,600	
第315回政府保証道路債券	225,000,000	226,881,000	
第316回政府保証道路債券	120,000,000	120,862,800	
第319回政府保証道路債券	30,000,000	30,413,100	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	88,584,000	91,602,942	
第322回東京交通債券	10,000,000	11,193,400	
第323回政府保証道路債券	100,000,000	102,898,000	
第327回政府保証道路債券	100,000,000	103,302,000	
第328回政府保証道路債券	114,000,000	117,874,860	
第331回政府保証道路債券	102,000,000	106,632,840	
第333回政府保証道路債券	48,000,000	49,985,760	
第344回東京交通債券	100,000,000	103,516,000	
第346回政府保証道路債券	143,000,000	148,915,910	
第346回東京交通債券	20,000,000	19,464,600	
第347回政府保証道路債券	181,000,000	187,852,660	
第34回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,782,000	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,408,000	93,585,841	
第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,449,000	
第36回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	215,000,000	232,066,700	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	65,294,000	67,463,719	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	92,766,000	95,605,567	
第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,582,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,732,000	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	65,168,000	67,220,792	

第3回公営企業債券(20年)	10,000,000	9,696,300	
第3回政府保証首都高速道路株式会社債券	103,000,000	109,835,080	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	64,989,000	69,166,492	
第42回道路債券	100,000,000	108,009,000	
第44回政府保証日本高速道路保有・債務返機構債	100,000,000	106,989,000	
第44回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,033,000	
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,088,000	99,866,658	
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	61,269,000	64,946,978	
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,516,000	100,778,885	
第47回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,797,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,213,000	
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,293,000	101,816,804	
第48回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,639,000	
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	68,093,000	72,057,374	
第4回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債	100,000,000	101,257,000	
第4回貸付債権担保5種住宅金融支援機構債券	59,272,000	61,679,035	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	67,920,000	71,879,056	
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	198,828,000	202,090,767	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	99,802,000	101,278,071	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	68,219,000	71,306,591	
第54回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	30,000,000	31,565,400	
第56回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	111,000,000	116,781,990	
第5回SBAB銀行AB(PUBL)円貨社債	100,000,000	100,007,000	
第5回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	108,086,000	
第5回公営企業債券	100,000,000	100,808,000	
第5回新東京国際空港債券	100,000,000	103,131,000	
第5回政府保証首都高速道路株式会社債券	80,000,000	84,126,400	

第5回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	104,433,000	
第5回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債	100,000,000	105,350,000	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	41,880,000	43,159,434	
第5回本州四国連絡橋債券	100,000,000	108,292,000	
第60回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	102,226,000	
第60回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,847,000	
第62回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	181,000,000	194,060,960	
第6回公営企業債券	10,000,000	10,061,700	
第6回阪神高速道路債券	100,000,000	103,748,000	
第6回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債	100,000,000	108,023,000	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	91,112,000	96,176,004	
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	60,747,000	62,825,762	
第6回都市基盤整備債券	100,000,000	100,948,000	
第7回公営企業債券（20年）	100,000,000	109,070,000	
第7回首都高速道路株式会社社債	100,000,000	100,738,000	
第7回地方公共団体金融機構債券（20年）	100,000,000	105,670,000	
第7回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	104,953,000	
第827回政府保証公営企業債券	100,000,000	100,717,000	
第836回政府保証公営企業債券	10,000,000	10,264,800	
第838回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,302,000	
第839回政府保証公営企業債券	128,000,000	132,341,760	
第840回政府保証公営企業債券	13,000,000	13,485,160	
第848回政府保証公営企業債券	100,000,000	103,438,000	
第84回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	104,885,000	
第855回政府保証公営企業債券	140,000,000	145,286,400	
第859回政府保証公営企業債券	131,000,000	137,362,670	
第862回政府保証公営企業債券	200,000,000	212,756,000	
第866回政府保証公営企業債券	100,000,000	107,671,000	
第867回政府保証公営企業債券	100,000,000	106,776,000	
第872回政府保証公営企業債券	200,000,000	214,328,000	
第874回政府保証公営企業債券	100,000,000	106,703,000	
第875回政府保証公営企業債券	112,000,000	119,582,400	

	第876回政府保証公営企業債券	122,000,000	131,684,360	
	第8回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	106,486,000	
	第8回公営企業債券(20年)	40,000,000	43,841,600	
	第8回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債	100,000,000	105,417,000	
	第8回西日本高速道路株式会社社債	200,000,000	200,076,000	
	第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	47,194,000	49,676,876	
	第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	65,422,000	68,265,894	
	第8回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	104,833,000	
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	110,327,000	
	第98回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	300,000,000	310,986,000	
	第9回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債	100,000,000	108,035,000	
	第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	47,085,000	49,768,845	
	小計	16,757,668,000	17,452,686,312	
社債券	第11回シティグループ・インク円貨社債(2003)	200,000,000	197,840,000	
	第11回パナソニック株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,260,000	
	第123回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	100,000,000	101,088,000	
	第12回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	101,572,000	
	第133回オリックス株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,819,000	
	第138回オリックス株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,835,000	
	第13回積水ハウス株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,678,000	
	第14回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,610,000	
	第15回シエイエフイーホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,513,000	
	第15回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	102,360,000	
	第15回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	100,000,000	100,001,000	
	第15回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	103,736,000	
	第16回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	200,000,000	204,692,000	

第16回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	107,654,000	
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	109,555,000	
第17回電源開発株式会社無担保社債間限定同順位特約付	200,000,000	211,464,000	
第17回東日本旅客鉄道株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	110,565,000	
第18回ゼネラル・エレクトリック・キャピタル・コーポ円貨社債	100,000,000	101,929,000	
第18回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債間限定同順位特約付	200,000,000	202,730,000	
第19回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	111,037,000	
第1回A号日本生命2009基金特定目的会社特定社債(一般担保付)	100,000,000	101,738,000	
第1回ラボバンク円貨社債	100,000,000	102,267,000	
第1回株式会社ジェイテクト無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,367,000	
第1回大和ハウス工業株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,261,000	
第20回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	200,000,000	202,824,000	
第20回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	107,188,000	
第20回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,849,000	
第21回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	105,352,000	
第22回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	99,901,000	
第22回野村ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	100,570,000	
第23回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債間限定特約付	100,000,000	99,756,000	
第23回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	108,674,000	
第248回北陸電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	114,481,000	
第24回シャープ株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	101,451,000	
第24回三井不動産株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,784,000	
第24回三菱重工工業株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,803,000	

第257回四国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,465,000	
第25回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	100,983,000	
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	98,948,000	
第261回北海道電力株式会社社債(一般担保付)	31,000,000	34,388,300	
第26回富士通株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,021,000	
第27回トヨタファイナンス株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	106,649,000	
第27回大阪瓦斯株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	101,964,000	
第285回北海道電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	104,222,000	
第286回北海道電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,768,000	
第28回住友化学工業株式会社無担保社債	100,000,000	103,604,000	
第28回住友金属鉱山株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,691,000	
第2回ウォルマート・ストアーズ・インク円貨社債(2008)	100,000,000	102,588,000	
第2回三菱信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	103,618,000	
第2回大日本住友製薬株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,122,000	
第2回東日本旅客鉄道株式会社社債	100,000,000	115,218,000	
第30回京王電鉄株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,554,000	
第30回京浜急行電鉄株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,676,000	
第30回東京瓦斯株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,520,000	
第32回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	100,883,000	
第362回中国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	104,016,000	
第364回中国電力株式会社社債(一般担保付)	107,700,000	107,836,779	
第376回東北電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	111,889,000	
第380回東北電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	113,473,000	
第382回東北電力株式会社社債(一般担保付)	20,000,000	22,393,000	

第387回九州電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	104,141,000	
第39回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	102,630,000	
第3回エイチエスピーシー・バンク・ピーエルシー円貨社債	100,000,000	97,930,000	
第3回キリンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	106,091,000	
第3回株式会社サンケイビル無担保社債 間限定同順位特約付	100,000,000	100,731,000	
第3回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	100,000,000	107,300,000	
第3回松下電工株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	104,484,000	
第405回中部電力株式会社社債(一般担保付)	50,000,000	56,097,500	
第408回九州電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,962,000	
第408回中部電力株式会社社債(一般担保付)	50,000,000	56,160,000	
第40回日立キャピタル株式会社無担保社債間同順位特約付	100,000,000	101,055,000	
第425回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	91,857,000	
第451回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	105,019,000	
第455回東京電力株式会社社債(一般担保付)	120,000,000	83,199,600	
第459回東京電力株式会社社債(一般担保付)	10,000,000	7,267,900	
第46回株式会社三井住友銀行無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,456,000	
第471回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	101,311,000	
第473回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,871,000	
第474回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,879,000	
第47回株式会社三井住友銀行無担保社債間限定同順位特約付	200,000,000	203,384,000	
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,363,000	
第4回ウエストバック・バンキング・コーポレーション円貨社債	100,000,000	102,877,000	
第4回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債(2010)	100,000,000	100,766,000	

第4回パークレイズ・バンク・ピーエルシー円貨社債(2010)	100,000,000	98,487,000	
第4回株式会社フジ・メディア・ホールディングス無担保社債	100,000,000	102,429,000	
第4回電源開発株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,596,000	
第501回東京電力株式会社社債(一般担保付)	30,000,000	27,240,900	
第505回東京電力株式会社社債(一般担保付)	30,000,000	26,976,300	
第50回株式会社東芝無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,706,000	
第50回日本電信電話株式会社電信電話債券(一般担保付)	100,000,000	104,483,000	
第510回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	88,356,000	
第518回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	80,328,000	
第51回日産自動車株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,961,000	
第51回日本電信電話株式会社電信電話債券(一般担保付)	100,000,000	107,269,000	
第521回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	77,062,000	
第528回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	68,683,000	
第52回日産自動車株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,178,000	
第536回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	68,558,000	
第53回伊藤忠商事株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,289,000	
第53回三井物産株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,973,000	
第542回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	68,818,000	
第544回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	69,234,000	
第554回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	68,521,000	
第55回新日本製鐵株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,981,000	
第5回株式会社ドン・キホーテ無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,162,000	
第5回株式会社資生堂無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	100,918,000	

第5回日本たばこ産業株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,131,000	
第69回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	107,671,000	
第6回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債	100,000,000	100,016,000	
第6回株式会社りそな銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	103,319,000	
第6回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	104,273,000	
第70回住友不動産株式会社無担保社債 間限定同順位特約付	100,000,000	102,740,000	
第74回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	105,277,000	
第75回丸紅株式会社無担保社債(社債 間限定同順位特約付)	100,000,000	101,913,000	
第7回KDDI株式会社無担保社債間限 定同順位特約付	100,000,000	104,683,000	
第7回ウエストパック・バンキング・ コーポレーション円貨社債	100,000,000	100,494,000	
第7回エーザイ株式会社無担保社債	100,000,000	105,055,000	
第7回麒麟ホールディングス株式会社 無担保社債	100,000,000	105,307,000	
第7回ジャパンリアルエステイト投資法 人無担保投資法人債	100,000,000	101,597,000	
第7回トヨタ自動車株式会社無担保社債 (社債間限定同等特約付)	200,000,000	204,658,000	
第7回パナソニック株式会社無担保社債 間限定同順位特約付	100,000,000	102,684,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通 社債	20,000,000	21,892,000	
第8回旭化成株式会社無担保社債間限定 同順位特約付	100,000,000	103,916,000	
第8回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	104,053,000	
第8回株式会社大和証券グループ本社無 担保社債	100,000,000	101,876,000	
第8回三菱UFJリース無担保社債間限定同 順位特約付	100,000,000	100,602,000	
第8回昭和シェル石油株式会社無担保社 債間限定同順位特約付	100,000,000	100,230,000	
第93回株式会社三菱東京UFJ銀行無担 保社債間限定同順位特約付	100,000,000	108,020,000	
第9回ザ・ゴールドマン・サックス・グ ループ・インク円貨社債	100,000,000	98,065,000	
第9回株式会社日興コーディアルグルー プ無担保社債	100,000,000	100,416,000	
第9回三井倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	102,675,000	

第9回三菱UFJリース株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,730,000	
第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債間限定同順位特約付	19,000,000	20,949,400	
第9回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	113,832,000	
第9回東京地下鉄株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,892,000	
小計	13,587,700,000	13,746,701,679	
合計	170,710,948,000	177,919,655,792	

2)信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

3)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。

[次へ](#)

「住信 外国株式インデックス マザーファンド」の状況

(1)貸借対照表

(単位：円)

	(平成22年 9月30日現在)	(平成23年 9月30日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	3,184,363,077	3,518,774,010
コール・ローン	91,498,278	181,950,010
株式	116,722,352,011	106,417,415,359
投資信託受益証券	259,795,974	121,916,421
投資証券	1,860,235,128	1,885,264,603
派生商品評価勘定	24,228,987	82,893,677
未収入金	33,433,539	1,411,126
未収配当金	194,507,465	212,120,051
未収利息	239	226
差入委託証拠金	884,769,536	1,282,229,752
流動資産合計	123,255,184,234	113,703,975,235
資産合計	123,255,184,234	113,703,975,235
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	9,678,568	23,018,264
未払金	140,438,579	10,265,807
未払解約金	52,702,868	39,503,483
流動負債合計	202,820,015	72,787,554
負債合計	202,820,015	72,787,554
純資産の部		
元本等		
元本	142,024,271,866	147,276,730,211
剰余金		
剰余金又は欠損金()	18,971,907,647	33,645,542,530
元本等合計	123,052,364,219	113,631,187,681
純資産合計	123,052,364,219	113,631,187,681
負債純資産合計	123,255,184,234	113,703,975,235

(注)「住信 外国株式インデックス マザーファンド」の計算期間は、原則として毎年5月30日から翌年5月29日までであり、「すみしん DCマイセレクション50」の計算期間とは異なっております。上記の表は、平成22年9月30日及び平成23年9月30日現在の同マザーファンドの貸借対照表です。

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	(自 平成21年10月 1日 至 平成22年 9月30日)	(自 平成22年10月 1日 至 平成23年 9月30日)
1. 資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 株式 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、金融商品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）、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。</p> <p>(2) 投資信託受益証券 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、金融商品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）、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。</p> <p>(3) 投資証券 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、金融商品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）、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。</p> <p>(4) 先物取引 個別法に基づき、時価評価しております。</p> <p>(5) 外国為替予約 個別法に基づき、時価評価しております。</p>	<p>(1) 株式 同左</p> <p>(2) 投資信託受益証券 同左</p> <p>(3) 投資証券 同左</p> <p>(4) 先物取引 同左</p> <p>(5) 外国為替予約 同左</p>
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として我が国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等の会計処理は「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）第60条及び第61条に基づいております。</p>	同左

3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式・投資信託受益証券・投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額を計上し、まだ確定していない場合には、入金日基準で計上しております。	受取配当金 同左
----------------	---	-------------

(貸借対照表に関する注記)

	(平成22年 9月30日現在)	(平成23年 9月30日現在)
1. 期首元本額	137,441,585,574円	142,024,271,866円
期中追加設定元本額	26,113,980,149円	28,982,176,288円
期中一部解約元本額	21,531,293,857円	23,729,717,943円
期末元本額	142,024,271,866円	147,276,730,211円
元本額の内訳		
SBI資産設計オープン（資産成長型）	596,907,264円	791,647,461円
SBI資産設計オープン（分配型）	33,064,350円	29,935,790円
STAM グローバル株式インデックス・オープン	12,169,756,947円	14,784,734,665円
世界経済インデックスファンド	266,477,247円	560,506,038円
すみしん マイセレクション25	33,255,194円	25,001,152円
すみしん マイセレクション50	126,303,991円	106,475,107円
すみしん マイセレクション75	115,239,995円	104,055,818円
すみしん 外国株式インデックス・オープン	1,372,242,575円	1,441,334,100円
すみしん DCマイセレクション25	783,775,433円	966,092,398円
すみしん DCマイセレクション50	4,779,047,450円	5,248,146,429円
すみしん DCマイセレクション75	4,825,143,404円	5,449,870,546円
すみしん DC外国株式インデックス・オープン	4,011,911,792円	4,808,558,155円
すみしん DCマイセレクションS25	65,121,358円	255,847,151円
すみしん DCマイセレクションS50	533,927,070円	1,240,068,374円
すみしん DCマイセレクションS75	454,056,173円	889,146,517円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2015	8,702,419円	11,495,082円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2025	34,340,883円	118,252,487円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2035	29,323,661円	98,773,022円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2045	12,164,312円	34,076,923円
すみしん DCマルチアセット ファンド	371,236円	75,626円
STAM 外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	6,470,012,102円	10,538,498,441円
すみしん マイセレクション50 V A 1 （適格機関投資家専用）	337,690,473円	297,258,482円
すみしん マイセレクション75 V A 1 （適格機関投資家専用）	176,542,084円	155,797,065円
すみしん 外国株式インデックス・オープンVA1 （適格機関投資家専用）	629,794,681円	585,674,871円

すみしん マイセレクション50V A 2 (適格機関投資家専用)	1,865,163円	1,447,450円
すみしん バランス30V A 1 (適格機関投資家専用)	1,627,695,727円	1,553,950,894円
すみしん バランス50V A 1 (適格機関投資家専用)	5,990,514,392円	5,732,224,311円
すみしん バランス25VA2(適格機関投資家専用)	16,172,611,936円	14,810,980,092円
すみしん バランス50VA2(適格機関投資家専用)	4,707,873,629円	4,365,776,102円
すみしん バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	6,837,857,935円	6,714,513,076円
すみしん バランスB(37.5)VA1 (適格機関投資家専用)	1,798,038,043円	1,719,985,081円
すみしん バランスC(50)VA1 (適格機関投資家専用)	10,843,686,556円	10,445,803,514円
すみしん 世界バランスVA1 (適格機関投資家専用)	24,016,966,166円	22,515,112,751円
すみしん 世界バランスVA2 (適格機関投資家専用)	11,223,333,920円	10,457,199,894円
すみしん バランスD(35)VA1 (適格機関投資家専用)	1,976,807,649円	1,872,643,990円
すみしん グローバルバランスファンドVA35 (適格機関投資家専用)	1,821,625,106円	1,761,347,533円
すみしん バランスE(25)VA1 (適格機関投資家専用)	736,456,607円	629,743,240円
住信 グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,669,567,795円	1,732,245,405円
住信 FOFs用外国株式インデックス・オープン (適格機関投資家専用)	7,966,508,811円	8,058,902,674円
住信 外国株式ファンド・シリーズ1	6,767,690,337円	6,363,532,504円
2. 元本の欠損	純資産額は、元本を 18,971,907,647円下回っており ます。	純資産額は、元本を 33,645,542,530円下回っており ます。
3. 計算期間末日における受益権の総数	142,024,271,866口	147,276,730,211口

(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21年10月 1日 至 平成22年 9月30日)	(自 平成22年10月 1日 至 平成23年 9月30日)
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、金融商品に対する取組方針は投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。	同左

2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	<p>当ファンドは、日本を除く世界の主要国の株式市場の動きをとらえることをめざして、MSCIコクサイ・インデックス(除く日本、円ベース)に連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>なお、当ファンドには、以下のリスクがあります。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・ 価格変動リスク ・ 為替変動リスク 	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>運用各部から独立した部署によって、ファンドの運用状況や運用ガイドライン、法令等の遵守状況についてモニタリングを行っております（運用を再委託しているファンドも含まれます。）。</p> <p>モニタリング結果は、原則月1回（必要に応じ随時）開催される運用リスクの管理に関する委員会に報告され、委員会は適切な運用リスク管理に必要な措置を講じることとしております。</p>	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価額がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>	同左

金融商品の時価に関する事項

項目	（平成22年 9月30日現在）	（平成23年 9月30日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>a. 株式、投資信託受益証券、投資証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p>	<p>a. 株式、投資信託受益証券、投資証券 同左</p>

b. 先物取引

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

外貨建て先物取引の時価の邦貨換算額は計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。換算において円未満の端数は切り捨てております。

c. 外国為替予約

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

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

計算期間末日において当該日の対顧客先物相場が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算期間末日に当該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該当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おります。

- ・ 計算期間末日に当該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、該当日に最も近い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。

2. 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

b. 先物取引

同左

c. 外国為替予約

同左

	d. コールローン等の金銭債権及び金銭債務 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。	d. コールローン等の金銭債権及び金銭債務 同左
--	--	-----------------------------

(追加情報)

(自 平成21年10月 1日 至 平成22年 9月30日)	(自 平成22年10月 1日 至 平成23年 9月30日)
当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 平成20年3月10日)及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日)を適用しております。	

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	(平成22年 9月30日現在)	(平成23年 9月30日現在)
	当計算期間の損益に含まれた 評価差額(円)	当計算期間の損益に含まれた 評価差額(円)
株 式	6,337,768,372	17,218,358,370
投資信託受益証券	6,529,645	27,285,439
投資証券	135,504,116	274,606,655
合 計	6,479,802,133	17,520,250,464

(注) 当計算期間の損益に含まれた評価差額は、当親投資信託の計算期間開始日から本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日までの期間に対応する金額であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

区分	種 類	(平成22年 9月30日現在)			
		契 約 額 等(円)		時 価 (円)	評 価 損 益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	S&P 500 FUTU	1,268,609,414		1,291,008,212	22,398,798
	S&P/TSE 60	137,699,139		138,934,698	1,235,559
	SPI 200 FUTU	162,246,363		161,761,736	484,627
	FTSE 100	271,718,773		272,266,037	547,264
	SWISS MKT IX	104,879,109		102,950,508	1,928,601
	DJ EURO STOXX	457,980,163		450,909,849	7,070,314
合 計	2,403,132,961		2,417,831,040	14,698,079	

（注）時価の算定方法

前述の（金融商品の時価に関する事項）に記載していますのでここでは省略しております。

株式関連

区分	種類	（平成23年 9月30日現在）			
		契約額等（円）		時価 （円）	評価損益 （円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	S&P 500 FUTU	3,483,836,390		3,478,743,000	5,093,390
	S&P/TSE 60	364,887,795		356,671,502	8,216,293
	SPI 200 FUTU	382,600,264		376,413,773	6,186,491
	FTSE 100	660,385,428		661,722,658	1,337,230
	SWISS MKT IX	253,422,352		262,547,765	9,125,413
	DJ EURO STOXX	939,584,419		1,008,242,881	68,658,462
合計	6,084,716,648		6,144,341,579	59,624,931	

（注）時価の算定方法

前述の（金融商品の時価に関する事項）に記載していますのでここでは省略しております。

通貨関連

区分	種類	（平成22年 9月30日現在）			
		契約額等（円）		時価 （円）	評価損益 （円）
			うち1年超		
市場取引 以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカドル	1,678,780		1,676,200	2,580
	イギリスポンド	2,653,960		2,653,200	760
	香港ドル	2,163,980		2,160,000	3,980
	売建				
	アメリカドル	940,292,100		940,348,200	56,100
	カナダドル	99,011,540		99,027,400	15,860
	オーストラリアドル	71,658,400		71,658,400	0
	イギリスポンド	220,190,700		220,215,600	24,900
	スイスフラン	68,648,000		68,656,000	8,000
	香港ドル	24,828,500		24,840,000	11,500
	シンガポールドル	14,630,760		14,632,600	1,840
	スウェーデンクローナ	29,904,000		29,904,000	0
	ノルウェークローネ	8,584,800		8,586,000	1,200
デンマーククローネ	9,193,200		9,192,000	1,200	
イスラエルシェケル	8,274,960		8,272,800	2,160	

	ユーロ	277,554,600		277,578,900	24,300
	合計	1,779,268,280		1,779,401,300	147,660

(注) 時価の算定方法

前述の(金融商品の時価に関する事項)に記載していますのでここでは省略しております。

通貨関連

区分	種類	(平成23年 9月30日現在)			
		契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引 以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカドル	620,650,188		620,784,000	133,812
	カナダドル	58,422,535		58,420,500	2,035
	オーストラリアドル	38,310,180		38,306,100	4,080
	イギリスポンド	107,711,900		107,775,600	63,700
	スイスフラン	46,928,870		46,959,000	30,130
	香港ドル	10,321,290		10,321,500	210
	シンガポールドル	12,396,690		12,406,800	10,110
	スウェーデンクローナ	15,745,975		15,750,000	4,025
	ノルウェークローネ	3,306,750		3,305,000	1,750
	デンマーククローネ	6,283,080		6,291,000	7,920
	イスラエルシェケル	5,151,250		5,150,000	1,250
ユーロ	138,430,010		138,439,700	9,690	
合計		1,063,658,718		1,063,909,200	250,482

(注) 時価の算定方法

前述の(金融商品の時価に関する事項)に記載していますのでここでは省略しております。

(関連当事者との取引に関する注記)

(自 平成21年10月 1日 至 平成22年 9月30日)	(自 平成22年10月 1日 至 平成23年 9月30日)
本報告書における開示対象ファンドの計算期間中に利害関係人との間で、一般の取引条件と同様のもの以外の取引は行っておりません。 また、当ファンドの関連当事者である受託会社及び投資信託委託業者と財務諸表上で開示している報酬等の給付以外の取引は行っておりません。	同左

(1口当たり情報)

(平成22年 9月30日現在)	(平成23年 9月30日現在)
1口当たり純資産額 = 0.8664円	1口当たり純資産額 = 0.7715円

(3)附属明細表（平成23年9月30日現在）

1)有価証券明細表

株式

通貨	銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	3 M COMPANY	49,326	74.53	3,676,266.78	
	ABBOTT LABORATORIES	113,573	51.85	5,888,760.05	
	ABERCROMBIE & FITCH CO-CL A	6,433	64.18	412,869.94	
	ACCENTURE PLC-CL A	47,444	54.44	2,582,851.36	
	ACE LTD	24,654	61.72	1,521,644.88	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	36,980	11.98	443,020.40	
	ADOBE SYSTEMS INC	36,861	24.99	921,156.39	
	ADVANCE AUTO PARTS	5,714	59.00	337,126.00	
	ADVANCED MICRO DEVICES	42,704	5.31	226,758.24	
	AES CORP	48,571	10.26	498,338.46	
	AETNA INC	27,730	37.22	1,032,110.60	
	AFLAC	34,176	35.88	1,226,234.88	
	AGCO CORP	6,928	36.02	249,546.56	
	AGILENT TECHNOLOGIES	25,218	32.52	820,089.36	
	AIR PRODUCTS&CHEMICALS	15,484	79.29	1,227,726.36	
	AIRGAS INC	5,449	65.77	358,380.73	
	AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	13,643	20.99	286,366.57	
	ALCOA	77,571	10.06	780,364.26	
	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	13,344	64.23	857,085.12	
	ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	7,367	38.80	285,839.60	
	ALLERGAN INC	22,271	85.03	1,893,703.13	
	ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,728	93.65	349,127.20	
	ALLIANT ENERGY CORPORATION	8,107	38.87	315,119.09	
	ALLSTATE CORP	38,160	24.56	937,209.60	
	ALPHA NATURAL RESOURCES INC	16,554	18.71	309,725.34	
	ALTERA CORPORATION	23,545	33.07	778,633.15	
	ALTRIA GROUP INC	152,966	26.44	4,044,421.04	
	AMAZON.COM	26,498	222.44	5,894,215.12	
	AMEREN CORPORATION	17,621	30.27	533,387.67	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	35,205	38.47	1,354,336.35	
	AMERICAN EXPRESS	79,058	46.72	3,693,589.76	
	AMERICAN INT'L GROUP	34,649	22.89	793,115.61	
	AMERICAN TOWER-A	28,982	53.59	1,553,145.38	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	12,813	30.36	389,002.68		
AMERIPRISE FINANCIAL INC	17,704	41.11	727,811.44		

AMERISOURCEBERGEN CORP	20,019	37.72	755,116.68
AMETEK INC	11,751	34.43	404,586.93
AMGEN	67,936	55.78	3,789,470.08
AMPHENOL CORPORATION	12,872	43.20	556,070.40
ANADARKO PETROLEUM CORP	36,354	67.15	2,441,171.10
ANALOG DEVICES	21,895	32.41	709,616.95
AON CORP	21,738	42.29	919,300.02
APACHE CORP	28,019	82.88	2,322,214.72
APOLLO GROUP INC-CLA	9,307	40.96	381,214.72
APPLE INC	67,573	390.57	26,391,986.61
APPLIED MATERIALS	96,326	10.62	1,022,982.12
ARCH CAPITAL GROUP LTD	9,851	32.54	320,551.54
ARCH COAL INC	15,406	15.37	236,790.22
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	46,611	25.77	1,201,165.47
ARROW ELECTRONICS INC	8,481	29.03	246,203.43
ASSURANT INC	6,946	36.14	251,028.44
AT&T INC	432,727	28.84	12,479,846.68
AUTODESK INC	16,792	29.29	491,837.68
AUTOLIV INC	6,534	50.19	327,941.46
AUTOMATIC DATA PROCESS	36,514	48.12	1,757,053.68
AUTOZONE INC	1,832	317.58	581,806.56
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	15,312	33.17	507,899.04
AVERY DENNISON CORP	7,057	26.48	186,869.36
AVNET INC	11,164	27.18	303,437.52
AVON PRODUCTS INC	31,434	19.83	623,336.22
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	8,984	25.70	230,888.80
BAKER HUGHES	31,759	48.59	1,543,169.81
BALL CORP	11,693	31.61	369,615.73
BANK NEW YORK CO	90,734	19.37	1,757,517.58
BANK OF AMERICA CORP	740,426	6.35	4,701,705.10
BARD C R INC	6,259	88.89	556,362.51
BAXTER INTERNATIONAL	41,678	56.21	2,342,720.38
BB&T CORP	50,892	22.08	1,123,695.36
BECTON DICKINSON & CO	15,984	74.34	1,188,250.56
BED BATH & BEYOND INC	18,254	59.39	1,084,105.06
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	65,949	72.71	4,795,151.79
BEST BUY COMPANY INC	24,210	24.38	590,239.80
BIOGEN IDEC INC	16,773	94.46	1,584,377.58
BLACKROCK INC	6,768	151.66	1,026,434.88
BLOCK H & R INC	22,367	13.73	307,098.91
BMC SOFTWARE	12,923	39.90	515,627.70

BOEING CO	51,249	62.37	3,196,400.13
BORGWARNER INC	8,024	61.54	493,796.96
BOSTON SCIENTIFIC CORP	111,668	6.10	681,174.80
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	124,658	31.12	3,879,356.96
BROADCOM CORP-CL A	35,264	34.22	1,206,734.08
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	6,151	69.96	430,323.96
BUNGE LIMITED	10,759	58.96	634,350.64
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	11,909	68.37	814,218.33
CA INC	29,585	20.03	592,587.55
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	15,403	16.67	256,768.01
CABOT OIL & GAS CORP	7,634	64.13	489,568.42
CALPINE CORP	22,805	14.33	326,795.65
CAMERON INTERNATIONAL CORP	17,904	43.54	779,540.16
CAMPBELL SOUP CO (US)	13,911	32.27	448,907.97
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	33,515	41.03	1,375,120.45
CARDINAL HEALTH	25,618	43.04	1,102,598.72
CAREFUSION CORP	16,327	24.58	401,317.66
CARMAX INC	16,549	24.00	397,176.00
CATERPILLAR	47,108	75.39	3,551,472.12
CB RICHARD ELLIS GROUP INC-A	21,372	14.41	307,970.52
CBS CORP-CL B	45,807	20.97	960,572.79
CELANESE CORP-SERIES A	11,415	35.88	409,570.20
CELGENE CORP	33,817	62.93	2,128,103.81
CENTERPOINT ENERGY INC	29,531	19.96	589,438.76
CENTURYLINK INC	44,920	33.72	1,514,702.40
CEPHALON INC	5,621	81.04	455,525.84
CERNER CORP	10,448	70.49	736,479.52
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	5,223	140.94	736,129.62
CHESAPEAKE ENERGY CORP	48,056	26.78	1,286,939.68
CHEVRON CORP	146,890	94.39	13,864,947.10
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,280	313.14	713,959.20
CHUBB CORPORATION	21,377	60.52	1,293,736.04
CHURCH & DWIGHT CO INC	10,420	44.49	463,585.80
CIGNA CORP	19,771	42.52	840,662.92
CIMAREX ENERGY CO	6,250	57.42	358,875.00
CINCINNATI FINANCIAL CORP	11,315	26.79	303,128.85
CINTAS CORP	9,556	28.88	275,977.28
CISCO SYSTEMS	401,904	15.85	6,370,178.40
CIT GROUP INC	13,920	31.61	440,011.20
CITIGROUP	212,344	26.90	5,712,053.60
CITRIX SYSTEMS INC	13,737	56.86	781,085.82

CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	10,570	54.19	572,788.30
CLOROX COMPANY	9,565	66.90	639,898.50
CME GROUP INC	4,655	257.18	1,197,172.90
COACH INC	21,513	54.00	1,161,702.00
COCA-COLA CO	150,550	69.05	10,395,477.50
COCA-COLA ENTERPRISES	23,750	25.21	598,737.50
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	22,232	65.05	1,446,191.60
COLGATE-PALMOLIVE CO	35,724	89.54	3,198,726.96
COMCAST CORP-CL A	152,727	21.69	3,312,648.63
COMCAST CORP-SPECIAL A	49,267	21.43	1,055,791.81
COMERICA INC	14,682	23.95	351,633.90
COMPUTER SCIENCES CORP	11,333	27.63	313,130.79
CONAGRA	29,878	24.36	727,828.08
CONCHO RESOURCES INC	7,176	74.19	532,387.44
CONOCOPHILLIPS	98,122	64.37	6,316,113.14
CONSOL ENERGY INC	16,561	35.02	579,966.22
CONSOLIDATED EDISON INC	21,379	57.31	1,225,230.49
CONSTELLATION BRANDS INC-A	13,841	18.39	254,535.99
CONSTELLATION ENERGY GROUP	13,932	38.67	538,750.44
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	3,121	50.80	158,546.80
COOPER INDUSTRIES PLC-CL A	12,058	48.37	583,245.46
CORNING	114,715	12.66	1,452,291.90
COSTCO WHOLESALE CORP	31,922	82.98	2,648,887.56
COVANCE INC	4,199	46.29	194,371.71
COVENTRY HEALTH CARE INCON	10,831	29.18	316,048.58
COVIDIEN PLC	36,224	45.15	1,635,513.60
CREE INC	7,602	27.51	209,131.02
CROWN CASTLE INTL CORP	21,222	41.21	874,558.62
CROWN HOLDINGS INC	11,395	31.12	354,612.40
CSX CORP	80,580	19.58	1,577,756.40
CUMMINS INC	13,623	86.45	1,177,708.35
CVS CAREMARK CORPORATION	99,080	34.08	3,376,646.40
DANAHER CORP	41,245	43.53	1,795,394.85
DARDEN RESTAURANTS INC	9,997	43.49	434,769.53
DAVITA INC	6,978	62.93	439,125.54
DEERE&CO	30,669	68.04	2,086,718.76
DELL INC	124,026	14.87	1,844,266.62
DELTA AIR LINES INC	15,452	7.95	122,843.40
DENBURY RESOURCES INC	29,366	12.01	352,685.66
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	10,287	31.45	323,526.15
DEVON ENERGY CORPORATION	29,364	57.67	1,693,421.88

DEVRY INC	4,788	38.27	183,236.76
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	5,079	56.80	288,487.20
DIRECTV	56,258	43.33	2,437,659.14
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	39,859	23.60	940,672.40
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	10,193	38.54	392,838.22
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	9,805	36.10	353,960.50
DISH NETWORK CORPORATION-A	15,117	26.19	395,914.23
DOLBY LABORATORIES INC-CL A	3,573	28.57	102,080.61
DOLLAR GENERAL CORP	10,008	37.72	377,501.76
DOLLAR TREE INC	8,960	75.28	674,508.80
DOMINION RESOURCES	42,074	51.25	2,156,292.50
DONNELLEY (RR) & SONS	14,356	14.64	210,171.84
DOVER CORP	13,634	47.75	651,023.50
DOW CHEMICAL CO	85,901	23.74	2,039,289.74
DR HORTON INC	21,061	9.44	198,815.84
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	16,175	38.16	617,238.00
DTE ENERGY COMPANY	12,374	49.45	611,894.30
DU PONT (E. I) DE NEMOURS	67,862	41.35	2,806,093.70
DUKE ENERGY CORP	97,282	20.13	1,958,286.66
DUN & BRADSTREET CORP	3,610	62.91	227,105.10
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	5,191	70.74	367,211.34
EATON CORP	23,685	36.81	871,844.85
EATON VANCE CORP	8,676	23.12	200,589.12
EBAY	85,355	30.67	2,617,837.85
ECOLAB INC	16,952	49.33	836,242.16
EDISON INTL	22,617	38.26	865,326.42
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	8,380	70.88	593,974.40
EL PASO CORP	56,189	17.72	995,669.08
ELECTRONIC ARTS INC	24,292	20.62	500,901.04
EMC CORP	150,349	21.33	3,206,944.17
EMERSON ELECTRIC CO	54,925	43.79	2,405,165.75
ENERGEN CORP	5,267	43.17	227,376.39
ENERGIZER HOLDINGS INC	5,092	69.01	351,398.92
ENTERGY CORP	13,004	67.02	871,528.08
EOG RESOURCES INC	19,615	73.78	1,447,194.70
EQT CORPORATION	10,373	55.49	575,597.77
EQUIFAX INC	8,993	31.36	282,020.48
ESTEE LAUDER CO-CL A	8,794	88.94	782,138.36
EVEREST RE GROUP LTD	3,967	79.26	314,424.42
EXELON CORP	48,401	43.30	2,095,763.30
EXPEDIA INC	14,523	27.10	393,573.30

EXPEDITORS INTL WASH INC	15,518	41.79	648,497.22
EXPRESS SCRIPTS INC	36,730	38.29	1,406,391.70
EXXON MOBIL	359,954	73.88	26,593,401.52
F5 NETWORKS INC	5,927	74.75	443,043.25
FAMILY DOLLAR STORES	8,812	50.99	449,323.88
FASTENAL CO	20,469	34.18	699,630.42
FEDEX CORP	21,912	69.70	1,527,266.40
FIDELITY NATIONAL FINL-A	14,773	15.47	228,538.31
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	17,875	24.79	443,121.25
FIFTH THIRD BANCORP	67,132	10.46	702,200.72
FIRST SOLAR INC	4,092	65.03	266,102.76
FIRSTENERGY CORP	30,559	45.41	1,387,684.19
FISERV INC	10,494	50.85	533,619.90
FLEXTRONICS INTL LTD	55,389	5.84	323,471.76
FLIR SYSTEMS INC	11,668	26.17	305,351.56
FLOWSERVE CORP	4,079	78.60	320,609.40
FLUOR CORP	12,735	49.56	631,146.60
FMC CORP	5,242	71.67	375,694.14
FMC TECHNOLOGIES INC	17,561	38.73	680,137.53
FORD MOTOR COMPANY	259,457	10.00	2,594,570.00
FOREST LABORATORIES INC	20,910	31.07	649,673.70
FORTUNE BRANDS INC	10,166	56.89	578,343.74
FOSSIL INC	3,941	88.90	350,354.90
FOSTER WHEELER AG	8,680	18.96	164,572.80
FRANKLIN RESOURCES INC	11,349	100.51	1,140,687.99
FREEMPORT-MCMOR-B	69,221	31.34	2,169,386.14
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	72,722	6.23	453,058.06
GAMESTOP CORP-CLASS A	10,555	23.99	253,214.45
GAP	29,983	16.77	502,814.91
GARMIN LTD	8,530	31.83	271,509.90
GENERAL DYNAMICS CORP	23,105	58.18	1,344,248.90
GENERAL ELECTRIC CO	774,951	15.86	12,290,722.86
GENERAL MILLS INC	46,649	38.91	1,815,112.59
GENERAL MOTORS CO	57,180	20.76	1,187,056.80
GENUINE PARTS CO	11,527	52.39	603,899.53
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	35,846	6.00	215,076.00
GILEAD SCIENCES INC	57,511	39.25	2,257,306.75
GOLDMAN SACHS GROUP INC	35,940	99.87	3,589,327.80
GOODRICH CORP	9,124	121.08	1,104,733.92
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	17,889	10.45	186,940.05

GOOGLE INC-CL A	18,486	527.50	9,751,365.00
GRAINGER (WW) INC	4,302	153.27	659,367.54
GREEN MOUNTAIN COFFEE ROASTE	9,331	96.39	899,415.09
HALLIBURTON CO	66,861	32.25	2,156,267.25
HANSEN NATURAL CORPORATION	5,490	88.32	484,876.80
HARLEY-DAVIDSON	17,312	36.12	625,309.44
HARRIS CORP	9,295	35.45	329,507.75
HARTFORD FINANCIAL SVCS	30,910	17.11	528,870.10
HASBRO INC	8,984	34.03	305,725.52
HCA HOLDINGS INC	10,778	19.80	213,404.40
HEINZ (H.J) CO	23,516	51.40	1,208,722.40
HELMERICH & PAYNE	7,816	43.35	338,823.60
HENRY SCHEIN INC	6,741	63.57	428,525.37
HERSHEY FOODS CORPORATION	12,047	58.95	710,170.65
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	18,747	9.36	175,471.92
HESS CORP	22,343	55.54	1,240,930.22
HEWLETT-PACKARD CO	158,121	23.78	3,760,117.38
HOLLYFRONTIER CORP	15,276	25.59	390,912.84
HOLOGIC INC	19,110	15.61	298,307.10
HOME DEPOT	117,095	33.79	3,956,640.05
HONEYWELL INTL INC	54,632	45.00	2,458,440.00
HORMEL FOODS CORP	10,732	27.20	291,910.40
HOSPIRA INC	12,259	37.67	461,796.53
HUDSON CITY BANCORP INC	32,951	5.86	193,092.86
HUMAN GENOME SCIENCES INC	13,856	13.73	190,242.88
HUMANA INC	12,305	75.07	923,736.35
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	7,028	37.77	265,447.56
IHS INC-CLASS A	3,080	75.63	232,940.40
ILLINOIS TOOL WORKS	32,885	43.20	1,420,632.00
ILLUMINA INC	8,871	41.54	368,501.34
INGERSOLL-RAND PLC	24,203	31.96	773,527.88
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	5,721	49.12	281,015.52
INTEL CORP	387,423	22.21	8,604,664.83
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	5,372	122.18	656,350.96
INTERPUBLIC GROUP OF COS	35,808	7.41	265,337.28
INTL BUSINESS MACHINES CORP	88,504	179.17	15,857,261.68
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	5,874	57.60	338,342.40
INT'L GAME TECHNOLOGY	21,975	14.89	327,207.75
INT'L PAPER CO	30,353	24.15	733,024.95
INTUIT INC	21,004	48.44	1,017,433.76
INTUITIVE SURGICAL INC	2,871	373.22	1,071,514.62

INVESCO PLC	33,764	16.46	555,755.44
IRON MOUNTAIN INC	13,198	32.31	426,427.38
ITT CORPORATION	12,780	43.47	555,546.60
J.C. PENNEY CO INC	11,717	27.58	323,154.86
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	9,266	34.61	320,696.26
JEFFERIES GROUP INC (NEW)	10,112	13.16	133,073.92
JM SMUCKER CO	8,475	73.90	626,302.50
JOHNSON & JOHNSON	200,298	63.90	12,799,042.20
JOHNSON CONTROLS INC	49,712	27.40	1,362,108.80
JOY GLOBAL INC	7,657	65.92	504,749.44
JPMORGAN CHASE & CO	290,361	31.39	9,114,431.79
JUNIPER NETWORKS INC	38,952	18.40	716,716.80
KBR INC	11,074	25.41	281,390.34
KELLOGG CO	18,561	53.85	999,509.85
KEY CORP	69,477	6.23	432,841.71
KIMBERLY-CLARK CORP	28,708	71.23	2,044,870.84
KINDER MORGAN INC	7,631	26.32	200,847.92
KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	6,259	59.32	371,283.88
KLA-TENCOR CORP	12,269	39.03	478,859.07
KOHL'S CORP	20,216	49.08	992,201.28
KRAFT FOODS INC-A	122,027	34.48	4,207,490.96
KROGER CO	41,994	22.22	933,106.68
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	7,867	63.36	498,453.12
LABORATORY CRP OF AMER	7,322	80.60	590,153.20
LAM RESEARCH CORP	9,097	38.32	348,597.04
LAS VEGAS SANDS CORP	26,707	41.33	1,103,800.31
LEGG MASON INC	10,328	26.83	277,100.24
LEGGETT & PLATT INC	9,883	20.58	203,392.14
LEUCADIA NATIONAL CORP	15,190	23.88	362,737.20
LIBERTY GLOBAL INC-A	8,682	36.93	320,626.26
LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	8,207	35.40	290,527.80
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION	41,923	15.34	643,098.82
LIFE TECHNOLOGIES CORP	13,063	38.92	508,411.96
LILLY (ELI) & CO	76,133	37.25	2,835,954.25
LIMITED	19,832	39.93	791,891.76
LINCOLN NATIONAL CORP	22,905	16.46	377,016.30
LINEAR TECHNOLOGY CORP	16,641	28.52	474,601.32
LOCKHEED MARTIN CORP	21,709	72.49	1,573,685.41
LOEWS CORP	23,898	35.23	841,926.54
LORILLARD INC	10,501	110.07	1,155,845.07

LOWES COMPANIES	95,406	20.02	1,910,028.12
LSI CORP	42,820	5.36	229,515.20
LULULEMON ATHLETICA INC	7,311	51.91	379,514.01
LYONDELLBASELL INDU-CL A	20,763	26.65	553,333.95
M & T BANK CORP	8,216	72.05	591,962.80
MACY'S INC	31,200	27.26	850,512.00
MANPOWER GROUP	6,006	34.44	206,846.64
MARATHON OIL CORP	52,033	22.32	1,161,376.56
MARATHON PETROLEUM CORP	25,950	27.84	722,448.00
MARRIOTT INTL A	21,066	28.70	604,594.20
MARSH & MCLENNAN COS	40,025	27.09	1,084,277.25
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,325	65.82	218,851.50
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	38,433	14.96	574,957.68
MASCO CORP	25,016	7.52	188,120.32
MASTERCARD INC-CLASS A	7,935	328.37	2,605,615.95
MATTEL INC	25,469	26.40	672,381.60
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	21,583	23.50	507,200.50
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	8,767	46.33	406,175.11
MCDONALD'S CORP	76,026	88.78	6,749,588.28
MCGRAW-HILL COS	22,326	42.31	944,613.06
MCKESSON CORP	18,423	74.78	1,377,671.94
MDU RESOURCES GROUP INC	13,795	19.64	270,933.80
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	14,932	71.21	1,063,307.72
MEADWESTVACO CORP	12,399	25.76	319,398.24
MEDCO HEALTH SOLUTIONS	29,214	48.06	1,404,024.84
MEDTRONIC	78,198	33.96	2,655,604.08
MERCK & CO	225,540	32.66	7,366,136.40
METLIFE INC	77,239	29.30	2,263,102.70
METROPCS COMMUNICATIONS INC	18,351	9.07	166,443.57
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	13,919	32.02	445,686.38
MICRON TECHNOLOGY	65,861	5.87	386,604.07
MICROSOFT CORP	554,572	25.45	14,113,857.40
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,281	45.00	192,645.00
MOLSON COORS BREWING CO -B	11,932	40.30	480,859.60
MONSANTO CO	39,165	63.15	2,473,269.75
MOODY'S CORP	14,981	30.95	463,661.95
MORGAN STANLEY	101,583	15.09	1,532,887.47
MOSAIC CO/THE	22,354	54.20	1,211,586.80
MOTOROLA MOBILITY HOLDINGS	20,475	37.87	775,388.25
MOTOROLA SOLUTIONS INC	22,329	42.44	947,642.76

MURPHY OIL CORP	13,427	45.30	608,243.10
MYLAN INC	32,097	17.69	567,795.93
NABORS INDUSTRIES LTD	20,998	13.11	275,283.78
NASDAQ OMX GROUP	8,573	24.06	206,266.38
NATIONAL OILWELL VARCO INC	30,915	52.78	1,631,693.70
NETAPP INC	26,881	34.97	940,028.57
NETFLIX INC	3,654	113.19	413,596.26
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	31,958	12.35	394,681.30
NEWELL RUBBERMAID	21,337	11.94	254,763.78
NEWFIELD EXPLORATION CO	9,826	40.82	401,097.32
NEWMONT MINING CORP	36,074	62.52	2,255,346.48
NEWS CORP -CLASS A	133,951	15.93	2,133,839.43
NEWS CORP -CLASS B	32,180	16.05	516,489.00
NEXTERA ENERGY INC	29,291	54.52	1,596,945.32
NIELSEN HOLDINGS NV	6,225	26.75	166,518.75
NII HOLDINGS INC	12,436	29.50	366,862.00
NIKE B	26,740	87.99	2,352,852.60
NISOURCE INC	20,429	21.66	442,492.14
NOBLE CORP	18,426	30.36	559,413.36
NOBLE ENERGY INC	12,895	72.78	938,498.10
NORDSTROM INC	12,884	46.65	601,038.60
NORFOLK SOUTHERN CORP	25,810	63.47	1,638,160.70
NORTHEAST UTILITIES	12,917	34.11	440,598.87
NORTHERN TRUST CORP	15,902	36.01	572,631.02
NORTHROP GRUMMAN CORP	20,320	53.27	1,082,446.40
NRG ENERGY INC	17,206	21.64	372,337.84
NSTAR	7,569	45.00	340,605.00
NUANCE COMMUNICATIONS INC	17,695	21.04	372,302.80
NUCOR CORP	23,095	32.46	749,663.70
NVIDIA CORP	43,864	13.09	574,179.76
NYSE EURONEXT	19,130	24.45	467,728.50
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	59,398	75.35	4,475,639.30
OLD REPUBLIC INTL CORP	17,119	9.04	154,755.76
OMNICARE INC	8,472	26.05	220,695.60
OMNICO GROUP	20,599	37.72	776,994.28
ONEOK INC	7,436	67.67	503,194.12
ORACLE CORP	295,822	29.65	8,771,122.30
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	10,102	67.35	680,369.70
OWENS-ILLINOIS INC	11,984	16.11	193,062.24
PACCAR INC	24,035	35.69	857,809.15
PALL CORP	8,485	43.93	372,746.05

PARKER HANNIFIN CORP	11,850	65.37	774,634.50
PARTNERRE LTD	4,687	53.55	250,988.85
PATTERSON COMPANIES INC	6,826	29.21	199,387.46
PAYCHEX INC	23,797	27.11	645,136.67
PEABODY ENERGY CORP	19,783	35.98	711,792.34
PENTAIR INC	6,840	32.57	222,778.80
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	27,512	11.74	322,990.88
PEPCO HOLDINGS INC	16,497	19.10	315,092.70
PEPSICO INC	115,500	62.58	7,227,990.00
PERRIGO CO	6,098	98.53	600,835.94
PETSMART INC	8,199	43.58	357,312.42
PFIZER	577,344	17.98	10,380,645.12
PG&E CORP	29,079	42.77	1,243,708.83
PHARMACEUTICAL PRODUCT DEVEL	7,861	26.22	206,115.42
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	129,950	64.01	8,318,099.50
PINNACLE WEST CAPITAL	7,966	43.21	344,210.86
PIONEER NATURAL RESOURCES	7,678	68.50	525,943.00
PITNEY BOWES INC	14,896	19.45	289,727.20
PLAINS EXPLORATION & PRODUCT	10,303	23.72	244,387.16
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	38,456	49.79	1,914,724.24
PPG INDUSTRIES INC	11,556	72.35	836,076.60
PPL CORPORATION	42,173	28.85	1,216,691.05
PRAXAIR INC	22,219	95.41	2,119,914.79
PRECISION CASTPARTS CORP	10,482	158.09	1,657,099.38
PRICE T ROWE GROUP INC	18,980	49.69	943,116.20
PRICELINE.COM INC	3,638	478.02	1,739,036.76
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	23,479	23.92	561,617.68
PROCTER & GAMBLE CO	203,963	63.70	12,992,443.10
PROGRESS ENERGY INC	21,521	52.23	1,124,041.83
PROGRESSIVE CORP	45,378	18.00	816,804.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	35,513	48.06	1,706,754.78
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	36,967	33.96	1,255,399.32
PULTE GROUP INC	22,649	4.14	93,766.86
QEP RESOURCES INC	12,916	27.88	360,098.08
QUALCOMM	121,994	50.13	6,115,559.22
QUANTA SERVICES INC	15,472	19.44	300,775.68
QUEST DIAGNOSTICS	11,498	50.71	583,063.58
RALCORP HOLDINGS INC	4,022	75.84	305,028.48
RALPH LAUREN CORPORATION	4,671	139.80	653,005.80
RANGE RESOURCES CORP	11,738	59.88	702,871.44

RAYTHEON COMPANY	26,026	41.26	1,073,832.76
RED HAT INC	14,104	43.93	619,588.72
REGIONS FINL CORP	91,811	3.55	325,929.05
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	3,672	63.63	233,649.36
REPUBLIC SERVICES INC	22,170	28.10	622,977.00
REYNOLDS AMERICAN INC	25,555	37.20	950,646.00
ROBERT HALF INTL INC	10,193	21.96	223,838.28
ROCK-TENN COMPANY -CL A	5,061	50.63	256,238.43
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,545	57.45	605,810.25
ROCKWELL COLLIN	11,257	53.57	603,037.49
ROPER INDUSTRIES INC	7,007	72.12	505,344.84
ROSS STORES INC	8,610	78.39	674,937.90
ROWAN COMPANIES INC	9,313	31.85	296,619.05
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	10,334	22.40	231,481.60
SAFEWAY INC	25,593	16.99	434,825.07
SAIC INC	20,676	12.19	252,040.44
SALESFORCE.COM INC	9,295	119.55	1,111,217.25
SANDISK CORP	17,418	40.62	707,519.16
SARA LEE CORP	40,616	16.84	683,973.44
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	8,282	35.23	291,774.86
SCANA CORP	8,915	40.80	363,732.00
SCHLUMBERGER	99,153	61.33	6,081,053.49
SCHWAB (CHARLES) CORP	74,950	11.63	871,668.50
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	6,860	38.45	263,767.00
SEAGATE TECHNOLOGY	31,485	10.71	337,204.35
SEALED AIR CORP	11,100	17.45	193,695.00
SEARS HOLDINGS CORPORATION	3,037	57.37	174,232.69
SEI INVESTMENTS COMPANY	10,349	15.82	163,721.18
SEMPRA ENERGY	16,622	51.41	854,537.02
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,613	76.30	504,571.90
SIGMA-ALDRICH	8,900	63.51	565,239.00
SIRIUS XM RADIO INC	273,948	1.49	408,182.52
SLM CORP	38,539	12.77	492,143.03
SOUTHERN CO	62,046	42.87	2,659,912.02
SOUTHWEST AIRLINES CO	12,987	8.63	112,077.81
SOUTHWESTERN ENERGY CO	25,421	34.59	879,312.39
SPECTRA ENERGY CORP	47,496	25.09	1,191,674.64
SPRINT NEXTEL CORPORATION	218,606	3.13	684,236.78
SPX CORP	3,727	47.99	178,858.73
ST JUDE MEDICAL INC	23,810	36.91	878,827.10
STANLEY BLACK&DECKER	11,670	51.64	602,638.80

STAPLES INC	52,255	13.76	719,028.80
STARBUCKS CORP	54,925	38.17	2,096,487.25
STARWOOD HOTELS & RESORTS	14,294	41.02	586,339.88
STATE STREET CORP	36,831	33.07	1,218,001.17
STERICYCLE INC	5,959	81.21	483,930.39
STRYKER CORP	21,264	48.22	1,025,350.08
SUNOCO INC	8,849	31.82	281,575.18
SUNTRUST BANKS	39,231	18.71	734,012.01
SYMANTEC CORP	55,208	16.89	932,463.12
SYNOPSIS INC	10,718	24.76	265,377.68
SYSCO CORP	42,635	26.12	1,113,626.20
TARGET (DAYTON HUDSON)	47,971	50.23	2,409,583.33
TD AMERITRADE HOLDING CORP	16,700	15.05	251,335.00
TE CONNECTIVITY LTD	32,132	29.11	935,362.52
TERADATA CORP	12,334	55.05	678,986.70
TEXAS INSTRUMENTS	84,848	27.19	2,307,017.12
TEXTRON	20,179	18.23	367,863.17
THE WALT DISNEY CO	131,572	30.65	4,032,681.80
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	28,005	51.50	1,442,257.50
TIFFANY & CO	8,890	64.70	575,183.00
TIME WARNER CABLE-A	24,649	64.74	1,595,776.26
TIME WARNER INC	78,462	30.70	2,408,783.40
TJX COMPANIES INC	28,291	55.69	1,575,525.79
TOLL BROTHERS INC	10,462	14.87	155,569.94
TORCHMARK CORP	8,125	35.78	290,712.50
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	11,427	17.20	196,544.40
TRAVELERS COS INC/THE	30,607	49.69	1,520,861.83
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	7,697	33.56	258,311.32
TYCO INTERNATIONAL LTD	34,266	42.23	1,447,053.18
TYSON FOODS INC	22,615	17.11	386,942.65
ULTRA PETROLEUM CORP	11,175	28.51	318,599.25
UNION PACIFIC CORP	35,853	85.22	3,055,392.66
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	5,391	20.52	110,623.32
UNITED HEALTHCARE CORP	79,168	46.58	3,687,645.44
UNITED PARCEL SERVICE B	53,911	64.67	3,486,424.37
UNITED STATES STEEL CORP	10,505	23.07	242,350.35
UNITED TECHNOLOGIES CORP	63,535	72.42	4,601,204.70
UNUM GROUP	22,491	21.57	485,130.87
URBAN OUTFITTERS INC	9,150	23.31	213,286.50
URS CORP	5,746	30.83	177,149.18

US BANCORP	140,782	24.21	3,408,332.22
VALERO ENERGY CORP	41,669	18.60	775,043.40
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,563	52.10	446,132.30
VERISIGN INC	11,357	28.95	328,785.15
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	9,475	34.49	326,792.75
VERIZON COMMUNICATIONS	206,724	37.15	7,679,796.60
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	15,052	44.51	669,964.52
VF CORP	6,413	125.56	805,216.28
VIACOM INC-CLASS B	39,311	41.03	1,612,930.33
VIRGIN MEDIA INC	22,024	24.93	549,058.32
VISA INC-CLASS A SHARES	38,234	87.69	3,352,739.46
VMWARE INC-CLASS A	6,112	83.06	507,662.72
VULCAN MATERIALS CO	9,434	28.95	273,114.30
WALGREEN CO	66,894	32.53	2,176,061.82
WAL-MART STORES	139,559	51.93	7,247,298.87
WALTER ENERGY INC	4,552	60.45	275,168.40
WARNER CHILCOTT PLC-CLASS A	10,203	14.88	151,820.64
WASHINGTON POST -CL B	351	323.84	113,667.84
WASTE MANAGEMENT INC	32,918	32.37	1,065,555.66
WATERS CORP	6,696	77.75	520,614.00
WATSON PHARMACEUTICALS INC	9,242	70.91	655,350.22
WEATHERFORD INTL LTD	54,457	12.75	694,326.75
WELLPOINT INC	26,829	65.37	1,753,811.73
WELLS FARGO & CO	367,156	24.99	9,175,228.44
WESTERN DIGITAL CORP	16,982	26.74	454,098.68
WESTERN UNION CO	46,200	15.83	731,346.00
WEYERHAEUSER CO	39,355	16.09	633,221.95
WHIRLPOOL CORP	5,585	51.09	285,337.65
WHITING PETROLEUM CORP	8,576	36.32	311,480.32
WHOLE FOODS MKT INC	10,914	67.07	732,001.98
WILLIAMS COS	42,976	25.04	1,076,119.04
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	11,942	34.65	413,790.30
WINDSTREAM CORP	37,264	11.85	441,578.40
WISCONSIN ENERGY CORP	17,080	31.57	539,215.60
WR BERKLEY CORP	8,797	29.58	260,215.26
WYNN RESORTS LTD	5,942	125.54	745,958.68
XCEL ENERGY INC	35,379	24.91	881,290.89
XEROX CORP	102,386	7.34	751,513.24
XILINX INC	19,409	28.36	550,439.24
XL GROUP PLC	22,609	19.32	436,805.88
YAHOO	90,447	13.42	1,213,798.74

	YUM BRANDS INC	34,113	49.54	1,689,958.02	
	ZIMMER HOLDINGS INC	14,027	55.66	780,742.82	
小計		22,145,408		785,508,564.29 (60,209,231,452)	
カナダドル	AGNICO-EAGLE MINES	12,350	62.08	766,688.00	
	AGRIUM INC	11,524	73.00	841,252.00	
	ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	9,017	29.20	263,296.40	
	ARC RESOURCES LTD	20,882	22.66	473,186.12	
	ATHABASCA OIL SANDS CORP	21,957	10.69	234,720.33	
	BANK MONTREAL	46,486	58.94	2,739,884.84	
	BANK NOVA SCOTIA	78,726	53.70	4,227,586.20	
	BARRICK GOLD CORP	73,022	48.01	3,505,786.22	
	BAYTEX ENERGY CORP	8,438	43.80	369,584.40	
	BCE INC	18,708	38.88	727,367.04	
	BELL ALIANT INC	5,225	27.60	144,210.00	
	BOMBARDIER B	105,006	3.77	395,872.62	
	BONAVISTA ENERGY CORP	10,440	23.53	245,653.20	
	BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	41,041	28.89	1,185,674.49	
	BROOKFIELD OFFICE PROPERTIES INC	18,367	14.95	274,586.65	
	CAE INC	18,777	10.10	189,647.70	
	CAMECO CORP	28,841	19.13	551,728.33	
	CANADIAN IMPERIAL BANK	29,008	73.55	2,133,538.40	
	CANADIAN NATL RAILWAY CO	33,303	70.98	2,363,846.94	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES	79,876	31.52	2,517,691.52	
	CANADIAN OIL SANDS LTD	35,402	20.67	731,759.34	
	CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,717	57.50	328,727.50	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	6,363	62.24	396,033.12	
	CENOVUS ENERGY INC	55,087	33.22	1,829,990.14	
	CENTERRA GOLD INC	12,066	19.61	236,614.26	
	CGI GROUP INC - CL A	16,894	20.17	340,751.98	
	CI FINANCIAL CORP	11,592	20.68	239,722.56	
	CP RAILWAY LIMITED	12,377	51.72	640,138.44	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	17,883	39.11	699,404.13	
	ELDORADO GOLD CORP	40,112	17.61	706,372.32	
	EMPIRE CO LTD 'A'	2,092	57.00	119,244.00	
	ENBRIDGE	53,764	33.25	1,787,653.00	
	ENCANA CORP	53,802	20.34	1,094,332.68	
	ENERPLUS CORP	13,100	25.76	337,456.00	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,453	398.02	578,323.06	

FINNING INTERNATIONAL INC	12,534	20.26	253,938.84
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	34,804	14.40	501,177.60
FORTIS INC	13,487	33.09	446,284.83
FRANCO-NEVADA CORP	9,226	37.30	344,129.80
GILDAN ACTIVEWEAR INC	8,462	27.00	228,474.00
GOLDCORP INC	58,381	46.26	2,700,705.06
GREAT-WEST LIFECEO INC	20,809	20.63	429,289.67
HUSKY ENERGY INC	19,668	23.32	458,657.76
IAMGOLD CORP	27,384	20.64	565,205.76
IGM FINANCIAL INC	8,497	44.30	376,417.10
IMPERIAL OIL	21,677	37.78	818,957.06
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	6,147	30.81	189,389.07
INMET MINING CORPORATION	3,823	46.33	177,119.59
INTACT FINANCIAL CORP	8,002	56.30	450,512.60
IVANHOE MINES LTD	19,145	15.71	300,767.95
KINROSS GOLD CORP	82,942	15.00	1,244,130.00
LOBLAW COMPANIES LTD	8,241	38.81	319,833.21
MAGNA INTERNATIONAL INC	15,953	35.39	564,576.67
MANULIFE FINANCIAL CORP	129,917	12.30	1,597,979.10
MEG ENERGY CORP	9,094	39.48	359,031.12
METRO INC -A	7,496	45.94	344,366.24
NATIONAL BANK OF CANADA	11,888	69.91	831,090.08
NEW GOLD INC	31,238	10.85	338,932.30
NEXEN INC	38,487	16.48	634,265.76
NIKO RESOURCES LTD	3,389	44.10	149,454.90
ONEX CORP	6,914	33.44	231,204.16
OPEN TEXT CORP	4,182	53.74	224,740.68
OSISKO MINING CORP	25,136	13.01	327,019.36
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	18,633	21.70	404,336.10
PAN AMERICAN SILVER CORP	7,491	28.12	210,646.92
PENGROWTH ENERGY CORP	23,930	9.54	228,292.20
PENN WEST PETROLEUM LTD	34,051	15.72	535,281.72
PETROBAKKEN ENERGY LTD-A	5,528	6.42	35,489.76
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	62,460	47.14	2,944,364.40
POWER CORP OF CANADA	25,525	22.90	584,522.50
POWER FINANCIAL CORP	18,106	25.53	462,246.18
PRECISION DRILLING CORP	17,134	9.33	159,860.22
PROGRESS ENERGY RESOURCES CO	13,474	13.30	179,204.20
RESEARCH IN MOTION	34,467	21.97	757,239.99
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	6,975	21.26	148,288.50
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	30,134	35.39	1,066,442.26

	ROYAL BANK OF CANADA	104,289	48.41	5,048,630.49
	SAPUTO INC	10,425	41.50	432,637.50
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	27,193	20.94	569,421.42
	SHOPPERS DRUG MART CORP	15,891	40.77	647,876.07
	SILVER WHEATON CORP	25,812	31.30	807,915.60
	SNC-LAVALIN GROUP INC	11,018	43.75	482,037.50
	SUN LIFE FINANCIAL INC	42,250	25.10	1,060,475.00
	SUNCOR ENERGY	114,815	27.71	3,181,523.65
	TALTSMAN ENERGY INC	74,948	12.88	965,330.24
	TECK RESOURCES LTD-CL B	42,486	30.72	1,305,169.92
	TELUS CORPORATION -NON VOTE	15,427	48.75	752,066.25
	THOMSON REUTERS CORP	27,561	28.74	792,103.14
	TIM HORTONS INC	12,022	48.90	587,875.80
	TMX GROUP INC	5,451	40.54	220,983.54
	TORONTO-DOMINION BANK	64,748	75.00	4,856,100.00
	TOURMALINE OIL CORP	8,840	31.27	276,426.80
	TRANSALTA CORP	15,411	23.13	356,456.43
	TRANSCANADA CORP	51,328	42.42	2,177,333.76
	VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	20,691	38.90	804,879.90
	VERMILION ENERGY INC	6,254	44.03	275,363.62
	VITERRA INC	27,159	10.42	282,996.78
	WESTON (GEORGE) LTD	3,773	68.70	259,205.10
	YAMANA GOLD INC	54,428	14.04	764,169.12
小計		2,735,749		84,249,166.78 (6,231,910,866)
オーストラリアドル	AGL ENERGY LTD	33,709	14.18	477,993.62
	ALUMINA LIMITED	178,308	1.46	260,329.68
	AMCOR	89,689	6.83	612,575.87
	AMP LTD	205,453	3.85	790,994.05
	ASCIANO GROUP	213,813	1.42	303,614.46
	ASX LTD	12,797	29.92	382,886.24
	AUST AND NZ BANKING GROUP	189,753	19.58	3,715,363.74
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	26,842	8.33	223,593.86
	BHP BILLITON LTD	234,665	35.04	8,222,661.60
	BLUESCOPE STEEL LTD	128,050	0.74	94,757.00
	BORAL LIMITED	53,336	3.34	178,142.24
	BRAMBLES LTD	108,098	6.35	686,422.30
	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	9,865	10.78	106,344.70
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	41,540	11.98	497,649.20
	COCHLEAR LIMITED	4,146	48.20	199,837.20

COMMONWEALTH BANK OF AUST	113,891	45.51	5,183,179.41
COMPUTERSHARE LIMITED	32,482	7.56	245,563.92
CROWN LTD	33,250	8.04	267,330.00
CSL LIMITED	38,454	29.87	1,148,620.98
ECHO ENTERTAINMENT GROUP LIMITED	50,048	3.60	180,172.80
FAIRFAX MEDIA LTD	155,308	0.80	125,022.94
FORTESCUE METALS GROUP LTD	91,003	4.45	404,963.35
FOSTERS GROUP LTD	141,421	5.29	748,117.09
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	38,812	2.15	83,445.80
ILUKA RESOURCES LTD	30,595	12.46	381,213.70
INCITEC PIVOT LTD	119,013	3.30	392,742.90
INSURANCE AUSTRALIA GRP.	151,917	3.02	458,789.34
JAMES HARDIE INDUSTRIES NV	31,955	5.77	184,380.35
LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	11,065	18.71	207,026.15
LYNAS CORP LTD	124,409	1.11	138,093.99
MACARTHUR COAL LTD	12,141	15.87	192,677.67
MACQUARIE GROUP LIMITED	25,344	22.51	570,493.44
METCASH LTD	56,181	4.10	230,342.10
NATIONAL AUSTRALIA BANK	158,553	22.50	3,567,442.50
NEWCREST MINING LIMITED	55,929	34.16	1,910,534.64
ONESTEEL LIMITED	92,775	1.26	116,896.50
ORICA LTD	26,541	23.32	618,936.12
ORIGIN ENERGY LIMITED	77,779	13.19	1,025,905.01
OZ MINERALS LTD	23,664	9.39	222,204.96
PALADIN ENERGY LIMITED	45,949	1.17	53,760.33
QANTAS AIRWAYS LIMITED	77,149	1.42	109,551.58
QBE INSURANCE GROUP	79,841	12.62	1,007,593.42
QR NATIONAL LTD	124,805	3.19	398,127.95
RAMSAY HEALTH CARE LTD	9,598	18.75	179,962.50
RIO TINTO LTD	31,841	62.45	1,988,470.45
SANTOS	63,882	11.27	719,950.14
SIMS METAL MANAGEMENT LIMITED	12,007	12.36	148,406.52
SONIC HEALTHCARE LTD	26,964	11.80	318,175.20
SP AUSNET	102,121	0.90	92,419.50
SUNCORP GROUP LIMITED	94,013	7.86	738,942.18
TABCORP HOLDINGS	47,608	2.56	121,876.48
TATTS GROUP LTD	96,358	2.20	211,987.60
TELSTRA CORP	318,230	3.09	983,330.70
TOLL HOLDINGS LIMITED	49,295	4.46	219,855.70

	TRANSURBAN GROUP	94,933	5.41	513,587.53
	WESFARMERS LIMITED	73,451	31.66	2,325,458.66
	WESFARMERS LTD-PPS	11,098	32.32	358,687.36
	WESTPAC BANKING	219,919	20.55	4,519,335.45
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	46,370	32.14	1,490,331.80
	WOOLWORTHS LTD	88,885	25.00	2,222,125.00
	WORLEYPARSONS LTD	14,127	25.40	358,825.80
小計		4,951,038		54,438,023.27 (4,092,106,209)
イギリスポンド	3I GROUP PLC	70,981	1.93	137,064.31
	ADMIRAL GROUP PLC	14,827	13.05	193,492.35
	AGGREKO PLC	19,436	16.82	326,913.52
	AMEC PLC	24,255	8.53	206,895.15
	ANGLO AMERICAN PLC	96,639	22.91	2,214,482.68
	ANTOFAGASTA PLC	28,815	9.58	276,191.77
	ARM HOLDINGS PLC	98,365	5.73	563,631.45
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	26,032	11.17	290,777.44
	ASTRAZENECA	100,759	28.74	2,896,317.45
	AUTONOMY CORP PLC	16,883	25.44	429,503.52
	AVIVA PIC	209,345	3.12	654,203.12
	BABCOCK INTL GROUP PLC	26,235	6.70	175,774.50
	BAE SYSTEMS PLC	249,729	2.68	669,773.17
	BALFOUR BEATTY PLC	50,164	2.59	130,225.74
	BARCLAYS	846,667	1.69	1,432,137.23
	BG GROUP	247,652	12.37	3,063,455.24
	BHP BILLITON PLC	156,249	17.65	2,757,794.85
	BP PLC	1,379,063	3.91	5,403,168.83
	BRITISH AMERICAN TOBACCO	145,256	27.62	4,011,970.72
	BRITISH SKY BROADCASTING	83,253	6.82	568,201.72
	BT GROUP PLC	567,263	1.75	994,412.03
	BUNZL PLC	24,139	7.88	190,215.32
	BURBERRY GROUP PLC	31,849	12.01	382,506.49
	CAIRN ENERGY PLC	102,359	2.81	288,242.94
	CAPITA GROUP PLC	44,808	7.18	321,945.48
	CARNIVAL PLC	13,386	20.61	275,885.46
	CENTRICA PLC	377,329	2.97	1,120,667.13
	COBHAM PLC	83,173	1.80	149,711.40
	COMPASS GROUP PLC	138,435	5.20	720,554.17
	DIAGEO	182,935	12.37	2,263,820.62
	ESSAR ENERGY PLC	22,650	2.58	58,482.30
	EURASIAN NATURAL RESOURCES	18,819	5.76	108,491.53

EXPERIAN PLC	73,300	7.33	537,289.00
FRESNILLO PLC	13,102	15.14	198,364.28
G4S PLC	103,075	2.67	275,828.70
GLAXOSMITHKLINE	377,015	13.38	5,044,460.70
GLENCORE INTERNATIONAL PLC	60,702	4.09	248,422.93
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,309,834	5.12	6,716,828.75
ICAP PLC	41,029	4.26	175,111.77
IMPERIAL-TOBACCO GROUP	74,432	21.71	1,615,918.72
INMARSAT PLC	33,741	4.92	166,174.42
INTERCONTINENTAL HOTELS	21,210	10.70	226,947.00
INTERNATIONAL POWER PLC	111,658	3.14	351,387.72
INTERTEK GROUP PLC	11,701	20.50	239,870.50
INVENSYS PLC	59,169	2.37	140,230.53
INVESTEC PLC	35,352	3.63	128,433.81
ITV PLC	269,974	0.60	163,739.23
JOHNSON MATTHEY PLC	15,687	16.34	256,325.58
KAZAKHMYS PLC	15,644	8.34	130,470.96
KINGFISHER PLC	172,739	2.48	429,774.63
LEGAL & GENERAL GROUP	429,256	0.99	426,036.58
LLOYDS BANKING GROUP PLC	3,015,230	0.36	1,100,106.66
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	10,373	8.30	86,147.76
LONMIN PLC	11,837	10.68	126,419.16
MAN GROUP PLC	137,864	1.76	242,640.64
MARKS & SPENCER GROUP PLC	115,824	3.26	377,586.24
MORRISON SUPERMARKETS	162,897	2.87	468,491.77
NATIONAL GRID PLC	256,574	6.40	1,642,073.60
NEW GKN	113,486	1.78	202,685.99
NEXT PLC	12,520	26.11	326,897.20
OLD MUTUAL PLC	404,217	1.08	438,171.22
PEARSON	59,432	11.44	679,902.08
PETROFAC LTD	18,946	12.44	235,688.24
PRUDENTIAL	186,295	5.74	1,070,264.77
RANDGOLD RESOURCES LTD	6,654	61.30	407,890.20
RECKITT BENCKISER PLC	45,227	32.67	1,477,566.09
REED ELSEVIER PLC	88,856	5.01	445,168.56
RESOLUTION LTD	107,213	2.54	272,535.44
REXAM	64,080	3.16	202,620.96
RIO TINTO PLC REG	104,173	29.66	3,090,292.04
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	136,803	6.10	835,182.31
ROYAL BANK OF SCOTLAND	1,284,194	0.24	314,627.53
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	262,697	20.09	5,278,896.21

	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	196,986	20.20	3,979,117.20	
	RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	257,698	1.13	291,971.83	
	SABMILLER PLC	69,597	20.97	1,459,449.09	
	SAGE GROUP PLC	96,641	2.55	247,207.67	
	SAINSBURY (J) PLC	89,044	2.74	244,247.69	
	SCHRODERS PLC	8,264	12.81	105,861.84	
	SCOTTISH & SOUTHERN ENERG	68,464	13.06	894,139.84	
	SERCO GROUP PLC	36,053	5.17	186,574.27	
	SEVERN TRENT PLC	17,353	15.26	264,806.78	
	SHIRE PLC	41,088	19.81	813,953.28	
	SMITH & NEPHEW PLC	65,209	5.90	384,733.10	
	SMITHS GROUP PLC	28,658	10.06	288,299.48	
	STANDARD CHARTERED PLC	174,773	13.58	2,373,417.34	
	STANDARD LIFE PLC	170,232	2.06	350,848.15	
	TESCO	588,131	3.80	2,237,544.38	
	TUI TRAVEL PLC	34,970	1.52	53,329.25	
	TULLOW OIL PLC	65,020	13.12	853,062.40	
	UNILEVER PLC	93,784	20.33	1,906,628.72	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	49,812	6.20	308,834.40	
	VEDANTA RESOURCES PLC	8,738	11.08	96,817.04	
	VODAFONE GROUP PLC	3,746,655	1.67	6,262,533.83	
	WEIR GROUP PLC/THE	15,441	16.00	247,056.00	
	WHITBREAD PLC	12,946	16.29	210,890.34	
	WOLSELEY LTD	20,813	16.01	333,216.13	
	WPP PLC	92,477	6.29	582,142.71	
	XSTRATA PLC	151,643	8.45	1,281,534.99	
小計		21,532,252		96,328,597.86 (11,537,276,165)	
スイスフラン	ABB LTD	160,180	16.30	2,610,934.00	
	ACTELION LTD-REG	8,086	30.48	246,461.28	
	ADECCO	9,681	38.55	373,202.55	
	ARYZTA AG	6,174	39.80	245,725.20	
	BALOISE HOLDING AG	3,473	68.45	237,726.85	
	CIE FINANCIERE RICHEMON-BR A	38,143	43.21	1,648,159.03	
	CREDIT SUISSE GROUP AG	83,431	24.96	2,082,437.76	
	GAM HOLDING LTD	15,109	11.55	174,508.95	
	GEBERIT AG-REG	2,766	173.30	479,347.80	
	GIVAUDAN-REG	607	710.50	431,273.50	
	HOLCIM LTD	17,925	49.00	878,325.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	15,109	31.63	477,897.67	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,946	107.30	423,405.80	

	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	65	2,638.00	171,470.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-REG	8	31,750.00	254,000.00	
	LONZA GROUP AG-REG	3,674	57.45	211,071.30	
	NESTLE SA - REGISTERED	253,191	50.20	12,710,188.20	
	NOVARTIS	170,532	50.80	8,663,025.60	
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,880	63.20	118,816.00	
	ROCHE HOLDING GENUSS	51,337	146.40	7,515,736.80	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,573	101.30	159,344.90	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,552	100.00	355,200.00	
	SGS SA	400	1,447.00	578,800.00	
	SIKA AG-BR	149	1,670.00	248,830.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,590	84.25	302,457.50	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	545	147.50	80,387.50	
	SULZER AG-REG	1,753	100.10	175,475.30	
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,254	325.00	732,550.00	
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,172	58.60	185,879.20	
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,227	104.30	232,276.10	
	SWISS RE LTD	25,752	43.70	1,125,362.40	
	SWISSCOM	1,703	372.20	633,856.60	
	SYNGENTA AG	6,913	246.50	1,704,054.50	
	SYNTHES INC	4,771	147.10	701,814.10	
	TRANSOCEAN LTD	23,351	44.45	1,037,951.95	
	UBS AG-REG	267,547	11.30	3,023,281.10	
	ZURICH FINANCIAL SERVICES AG	10,649	194.30	2,069,100.70	
小計		1,205,218		53,300,335.14 (4,550,782,614)	
香港ドル	AIA GROUP LTD	616,000	22.15	13,644,400.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	13,800	76.95	1,061,910.00	
	BANK EAST ASIA	112,760	25.45	2,869,742.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	270,500	17.58	4,755,390.00	
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	82,000	12.76	1,046,320.00	
	CHEUNG KONG HOLDINGS	102,000	87.10	8,884,200.00	
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	33,000	44.00	1,452,000.00	
	CLP HOLDINGS	140,500	70.55	9,912,275.00	
	ESPRIT HOLDINGS LTD	89,574	9.55	855,431.70	
	FOXCONN INTERNATIONAL HLDGS	141,000	4.08	575,280.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	91,000	13.40	1,219,400.00	
	HANG LUNG GROUP LTD	64,000	39.40	2,521,600.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	180,000	24.40	4,392,000.00	
	HANG SENG BANK	55,900	95.40	5,332,860.00	
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	69,000	38.10	2,628,900.00	

	HONG KONG & CHINA GAS	346,601	17.48	6,058,585.48	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	74,900	118.70	8,890,630.00	
	HOPEWELL HOLDINGS	41,500	22.25	923,375.00	
	HUTCHISON WHAMPOA	156,000	60.10	9,375,600.00	
	HYSAN DEVELOPMENT CO	46,000	25.35	1,166,100.00	
	KERRY PROPERTIES LTD	52,500	25.30	1,328,250.00	
	LI & FUNG	414,800	13.72	5,691,056.00	
	LIFESTYLE INTL HLDGS LTD	43,000	20.00	860,000.00	
	MTR CORP	105,500	23.80	2,510,900.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	175,000	7.45	1,303,750.00	
	NWS HOLDINGS LTD	99,000	10.56	1,045,440.00	
	ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD	14,500	33.00	478,500.00	
	PCCW LTD	292,000	3.05	890,600.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	101,500	60.50	6,140,750.00	
	SANDS CHINA LTD	176,400	21.70	3,827,880.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	102,000	14.82	1,511,640.00	
	SINO LAND CO	194,000	10.70	2,075,800.00	
	SJM HOLDINGS LTD	121,000	15.44	1,868,240.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	103,000	92.30	9,506,900.00	
	SWIRE PACIFIC A	53,000	82.50	4,372,500.00	
	WHARF HOLDINGS	111,000	41.45	4,600,950.00	
	WHEELOCK & CO LTD	67,000	23.90	1,601,300.00	
	WING HANG BANK LIMITED	12,500	66.80	835,000.00	
	WYNN MACAU LTD	113,600	22.60	2,567,360.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	51,500	19.08	982,620.00	
小計		5,128,835		141,565,435.18 (1,391,588,227)	
シンガポールドル	CAPITALAND LTD	187,500	2.49	466,875.00	
	CAPITAMALLS ASIA LTD	99,000	1.20	118,800.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	37,000	9.69	358,530.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	131,000	1.33	174,230.00	
	COSCO CORP SINGAPORE LTD	68,000	0.94	63,920.00	
	DBS GROUP	127,000	12.00	1,524,000.00	
	FRASER AND NEAVE LTD	67,000	5.76	385,920.00	
	GENTING INTERNATIONAL PLC	445,000	1.60	712,000.00	
	GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	134,000	1.65	221,100.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	488,000	0.62	305,000.00	
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	8,000	41.14	329,120.00	
	KEPPEL CORP LTD	104,300	7.94	828,142.00	

	KEPPEL LAND LTD	50,000	2.61	130,500.00	
	NEPTUNE ORIENT LINES LTD	61,000	1.13	69,235.00	
	NOBLE GROUP LTD	280,363	1.40	393,910.01	
	OCBC BANK	183,000	8.28	1,515,240.00	
	OLAM INTERNATIONAL LTD	98,000	2.33	228,340.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	72,000	3.46	249,120.00	
	SEMBCORP MARINE LTD	61,000	3.35	204,350.00	
	SINGAPORE AIRLINES	39,533	11.42	451,466.86	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	63,000	6.72	423,360.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	112,000	3.75	420,000.00	
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	112,000	2.91	325,920.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	582,243	3.17	1,845,710.31	
	STARHUB LTD	44,000	2.87	126,280.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	92,000	17.21	1,583,320.00	
	UOL GROUP LIMITED	31,300	4.34	135,842.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	140,000	5.24	733,600.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	133,000	0.93	123,690.00	
小計		4,050,239		14,447,521.18 (853,704,026)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	67,649	2.26	153,224.98	
	CONTACT ENERGY LTD	25,503	5.35	136,441.05	
	FLETCHER BUILDING LTD	49,584	7.53	373,367.52	
	SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP	42,159	3.40	143,340.60	
	TELECOM CORP NEW ZEALAND	140,637	2.55	358,624.35	
小計		325,532		1,164,998.50 (68,641,711)	
スウェーデンクローナ	ALFA LAVAL AB	24,671	113.90	2,810,026.90	
	ASSA ABLOY B	22,957	149.20	3,425,184.40	
	ATLAS COPCO A	49,068	128.60	6,310,144.80	
	ATLAS COPCO B	28,514	113.40	3,233,487.60	
	BOLIDEN AB	19,986	74.50	1,488,957.00	
	ELECTROLUX AB-SER B	17,558	105.30	1,848,857.40	
	ERICSSON (LM) B	220,060	68.25	15,019,095.00	
	GETINGE AB-B SHS	14,625	154.40	2,258,100.00	
	HENNES & MAURITZ B	74,713	209.20	15,629,959.60	
	HEXAGON AB-B SHS	18,518	94.00	1,740,692.00	
	HOLMEN AB-B SHARES	3,671	176.10	646,463.10	
	HUSQVARNA AB-B SHS	30,739	28.36	871,758.04	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	8,608	75.05	646,030.40	
	INVESTOR AB-B SHS	33,306	123.70	4,119,952.20	

	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	15,037	130.50	1,962,328.50	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	5,578	688.00	3,837,664.00	
	MODERN TIMES GROUP-B SHS	3,529	280.40	989,531.60	
	NORDEA BANK AB	192,366	58.40	11,234,174.40	
	RATOS AB-B SHS	14,010	82.85	1,160,728.50	
	SANDVIK AB	73,681	84.85	6,251,832.85	
	SCA SV CELLULOSA B	42,182	86.00	3,627,652.00	
	SCANIA AB-B SHS	23,383	102.30	2,392,080.90	
	SECURITAS B	22,880	53.30	1,219,504.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	103,141	39.27	4,050,347.07	
	SKANSKA B	29,222	98.85	2,888,594.70	
	SKF AB-B	28,522	137.80	3,930,331.60	
	SSAB AB-A SHS	10,878	51.45	559,673.10	
	SVENSKA HANDELSBK A	35,784	177.90	6,365,973.60	
	SWEDBANK AB-A	59,191	80.70	4,776,713.70	
	SWEDISH MATCH AB	15,564	229.20	3,567,268.80	
	TELE2 AB-B SHS	23,166	128.90	2,986,097.40	
	TELIASONERA AB	158,202	45.21	7,152,312.42	
	VOLVO B	100,834	71.05	7,164,255.70	
小計		1,524,144		136,165,773.28 (1,533,226,607)	
ノルウェークローネ	ACERGY S.A.	20,565	114.00	2,344,410.00	
	AKER SOLUTIONS ASA	12,013	56.85	682,939.05	
	DNB NOR ASA	71,461	59.75	4,269,794.75	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	14,625	60.30	881,887.50	
	NORSK HYDRO	68,033	27.40	1,864,104.20	
	ORKLA	56,389	45.25	2,551,602.25	
	RENEWABLE ENERGY CORP AS	33,457	5.55	185,686.35	
	SEADRILL LTD	24,002	166.10	3,986,732.20	
	STATOIL ASA	81,549	122.80	10,014,217.20	
	TELENOR ASA	54,515	92.00	5,015,380.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	13,849	245.90	3,405,469.10	
小計		450,458		35,202,222.60 (465,725,404)	
デンマーククローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	40	32,000.00	1,280,000.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S	96	33,580.00	3,223,680.00	
	CARLSBERG AS-B	7,817	333.10	2,603,842.70	
	COLOPLAST-B	1,664	830.00	1,381,120.00	
	DANSKE BANK A/S	47,692	80.55	3,841,590.60	
	DSV A/S	14,538	104.90	1,525,036.20	

	NOVO NORDISK A/S-B	31,074	550.00	17,090,700.00
	NOVOZYMES A/S	3,370	812.00	2,736,440.00
	PANDORA A/S	3,792	38.43	145,726.56
	TDC A/S	27,128	45.15	1,224,829.20
	TRYG A/S	1,870	298.00	557,260.00
	VESTAS WIND SYSEMS	14,885	94.85	1,411,842.25
	WILLIAM DEMANT HOLDING	1,705	422.90	721,044.50
小計		155,671		37,743,112.01 (528,026,137)
イスラエルシケル	BANK HAPOALIM BM	77,463	13.40	1,038,004.20
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	86,200	11.92	1,027,504.00
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	128,316	7.20	923,875.20
	CELLCOM ISRAEL LTD	3,998	77.98	311,764.04
	DELEK GROUP LTD	299	593.00	177,307.00
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,551	149.50	231,874.50
	ISRAEL CHEMICALS LTD	32,475	44.50	1,445,137.50
	ISRAEL CORP LIMITED/THE	161	2,524.00	406,364.00
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	54,988	5.67	311,781.96
	MAKHTESHIM-AGAN INDUSTRIES	17,480	20.52	358,689.60
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,200	31.76	260,432.00
	NICE SYSTEMS LTD	4,195	117.60	493,332.00
	PARTNER COMMUNICATIONS CO	5,625	36.20	203,625.00
TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	68,685	133.10	9,141,973.50	
小計		489,636		16,331,664.50 (336,595,605)
ユーロ	ABERTIS INFRAESTRUCTURAS	28,351	11.57	328,021.07
	ACCIONA SA	1,857	64.49	119,757.93
	ACCOR	10,777	20.57	221,736.77
	ACERINOX SA	6,932	8.65	60,003.39
	ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	10,347	27.15	280,921.05
	ADIDAS AG	15,288	46.24	706,917.12
	ADP	2,531	57.55	145,659.05
	AEGON	125,675	3.15	396,253.27
	AEM SPA	80,124	0.94	75,757.24
	AGEAS	161,673	1.38	223,108.74
	AHOLD (KON.)	84,900	8.76	744,403.20
	AIR FRANCE-KLM	9,087	5.85	53,168.03
	AIR LIQUIDE	20,718	87.90	1,821,112.20
	AKZO NOBEL	16,928	34.52	584,354.56
	ALCATEL-LUCENT	169,545	2.30	390,292.59
	ALLIANZ SE-REG	33,190	72.50	2,406,275.00

ALSTOM RGPT	15,059	25.42	382,875.07
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	21,258	12.01	255,308.58
ANGLO IRISH BANK CORP PLC	45,054	0.00	0.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV	58,656	39.70	2,328,643.20
ARCELORMITTAL	62,732	12.37	776,308.50
ARKEMA	4,044	46.39	187,601.16
ASML HOLDING NV	31,514	26.49	834,963.43
ASSICURAZIONI GENERALI	85,382	12.08	1,031,414.56
ATLANTIA SPA	23,029	10.88	250,555.52
ATOS	3,615	33.23	120,126.45
AUTOGRILL SPA	7,704	7.50	57,818.52
AXA	127,245	10.28	1,308,714.82
AXEL SPRINGER AG	2,751	26.55	73,039.05
BANCA CARIGE SPA	47,269	1.43	67,878.28
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	313,662	0.42	133,839.57
BANCO BILBAO VIZCAYA	316,184	6.29	1,988,797.36
BANCO DE SABADELL SA	81,312	2.68	218,241.40
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	36,302	1.99	72,240.98
BANCO POPOLARE SPA	128,954	1.23	158,871.32
BANCO POPULAR ESPANOL	71,010	3.52	250,097.22
BANCO SANTANDER CENTRAL HISPANO SA	620,481	6.18	3,838,295.46
BANKIA SAU	63,345	3.74	237,480.40
BANKINTER SA	15,579	4.15	64,652.85
BASF SE	67,114	47.24	3,170,465.36
BAYER	60,426	42.00	2,537,892.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	24,194	52.75	1,276,233.50
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	3,814	36.91	140,793.81
BCP BANCO COMERCIAL NOM	212,870	0.19	42,361.13
BEIERSDORF AG	7,366	40.22	296,260.52
BEKAERT NV	2,844	32.30	91,875.42
BELGACOM	11,115	22.61	251,365.72
BNP PARIBAS	70,119	31.14	2,183,505.66
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	5,165	23.71	122,462.15
BOUYGUES ORD	17,386	25.45	442,473.70
BRENNTAG AG	2,446	68.89	168,504.94
BUREAU VERITAS SA	3,992	56.61	225,987.12
CAIXABANK	54,400	3.35	182,512.00
CAIXABANK-RTS	54,400	0.06	3,372.80
CAP GEMINI SA	10,813	25.92	280,272.96
CARREFOUR	42,194	17.36	732,698.81

CASINO GUICHARD PERRACHON	4,044	59.33	239,930.52
CELESIO AG	5,912	10.60	62,696.76
CHRISTIAN DIOR	3,984	89.00	354,576.00
CIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE	10,539	13.97	147,229.83
CIMPOR-CIMENTOS DE PORTUGAL	14,731	4.90	72,240.82
CNP ASSURANCES	10,861	11.12	120,828.62
COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	13,390	13.39	179,292.10
COLRUYT SA	5,534	31.68	175,317.12
COMMERZBANK AG	261,664	2.00	525,159.64
CONTINENTAL AG	5,846	46.55	272,160.53
CREDIT AGRICOLE SA	70,246	5.40	379,398.64
CRH	52,350	11.72	613,803.75
DAIMLER AG	66,188	34.82	2,304,997.10
DANONE (GROUPE)	42,672	46.15	1,969,312.80
DASSAULT SYSTEMES SA	4,416	54.42	240,318.72
DELHAIZE GROUP	7,421	43.63	323,815.33
DELTA LLOYD NV	6,994	11.83	82,739.02
DEUTSCHE BANK NAMEN	67,968	28.25	1,920,096.00
DEUTSCHE BOERSE AG NEW	14,259	38.09	543,196.60
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	16,731	10.11	169,150.41
DEUTSCHE POST AG-REG	61,841	9.86	609,752.26
DEUTSCHE TELEKOM	205,246	8.83	1,813,553.65
DEXIA	39,363	1.47	58,060.42
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL DE ALIMENT	40,137	3.07	123,341.00
E.ON AG	131,594	16.70	2,198,277.77
EDENRED	11,555	18.61	215,038.55
EDP RENOVAVEIS SA	14,634	4.12	60,423.78
EIFFAGE	2,815	23.50	66,152.50
ELAN CORPORATION PLC	36,440	7.80	284,232.00
ELECTRICITE DE FRANCE	17,563	22.13	388,757.00
ELISA A	10,330	15.38	158,875.40
ENAGAS	13,083	13.56	177,405.48
ENEL	480,979	3.34	1,607,431.81
ENEL GREEN POWER SPA	127,874	1.71	219,559.65
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	139,459	2.35	327,868.10
ENI	175,605	13.26	2,328,522.30
ERAMET	369	109.35	40,350.15
ERSTE GROUP BANK AG	13,827	20.00	276,540.00
ESSILOR INTERNATIONAL	14,693	54.50	800,768.50
EURAZEO	2,245	32.67	73,355.37

EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	29,850	21.59	644,461.50
EUTELSAT COMMUNICATIONS	7,238	30.45	220,397.10
EXOR SPA	4,687	15.21	71,289.27
FERROVIAL SA	26,799	8.68	232,615.32
FIAT INDUSTRIAL	55,872	5.85	326,851.20
FIAT ORD	55,890	4.21	235,744.02
FINMECCANICA SPA	29,572	5.38	159,097.36
FOMENTO DE CONSTRUCC Y CONTRA	3,419	20.50	70,089.50
FORTUM OYJ	32,457	18.03	585,199.71
FRANCE TELECOM	135,486	12.31	1,668,510.09
FRAPORT AG	2,685	46.75	125,523.75
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	15,261	50.26	767,017.86
FRESENIUS SE&CO KGAA	8,309	67.03	556,952.27
FUGRO NV-CVA	4,986	38.86	193,755.96
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	16,905	13.79	233,119.95
GAS NATURAL SDG SA	23,574	12.81	302,100.81
GDF SUEZ	90,467	22.94	2,075,312.98
GEA GROUP AG	12,759	18.71	238,720.89
GRIFOLS SA	10,120	14.05	142,236.60
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,899	53.37	314,829.63
GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	38,589	6.59	254,610.22
HANNOVER RUECKVERSICHERU-REG	4,409	34.42	151,757.78
HEIDELBERGCEMENT AG	10,276	28.65	294,458.78
HEINEKEN HOLDING NV	8,419	29.04	244,487.76
HEINEKEN NV	18,940	33.66	637,520.40
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	17,908	3.20	57,305.60
HENKEL AG & CO KGAA	9,492	32.97	312,998.70
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	13,019	40.21	523,493.99
HOCHTIEF AG	3,095	47.80	147,941.00
IBERDROLA SA	288,449	5.11	1,476,281.98
ILIAD SA	1,399	86.01	120,327.99
IMERYS SA	2,361	39.85	94,085.85
IMMOFINANZ AG	68,672	2.26	155,542.08
INDITEX	15,942	65.27	1,040,534.34
INDRA SISTEMAS SA	6,845	10.82	74,062.90
INFINEON TECHNOLOGIES	79,409	5.79	460,254.56
ING GROEP	280,077	5.74	1,607,641.98
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINE	67,787	1.84	124,795.86
INTESA SANPAOLO	736,773	1.22	902,546.92

INTESA SANPAOLO-RNC	64,873	1.02	66,689.44
JC DECAUX SA	4,621	18.99	87,752.79
JERONIMO MARTINS	16,094	12.14	195,381.16
K+S AG	12,587	41.65	524,311.48
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	6,576	41.50	272,904.00
KBC GROEP NV	11,778	18.00	212,004.00
KERRY GROUP PLC-A	10,260	26.41	270,966.60
KESKO OYJ-B SHS	4,889	23.92	116,944.88
KONE OYJ-B	11,377	36.88	419,583.76
KONINKLIJKE DSM NV	11,268	33.50	377,478.00
KPN (KON.)	111,671	9.75	1,089,462.27
LAFARGE (FRANCE)	14,652	26.11	382,563.72
LAGADERE S.C.A	8,624	18.28	157,689.84
LANXESS	6,080	38.90	236,512.00
LEGRAND SA	14,429	24.07	347,378.17
LINDE AG	12,354	103.45	1,278,021.30
LOREAL	17,566	73.57	1,292,330.62
LUXOTTICA GROUP SPA	8,527	19.77	168,578.79
LVMH	18,518	103.20	1,911,057.60
M6-METROPOLE TELEVISION	4,240	12.37	52,470.00
MAN SE	4,636	61.74	286,226.64
MAPFRE SA	55,064	2.37	130,501.68
MEDIASET	51,788	2.38	123,669.74
MEDIASET ESPANA COMUNICACION SA	11,312	4.31	48,856.52
MEDIOBANCA	37,781	6.08	229,708.48
MERCK KGAA	4,722	61.62	290,969.64
METRO STAMM	9,473	33.35	315,924.55
METSO OYJ	9,338	23.24	217,015.12
MICHELIN	12,905	46.89	605,179.97
MOBISTAR SA	2,086	43.23	90,188.21
MUENCHENER RUECKVERSICH.	13,781	93.63	1,290,315.03
NATIXIS	63,795	2.49	159,423.70
NEOPOST SA	2,357	55.45	130,695.65
NESTE OIL OYJ	8,623	6.67	57,515.41
NOKIA CORP	273,648	4.26	1,166,835.07
NOKIAN RENKAAT OYJ	8,042	23.00	184,966.00
OKO BANK-A	9,611	8.09	77,801.04
OMV AG	11,957	22.85	273,217.45
OPAP SA	16,317	7.55	123,193.35
ORION OYJ-CLASS B	6,894	14.99	103,341.06

OUTOKUMPU OYJ	8,903	5.04	44,871.12
PARMALAT SPA	22,764	1.61	36,763.86
PERNOD-RICARD	14,481	60.44	875,231.64
PEUGEOT SA	11,116	16.66	185,248.14
PHILIPS ELECTRS (KON.)	73,727	14.12	1,041,393.87
PIRELLI & CO	17,381	5.36	93,249.06
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	11,189	36.91	412,985.99
PORTUGAL TELECOM	49,132	5.60	275,139.20
POST NL	24,330	3.43	83,549.22
PPR	5,561	103.80	577,231.80
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA AG-PFD	5,151	13.71	70,620.21
PRYSMIAN SPA	14,881	10.33	153,720.73
PUBLIC POWER CORP	7,659	6.07	46,490.13
PUBLICIS GROUPE	9,102	32.09	292,128.69
QIAGEN N.V.	17,075	10.70	182,702.50
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	3,400	23.35	79,390.00
RANDSTAD HOLDING NV	8,741	24.95	218,131.65
RAUTARUUKKI OYJ	6,150	7.80	47,970.00
RED ELECTRICA CORPORACION SA	7,907	33.97	268,640.32
REED ELSEVIER NV	50,261	8.24	414,552.72
RENAULT SA	14,046	26.01	365,406.69
REPSOL YPF	57,986	19.92	1,155,081.12
RWE AG-NON VTG PFD	2,623	26.45	69,378.35
RWE STAMM	30,597	28.37	868,189.87
SAFRAN SA	12,189	24.06	293,328.28
SAINT-GOBAIN	29,092	29.50	858,214.00
SAIPEM	19,346	27.39	529,886.94
SALZGITTER AG	2,854	37.07	105,797.78
SAMPO OYJ-A SHS	30,716	19.47	598,040.52
SANOFI	81,469	49.85	4,061,636.99
SANOMA OYJ	5,948	9.05	53,829.40
SAP AG	67,234	38.53	2,590,526.02
SBM OFFSHORE NV	12,325	13.29	163,860.87
SCHNEIDER ELECTRIC	35,770	40.50	1,448,685.00
SCOR SE	12,355	16.55	204,475.25
SES	21,898	17.82	390,331.85
SIEMENS	60,122	69.65	4,187,497.30
SNAM RETE GAS	117,426	3.46	406,763.66
SOCIETE BIC SA	2,129	64.36	137,022.44
SOCIETE GENERALE	46,393	21.08	977,964.44

SODEXO	6,889	49.80	343,072.20
SOLVAY SA	4,332	71.93	311,600.76
STMICROELECTRONICS	46,564	4.98	231,981.84
STORA ENSO OYJ R	42,511	4.55	193,595.09
SUEDZUCKER AG	4,843	22.14	107,224.02
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	19,681	10.58	208,323.38
TECHNIP S.A.	7,250	62.49	453,052.50
TELECOM ITALIA ORD	685,814	0.84	577,798.29
TELECOM ITALIA RNC	440,335	0.74	327,168.90
TELEFONICA	300,146	14.45	4,337,109.70
TELEKOM AUSTRIA AG	24,278	7.53	182,983.28
TELEVISION FRANCAISE (T.F.1)	8,577	9.49	81,412.88
TENARIS SA	34,505	9.52	328,660.12
TERNA SPA	88,123	2.78	244,981.94
THALES SA	7,274	24.47	178,031.15
THYSSEN KRUPP	28,196	19.41	547,425.34
TNT EXPRESS	25,745	5.52	142,138.14
TOTAL SA	155,107	32.96	5,113,102.25
TUI AG	9,910	4.09	40,531.90
UCB (GROUPE)	7,369	32.64	240,524.16
UMICORE	8,330	28.47	237,155.10
UNICREDIT SPA	986,570	0.81	805,534.40
UNILEVER NV-CVA	119,032	23.65	2,815,106.80
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SC	58,086	2.84	165,196.58
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	7,820	12.93	101,112.60
UPM KYMMENE CORP	37,995	8.81	334,735.95
VALLOUREC	8,187	45.81	375,087.40
VEOLIA ENVIRONNEMENT	25,530	11.39	290,786.70
VERBUND AG	4,976	21.76	108,302.64
VIENNA INSURANCE GROUP AG WIENER VERSICH	2,808	28.61	80,336.88
VINCI S.A.	32,501	33.12	1,076,595.62
VIVENDI	90,436	15.38	1,390,905.68
VOESTALPINE AG	8,029	22.80	183,101.34
VOLKSWAGEN AG-PFD	10,568	106.30	1,123,378.40
VOLKSWAGEN STAMM	2,156	96.70	208,485.20
VOPAK	5,138	36.32	186,637.85
WACKER CHEMIE AG	1,088	72.67	79,064.96
WARTSILA OYJ	12,251	18.65	228,481.15
WENDEL	2,399	50.20	120,429.80
WOLTERS KLUWER	21,823	12.44	271,587.23

	ZARDOYA OTIS SA	10,201	9.52	97,113.52	
小計		13,500,136		140,414,948.96 (14,618,600,336)	
合計		78,194,316		(106,417,415,359)	

(注1)各種通貨ごとの小計の欄における()内の金額は、邦貨換算額であります。

(注2)合計欄における()内の金額は、各通貨の邦貨換算額合計の数字であります。

(注3)外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入株式時価比率	合計金額に対する比率
アメリカドル	株式 565銘柄	100.0%	56.7%
カナダドル	株式 99銘柄	100.0%	5.9%
オーストラリアドル	株式 61銘柄	100.0%	3.8%
イギリスポンド	株式 99銘柄	100.0%	10.8%
スイスフラン	株式 37銘柄	100.0%	4.3%
香港ドル	株式 40銘柄	100.0%	1.3%
シンガポールドル	株式 29銘柄	100.0%	0.8%
ニュージーランドドル	株式 5銘柄	100.0%	0.1%
スウェーデンクローナ	株式 33銘柄	100.0%	1.4%
ノルウェークローネ	株式 11銘柄	100.0%	0.4%
デンマーククローネ	株式 13銘柄	100.0%	0.5%
イスラエルシェケル	株式 14銘柄	100.0%	0.3%
ユーロ	株式 256銘柄	100.0%	13.7%

株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	口数(口)	評価額	備考
投資信託受益証券	アメリカドル	CARNIVAL CORP	33,428.00	1,072,035.96	
		HUTCHISON PORT HOLDINGS TR-U	382,000.00	242,570.00	
	小計		415,428.00	1,314,605.96 (100,764,546)	
	オーストラリアドル	LEND LEASE GROUP	39,632.00	281,387.20	
	小計		39,632.00	281,387.20 (21,151,875)	
投資信託受益証券計				(121,916,421)	

投資証券	アメリカドル	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	69,494.00	1,160,549.80	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,872.00	813,644.80	
		BOSTON PROPERTIES	10,639.00	986,022.52	
		DUKE REALTY CORP	17,553.00	190,625.58	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	21,530.00	1,153,792.70	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	4,548.00	382,987.08	
		GENERAL GROWTH PROPERTIES	31,790.00	404,050.90	
		HCP INC	29,669.00	1,067,787.31	
		HEALTH CARE REIT INC	12,916.00	628,492.56	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	50,139.00	564,063.75	
		KIMCO REALTY CORP	29,735.00	465,650.10	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	8,421.00	249,598.44	
		MACERICH CO/THE	9,565.00	424,399.05	
		PLUM CREEK TIMBER COMMON	11,833.00	421,254.80	
		PROLOGIS INC	33,202.00	844,326.86	
		PUBLIC STORAGE	10,598.00	1,204,250.74	
		RAYONIER INC	8,893.00	334,287.87	
		REGENCY CENTERS CORP	6,569.00	240,622.47	
		SIMON PROPERTY GROUP	21,436.00	2,413,264.88	
		VENTAS INC	20,011.00	1,002,751.21	
VORNADO REALTY TRUST	12,116.00	941,170.88			
小計		427,529.00	15,893,594.30 (1,218,244,003)		
カナダドル	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	9,313.00	240,182.27		
小計		9,313.00	240,182.27 (17,766,282)		
オーストラリアドル	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	134,870.00	236,022.50		
	DEXUS PROPERTY GROUP	353,593.00	291,714.22		
	GOODMAN GROUP	513,315.00	292,589.55		
	GPT GROUP	128,806.00	408,315.02		
	MIRVAC GROUP	249,678.00	282,136.14		
	STOCKLAND	174,131.00	499,755.97		
	WESTFIELD GROUP	160,284.00	1,253,420.88		
	WESTFIELD RETAIL TRUST	212,013.00	519,431.85		
小計		1,926,690.00	3,783,386.13 (284,397,135)		

イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	61,632.00	297,990.72	
	CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP PLC	40,840.00	135,793.00	
	HAMMERSON PLC	52,079.00	200,608.30	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	56,506.00	365,876.35	
	SEGRO PLC	54,233.00	118,878.73	
小計		265,290.00	1,119,147.10 (134,040,248)	
香港ドル	LINK REIT	163,000.00	4,164,650.00	
小計		163,000.00	4,164,650.00 (40,938,509)	
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	129,000.00	265,740.00	
	CAPITAMALL TRUST	140,000.00	257,600.00	
小計		269,000.00	523,340.00 (30,924,160)	
ユーロ	CORIO NV	4,387.00	152,163.09	
	FONCIERE DES REGIONS	1,911.00	100,021.74	
	GECINA SA	1,603.00	108,122.35	
	ICADE	1,705.00	100,100.55	
	KLEPIERRE	7,627.00	163,217.80	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	6,710.00	903,166.00	
小計		23,943.00	1,526,791.53 (158,954,266)	
投資証券計			(1,885,264,603)	
合計			(2,007,181,024)	

(注1)各種通貨ごとの小計の欄における()内の金額は、邦貨換算額であります。

(注2)合計欄における()内の金額は、各通貨の邦貨換算額合計の数字であります。

(注3)外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入投資信託受益証券時価比率	組入投資証券時価比率	合計金額に対する比率
アメリカドル	投資信託受益証券 2銘柄	7.6%		65.8%
	投資証券 21銘柄		92.4%	
カナダドル	投資証券 1銘柄		100.0%	0.9%
オーストラリアドル	投資信託受益証券 1銘柄	6.9%		15.2%
	投資証券 8銘柄		93.1%	
イギリスポンド	投資証券 5銘柄		100.0%	6.7%
香港ドル	投資証券 1銘柄		100.0%	2.0%
シンガポールドル	投資証券 2銘柄		100.0%	1.5%
ユーロ	投資証券 6銘柄		100.0%	7.9%

2)信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

3)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

前述の(デリバティブ取引に関する注記)に記載していますので、ここでは省略しております。

[次へ](#)

「住信 外国債券インデックス マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	(平成22年 9月30日現在)	(平成23年 9月30日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	381,073,630	261,712,237
コール・ローン	732,879,567	354,988,919
国債証券	249,486,067,349	204,059,393,919
特殊債券	1,926,424,245	1,229,228,023
未収利息	3,017,428,799	2,346,386,170
前払費用	116,107,992	98,874,013
流動資産合計	255,659,981,582	208,350,583,281
資産合計	255,659,981,582	208,350,583,281
負債の部		
流動負債		
未払解約金	309,404,066	108,491,072
流動負債合計	309,404,066	108,491,072
負債合計	309,404,066	108,491,072
純資産の部		
元本等		
元本	141,483,179,594	122,900,787,734
剰余金		
剰余金又は欠損金()	113,867,397,922	85,341,304,475
元本等合計	255,350,577,516	208,242,092,209
純資産合計	255,350,577,516	208,242,092,209
負債純資産合計	255,659,981,582	208,350,583,281

(注) 「住信 外国債券インデックス マザーファンド」の計算期間は、原則として毎年5月30日から翌年5月29日までであり、「すみしん DCマイセレクション50」の計算期間とは異なっております。上記の表は、平成22年9月30日及び平成23年9月30日現在の同マザーファンドの貸借対照表です。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	(自平成21年10月1日 至平成22年9月30日)	(自平成22年10月1日 至平成23年9月30日)

1. 資産の評価基準及び評価方法	国債証券、特殊債券 移動平均法(買付約定後、最初の利 払日までは個別法)に基づき、原則 として時価評価しております。時価 評価にあたっては、金融商品取引業 者等の提示する価格、価格情報会 社の提供する価格又は業界団体が公 表する売買参考統計値等で評価し ております。	国債証券、特殊債券 同左
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	投資信託財産に属する外貨建資産 ・負債の円換算は、原則として我が 国における計算期間末日の対顧客 電信売買相場の仲値によって計算 しております。 なお、外貨建資産等の会計処理は 「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) 第60条及び第61条に基づいており ます。	同左

(貸借対照表に関する注記)

	(平成22年9月30日現在)	(平成23年9月30日現在)
1. 期首元本額	155,643,938,944円	141,483,179,594円
期中追加設定元本額	13,063,344,127円	18,010,158,793円
期中一部解約元本額	27,224,103,477円	36,592,550,653円
期末元本額	141,483,179,594円	122,900,787,734円
元本額の内訳		
住信 外国債券オープン(毎月決算型)	17,399,727,530円	11,312,111,816円
住信 外国債券オープン(3ヶ月決算型)	590,424,341円	428,741,031円
住信 グローバル・インカム&プラス (毎月決算型)	6,046,425,548円	3,919,064,984円
住信 財産四分法ファンド(毎月決算型)	4,818,453,313円	2,119,239,134円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	248,503,857円	349,765,491円
SBI資産設計オープン(分配型)	14,195,164円	13,960,904円
STAM グローバル債券インデックス・オープン	1,856,043,351円	2,682,228,680円
世界経済インデックスファンド	126,903,864円	278,755,599円
すみしん マイセクション25	29,306,059円	24,182,247円
すみしん マイセクション50	18,990,110円	17,419,018円
すみしん マイセクション75	10,140,889円	9,939,136円
すみしん DCマイセクション25	709,978,550円	853,134,009円
すみしん DCマイセクション50	731,996,573円	831,468,056円
すみしん DCマイセクション75	428,902,317円	492,465,690円
すみしん DC外国債券インデックス・オープン	899,218,546円	1,034,534,928円
すみしん DCマイセクションS25	60,003,261円	226,185,823円

すみしん DCマイセレクションS50	81,615,509円	196,875,917円
すみしん DCマイセレクションS75	40,889,492円	80,467,491円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2015	2,008,030円	2,705,787円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2025	6,265,228円	21,739,257円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2035	3,788,129円	12,821,389円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2045	1,235,111円	3,406,855円
すみしん DCマルチアセット ファンド	170,560円	38,592円
STAM 外国債券インデックス・オープン(SMA専用)	1,136,320,134円	5,602,440,107円
STAM 外国債券インデックス 為替ヘッジあり (SMA専用)	2,006,533,273円	4,069,978,553円
すみしん マイセレクション50V A 1 (適格機関投資家専用)	51,585,543円	47,454,637円
すみしん マイセレクション75V A 1 (適格機関投資家専用)	15,879,408円	14,245,527円
すみしん 外国債券インデックス・オープンVA1 (適格機関投資家専用)	656,875,083円	599,568,331円
すみしん マイセレクション50V A 2 (適格機関投資家専用)	284,680円	215,392円
すみしん バランス30V A 1 (適格機関投資家専用)	1,707,921,101円	1,636,492,242円
すみしん バランス50V A 1 (適格機関投資家専用)	2,710,905,430円	2,592,454,946円
すみしん バランス25VA2(適格機関投資家専用)	35,254,340,313円	33,263,081,407円
すみしん バランス50VA2(適格機関投資家専用)	3,421,702,087円	3,268,796,782円
すみしん バランスA(25)VA1 (適格機関投資家専用)	10,989,027,506円	10,586,534,213円
すみしん バランスB(37.5)VA1 (適格機関投資家専用)	1,553,616,723円	1,440,441,971円
すみしん バランスC(50)VA1 (適格機関投資家専用)	5,141,146,213円	4,729,113,160円
すみしん 世界バランスVA1 (適格機関投資家専用)	5,351,328,546円	5,250,921,826円
すみしん 世界バランスVA2 (適格機関投資家専用)	5,841,001,580円	5,691,937,008円
すみしん バランスD(35)VA1 (適格機関投資家専用)	1,887,187,976円	1,690,151,555円
すみしん グローバルバランスファンドVA35 (適格機関投資家専用)	3,692,004,344円	3,550,366,707円
すみしん バランスE(25)VA1 (適格機関投資家専用)	781,085,038円	696,099,083円
すみしん バランスF(25)VA1 (適格機関投資家専用)	573,380,137円	844,501,822円
住信 FOFs用外国債券オープン (適格機関投資家専用)	19,825,417,261円	8,465,139,545円
住信 グローバル債券ファンド・シリーズ1 (適格機関投資家専用)	3,044,925,243円	2,384,405,291円

住信 グローバル・バランスファンド・シリーズ1	383,442,278円	382,038,804円
住信 外国債券ファンド・シリーズ1	1,332,084,365円	1,183,156,991円
2. 計算期間末日における受益権の総数	141,483,179,594口	122,900,787,734口

(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21年10月 1日 至 平成22年 9月30日)	(自 平成22年10月 1日 至 平成23年 9月30日)
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、金融商品に対する取組方針は投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。	同左
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドは、日本を除く世界の主要国の公社債を中心に投資を行い、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標として運用を行います。なお、当ファンドには、以下のリスクがあります。 ・ 価格変動リスク ・ 為替変動リスク	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用各部から独立した部署によって、ファンドの運用状況や運用ガイドライン、法令等の遵守状況についてモニタリングを行っております(運用を再委託しているファンドも含まれます。)。 モニタリング結果は、原則月1回(必要に応じ随時)開催される運用リスクの管理に関する委員会に報告され、委員会は適切な運用リスク管理に必要な措置を講じることとしております。	同左
4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価額がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

金融商品の時価に関する事項

項目	(平成22年 9月30日現在)	(平成23年 9月30日現在)
----	-----------------	-----------------

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>a. 国債証券、特殊債券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>b. コールローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>a. 国債証券、特殊債券 同左</p> <p>b. コールローン等の金銭債権及び金銭債務 同左</p>

(追加情報)

(自 平成21年10月 1日 至 平成22年 9月30日)	(自 平成22年10月 1日 至 平成23年 9月30日)
当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 平成20年3月10日)及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日)を適用しております。	

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	(平成22年 9月30日現在)	(平成23年 9月30日現在)
	当計算期間の損益に含まれた 評価差額(円)	当計算期間の損益に含まれた 評価差額(円)
国債証券	5,206,514,764	6,828,907,073
特殊債券	18,027,247	43,985,124
合 計	5,224,542,011	6,872,892,197

(注) 当計算期間の損益に含まれた評価差額は、当親投資信託の計算期間開始日から本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日までの期間に対応する金額であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(平成22年 9月30日現在)	(平成23年 9月30日現在)
該当事項はありません。	同左

(関連当事者との取引に関する注記)

(自 平成21年10月 1日 至 平成22年 9月30日)	(自 平成22年10月 1日 至 平成23年 9月30日)
----------------------------------	----------------------------------

本報告書における開示対象ファンドの計算期間中に利害関係人との間で、一般の取引条件と同様のもの以外の取引は行っておりません。 また、当ファンドの関連当事者である受託会社及び投資信託委託業者と財務諸表上で開示している報酬等の給付以外の取引は行っておりません。	同左
--	----

(1口当たり情報)

(平成22年 9月30日現在)	(平成23年 9月30日現在)
1口当たり純資産額 = 1.8048円	1口当たり純資産額 = 1.6944円

(3)附属明細表（平成23年9月30日現在）

1)有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.375% 08/31/12	15,500,000.00	15,532,695.39	
		T 0.5% 10/15/13	16,200,000.00	16,262,015.70	
		T 0.625% 02/28/13	16,700,000.00	16,795,242.27	
		T 0.75% 09/15/13	12,200,000.00	12,308,179.71	
		T 0.75% 12/15/13	15,000,000.00	15,137,109.45	
		T 1% 01/15/14	3,900,000.00	3,957,281.25	
		T 1.125% 12/15/12	16,200,000.00	16,380,984.45	
		T 1.25% 04/15/14	2,100,000.00	2,144,789.07	
		T 1.375% 01/15/13	23,000,000.00	23,339,609.49	
		T 1.375% 05/15/13	5,000,000.00	5,089,453.15	
		T 1.375% 10/15/12	800,000.00	810,062.50	
		T 1.375% 11/15/12	10,200,000.00	10,335,867.16	
		T 1.5% 12/31/13	8,650,000.00	8,877,062.50	
		T 1.75% 01/31/14	22,600,000.00	23,324,789.00	
		T 1.75% 03/31/14	6,100,000.00	6,305,875.00	
		T 1.75% 07/31/15	27,000,000.00	28,111,640.76	
		T 1.875% 02/28/14	7,800,000.00	8,079,093.75	
		T 1.875% 04/30/14	2,400,000.00	2,490,937.51	
		T 1.875% 06/30/15	15,900,000.00	16,624,816.44	
		T 1.875% 08/31/17	9,800,000.00	10,156,015.67	
		T 1.875% 09/30/17	9,000,000.00	9,323,085.96	
		T 1.875% 10/31/17	2,500,000.00	2,587,792.97	
T 2% 11/30/13	15,000,000.00	15,539,062.50			

T 2.125% 02/29/16	14,000,000.00	14,789,687.50	
T 2.25% 01/31/15	14,000,000.00	14,793,515.66	
T 2.25% 05/31/14	10,100,000.00	10,592,375.00	
T 2.25% 11/30/17	9,000,000.00	9,511,171.92	
T 2.375% 02/28/15	14,500,000.00	15,388,691.37	
T 2.375% 05/31/18	4,000,000.00	4,244,218.76	
T 2.375% 06/30/18	4,300,000.00	4,561,023.45	
T 2.375% 08/31/14	12,500,000.00	13,199,707.00	
T 2.375% 10/31/14	7,500,000.00	7,937,988.30	
T 2.5% 03/31/13	11,800,000.00	12,197,328.18	
T 2.625% 02/29/16	1,000,000.00	1,077,578.13	
T 2.625% 04/30/16	9,100,000.00	9,813,781.25	
T 2.625% 08/15/20	18,400,000.00	19,598,875.00	
T 2.625% 11/15/20	17,500,000.00	18,607,421.87	
T 2.625% 12/31/14	8,000,000.00	8,541,875.04	
T 2.75% 02/15/19	10,000,000.00	10,839,062.50	
T 2.75% 02/28/13	6,000,000.00	6,212,343.78	
T 2.75% 02/28/18	3,800,000.00	4,130,273.42	
T 2.75% 05/31/17	16,000,000.00	17,398,750.08	
T 2.75% 10/31/13	1,500,000.00	1,575,527.34	
T 2.75% 11/30/16	14,000,000.00	15,208,593.82	
T 2.875% 01/31/13	15,800,000.00	16,356,085.89	
T 2.875% 03/31/18	3,900,000.00	4,269,585.95	
T 3% 02/28/17	9,500,000.00	10,450,742.23	
T 3% 08/31/16	8,700,000.00	9,550,289.10	
T 3.125% 01/31/17	3,500,000.00	3,871,601.58	
T 3.125% 04/30/17	6,500,000.00	7,198,496.11	
T 3.125% 05/15/19	9,000,000.00	9,989,296.92	
T 3.125% 05/15/21	11,250,000.00	12,414,990.25	
T 3.125% 08/31/13	3,500,000.00	3,689,628.91	
T 3.125% 10/31/16	8,500,000.00	9,389,843.75	
T 3.25% 06/30/16	6,100,000.00	6,764,566.38	
T 3.25% 07/31/16	7,000,000.00	7,764,804.67	
T 3.25% 12/31/16	7,000,000.00	7,783,671.91	
T 3.375% 06/30/13	11,200,000.00	11,809,437.47	
T 3.375% 07/31/13	21,000,000.00	22,193,554.73	
T 3.375% 11/15/19	8,300,000.00	9,371,218.75	
T 3.375% 11/30/12	6,500,000.00	6,740,449.23	
T 3.5% 02/15/18	5,700,000.00	6,458,812.50	
T 3.5% 02/15/39	7,900,000.00	8,569,031.25	
T 3.5% 05/15/20	12,300,000.00	14,014,792.93	

T 3.5% 05/31/13	2,400,000.00	2,528,625.00	
T 3.625% 02/15/20	11,300,000.00	12,980,433.62	
T 3.625% 02/15/21	15,000,000.00	17,230,078.20	
T 3.625% 05/15/13	7,750,000.00	8,169,892.59	
T 3.625% 08/15/19	3,900,000.00	4,472,203.12	
T 3.625% 12/31/12	5,100,000.00	5,316,949.20	
T 3.75% 08/15/41	3,200,000.00	3,634,000.00	
T 3.875% 02/15/13	3,900,000.00	4,093,933.58	
T 3.875% 05/15/18	5,000,000.00	5,791,992.20	
T 3.875% 08/15/40	12,300,000.00	14,245,898.49	
T 3.875% 10/31/12	3,700,000.00	3,848,144.52	
T 4% 02/15/14	5,450,000.00	5,917,507.81	
T 4.0% 02/15/15	12,700,000.00	14,160,996.06	
T 4.0% 08/15/18	3,300,000.00	3,857,390.62	
T 4.0% 11/15/12	1,700,000.00	1,772,582.02	
T 4.125% 05/15/15	6,700,000.00	7,542,996.07	
T 4.125% 08/31/12	5,600,000.00	5,803,437.52	
T 4.25% 05/15/39	4,300,000.00	5,284,632.83	
T 4.25% 08/15/13	8,000,000.00	8,592,500.00	
T 4.25% 08/15/14	12,000,000.00	13,312,031.27	
T 4.25% 08/15/15	12,500,000.00	14,200,683.62	
T 4.25% 09/30/12	6,400,000.00	6,661,249.98	
T 4.25% 11/15/13	5,100,000.00	5,524,136.70	
T 4.25% 11/15/14	7,700,000.00	8,599,636.73	
T 4.25% 11/15/17	4,600,000.00	5,413,625.00	
T 4.25% 11/15/40	15,000,000.00	18,496,875.00	
T 4.375% 02/15/38	5,900,000.00	7,367,625.00	
T 4.375% 05/15/40	5,900,000.00	7,413,718.75	
T 4.375% 11/15/39	10,500,000.00	13,177,500.00	
T 4.5% 02/15/16	3,200,000.00	3,705,624.99	
T 4.5% 02/15/36	5,400,000.00	6,846,609.40	
T 4.5% 05/15/17	3,300,000.00	3,906,375.00	
T 4.5% 05/15/38	2,000,000.00	2,546,406.26	
T 4.5% 08/15/39	8,600,000.00	10,993,218.75	
T 4.5% 11/15/15	3,100,000.00	3,572,628.91	
T 4.625% 02/15/17	5,000,000.00	5,925,390.65	
T 4.625% 02/15/40	8,900,000.00	11,614,500.00	
T 4.75% 02/15/37	4,000,000.00	5,260,312.52	
T 4.75% 02/15/41	2,100,000.00	2,800,710.94	
T 4.75% 05/15/14	6,200,000.00	6,902,343.75	
T 4.75% 08/15/17	1,300,000.00	1,562,234.37	

	T 5.0% 05/15/37	2,000,000.00	2,726,718.76	
	T 5.125% 05/15/16	5,800,000.00	6,917,632.79	
	T 5.25% 02/15/29	2,050,000.00	2,767,820.31	
	T 5.25% 11/15/28	1,900,000.00	2,561,140.62	
	T 5.375% 02/15/31	2,610,000.00	3,623,617.98	
	T 5.5% 08/15/28	2,000,000.00	2,763,593.76	
	T 6.0% 02/15/26	2,200,000.00	3,122,625.00	
	T 6.125% 08/15/29	1,400,000.00	2,074,734.38	
	T 6.125% 11/15/27	3,220,000.00	4,697,678.12	
	T 6.25% 05/15/30	2,380,000.00	3,597,332.82	
	T 6.25% 08/15/23	3,490,000.00	4,941,894.54	
	T 6.375% 08/15/27	1,200,000.00	1,787,812.50	
	T 6.5% 11/15/26	2,110,000.00	3,151,317.97	
	T 6.625% 02/15/27	1,150,000.00	1,741,621.09	
	T 6.75% 08/15/26	800,000.00	1,216,812.50	
	T 6.875% 08/15/25	1,000,000.00	1,520,078.13	
	T 7.25% 05/15/16	6,350,000.00	8,193,732.40	
	T 7.25% 08/15/22	2,600,000.00	3,904,265.63	
	T 7.5% 11/15/16	6,100,000.00	8,082,500.00	
	T 7.625% 02/15/25	3,400,000.00	5,435,750.00	
	T 8.0% 11/15/21	3,410,000.00	5,300,152.36	
	T 8.125% 08/15/19	2,100,000.00	3,118,828.12	
	T 8.75% 05/15/17	4,800,000.00	6,801,375.02	
	T 8.75% 08/15/20	2,800,000.00	4,405,078.13	
	T 8.875% 02/15/19	4,800,000.00	7,285,687.48	
小計		975,370,000.00	1,081,171,582.98 (82,871,801,835)	
カナダドル	CAN 1.5% 12/01/12	1,900,000.00	1,913,490.00	
	CAN 1.75% 03/01/13	5,200,000.00	5,262,660.00	
	CAN 2% 03/01/14	800,000.00	819,736.00	
	CAN 2% 06/01/16	1,400,000.00	1,438,024.00	
	CAN 2% 09/01/12	2,050,000.00	2,070,930.50	
	CAN 2% 12/01/14	3,000,000.00	3,080,310.00	
	CAN 2.5% 06/01/15	2,000,000.00	2,090,380.00	
	CAN 2.5% 09/01/13	1,800,000.00	1,854,234.00	
	CAN 3% 12/01/15	1,000,000.00	1,067,350.00	
	CAN 3.0% 06/01/14	4,900,000.00	5,152,693.00	
	CAN 3.25% 06/01/21	2,300,000.00	2,505,689.00	
	CAN 3.5% 06/01/13	3,000,000.00	3,128,250.00	
	CAN 3.5% 06/01/20	2,900,000.00	3,217,492.00	
	CAN 3.75% 06/01/19	3,600,000.00	4,063,500.00	

	CAN 4% 06/01/16	4,000,000.00	4,468,800.00	
	CAN 4% 06/01/17	2,950,000.00	3,334,090.00	
	CAN 4.0% 06/01/41	2,600,000.00	3,201,926.00	
	CAN 4.25% 06/01/18	2,350,000.00	2,719,208.50	
	CAN 4.5% 06/01/15	4,200,000.00	4,689,678.00	
	CAN 5% 06/01/14	2,600,000.00	2,870,426.00	
	CAN 5% 06/01/37	3,650,000.00	5,048,753.00	
	CAN 5.25% 06/01/13	5,120,000.00	5,486,489.60	
	CAN 5.75% 06/01/29	2,260,000.00	3,216,658.00	
	CAN 5.75% 06/01/33	2,710,000.00	3,985,055.00	
	CAN 8.0% 06/01/23	1,000,000.00	1,572,620.00	
	CAN 8.0% 06/01/27	1,450,000.00	2,456,749.50	
	CAN 9% 06/01/25	350,000.00	614,491.50	
小計		71,090,000.00	81,329,683.60 (6,015,956,695)	
オーストラリアドル	ACGB 4.5% 04/15/20	3,500,000.00	3,574,270.00	
	ACGB 4.75% 11/15/12	1,200,000.00	1,212,768.00	
	ACGB 5.25% 03/15/19	2,450,000.00	2,627,527.00	
	ACGB 5.5% 01/21/18	250,000.00	270,647.50	
	ACGB 5.5% 12/15/13	700,000.00	727,433.00	
	ACGB 5.75% 05/15/21	1,400,000.00	1,562,666.00	
	ACGB 5.75% 07/15/22	2,000,000.00	2,240,500.00	
	ACGB 6.25% 04/15/15	800,000.00	866,552.00	
	ACGB 6.25% 06/15/14	1,200,000.00	1,279,692.00	
	ACGB 6.5% 05/15/13	3,900,000.00	4,070,118.00	
小計		17,400,000.00	18,432,173.50 (1,385,546,481)	
イギリスポンド	UKT 2% 01/22/16	1,300,000.00	1,338,844.00	
	UKT 2.25% 03/07/14	4,800,000.00	4,981,680.00	
	UKT 2.75% 01/22/15	5,400,000.00	5,710,230.00	
	UKT 3.75% 09/07/19	2,500,000.00	2,790,375.00	
	UKT 3.75% 09/07/20	3,350,000.00	3,724,697.50	
	UKT 4% 01/22/60	3,050,000.00	3,249,866.50	
	UKT 4% 03/07/22	4,200,000.00	4,744,110.00	
	UKT 4% 09/07/16	5,300,000.00	5,952,854.00	
	UKT 4.25% 03/07/36	4,650,000.00	5,202,652.50	
	UKT 4.25% 06/07/32	3,910,000.00	4,410,597.30	
	UKT 4.25% 09/07/39	1,600,000.00	1,780,448.00	
	UKT 4.25% 12/07/27	4,650,000.00	5,302,162.50	
	UKT 4.25% 12/07/40	3,450,000.00	3,831,673.50	
UKT 4.25% 12/07/46	3,850,000.00	4,292,288.00		

	UKT 4.25% 12/07/49	3,400,000.00	3,781,922.00	
	UKT 4.25% 12/07/55	3,400,000.00	3,803,172.00	
	UKT 4.5% 03/07/13	5,600,000.00	5,914,160.00	
	UKT 4.5% 03/07/19	4,250,000.00	4,971,522.50	
	UKT 4.5% 09/07/34	2,200,000.00	2,555,916.00	
	UKT 4.5% 12/07/42	4,600,000.00	5,343,820.00	
	UKT 4.75% 03/07/20	5,900,000.00	7,034,275.00	
	UKT 4.75% 09/07/15	5,600,000.00	6,383,888.00	
	UKT 4.75% 12/07/30	3,600,000.00	4,339,368.00	
	UKT 4.75% 12/07/38	4,900,000.00	5,905,088.00	
	UKT 5% 03/07/18	3,200,000.00	3,828,576.00	
	UKT 5% 03/07/25	3,620,000.00	4,474,139.00	
	UKT 5.0% 09/07/14	5,010,000.00	5,612,202.00	
	UKT 6.0% 12/07/28	2,460,000.00	3,398,736.00	
	UKT 8% 06/07/21	3,840,000.00	5,727,744.00	
	UKT 8% 09/27/13	2,100,000.00	2,406,348.00	
	UKT 8% 12/07/15	3,345,000.00	4,279,693.35	
	UKT 8.75% 08/25/17	2,050,000.00	2,866,576.50	
小計		121,085,000.00	139,939,625.15 (16,760,568,904)	
スイスフラン	SWISS 3% 01/08/18	2,400,000.00	2,754,984.00	
	SWISS 4% 02/11/13	3,200,000.00	3,374,976.00	
	SWISS 4% 02/11/23	3,900,000.00	5,105,607.00	
小計		9,500,000.00	11,235,567.00 (959,292,710)	
シンガポールドル	SIGB 1.125% 04/01/16	700,000.00	719,236.00	
	SIGB 1.625% 04/01/13	800,000.00	817,952.00	
	SIGB 2.25% 06/01/21	500,000.00	527,255.00	
	SIGB 2.25% 07/01/13	1,550,000.00	1,607,722.00	
	SIGB 2.5% 06/01/19	550,000.00	596,079.00	
	SIGB 2.5% 10/01/12	600,000.00	614,280.00	
	SIGB 2.875% 07/01/15	1,000,000.00	1,089,090.00	
	SIGB 2.875% 09/01/30	350,000.00	392,738.50	
	SIGB 3.125% 09/01/22	900,000.00	1,026,702.00	
	SIGB 3.25% 09/01/20	900,000.00	1,023,894.00	
	SIGB 3.5% 03/01/27	1,200,000.00	1,419,540.00	
	SIGB 3.625% 07/01/14	1,300,000.00	1,417,923.00	
	SIGB 3.75% 09/01/16	1,300,000.00	1,493,531.00	
	SIGB 4% 09/01/18	900,000.00	1,071,162.00	
小計		12,550,000.00	13,817,104.50 (816,452,704)	

マレーシアリングット	MGS 3.21% 05/31/13	4,400,000.00	4,410,252.00	
	MGS 3.434% 08/15/14	1,000,000.00	1,005,110.00	
	MGS 3.461% 07/31/13	4,900,000.00	4,932,398.80	
	MGS 3.502% 05/31/27	2,400,000.00	2,232,259.20	
	MGS 3.702% 02/25/13	2,250,000.00	2,270,574.00	
	MGS 3.741% 02/27/15	1,300,000.00	1,314,963.00	
	MGS 3.814% 02/15/17	2,500,000.00	2,532,600.00	
	MGS 4.16% 07/15/21	1,900,000.00	1,971,668.00	
	MGS 4.24% 02/07/18	400,000.00	414,024.00	
	MGS 4.262% 09/15/16	9,600,000.00	9,924,432.00	
	MGS 4.378% 11/29/19	2,800,000.00	2,928,464.00	
	MGS 4.72% 09/30/15	1,600,000.00	1,674,926.40	
	MGS 5.094% 04/30/14	3,000,000.00	3,133,350.00	
	MGS 5.248% 09/15/28	3,650,000.00	4,157,120.05	
小計		41,700,000.00	42,902,141.45 (1,031,796,501)	
スウェーデンクローナ	SGB 3% 07/12/16	11,700,000.00	12,516,309.00	
	SGB 3.5% 03/30/39	8,850,000.00	10,956,477.00	
	SGB 3.5% 06/01/22	4,900,000.00	5,688,410.00	
	SGB 3.75% 08/12/17	15,100,000.00	16,871,230.00	
	SGB 4.25% 03/12/19	15,200,000.00	17,833,096.00	
	SGB 4.5% 08/12/15	4,900,000.00	5,479,768.00	
	SGB 5% 12/01/20	15,300,000.00	19,394,739.00	
	SGB 5.5% 10/08/12	11,700,000.00	12,207,897.00	
	SGB 6.75% 05/05/14	21,000,000.00	23,952,600.00	
小計		108,650,000.00	124,900,526.00 (1,406,379,922)	
ノルウェークローネ	NGB 3.75% 05/25/21	4,650,000.00	5,186,517.00	
	NGB 4.25% 05/19/17	8,100,000.00	9,073,053.00	
	NGB 4.5% 05/22/19	5,000,000.00	5,785,150.00	
	NGB 5% 05/15/15	10,600,000.00	11,827,798.00	
	NGB 6.5% 05/15/13	12,700,000.00	13,712,190.00	
小計		41,050,000.00	45,584,708.00 (603,085,686)	

デンマーククローネ	DGB 3% 11/15/21	4,500,000.00	4,829,175.00	
	DGB 4% 11/15/12	12,100,000.00	12,548,910.00	
	DGB 4% 11/15/15	20,400,000.00	22,703,568.00	
	DGB 4% 11/15/17	15,200,000.00	17,352,320.00	
	DGB 4% 11/15/19	13,900,000.00	16,050,052.00	
	DGB 4.5% 11/15/39	21,450,000.00	29,337,808.50	
	DGB 5% 11/15/13	20,100,000.00	21,916,035.00	
	DGB 7% 11/10/24	5,890,000.00	8,894,489.00	
小計		113,540,000.00	133,632,357.50 (1,869,516,681)	
メキシコペソ	MBONO 6% 06/18/15	82,000,000.00	84,649,420.00	
	MBONO 8% 06/11/20	40,000,000.00	44,626,800.00	
	MBONO 8.5% 05/31/29	61,400,000.00	68,136,194.00	
	MBONO 8.5% 11/18/38	32,300,000.00	35,246,406.00	
	MBONO 9% 12/20/12	71,100,000.00	74,865,456.00	
小計		286,800,000.00	307,524,276.00 (1,722,135,945)	
ポーランドズロチ	POLGB 5% 10/24/13	8,000,000.00	8,078,560.00	
	POLGB 5.25% 04/25/13	10,600,000.00	10,733,772.00	
	POLGB 5.25% 10/25/17	7,450,000.00	7,345,700.00	
	POLGB 5.25% 10/25/20	2,000,000.00	1,916,300.00	
	POLGB 5.5% 04/25/15	4,800,000.00	4,878,000.00	
	POLGB 5.5% 10/25/19	6,400,000.00	6,294,208.00	
	POLGB 5.75% 04/25/14	10,100,000.00	10,355,025.00	
	POLGB 5.75% 04/25/29	1,300,000.00	1,264,250.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	5,500,000.00	5,433,065.00	
	POLGB 6.25% 10/24/15	8,800,000.00	9,163,264.00	
小計		64,950,000.00	65,462,144.00 (1,537,705,762)	
ユーロ	BGB 3.25% 09/28/16	3,050,000.00	3,087,606.50	
	BGB 3.5% 03/28/15	1,000,000.00	1,032,130.00	
	BGB 3.75% 09/28/15	4,000,000.00	4,160,520.00	
	BGB 3.75% 09/28/20	3,550,000.00	3,589,511.50	
	BGB 4% 03/28/14	2,300,000.00	2,403,960.00	
	BGB 4% 03/28/18	2,500,000.00	2,604,375.00	
	BGB 4% 03/28/22	3,850,000.00	3,941,437.50	
	BGB 4.0% 03/28/13	3,000,000.00	3,110,790.00	
	BGB 4.0% 03/28/17	2,700,000.00	2,811,591.00	
	BGB 4.0% 03/28/19	2,400,000.00	2,493,432.00	
	BGB 4.25% 03/28/41	1,300,000.00	1,288,235.00	
	BGB 4.25% 09/28/13	4,100,000.00	4,295,488.00	

BGB 4.25% 09/28/14	2,950,000.00	3,113,223.50	
BGB 4.5% 03/28/26	1,100,000.00	1,149,588.00	
BGB 5% 03/28/35	2,900,000.00	3,222,915.00	
BGB 5% 09/28/12	3,100,000.00	3,222,295.00	
BGB 5.5% 03/28/28	3,700,000.00	4,302,804.00	
BGB 5.5% 09/28/17	2,050,000.00	2,297,025.00	
BGB 8.0% 03/28/15	2,000,000.00	2,360,360.00	
BKO 0.75% 09/14/12	3,800,000.00	3,811,704.00	
BKO 1% 12/14/12	1,200,000.00	1,207,260.00	
BKO 1.75% 06/14/13	5,500,000.00	5,608,735.00	
BTNS 2% 07/12/15	600,000.00	611,010.00	
BTNS 2.25% 02/25/16	1,000,000.00	1,024,680.00	
BTNS 2.5% 01/12/14	4,600,000.00	4,748,580.00	
BTNS 2.5% 01/15/15	5,600,000.00	5,805,352.00	
BTNS 3% 07/12/14	6,500,000.00	6,821,750.00	
BTNS 3.75% 01/12/13	8,200,000.00	8,506,270.00	
BTNS 4.5% 07/12/13	1,000,000.00	1,062,270.00	
BTPS 2% 06/01/13	1,300,000.00	1,257,724.00	
BTPS 2% 12/15/12	2,800,000.00	2,736,104.00	
BTPS 2.25% 11/01/13	4,100,000.00	3,928,825.00	
BTPS 3% 04/01/14	3,500,000.00	3,376,905.00	
BTPS 3% 04/15/15	2,500,000.00	2,365,950.00	
BTPS 3% 06/15/15	500,000.00	471,375.00	
BTPS 3% 11/01/15	2,800,000.00	2,615,144.00	
BTPS 3.5% 06/01/14	3,300,000.00	3,222,780.00	
BTPS 3.75% 03/01/21	2,000,000.00	1,759,000.00	
BTPS 3.75% 04/15/16	1,100,000.00	1,048,795.00	
BTPS 3.75% 08/01/15	7,500,000.00	7,288,350.00	
BTPS 3.75% 08/01/16	7,900,000.00	7,533,045.00	
BTPS 3.75% 08/01/21	8,000,000.00	6,992,640.00	
BTPS 3.75% 12/15/13	4,000,000.00	3,943,520.00	
BTPS 4% 02/01/17	6,300,000.00	6,028,911.00	
BTPS 4% 02/01/37	5,500,000.00	4,023,965.00	
BTPS 4% 09/01/20	3,500,000.00	3,155,705.00	
BTPS 4.25% 02/01/15	6,300,000.00	6,233,094.00	
BTPS 4.25% 02/01/19	6,900,000.00	6,449,430.00	
BTPS 4.25% 03/01/20	2,950,000.00	2,711,640.00	
BTPS 4.25% 04/15/13	1,800,000.00	1,801,404.00	
BTPS 4.25% 08/01/13	5,800,000.00	5,802,900.00	
BTPS 4.25% 08/01/14	8,500,000.00	8,443,050.00	
BTPS 4.25% 09/01/19	5,500,000.00	5,099,985.00	

BTPS 4.25% 10/15/12	1,500,000.00	1,506,075.00	
BTPS 4.5% 02/01/18	3,900,000.00	3,728,400.00	
BTPS 4.5% 02/01/20	6,100,000.00	5,715,273.00	
BTPS 4.5% 03/01/19	4,450,000.00	4,208,943.50	
BTPS 4.5% 03/01/26	3,350,000.00	2,827,835.50	
BTPS 4.5% 08/01/18	6,600,000.00	6,283,200.00	
BTPS 4.75% 02/01/13	10,100,000.00	10,172,518.00	
BTPS 4.75% 08/01/23	7,200,000.00	6,516,000.00	
BTPS 5% 03/01/25	3,850,000.00	3,500,728.00	
BTPS 5% 08/01/34	5,000,000.00	4,166,500.00	
BTPS 5% 09/01/40	3,000,000.00	2,464,590.00	
BTPS 5.0% 08/01/39	4,000,000.00	3,300,800.00	
BTPS 5.25% 08/01/17	4,040,000.00	4,055,150.00	
BTPS 5.25% 11/01/29	5,600,000.00	4,976,328.00	
BTPS 5.75% 02/01/33	3,000,000.00	2,739,990.00	
BTPS 6% 05/01/31	6,330,000.00	5,969,379.90	
BTPS 6.5% 11/01/27	5,500,000.00	5,527,665.00	
BTPS 7.25% 11/01/26	3,100,000.00	3,338,483.00	
BTPS 9% 11/01/23	800,000.00	971,680.00	
DBR 2.25% 09/04/20	5,400,000.00	5,557,950.00	
DBR 2.5% 01/04/21	3,200,000.00	3,357,120.00	
DBR 3% 07/04/20	5,000,000.00	5,462,000.00	
DBR 3.25% 01/04/20	4,100,000.00	4,559,733.00	
DBR 3.25% 07/04/15	7,200,000.00	7,808,400.00	
DBR 3.25% 07/04/21	3,000,000.00	3,336,090.00	
DBR 3.25% 07/04/42	1,600,000.00	1,768,048.00	
DBR 3.5% 01/04/16	8,000,000.00	8,800,240.00	
DBR 3.5% 07/04/19	7,000,000.00	7,899,500.00	
DBR 3.75% 01/04/15	6,200,000.00	6,775,546.00	
DBR 3.75% 01/04/17	6,100,000.00	6,850,483.00	
DBR 3.75% 01/04/19	4,050,000.00	4,633,524.00	
DBR 3.75% 07/04/13	5,000,000.00	5,278,500.00	
DBR 4% 07/04/16	3,900,000.00	4,401,150.00	
DBR 4.0% 01/04/18	4,500,000.00	5,176,125.00	
DBR 4.0% 01/04/37	3,800,000.00	4,643,980.00	
DBR 4.25% 01/04/14	5,000,000.00	5,404,400.00	
DBR 4.25% 07/04/14	8,000,000.00	8,762,400.00	
DBR 4.25% 07/04/17	4,200,000.00	4,857,426.00	
DBR 4.25% 07/04/18	5,700,000.00	6,686,385.00	
DBR 4.25% 07/04/39	3,500,000.00	4,494,175.00	
DBR 4.5% 01/04/13	7,800,000.00	8,193,120.00	

DBR 4.75% 07/04/28	4,450,000.00	5,708,371.00	
DBR 4.75% 07/04/34	4,700,000.00	6,258,426.00	
DBR 4.75% 07/04/40	4,100,000.00	5,702,075.00	
DBR 5.5% 01/04/31	3,600,000.00	5,068,440.00	
DBR 5.625% 01/04/28	1,970,000.00	2,752,050.60	
DBR 6% 06/20/16	560,000.00	681,408.00	
DBR 6.25% 01/04/24	2,500,000.00	3,556,800.00	
DBR 6.25% 01/04/30	2,000,000.00	3,030,560.00	
DBR 6.5% 07/04/27	1,600,000.00	2,414,768.00	
FRTR 2.5% 10/25/20	4,000,000.00	3,970,520.00	
FRTR 3% 10/25/15	5,800,000.00	6,122,654.00	
FRTR 3.25% 04/25/16	9,500,000.00	10,142,200.00	
FRTR 3.25% 10/25/21	2,000,000.00	2,098,000.00	
FRTR 3.5% 04/25/15	7,900,000.00	8,467,615.00	
FRTR 3.5% 04/25/20	5,600,000.00	6,025,768.00	
FRTR 3.5% 04/25/26	4,650,000.00	4,801,125.00	
FRTR 3.75% 04/25/17	4,600,000.00	5,033,918.00	
FRTR 3.75% 04/25/21	7,600,000.00	8,326,560.00	
FRTR 3.75% 10/25/19	6,600,000.00	7,234,788.00	
FRTR 4% 04/25/14	5,100,000.00	5,465,823.00	
FRTR 4% 04/25/18	6,400,000.00	7,122,432.00	
FRTR 4% 04/25/55	3,100,000.00	3,378,287.00	
FRTR 4% 04/25/60	1,700,000.00	1,855,465.00	
FRTR 4% 10/25/13	5,000,000.00	5,298,500.00	
FRTR 4% 10/25/14	3,500,000.00	3,784,795.00	
FRTR 4% 10/25/38	4,900,000.00	5,333,895.00	
FRTR 4.0% 04/25/13	6,800,000.00	7,124,360.00	
FRTR 4.25% 04/25/19	7,800,000.00	8,826,324.00	
FRTR 4.25% 10/25/17	3,100,000.00	3,487,128.00	
FRTR 4.25% 10/25/18	3,050,000.00	3,447,110.00	
FRTR 4.25% 10/25/23	8,500,000.00	9,611,800.00	
FRTR 4.5% 04/25/41	2,550,000.00	3,011,422.50	
FRTR 4.75% 04/25/35	4,300,000.00	5,181,070.00	
FRTR 4.75% 10/25/12	6,000,000.00	6,253,380.00	
FRTR 5% 10/25/16	6,210,000.00	7,154,851.50	
FRTR 5.5% 04/25/29	4,930,000.00	6,284,172.40	
FRTR 5.75% 10/25/32	4,600,000.00	6,154,800.00	
FRTR 6.0% 10/25/25	2,800,000.00	3,711,120.00	
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,545,820.00	
FRTR 8.5% 10/25/19	1,120,000.00	1,620,337.60	
FRTR 8.5% 12/26/12	1,500,000.00	1,640,175.00	

IRISH 4% 01/15/14	1,000,000.00	943,900.00	
IRISH 4.4% 06/18/19	1,700,000.00	1,416,066.00	
IRISH 4.5% 04/18/20	4,200,000.00	3,490,200.00	
IRISH 4.5% 10/18/18	1,600,000.00	1,350,960.00	
IRISH 4.6% 04/18/16	2,200,000.00	2,043,580.00	
IRISH 5% 04/18/13	3,100,000.00	3,040,573.00	
IRISH 5.4% 03/13/25	2,100,000.00	1,773,660.00	
IRISH 5.9% 10/18/19	600,000.00	545,478.00	
NETHER 1% 01/15/14	1,000,000.00	1,003,480.00	
NETHER 1.75% 01/15/13	2,300,000.00	2,333,120.00	
NETHER 2.75% 01/15/15	1,200,000.00	1,260,936.00	
NETHER 3.25% 07/15/15	4,600,000.00	4,928,440.00	
NETHER 3.25% 07/15/21	1,700,000.00	1,827,500.00	
NETHER 3.5% 07/15/20	3,400,000.00	3,733,982.00	
NETHER 3.75% 01/15/23	1,650,000.00	1,848,132.00	
NETHER 3.75% 01/15/42	2,250,000.00	2,680,875.00	
NETHER 3.75% 07/15/14	4,000,000.00	4,302,600.00	
NETHER 4% 01/15/37	2,550,000.00	3,084,480.00	
NETHER 4% 07/15/16	2,750,000.00	3,057,037.50	
NETHER 4% 07/15/19	3,000,000.00	3,399,390.00	
NETHER 4.0% 07/15/18	2,950,000.00	3,330,845.00	
NETHER 4.25% 07/15/13	4,300,000.00	4,570,685.00	
NETHER 4.5% 07/15/17	4,400,000.00	5,044,512.00	
NETHER 5.5% 01/15/28	2,300,000.00	3,110,060.00	
NETHER 7.5% 01/15/23	1,050,000.00	1,564,006.50	
OBL 1.75% 10/09/15	2,100,000.00	2,160,270.00	
OBL 2.25% 04/10/15	3,500,000.00	3,663,205.00	
OBL 2.25% 04/11/14	6,000,000.00	6,244,320.00	
OBL 2.5% 02/27/15	4,600,000.00	4,848,538.00	
OBL 2.5% 10/10/14	3,800,000.00	3,994,484.00	
OBL 2.75% 04/08/16	1,000,000.00	1,069,880.00	
OBL 3.5% 04/12/13	6,450,000.00	6,738,960.00	
OBL 4.25% 10/12/12	5,900,000.00	6,127,445.00	
RAGB 3.2% 02/20/17	300,000.00	316,860.00	
RAGB 3.4% 10/20/14	600,000.00	635,448.00	
RAGB 3.5% 07/15/15	3,550,000.00	3,790,690.00	
RAGB 3.5% 09/15/21	3,700,000.00	3,940,315.00	
RAGB 3.8% 10/20/13	3,000,000.00	3,167,040.00	
RAGB 3.9% 07/15/20	2,900,000.00	3,178,835.00	
RAGB 4% 09/15/16	3,400,000.00	3,725,380.00	
RAGB 4.15% 03/15/37	2,300,000.00	2,596,769.00	

RAGB 4.3% 07/15/14	2,200,000.00	2,380,070.00	
RAGB 4.3% 09/15/17	850,000.00	948,107.00	
RAGB 4.35% 03/15/19	1,300,000.00	1,463,670.00	
RAGB 4.65% 01/15/18	3,950,000.00	4,490,478.50	
RAGB 4.85% 03/15/26	1,350,000.00	1,610,523.00	
RAGB 6.25% 07/15/27	1,900,000.00	2,617,915.00	
RFGB 3.125% 09/15/14	1,600,000.00	1,695,568.00	
RFGB 3.375% 04/15/20	1,250,000.00	1,349,662.50	
RFGB 3.875% 09/15/17	2,000,000.00	2,218,000.00	
RFGB 4% 07/04/25	1,700,000.00	1,923,431.00	
RFGB 4.25% 07/04/15	1,400,000.00	1,548,260.00	
RFGB 4.25% 09/15/12	1,000,000.00	1,034,330.00	
RFGB 4.375% 07/04/19	1,600,000.00	1,842,368.00	
RFGB 5.375% 07/04/13	1,500,000.00	1,622,370.00	
SPGB 2.3% 04/30/13	800,000.00	788,400.00	
SPGB 2.5% 10/31/13	1,400,000.00	1,377,180.00	
SPGB 3.15% 01/31/16	4,900,000.00	4,761,967.00	
SPGB 3.25% 04/30/16	1,000,000.00	965,130.00	
SPGB 3.4% 04/30/14	1,250,000.00	1,243,462.50	
SPGB 3.8% 01/31/17	3,050,000.00	2,976,495.00	
SPGB 3.9% 10/31/12	3,500,000.00	3,520,300.00	
SPGB 4% 04/30/20	3,600,000.00	3,408,948.00	
SPGB 4.1% 07/30/18	3,650,000.00	3,558,494.50	
SPGB 4.2% 01/31/37	3,100,000.00	2,425,130.00	
SPGB 4.2% 07/30/13	4,500,000.00	4,572,225.00	
SPGB 4.25% 01/31/14	2,300,000.00	2,342,435.00	
SPGB 4.3% 10/31/19	1,300,000.00	1,263,275.00	
SPGB 4.4% 01/31/15	9,900,000.00	10,146,807.00	
SPGB 4.6% 07/30/19	4,200,000.00	4,175,346.00	
SPGB 4.65% 07/30/25	1,100,000.00	1,003,310.00	
SPGB 4.7% 07/30/41	2,000,000.00	1,664,260.00	
SPGB 4.75% 07/30/14	4,900,000.00	5,056,800.00	
SPGB 4.8% 01/31/24	3,900,000.00	3,693,495.00	
SPGB 4.85% 10/31/20	3,200,000.00	3,186,304.00	
SPGB 4.9% 07/30/40	2,800,000.00	2,409,484.00	
SPGB 5.5% 04/30/21	3,400,000.00	3,504,652.00	
SPGB 5.5% 07/30/17	2,800,000.00	2,959,516.00	
SPGB 5.75% 07/30/32	3,050,000.00	3,001,596.50	
SPGB 5.9% 07/30/26	1,000,000.00	1,013,080.00	
SPGB 6.0% 01/31/29	4,900,000.00	4,966,885.00	
SPGB 6.15% 01/31/13	4,300,000.00	4,452,134.00	

	小計		795,660,000.00	836,414,889.00 (87,079,154,093)	
国債証券計				(204,059,393,919)	
特殊債券	オーストラリアドル	NSWTC 5.5% 03/01/17	2,800,000.00	2,953,048.00	
		NSWTC 5.5% 08/01/14	3,300,000.00	3,427,338.00	
		QTC 6% 06/14/21	1,200,000.00	1,307,064.00	
		QTC 6% 08/14/13	2,800,000.00	2,901,836.00	
		QTC 6% 09/14/17	5,350,000.00	5,763,355.00	
	小計		15,450,000.00	16,352,641.00 (1,229,228,023)	
特殊債券計				(1,229,228,023)	
合計				(205,288,621,942)	

(注1)各種通貨ごとの小計の欄における()内の金額は、邦貨換算額であります。

(注2)合計欄における()内の金額は、各通貨の邦貨換算額合計の数字であります。

(注3)外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券時価比率	合計金額に対する比率
アメリカドル	国債証券 130銘柄	100.0%	40.4%
カナダドル	国債証券 27銘柄	100.0%	2.9%
オーストラリアドル	国債証券 10銘柄	53.0%	1.3%
	特殊債券 5銘柄	47.0%	
イギリスポンド	国債証券 32銘柄	100.0%	8.2%
スイスフラン	国債証券 3銘柄	100.0%	0.5%
シンガポールドル	国債証券 14銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングット	国債証券 14銘柄	100.0%	0.5%
スウェーデンクローナ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.7%
ノルウェークローネ	国債証券 5銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.9%
メキシコペソ	国債証券 5銘柄	100.0%	0.8%
ポーランドズロチ	国債証券 10銘柄	100.0%	0.7%
ユーロ	国債証券 217銘柄	100.0%	42.4%

2)信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

3)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)

「すみしん DCマイセレクション50」は、「住信 国内株式インデックス マザーファンド」、「住信 国内債券インデックス マザーファンド」、「住信 外国株式インデックス マザーファンド」、「住信 外国債券インデックス マザーファンド」を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、これらマザーファンドの受益証券です。

これらマザーファンドの状況は次の通りです。

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。

「住信 国内株式インデックス マザーファンド」の状況

(1)貸借対照表

(単位：円)

	(平成22年 9月30日現在)	(平成23年 9月30日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,412,947,709	3,183,434,121
株式	124,571,617,290	115,071,351,200
派生商品評価勘定	41,496,480	63,452,960
未収入金	35,067,360	44,525,000
未収配当金	1,055,211,493	1,140,002,596
未収利息	6,303	3,958
差入委託証拠金	131,355,000	106,080,000
流動資産合計	128,247,701,635	119,608,849,835
資産合計	128,247,701,635	119,608,849,835
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	21,072,720	1,479,200
前受金	120,089,000	120,941,000
未払金	42,281,941	
未払解約金	53,135,194	51,160,726
流動負債合計	236,578,855	173,580,926
負債合計	236,578,855	173,580,926
純資産の部		
元本等		
元本	201,400,845,672	200,026,741,191
剰余金		
剰余金又は欠損金()	73,389,722,892	80,591,472,282
元本等合計	128,011,122,780	119,435,268,909
純資産合計	128,011,122,780	119,435,268,909
負債純資産合計	128,247,701,635	119,608,849,835

(注)「住信 国内株式インデックス マザーファンド」の計算期間は、原則として毎年5月30日から翌年5月29日までであり、「すみしん DCマイセレクション50」の計算期間とは異なっております。上記の表は、平成22年9月30日及び平成23年9月30日現在の同マザーファンドの貸借対照表です。

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	(自 平成21年10月 1日 至 平成22年 9月30日)	(自 平成22年10月 1日 至 平成23年 9月30日)
1. 資産の評価基準及び評価方法	(1) 株式 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、金融商品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)、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) 先物取引 個別法に基づき、時価評価しております。	(1) 株式 同左 (2) 先物取引 同左
2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、株式の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。	受取配当金 同左

(貸借対照表に関する注記)

	(平成22年 9月30日現在)	(平成23年 9月30日現在)
1. 期首元本額	191,683,384,340円	201,400,845,672円
期中追加設定元本額	36,452,789,185円	43,047,682,019円
期中一部解約元本額	26,735,327,853円	44,421,786,500円
期末元本額	201,400,845,672円	200,026,741,191円
元本額の内訳		
住信 グローバル・インカム&プラス (毎月決算型)	7,185,082,746円	4,814,439,076円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	700,981,494円	973,371,440円
SBI資産設計オープン(分配型)	41,140,168円	37,537,812円
STAM TOPIXインデックス・オープン	4,371,405,750円	5,661,352,917円
世界経済インデックスファンド	56,721,278円	122,340,313円
住信 国内バランス30	640,092,692円	
住信 国内バランス60	506,420,847円	
すみしん マイセレクション25	157,304,680円	138,432,075円
すみしん マイセレクション50	369,474,260円	338,893,017円
すみしん マイセレクション75	292,422,992円	274,866,604円
すみしん 日本株式インデックス・オープン	18,868,118,143円	17,812,299,305円

すみしん DCマイセレクション25	3,954,050,003円	5,170,311,528円
すみしん DCマイセレクション50	13,946,536,058円	16,650,446,738円
すみしん DCマイセレクション75	12,343,313,134円	14,270,065,150円
すみしん DC日本株式インデックス・オープン	2,775,004,815円	3,205,862,072円
すみしん DCマイセレクションS25	329,262,863円	1,347,924,639円
すみしん DCマイセレクションS50	1,548,946,134円	3,931,885,882円
すみしん DCマイセレクションS75	1,168,203,214円	2,325,812,851円
すみしん DC日本株式インデックス・オープンS	487,667,580円	913,213,112円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2015	22,720,104円	31,074,990円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2025	89,142,069円	316,164,364円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2035	75,916,744円	264,181,358円
すみしん DCターゲット・イヤー ファンド2045	31,779,386円	91,218,989円
STAM 日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	3,963,633,533円	6,969,122,351円
住信 国内バランス60VA1 (適格機関投資家専用)	469,417,569円	420,946,303円
すみしん マイセレクション50VA1 (適格機関投資家専用)	981,615,573円	944,760,825円
すみしん マイセレクション75VA1 (適格機関投資家専用)	437,410,701円	411,899,365円
すみしん 日本株式インデックス・オープンVA1 (適格機関投資家専用)	3,774,038,589円	3,434,466,352円
住信 国内バランス30VA2 (適格機関投資家専用)	20,372,794円	19,408,078円
住信 国内バランス60VA2 (適格機関投資家専用)	83,413,467円	81,488,304円
すみしん マイセレクション50VA2 (適格機関投資家専用)	5,484,542円	4,453,817円
すみしん バランス30VA1 (適格機関投資家専用)	2,093,706,657円	2,031,420,075円
すみしん バランス50VA1 (適格機関投資家専用)	7,753,642,440円	7,500,491,013円
すみしん バランス25VA2(適格機関投資家専用)	20,829,077,674円	20,396,578,919円
すみしん バランス50VA2(適格機関投資家専用)	6,063,164,847円	6,013,289,494円
すみしん バランスA(25)VA1 (適格機関投資家専用)	12,621,242,968円	13,125,150,115円
すみしん バランスB(37.5)VA1 (適格機関投資家専用)	2,622,847,679円	2,562,925,279円
すみしん バランスC(50)VA1 (適格機関投資家専用)	14,184,726,621円	13,680,942,273円
すみしん 世界バランスVA1 (適格機関投資家専用)	6,069,317,753円	6,183,362,886円
すみしん 世界バランスVA2 (適格機関投資家専用)	4,731,796,249円	4,785,985,898円
すみしん バランスD(35)VA1 (適格機関投資家専用)	3,442,811,953円	3,258,946,468円

すみしん グローバルバランスファンドVA35 (適格機関投資家専用)	5,897,632,153円	5,924,578,075円
すみしん バランスE(25)VA1 (適格機関投資家専用)	2,128,986,313円	1,992,083,852円
すみしん バランスF(25)VA1 (適格機関投資家専用)	1,538,806,913円	2,388,457,135円
すみしん 国内バランス25VA1 (適格機関投資家専用)	212,375,516円	209,276,940円
住信 FOFs用日本株式インデックス・オープン (適格機関投資家専用)	27,549,180,512円	14,699,421,206円
住信 グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,089,412,501円	3,422,820,918円
住信 日本株式ファンド・シリーズ2	875,023,001円	872,771,018円
2. 元本の欠損	純資産額は、元本を 73,389,722,892円下回っており ます。	純資産額は、元本を 80,591,472,282円下回っており ます。
3. 計算期間末日における受益権の総数	201,400,845,672口	200,026,741,191口

(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21年10月 1日 至 平成22年 9月30日)	(自 平成22年10月 1日 至 平成23年 9月30日)
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」第2条第4項に定める証券投資信託であり、金融商品に対する取組方針は投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従っております。	同左
2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク	当ファンドは、わが国の株式を中心に投資を行い、東証株価指数(TOPIX)と連動する投資成果を目標として運用を行います。 なお、当ファンドには、以下のリスクがあります。 ・ 価格変動リスク	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	運用各部から独立した部署によって、ファンドの運用状況や運用ガイドライン、法令等の遵守状況についてモニタリングを行っております(運用を再委託しているファンドも含まれます。) モニタリング結果は、原則月1回(必要に応じ随時)開催される運用リスクの管理に関する委員会に報告され、委員会は適切な運用リスク管理に必要な措置を講じることとしております。	同左

4. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価額がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左
----------------------------	---	----

金融商品の時価に関する事項

項目	（平成22年 9月30日現在）	（平成23年 9月30日現在）
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	金融商品はすべて時価で計上されているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法	<p>a. 株式 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>b. 先物取引 原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。</p> <p>c. コールローン等の金銭債権及び金銭債務 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>a. 株式 同左</p> <p>b. 先物取引 同左</p> <p>c. コールローン等の金銭債権及び金銭債務 同左</p>

(追加情報)

（自 平成21年10月 1日 至 平成22年 9月30日）	（自 平成22年10月 1日 至 平成23年 9月30日）
当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 平成20年3月10日）及び「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 平成20年3月10日）を適用しております。	

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	(平成22年 9月30日現在)	(平成23年 9月30日現在)
	当計算期間の損益に含まれた 評価差額(円)	当計算期間の損益に含まれた 評価差額(円)
株 式	7,333,766,752	9,214,414,884
合 計	7,333,766,752	9,214,414,884

(注) 当計算期間の損益に含まれた評価差額は、当親投資信託の計算期間開始日から本報告書における開示対象ファンドの計算期間末日までの期間に対応する金額であります。

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

株式関連

区分	種 類	(平成22年 9月30日現在)			
		契 約 額 等(円)		時 価 (円)	評 価 損 益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	TOPIX先物	3,335,157,000		3,355,590,000	20,433,000
合 計		3,335,157,000		3,355,590,000	20,433,000

(注) 時価の算定方法

前述の(金融商品の時価に関する事項)に記載していますのでここでは省略しております。

株式関連

区分	種 類	(平成23年 9月30日現在)			
		契 約 額 等(円)		時 価 (円)	評 価 損 益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	TOPIX先物	3,505,842,000		3,567,825,000	61,983,000
合 計		3,505,842,000		3,567,825,000	61,983,000

(注) 時価の算定方法

前述の(金融商品の時価に関する事項)に記載していますのでここでは省略しております。

(関連当事者との取引に関する注記)

(自 平成21年10月 1日 至 平成22年 9月30日)	(自 平成22年10月 1日 至 平成23年 9月30日)
本報告書における開示対象ファンドの計算期間中に利害関係人との間で、一般の取引条件と同様のもの以外の取引は行っておりません。 また、当ファンドの関連当事者である受託会社及び投資信託委託業者と財務諸表上で開示している報酬等の給付以外の取引は行っておりません。	同左

(1口当たり情報)

(平成22年 9月30日現在)	(平成23年 9月30日現在)
1口当たり純資産額 = 0.6356円	1口当たり純資産額 = 0.5971円

(3) 附属明細表（平成23年9月30日現在）

1) 有価証券明細表

株式

銘柄	株式数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	49,000	184.00	9,016,000	
日本水産	144,700	294.00	42,541,800	
マルハニチロホールディングス	248,000	153.00	37,944,000	
ハウスイ	9,000	88.00	792,000	
サカタのタネ	18,500	1,195.00	22,107,500	
ホクト	12,800	1,798.00	23,014,400	
ショーボンドホールディングス	11,300	1,872.00	21,153,600	
ミライト・ホールディングス	33,300	617.00	20,546,100	
住石ホールディングス	34,800	73.00	2,540,400	
日鉄鉱業	32,000	322.00	10,304,000	
三井松島産業	72,000	137.00	9,864,000	
国際石油開発帝石	1,272	484,000.00	615,648,000	
日本海洋掘削	3,100	2,491.00	7,722,100	
関東天然瓦斯開発	13,000	424.00	5,512,000	
石油資源開発	19,900	2,845.00	56,615,500	
ダイセキ環境ソリューション	21	186,200.00	3,910,200	
間組	48,700	113.00	5,503,100	
東急建設	44,570	236.00	10,518,520	
コムシスホールディングス	61,400	771.00	47,339,400	
ミサワホーム	14,800	518.00	7,666,400	
高松コンストラクショングループ	9,800	1,392.00	13,641,600	
東建コーポレーション	5,790	3,085.00	17,862,150	
ヤマウラ	17,000	214.00	3,638,000	
大成建設	605,000	215.00	130,075,000	
大林組	382,000	387.00	147,834,000	
清水建設	362,000	344.00	124,528,000	
長谷工コーポレーション	785,000	49.00	38,465,000	
松井建設	27,000	333.00	8,991,000	
鹿島建設	562,000	257.00	144,434,000	
鉄建建設	76,000	85.00	6,460,000	

安藤建設	42,000	103.00	4,326,000
太平工業	25,000	369.00	9,225,000
三井住友建設	69,400	52.00	3,608,800
前田建設工業	91,000	291.00	26,481,000
ナカノフドー建設	23,000	192.00	4,416,000
奥村組	122,000	304.00	37,088,000
大和小田急建設	6,000	208.00	1,248,000
東鉄工業	18,000	651.00	11,718,000
イチケン	35,000	109.00	3,815,000
戸田建設	140,000	306.00	42,840,000
熊谷組	96,000	67.00	6,432,000
青木あすなる建設	8,500	435.00	3,697,500
北野建設	45,000	170.00	7,650,000
三井ホーム	20,000	404.00	8,080,000
矢作建設工業	15,500	427.00	6,618,500
ピーエス三菱	7,900	263.00	2,077,700
大東建託	49,400	7,140.00	352,716,000
新日本建設	34,900	209.00	7,294,100
N I P P O	30,000	682.00	20,460,000
東亜道路工業	40,000	148.00	5,920,000
前田道路	36,000	855.00	30,780,000
日本道路	42,000	209.00	8,778,000
東亜建設工業	102,000	137.00	13,974,000
五洋建設	162,500	227.00	36,887,500
大林道路	25,000	198.00	4,950,000
住友林業	90,300	679.00	61,313,700
日本基礎技術	22,900	321.00	7,350,900
巴コーポレーション	17,000	284.00	4,828,000
パナホーム	43,000	530.00	22,790,000
大和ハウス工業	315,000	1,004.00	316,260,000
ライト工業	30,800	323.00	9,948,400
積水ハウス	378,000	735.00	277,830,000
北陸電気工事	13,000	230.00	2,990,000
ユアテック	25,000	394.00	9,850,000
西部電気工業	13,000	352.00	4,576,000
四電工	13,000	334.00	4,342,000
中電工	18,500	1,010.00	18,685,000
関電工	60,000	364.00	21,840,000
きんでん	84,000	671.00	56,364,000
東京エネシス	18,000	366.00	6,588,000
トーエネック	20,000	465.00	9,300,000

住友電設	12,300	424.00	5,215,200	
日本電設工業	23,000	830.00	19,090,000	
協和エクシオ	45,600	744.00	33,926,400	
新日本空調	16,600	413.00	6,855,800	
日本工営	41,000	283.00	11,603,000	
日本電話施設	23,000	265.00	6,095,000	
九電工	25,000	532.00	13,300,000	
三機工業	35,000	433.00	15,155,000	
日揮	127,000	1,924.00	244,348,000	
中外炉工業	56,000	258.00	14,448,000	
ヤマト	24,000	334.00	8,016,000	
太平電業	18,000	496.00	8,928,000	
高砂熱学工業	38,900	676.00	26,296,400	
三晃金属工業	14,000	257.00	3,598,000	
NEC ネットエスアイ	10,700	1,221.00	13,064,700	
朝日工業社	22,000	344.00	7,568,000	
アタカ大機	10,000	247.00	2,470,000	
大気社	20,100	1,746.00	35,094,600	
ダイダン	23,000	545.00	12,535,000	
日比谷総合設備	17,000	881.00	14,977,000	
東芝プラントシステム	25,000	771.00	19,275,000	
日本製粉	73,000	377.00	27,521,000	
日清製粉グループ本社	114,000	1,017.00	115,938,000	
日東富士製粉	11,000	324.00	3,564,000	
昭和産業	48,000	252.00	12,096,000	
鳥越製粉	10,900	728.00	7,935,200	
協同飼料	43,000	88.00	3,784,000	
中部飼料	11,300	496.00	5,604,800	
日本配合飼料	38,000	111.00	4,218,000	
東洋精糖	25,000	94.00	2,350,000	
日本甜菜製糖	69,000	172.00	11,868,000	
三井製糖	50,000	329.00	16,450,000	
ネクスト	5,400	410.00	2,214,000	
日本M & Aセンター	27	447,000.00	12,069,000	
ノバレーゼ	36	54,100.00	1,947,600	
アコーディア・ゴルフ	349	60,800.00	21,219,200	
パソナグループ	120	79,000.00	9,480,000	
リンクアンドモチベーション	25	52,500.00	1,312,500	
テンプホールディングス	16,000	720.00	11,520,000	
森永製菓	123,000	194.00	23,862,000	
中村屋	29,000	423.00	12,267,000	

江崎グリコ	45,000	996.00	44,820,000
名糖産業	5,600	1,025.00	5,740,000
不二家	72,000	151.00	10,872,000
山崎製パン	92,000	1,178.00	108,376,000
モロゾフ	19,000	275.00	5,225,000
カルビー	7,500	3,850.00	28,875,000
森永乳業	107,000	344.00	36,808,000
ヤクルト本社	67,300	2,417.00	162,664,100
明治ホールディングス	37,200	3,685.00	137,082,000
雪印メグミルク	24,600	1,596.00	39,261,600
プリマハム	75,000	98.00	7,350,000
日本ハム	87,000	1,013.00	88,131,000
伊藤ハム	69,000	287.00	19,803,000
丸大食品	55,000	285.00	15,675,000
米久	11,000	604.00	6,644,000
S Foods	8,000	629.00	5,032,000
学情	4,000	275.00	1,100,000
スタジオアリス	6,000	1,576.00	9,456,000
シミック	4,100	1,388.00	5,690,800
システナ	118	63,900.00	7,540,200
NECフィールディング	9,500	987.00	9,376,500
新日鉄ソリューションズ	9,300	1,774.00	16,498,200
総合警備保障	42,700	874.00	37,319,800
日本駐車場開発	1,410	3,685.00	5,195,850
コア	4,300	693.00	2,979,900
カカクコム	16,300	3,215.00	52,404,500
ルネサンス	8,200	378.00	3,099,600
エムスリー	94	386,000.00	36,284,000
ベストプライダル	38	74,300.00	2,823,400
ディー・エヌ・エー	45,800	3,270.00	149,766,000
博報堂DYホールディングス	16,220	4,535.00	73,557,700
ぐるなび	8,700	987.00	8,586,900
一休	98	36,450.00	3,572,100
ジャパンベストレスキューシステム	20	71,400.00	1,428,000
ジェイコムホールディングス	3,300	815.00	2,689,500
パシフィックゴルフグループインターナショナル ホールディングス	319	39,600.00	12,632,400
サッポロホールディングス	208,000	290.00	60,320,000
アサヒグループホールディングス	235,600	1,649.00	388,504,400
キリンホールディングス	504,000	1,017.00	512,568,000
宝ホールディングス	106,000	471.00	49,926,000

オエノンホールディングス	34,000	187.00	6,358,000
養命酒製造	9,000	763.00	6,867,000
三国コカ・コーラボトリング	13,100	704.00	9,222,400
コカ・コーラウエスト	42,500	1,486.00	63,155,000
コカ・コーラ セントラル ジャパン	14,100	1,094.00	15,425,400
ダイドードリンコ	5,200	2,997.00	15,584,400
伊藤園	38,100	1,422.00	54,178,200
キーコーヒー	11,000	1,560.00	17,160,000
ユニカフェ	2,900	348.00	1,009,200
ジャパンフーズ	1,900	773.00	1,468,700
日清オイリオグループ	54,000	372.00	20,088,000
不二製油	30,500	1,282.00	39,101,000
J - オイルミルズ	47,000	244.00	11,468,000
ローソン	38,400	4,380.00	168,192,000
インターニックス	4,600	381.00	1,752,600
サンエー	3,800	3,185.00	12,103,000
キリン堂	4,800	482.00	2,313,600
ダイユーエイト	1,500	700.00	1,050,000
カワチ薬品	7,700	1,533.00	11,804,100
エービーシー・マート	13,100	2,992.00	39,195,200
ハードオフコーポレーション	5,400	420.00	2,268,000
高千穂交易	4,600	883.00	4,061,800
アスクル	8,700	1,115.00	9,700,500
ゲオ	184	93,000.00	17,112,000
ポイント	9,350	3,930.00	36,745,500
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	7,000	100.00	700,000
伊藤忠食品	2,700	2,912.00	7,862,400
くらコーポレーション	5,800	1,022.00	5,927,600
キャンドゥ	59	81,800.00	4,826,200
エレマテック	8,700	1,346.00	11,710,200
パル	3,250	2,738.00	8,898,500
JALUX	3,200	764.00	2,444,800
エディオン	39,500	652.00	25,754,000
サーラコーポレーション	9,500	505.00	4,797,500
トーマンデバイス	1,400	1,908.00	2,671,200
バルス	52	99,700.00	5,184,400
あみやき亭	19	191,400.00	3,636,600
東京エレクトロン デバイス	22	150,000.00	3,300,000
ひらまつ	47	57,500.00	2,702,500
双日	740,200	143.00	105,848,600
ゲンキー	800	1,835.00	1,468,000

アルフレッサ ホールディングス	28,900	3,245.00	93,780,500
ハニーズ	9,750	1,121.00	10,929,750
キッコーマン	102,000	890.00	90,780,000
味の素	341,000	920.00	313,720,000
キューピー	63,900	1,125.00	71,887,500
ハウス食品	44,600	1,494.00	66,632,400
カゴメ	45,100	1,531.00	69,048,100
焼津水産化学工業	5,900	773.00	4,560,700
アリアケジャパン	10,300	1,577.00	16,243,100
ニチレイ	141,000	359.00	50,619,000
横浜冷凍	25,600	588.00	15,052,800
東洋水産	54,000	2,123.00	114,642,000
日清食品ホールディングス	45,000	3,120.00	140,400,000
永谷園	11,000	890.00	9,790,000
フジッコ	13,000	1,033.00	13,429,000
ロック・フィールド	6,100	1,306.00	7,966,600
日本たばこ産業	2,609	363,500.00	948,371,500
わらべや日洋	7,000	1,026.00	7,182,000
なとり	5,800	849.00	4,924,200
片倉工業	14,700	799.00	11,745,300
ゲンゼ	80,000	255.00	20,400,000
昭栄	20,100	614.00	12,341,400
神栄	14,000	138.00	1,932,000
山下医科器械	900	991.00	891,900
ラサ商事	4,900	337.00	1,651,300
アルペン	7,100	1,439.00	10,216,900
アルコニックス	2,400	1,640.00	3,936,000
ビックカメラ	421	42,100.00	17,724,100
D C Mホールディングス	52,100	680.00	35,428,000
M o n o t a R O	6,300	785.00	4,945,500
あい ホールディングス	19,800	324.00	6,415,200
ユニバース	2,000	1,877.00	3,754,000
J . フロント リテイリング	261,000	371.00	96,831,000
ドトール・日レスホールディングス	19,400	980.00	19,012,000
マツモトキヨシホールディングス	20,500	1,582.00	32,431,000
物語コーポレーション	1,200	1,294.00	1,552,800
ココカラファイン	10,700	2,125.00	22,737,500
三越伊勢丹ホールディングス	219,800	789.00	173,422,200
東洋紡績	497,000	114.00	56,658,000
ユニチカ	319,000	46.00	14,674,000
富士紡ホールディングス	53,000	168.00	8,904,000

日清紡ホールディングス	75,000	681.00	51,075,000
倉敷紡績	113,000	155.00	17,515,000
ダイワボウホールディングス	109,000	174.00	18,966,000
シキボウ	72,000	89.00	6,408,000
日東紡績	96,000	239.00	22,944,000
トヨタ紡織	39,200	1,120.00	43,904,000
クリエイトSDホールディングス	4,700	1,808.00	8,497,600
バイタルケーエスケー・ホールディングス	20,800	682.00	14,185,600
UKCホールディングス	6,600	821.00	5,418,600
TOKAIホールディングス	54,000	415.00	22,410,000
日本毛織	40,000	694.00	27,760,000
トーア紡コーポレーション	47,000	51.00	2,397,000
ダイドーリミテッド	14,500	870.00	12,615,000
東京建物不動産販売	4,300	234.00	1,006,200
野村不動産ホールディングス	46,900	1,181.00	55,388,900
常和ホールディングス	2,700	1,266.00	3,418,200
ヒューリック	36,800	880.00	32,384,000
帝国繊維	12,000	503.00	6,036,000
ブックオフコーポレーション	6,800	696.00	4,732,800
日本コークス工業	94,500	102.00	9,639,000
ミタチ産業	2,600	420.00	1,092,000
JFE商事ホールディングス	74,000	344.00	25,456,000
あさひ	4,600	1,869.00	8,597,400
サークルKサンクス	24,000	1,308.00	31,392,000
日本調剤	1,410	2,895.00	4,081,950
コスモス薬品	5,600	3,985.00	22,316,000
シップヘルスケアホールディングス	14,400	1,927.00	27,748,800
ソフトクリエイト	1,000	1,087.00	1,087,000
セブン&アイ・ホールディングス	462,600	2,189.00	1,012,631,400
ツルハホールディングス	9,900	4,305.00	42,619,500
サンマルクホールディングス	3,600	3,095.00	11,142,000
フェリシモ	3,200	1,102.00	3,526,400
トリドール	8,200	723.00	5,928,600
クスリのアオキ	1,700	1,148.00	1,951,600
帝人	445,000	281.00	125,045,000
東レ	908,000	547.00	496,676,000
クラレ	173,200	1,065.00	184,458,000
旭化成	683,000	469.00	320,327,000
サカイオーベックス	35,000	109.00	3,815,000
稲葉製作所	6,100	917.00	5,593,700
三協・立山ホールディングス	158,000	102.00	16,116,000

トーカロ	6,600	1,520.00	10,032,000
アルファC o	4,400	874.00	3,845,600
SUMCO	72,500	734.00	53,215,000
川田テクノロジーズ	3,600	1,248.00	4,492,800
住江織物	32,000	136.00	4,352,000
日本フェルト	6,600	389.00	2,567,400
イチカワ	9,000	153.00	1,377,000
日本バイリーン	14,000	364.00	5,096,000
芦森工業	44,000	107.00	4,708,000
アツギ	93,000	93.00	8,649,000
ダイニック	22,000	134.00	2,948,000
共和レザー	6,800	292.00	1,985,600
セーレン	29,500	546.00	16,107,000
東海染工	16,000	84.00	1,344,000
小松精練	21,000	378.00	7,938,000
ワコールホールディングス	70,000	993.00	69,510,000
ホギメディカル	6,300	3,585.00	22,585,500
レナウン	22,500	167.00	3,757,500
クラウドディア	2,800	1,219.00	3,413,200
T S Iホールディングス	52,100	448.00	23,340,800
デジタルハーツ	11	133,600.00	1,469,600
I Tホールディングス	37,500	752.00	28,200,000
グリー	48,000	2,379.00	114,192,000
コーエーテックモホールディングス	21,900	744.00	16,293,600
三菱総合研究所	4,400	1,386.00	6,098,400
ボルテージ	1,500	1,166.00	1,749,000
特種東海製紙	74,000	155.00	11,470,000
ドワンゴ	57	141,300.00	8,054,100
ベリサーブ	8	133,100.00	1,064,800
マクロミル	14,100	919.00	12,957,900
ティーガイア	89	169,300.00	15,067,700
GMOペイメントゲートウェイ	25	364,000.00	9,100,000
ザッパラス	61	79,500.00	4,849,500
インターネットイニシアティブ	66	364,000.00	24,024,000
ソネットエンタテインメント	64	326,000.00	20,864,000
S R Aホールディングス	5,900	789.00	4,655,100
J B I Sホールディングス	13,000	272.00	3,536,000
朝日ネット	9,000	360.00	3,240,000
王子製紙	518,000	427.00	221,186,000
三菱製紙	167,000	76.00	12,692,000
北越紀州製紙	73,000	559.00	40,807,000

中越パルプ工業	45,000	124.00	5,580,000	
巴川製紙所	20,000	179.00	3,580,000	
大王製紙	49,000	724.00	35,476,000	
日本製紙グループ本社	56,600	2,068.00	117,048,800	
レンゴー	94,000	594.00	55,836,000	
トーモク	37,000	230.00	8,510,000	
ザ・パック	6,900	1,270.00	8,763,000	
コープケミカル	17,000	97.00	1,649,000	
昭和電工	729,000	154.00	112,266,000	
住友化学	806,000	301.00	242,606,000	
日本化成	22,000	158.00	3,476,000	
住友精化	24,000	365.00	8,760,000	
日産化学工業	83,300	731.00	60,892,300	
ラサ工業	44,000	129.00	5,676,000	
クレハ	76,000	336.00	25,536,000	
テイカ	20,000	332.00	6,640,000	
石原産業	197,000	95.00	18,715,000	
片倉チッカリン	8,000	198.00	1,584,000	
日本曹達	70,000	354.00	24,780,000	
東ソー	293,000	245.00	71,785,000	
トクヤマ	183,000	271.00	49,593,000	
セントラル硝子	112,000	380.00	42,560,000	
東亜合成	147,000	382.00	56,154,000	
ダイソー	47,000	264.00	12,408,000	
関東電化工業	26,000	380.00	9,880,000	
電気化学工業	246,000	298.00	73,308,000	
イビデン	68,300	1,658.00	113,241,400	
信越化学工業	195,400	3,830.00	748,382,000	
日本カーバイド工業	28,000	112.00	3,136,000	
堺化学工業	37,000	349.00	12,913,000	
エア・ウォーター	96,000	962.00	92,352,000	
大陽日酸	154,000	542.00	83,468,000	
日本化学工業	44,000	146.00	6,424,000	
日本パーカライズン	28,000	1,099.00	30,772,000	
高压ガス工業	17,000	505.00	8,585,000	
チタン工業	14,000	395.00	5,530,000	
四国化成工業	17,000	460.00	7,820,000	
戸田工業	17,000	621.00	10,557,000	
ステラ ケミファ	5,100	2,162.00	11,026,200	
保土谷化学工業	26,000	284.00	7,384,000	
日本触媒	96,000	970.00	93,120,000	

大日精化工業	42,000	399.00	16,758,000
カネカ	146,000	440.00	64,240,000
協和発酵キリン	160,000	868.00	138,880,000
三菱瓦斯化学	185,000	481.00	88,985,000
三井化学	533,000	261.00	139,113,000
J S R	97,900	1,346.00	131,773,400
東京応化工業	21,100	1,578.00	33,295,800
三菱ケミカルホールディングス	681,500	529.00	360,513,500
日本合成化学工業	27,000	408.00	11,016,000
ダイセル化学工業	152,000	445.00	67,640,000
住友ベークライト	110,000	416.00	45,760,000
積水化学工業	244,000	655.00	159,820,000
日本ゼオン	110,000	717.00	78,870,000
アイカ工業	34,000	1,117.00	37,978,000
宇部興産	492,000	260.00	127,920,000
積水樹脂	16,000	815.00	13,040,000
タキロン	27,000	285.00	7,695,000
旭有機材工業	41,000	216.00	8,856,000
日立化成工業	50,800	1,287.00	65,379,600
ニチバン	12,000	277.00	3,324,000
リケンテクノス	21,000	267.00	5,607,000
大倉工業	28,000	296.00	8,288,000
積水化成品工業	27,000	340.00	9,180,000
群栄化学工業	31,000	228.00	7,068,000
タイガースポリマー	5,800	351.00	2,035,800
日本カーリット	9,300	423.00	3,933,900
日本化薬	83,000	806.00	66,898,000
イーピーエス	63	177,500.00	11,182,500
パナソニック電工インフォメーションシステムズ	2,200	2,168.00	4,769,600
フェイス	473	7,690.00	3,637,370
アミューズ	3,200	1,049.00	3,356,800
野村総合研究所	62,700	1,775.00	111,292,500
ドリームインキュベータ	46	64,900.00	2,985,400
サイバネットシステム	92	20,750.00	1,909,000
T A C	12,100	198.00	2,395,800
電通	106,500	2,474.00	263,481,000
インテージ	3,300	1,578.00	5,207,400
テイクアンドギヴ・ニーズ	860	5,070.00	4,360,200
シンプレクス・ホールディングス	204	26,140.00	5,332,560
イオンファンタジー	4,400	1,193.00	5,249,200
メディカルシステムネットワーク	1,900	806.00	1,531,400

日本精化	9,700	524.00	5,082,800
A D E K A	46,900	835.00	39,161,500
日油	100,000	407.00	40,700,000
ミヨシ油脂	42,000	112.00	4,704,000
ハリマ化成	10,000	716.00	7,160,000
花王	311,200	2,164.00	673,436,800
第一工業製薬	21,000	246.00	5,166,000
三洋化成工業	33,000	602.00	19,866,000
武田薬品工業	439,600	3,680.00	1,617,728,000
アステラス製薬	260,500	2,941.00	766,130,500
大日本住友製薬	83,100	857.00	71,216,700
塩野義製薬	171,000	1,153.00	197,163,000
田辺三菱製薬	97,700	1,441.00	140,785,700
わかもと製薬	12,000	260.00	3,120,000
あすか製薬	14,000	650.00	9,100,000
日本新薬	27,000	999.00	26,973,000
中外製薬	136,300	1,319.00	179,779,700
科研製薬	50,000	1,081.00	54,050,000
エーザイ	144,500	3,125.00	451,562,500
ロート製薬	53,000	1,010.00	53,530,000
小野薬品工業	57,400	4,625.00	265,475,000
久光製薬	33,100	3,720.00	123,132,000
有機合成薬品工業	8,000	173.00	1,384,000
持田製薬	46,000	888.00	40,848,000
大正製薬	94,000	1,882.00	176,908,000
参天製薬	36,400	3,240.00	117,936,000
扶桑薬品工業	39,000	230.00	8,970,000
日本ケミファ	18,000	318.00	5,724,000
ツムラ	32,000	2,472.00	79,104,000
日医工	19,800	2,070.00	40,986,000
テルモ	88,100	4,065.00	358,126,500
みらかホールディングス	28,500	3,420.00	97,470,000
キッセイ薬品工業	23,800	1,695.00	40,341,000
生化学工業	22,400	908.00	20,339,200
栄研化学	9,100	1,039.00	9,454,900
日水製薬	4,700	696.00	3,271,200
鳥居薬品	8,000	1,598.00	12,784,000
東和薬品	6,000	3,560.00	21,360,000
沢井製薬	7,700	8,360.00	64,372,000
ゼリア新薬工業	17,000	1,320.00	22,440,000
第一三共	394,700	1,620.00	639,414,000

キョーリン製薬ホールディングス	31,000	1,618.00	50,158,000
大幸薬品	5,400	839.00	4,530,600
ダイト	3,300	1,393.00	4,596,900
大塚ホールディングス	271,700	2,125.00	577,362,500
大日本塗料	67,000	84.00	5,628,000
日本ペイント	102,000	627.00	63,954,000
関西ペイント	133,000	746.00	99,218,000
中国塗料	31,000	566.00	17,546,000
日本特殊塗料	9,100	329.00	2,993,900
藤倉化成	14,800	389.00	5,757,200
太陽ホールディングス	8,600	2,159.00	18,567,400
D I C	448,000	142.00	63,616,000
サカタインクス	24,000	366.00	8,784,000
東洋インキS Cホールディングス	105,000	308.00	32,340,000
アルプス技研	5,200	656.00	3,411,200
ダイオーズ	2,100	490.00	1,029,000
日本空調サービス	2,900	727.00	2,108,300
オリエンタルランド	31,700	8,270.00	262,159,000
ダスキン	32,800	1,584.00	51,955,200
パーク24	57,100	961.00	54,873,100
明光ネットワークジャパン	11,300	749.00	8,463,700
ファルコS Dホールディングス	6,900	941.00	6,492,900
クレスコ	3,800	543.00	2,063,400
フジ・メディア・ホールディングス	1,154	111,800.00	129,017,200
秀英予備校	4,500	309.00	1,390,500
田谷	1,900	658.00	1,250,200
ラウンドワン	32,200	565.00	18,193,000
リゾートトラスト	19,000	1,324.00	25,156,000
オービック	3,810	15,070.00	57,416,700
ティーディーシーソフトウェアエンジニアリング	2,400	745.00	1,788,000
ヤフー	8,098	24,250.00	196,376,500
ビー・エム・エル	6,900	2,000.00	13,800,000
ワタベウェディング	4,200	626.00	2,629,200
トレンドマイクロ	48,800	2,440.00	119,072,000
もしもしホットライン	15,000	759.00	11,385,000
東急コミュニティー	3,100	2,590.00	8,029,000
リソー教育	1,250	4,865.00	6,081,250
日本オラクル	17,800	2,737.00	48,718,600
アルファシステムズ	3,100	1,236.00	3,831,600
フューチャーアーキテクト	135	33,550.00	4,529,250
ウェアハウス	4,300	225.00	967,500

シーエーシー	7,600	637.00	4,841,200
ソフトバンク・テクノロジー	2,700	631.00	1,703,700
トーセ	3,000	502.00	1,506,000
ユー・エス・エス	15,260	6,600.00	100,716,000
オービックビジネスコンサルタント	2,800	4,470.00	12,516,000
日立ビジネスソリューション	3,600	659.00	2,372,400
伊藤忠テクノソリューションズ	15,700	3,500.00	54,950,000
アイティフォー	13,500	269.00	3,631,500
東京個別指導学院	8,300	127.00	1,054,100
東計電算	2,000	1,109.00	2,218,000
エクスネット	10	121,900.00	1,219,000
テー・オー・ダブリュー	3,600	450.00	1,620,000
大塚商会	8,800	5,360.00	47,168,000
総合メディカル	2,400	2,850.00	6,840,000
サイボウズ	183	16,920.00	3,096,360
ソフトブレーン	226	7,500.00	1,695,000
アグレックス	2,600	760.00	1,976,000
セントラルスポーツ	4,400	980.00	4,312,000
電通国際情報サービス	6,900	638.00	4,402,200
ウェザーニューズ	3,500	2,500.00	8,750,000
C I J	11,100	260.00	2,886,000
WOWOW	34	168,100.00	5,715,400
富士フイルムホールディングス	250,700	1,815.00	455,020,500
コニカミノルタホールディングス	296,000	535.00	158,360,000
資生堂	194,800	1,507.00	293,563,600
ライオン	135,000	467.00	63,045,000
高砂香料工業	39,000	379.00	14,781,000
マンダム	11,800	2,311.00	27,269,800
ミルボン	6,200	2,420.00	15,004,000
ファンケル	22,700	1,114.00	25,287,800
コーセー	21,100	1,972.00	41,609,200
ドクターシーラボ	71	501,000.00	35,571,000
ポーラ・オルビスホールディングス	12,000	2,281.00	27,372,000
エステー	5,600	1,044.00	5,846,400
コニシ	9,200	1,185.00	10,902,000
長谷川香料	14,900	1,307.00	19,474,300
小林製薬	16,300	4,170.00	67,971,000
荒川化学工業	9,100	728.00	6,624,800
メック	7,700	288.00	2,217,600
日本高純度化学	33	209,300.00	6,906,900
荏原ユーザライト	1,600	1,930.00	3,088,000

アース製薬	8,400	2,880.00	24,192,000
イハラケミカル工業	20,000	297.00	5,940,000
北興化学工業	12,000	236.00	2,832,000
大成ラミック	3,300	2,434.00	8,032,200
クミアイ化学工業	27,000	276.00	7,452,000
日本農薬	27,000	370.00	9,990,000
昭和シェル石油	104,900	557.00	58,429,300
コスモ石油	324,000	194.00	62,856,000
富士興産	43,000	65.00	2,795,000
ニチレキ	14,000	408.00	5,712,000
東燃ゼネラル石油	177,000	893.00	158,061,000
ユシロ化学工業	5,800	997.00	5,782,600
ビービー・カストロール	4,800	335.00	1,608,000
AOCホールディングス	29,900	442.00	13,215,800
MORESCO	2,000	805.00	1,610,000
出光興産	13,900	7,020.00	97,578,000
JXホールディングス	1,302,400	440.00	573,056,000
横浜ゴム	131,000	454.00	59,474,000
東洋ゴム工業	97,000	195.00	18,915,000
ブリヂストン	367,800	1,772.00	651,741,600
住友ゴム工業	91,500	998.00	91,317,000
藤倉ゴム工業	7,300	304.00	2,219,200
オカモト	43,000	328.00	14,104,000
アキレス	95,000	117.00	11,115,000
フコク	4,900	739.00	3,621,100
ニッタ	10,500	1,659.00	17,419,500
クリエートメディック	3,400	814.00	2,767,600
東海ゴム工業	18,100	1,081.00	19,566,100
三ツ星ベルト	28,000	439.00	12,292,000
バンドー化学	42,000	295.00	12,390,000
鬼怒川ゴム工業	28,000	653.00	18,284,000
旭硝子	578,000	762.00	440,436,000
日本板硝子	504,000	175.00	88,200,000
石塚硝子	15,000	164.00	2,460,000
有沢製作所	18,300	375.00	6,862,500
日本山村硝子	51,000	211.00	10,761,000
日本電気硝子	242,000	712.00	172,304,000
オハラ	4,500	710.00	3,195,000
住友大阪セメント	223,000	263.00	58,649,000
太平洋セメント	632,000	143.00	90,376,000
デイ・シー	16,400	227.00	3,722,800

リゾートソリューション	17,000	145.00	2,465,000	
日本ヒューム	9,000	302.00	2,718,000	
日本コンクリート工業	20,000	174.00	3,480,000	
東海カーボン	102,000	389.00	39,678,000	
日本カーボン	54,000	246.00	13,284,000	
東洋炭素	6,500	3,250.00	21,125,000	
ノリタケカンパニーリミテド	61,000	277.00	16,897,000	
TOTO	168,000	692.00	116,256,000	
日本碍子	141,000	1,181.00	166,521,000	
日本特殊陶業	101,000	1,057.00	106,757,000	
MARUWA	3,000	3,310.00	9,930,000	
品川リフラクトリーズ	30,000	215.00	6,450,000	
黒崎播磨	27,000	276.00	7,452,000	
東京窯業	14,000	173.00	2,422,000	
ニッカトー	4,200	497.00	2,087,400	
フジミインコーポレーテッド	10,700	922.00	9,865,400	
ニチアス	57,000	454.00	25,878,000	
新日本製鐵	3,079,000	224.00	689,696,000	
住友金属工業	2,174,000	162.00	352,188,000	
神戸製鋼所	1,626,000	131.00	213,006,000	
日新製鋼	450,000	140.00	63,000,000	
中山製鋼所	63,000	88.00	5,544,000	
合同製鐵	67,000	178.00	11,926,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	277,900	1,577.00	438,248,300	
東京製鐵	64,800	742.00	48,081,600	
共英製鋼	12,500	1,309.00	16,362,500	
大和工業	26,800	2,041.00	54,698,800	
東京鐵鋼	26,000	221.00	5,746,000	
大阪製鐵	7,400	1,406.00	10,404,400	
淀川製鋼所	90,000	359.00	32,310,000	
東洋鋼鈑	28,000	333.00	9,324,000	
住友鋼管	8,000	468.00	3,744,000	
丸一鋼管	39,300	1,837.00	72,194,100	
モリ工業	19,000	325.00	6,175,000	
大同特殊鋼	197,000	466.00	91,802,000	
日本高周波鋼業	48,000	91.00	4,368,000	
日本金属工業	90,000	75.00	6,750,000	
日本冶金工業	62,000	132.00	8,184,000	
山陽特殊製鋼	58,000	438.00	25,404,000	
愛知製鋼	62,000	464.00	28,768,000	
日立金属	77,000	900.00	69,300,000	

日本金属	30,000	143.00	4,290,000
大平洋金属	82,000	450.00	36,900,000
日本電工	42,000	413.00	17,346,000
栗本鐵工所	61,000	122.00	7,442,000
日本鑄鉄管	14,000	155.00	2,170,000
日本製鋼所	181,000	468.00	84,708,000
三菱製鋼	71,000	224.00	15,904,000
日亜鋼業	16,000	203.00	3,248,000
日本精線	9,000	369.00	3,321,000
日本軽金属	266,000	129.00	34,314,000
大紀アルミニウム工業所	18,000	254.00	4,572,000
三井金属鉱業	339,000	202.00	68,478,000
東邦亜鉛	66,000	292.00	19,272,000
三菱マテリアル	732,000	191.00	139,812,000
住友金属鉱山	324,000	1,037.00	335,988,000
DOWAホールディングス	140,000	435.00	60,900,000
古河機械金属	197,000	76.00	14,972,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	12,900	3,260.00	42,054,000
東邦チタニウム	19,200	1,304.00	25,036,800
住友軽金属工業	254,000	69.00	17,526,000
古河スカイ	49,000	222.00	10,878,000
古河電気工業	369,000	213.00	78,597,000
住友電気工業	414,400	917.00	380,004,800
フジクラ	176,000	257.00	45,232,000
昭和電線ホールディングス	140,000	77.00	10,780,000
タツタ電線	22,000	397.00	8,734,000
日立電線	91,000	203.00	18,473,000
沖電線	12,000	152.00	1,824,000
カナレ電気	1,500	1,248.00	1,872,000
平河ヒューテック	2,600	807.00	2,098,200
リョービ	66,000	355.00	23,430,000
アサヒホールディングス	16,400	1,647.00	27,010,800
東洋製罐	82,900	1,189.00	98,568,100
ホッカンホールディングス	32,000	259.00	8,288,000
コロナ	5,400	1,454.00	7,851,600
横河ブリッジホールディングス	21,000	463.00	9,723,000
駒井ハルテック	28,000	195.00	5,460,000
高田機工	14,000	176.00	2,464,000
三和ホールディングス	117,000	256.00	29,952,000
文化シャッター	33,000	240.00	7,920,000
住生活グループ	143,100	2,183.00	312,387,300

日本ファイルコン	10,800	434.00	4,687,200	
ノーリツ	23,000	1,780.00	40,940,000	
長府製作所	11,300	2,228.00	25,176,400	
リンナイ	18,900	6,510.00	123,039,000	
ユニプレス	16,200	2,109.00	34,165,800	
ダイニチ工業	6,100	1,028.00	6,270,800	
日東精工	17,000	205.00	3,485,000	
三洋工業	15,000	145.00	2,175,000	
岡部	23,100	398.00	9,193,800	
日立ツール	6,800	825.00	5,610,000	
東プレ	22,700	772.00	17,524,400	
高周波熱錬	15,600	662.00	10,327,200	
東京製綱	83,000	169.00	14,027,000	
パイオラックス	5,000	1,816.00	9,080,000	
日本発條	85,000	693.00	58,905,000	
中央発條	15,000	288.00	4,320,000	
三浦工業	18,900	2,284.00	43,167,600	
タクマ	43,000	323.00	13,889,000	
ツガミ	33,000	308.00	10,164,000	
オークマ	76,000	477.00	36,252,000	
東芝機械	70,000	327.00	22,890,000	
アマダ	166,000	513.00	85,158,000	
アイダエンジニアリング	31,200	378.00	11,793,600	
牧野フライス製作所	55,000	461.00	25,355,000	
オーエスジー	51,700	942.00	48,701,400	
ダイジェット工業	20,000	158.00	3,160,000	
旭ダイヤモンド工業	24,800	1,093.00	27,106,400	
森精機製作所	61,900	702.00	43,453,800	
ディスコ	11,900	3,720.00	44,268,000	
日東工器	6,900	1,900.00	13,110,000	
豊田自動織機	102,000	2,280.00	232,560,000	
豊和工業	72,000	60.00	4,320,000	
東洋機械金属	13,100	194.00	2,541,400	
津田駒工業	28,000	148.00	4,144,000	
島精機製作所	15,300	1,436.00	21,970,800	
日阪製作所	15,000	874.00	13,110,000	
やまびこ	4,600	970.00	4,462,000	
ペガサスミシン製造	15,600	217.00	3,385,200	
ナブテスコ	44,300	1,486.00	65,829,800	
三井海洋開発	9,700	1,384.00	13,424,800	
レオン自動機	12,000	183.00	2,196,000	

S M C	35,000	11,430.00	400,050,000
新川	9,900	435.00	4,306,500
ホソカワミクロン	21,000	350.00	7,350,000
ユニオンツール	6,500	1,357.00	8,820,500
オイレス工業	11,800	1,532.00	18,077,600
サトー	11,200	1,017.00	11,390,400
日本エアーテック	4,200	335.00	1,407,000
日精樹脂工業	11,600	248.00	2,876,800
ワイエイシイ	6,400	641.00	4,102,400
小松製作所	556,000	1,699.00	944,644,000
住友重機械工業	299,000	403.00	120,497,000
日立建機	52,400	1,312.00	68,748,800
日工	17,000	299.00	5,083,000
巴工業	4,700	1,461.00	6,866,700
井関農機	122,000	191.00	23,302,000
T O W A	14,000	339.00	4,746,000
丸山製作所	26,000	169.00	4,394,000
北川鉄工所	58,000	117.00	6,786,000
シンニッタン	12,000	326.00	3,912,000
クボタ	492,000	629.00	309,468,000
荏原実業	2,800	1,242.00	3,477,600
東洋エンジニアリング	87,000	260.00	22,620,000
三菱化工機	36,000	159.00	5,724,000
月島機械	19,000	673.00	12,787,000
帝国電機製作所	4,200	1,845.00	7,749,000
新東工業	23,700	760.00	18,012,000
澁谷工業	6,900	812.00	5,602,800
アイチ コーポレーション	20,700	321.00	6,644,700
小森コーポレーション	31,000	514.00	15,934,000
鶴見製作所	9,000	651.00	5,859,000
住友精密工業	22,000	524.00	11,528,000
酒井重工業	22,000	146.00	3,212,000
荏原製作所	190,000	310.00	58,900,000
石井鐵工所	22,000	143.00	3,146,000
西島製作所	13,700	1,101.00	15,083,700
千代田化工建設	85,000	765.00	65,025,000
ダイキン工業	122,400	2,236.00	273,686,400
オルガノ	20,000	601.00	12,020,000
トーヨーカネツ	64,000	156.00	9,984,000
栗田工業	64,700	2,183.00	141,240,100
椿本チエイン	60,000	407.00	24,420,000

大同工業	29,000	153.00	4,437,000
日本コンベヤ	36,000	73.00	2,628,000
日機装	39,000	689.00	26,871,000
木村化工機	10,800	321.00	3,466,800
新興プランテック	25,400	731.00	18,567,400
アネスト岩田	21,000	328.00	6,888,000
ダイフク	48,000	419.00	20,112,000
加藤製作所	29,000	205.00	5,945,000
油研工業	20,000	175.00	3,500,000
タダノ	50,000	543.00	27,150,000
フジテック	33,000	420.00	13,860,000
シーケーディ	32,000	462.00	14,784,000
キトー	38	61,400.00	2,333,200
平和	24,300	1,380.00	33,534,000
理想科学工業	9,100	1,402.00	12,758,200
SANKYO	34,000	4,205.00	142,970,000
日本金銭機械	10,800	715.00	7,722,000
マースエンジニアリング	5,600	1,300.00	7,280,000
福島工業	3,700	953.00	3,526,100
オーイズミ	8,300	337.00	2,797,100
ダイコク電機	5,000	697.00	3,485,000
アマノ	31,200	699.00	21,808,800
サンデン	66,000	273.00	18,018,000
ブラザー工業	144,900	917.00	132,873,300
マックス	19,000	1,005.00	19,095,000
モリタホールディングス	20,000	462.00	9,240,000
グローリー	31,100	1,825.00	56,757,500
大和冷機工業	16,000	399.00	6,384,000
セガサミーホールディングス	111,200	1,825.00	202,940,000
日本ピストンリング	44,000	161.00	7,084,000
リケン	45,000	325.00	14,625,000
帝国ピストンリング	14,400	942.00	13,564,800
ホシザキ電機	22,600	1,899.00	42,917,400
大豊工業	8,900	766.00	6,817,400
日本精工	250,000	576.00	144,000,000
NTN	260,000	368.00	95,680,000
ジェイテクト	119,400	937.00	111,877,800
不二越	115,000	382.00	43,930,000
ミネベア	167,000	263.00	43,921,000
日本トムソン	39,000	468.00	18,252,000
THK	74,600	1,311.00	97,800,600

ユーシン精機	5,600	1,466.00	8,209,600
前澤給装工業	4,300	1,047.00	4,502,100
イーグル工業	15,000	853.00	12,795,000
前澤工業	12,600	193.00	2,431,800
日本ピラー工業	14,000	477.00	6,678,000
キッツ	47,200	393.00	18,549,600
日立製作所	2,516,000	389.00	978,724,000
東芝	2,212,000	320.00	707,840,000
三菱電機	1,121,000	695.00	779,095,000
富士電機	338,000	203.00	68,614,000
東洋電機製造	21,000	393.00	8,253,000
安川電機	123,000	592.00	72,816,000
シンフォニアテクノロジー	70,000	206.00	14,420,000
明電舎	111,000	292.00	32,412,000
オリジン電気	18,000	299.00	5,382,000
デンヨー	11,300	971.00	10,972,300
日立工機	30,000	583.00	17,490,000
三櫻工業	12,900	742.00	9,571,800
マキタ	73,100	2,791.00	204,022,100
東芝テック	70,000	292.00	20,440,000
芝浦メカトロニクス	20,000	226.00	4,520,000
マブチモーター	15,300	3,610.00	55,233,000
日本電産	55,500	6,310.00	350,205,000
高岳製作所	44,000	198.00	8,712,000
ダイヘン	61,000	297.00	18,117,000
JVCケンウッド	53,200	312.00	16,598,400
第一精工	3,100	2,339.00	7,250,900
日新電機	20,000	584.00	11,680,000
大崎電気工業	17,000	765.00	13,005,000
オムロン	124,800	1,536.00	191,692,800
日東工業	17,100	1,051.00	17,972,100
I D E C	13,600	843.00	11,464,800
エルピーダメモリ	126,200	496.00	62,595,200
ジーエス・ユアサ コーポレーション	216,000	364.00	78,624,000
サクサホールディングス	31,000	135.00	4,185,000
メルコホールディングス	6,200	2,431.00	15,072,200
テクノメディカ	9	297,900.00	2,681,100
日本電気	1,450,000	159.00	230,550,000
富士通	1,080,000	369.00	398,520,000
沖電気工業	407,000	71.00	28,897,000
岩崎通信機	49,000	69.00	3,381,000

電気興業	35,000	312.00	10,920,000
サンケン電気	67,000	299.00	20,033,000
ナカヨ通信機	11,000	185.00	2,035,000
アイホン	7,200	1,500.00	10,800,000
ルネサスエレクトロニクス	29,100	521.00	15,161,100
セイコーエプソン	76,500	990.00	75,735,000
ワコム	221	90,800.00	20,066,800
アルバック	21,200	1,043.00	22,111,600
アクセル	5,200	1,794.00	9,328,800
ナナオ	9,800	1,708.00	16,738,400
日本信号	26,100	609.00	15,894,900
京三製作所	24,000	409.00	9,816,000
能美防災	15,000	513.00	7,695,000
ホーチキ	10,000	412.00	4,120,000
日本無線	36,000	205.00	7,380,000
パナソニック	1,304,800	754.00	983,819,200
シャープ	502,000	656.00	329,312,000
アンリツ	50,000	863.00	43,150,000
富士通ゼネラル	28,000	461.00	12,908,000
日立国際電気	26,000	501.00	13,026,000
ソニー	629,200	1,507.00	948,204,400
T D K	63,100	2,733.00	172,452,300
帝国通信工業	27,000	143.00	3,861,000
ミツミ電機	39,600	524.00	20,750,400
タムラ製作所	40,000	197.00	7,880,000
アルプス電気	88,500	601.00	53,188,500
パイオニア	160,700	329.00	52,870,300
日本電波工業	8,700	868.00	7,551,600
日本トリム	1,300	1,940.00	2,522,000
ローランド ディー . ジー .	5,000	830.00	4,150,000
フォスター電機	11,400	928.00	10,579,200
クラリオン	59,000	129.00	7,611,000
S M K	36,000	290.00	10,440,000
ヨコオ	9,500	475.00	4,512,500
東光	51,000	151.00	7,701,000
ホシデン	27,900	552.00	15,400,800
ヒロセ電機	18,100	7,240.00	131,044,000
日本航空電子工業	26,000	523.00	13,598,000
T O A	15,000	469.00	7,035,000
ユニデン	34,000	283.00	9,622,000
アルパイン	21,900	1,005.00	22,009,500

スミダコーポレーション	7,000	691.00	4,837,000
アイコム	6,200	1,987.00	12,319,400
船井電機	10,200	1,519.00	15,493,800
横河電機	112,200	740.00	83,028,000
新電元工業	40,000	325.00	13,000,000
山武	31,400	1,674.00	52,563,600
日本光電工業	20,700	2,095.00	43,366,500
チノー	24,000	207.00	4,968,000
共和電業	12,000	271.00	3,252,000
日本電子材料	6,200	425.00	2,635,000
堀場製作所	20,700	2,367.00	48,996,900
アドバンテスト	76,400	848.00	64,787,200
小野測器	12,000	214.00	2,568,000
エスペック	11,700	530.00	6,201,000
パナソニック電工SUNX	9,900	471.00	4,662,900
キーエンス	25,000	21,400.00	535,000,000
日置電機	5,400	1,600.00	8,640,000
シスメックス	39,400	2,795.00	110,123,000
メガチップス	10,100	1,103.00	11,140,300
OBARA	8,000	934.00	7,472,000
日本電産コバル電子	11,600	565.00	6,554,000
ミヤチテクノス	5,500	683.00	3,756,500
東京電波	3,400	408.00	1,387,200
澤藤電機	7,000	268.00	1,876,000
デンソー	246,100	2,511.00	617,957,100
コーセル	16,300	1,170.00	19,071,000
日立メディコ	8,000	852.00	6,816,000
新日本無線	8,000	122.00	976,000
オブテックス	7,700	1,024.00	7,884,800
千代田インテグレ	5,400	1,080.00	5,832,000
東光電気	9,000	344.00	3,096,000
スタンレー電気	75,700	1,183.00	89,553,100
岩崎電気	41,000	172.00	7,052,000
ウシオ電機	68,000	1,186.00	80,648,000
岡谷電機産業	6,100	367.00	2,238,700
ヘリオス テクノ ホールディング	10,500	163.00	1,711,500
日本セラミック	7,300	1,530.00	11,169,000
新神戸電機	9,000	1,332.00	11,988,000
日本デジタル研究所	9,500	897.00	8,521,500
古河電池	8,000	404.00	3,232,000
双信電機	5,500	385.00	2,117,500

山一電機	11,300	201.00	2,271,300	
図研	6,600	561.00	3,702,600	
日本電子	42,000	222.00	9,324,000	
カシオ計算機	106,800	495.00	52,866,000	
ファナック	116,700	10,830.00	1,263,861,000	
日本シイエムケイ	22,100	320.00	7,072,000	
エンプラス	5,700	1,515.00	8,635,500	
ローム	55,200	4,060.00	224,112,000	
浜松ホトニクス	43,700	3,145.00	137,436,500	
三井ハイテック	13,400	380.00	5,092,000	
新光電気工業	28,300	558.00	15,791,400	
京セラ	93,200	6,540.00	609,528,000	
協栄産業	13,000	140.00	1,820,000	
太陽誘電	50,400	572.00	28,828,800	
村田製作所	117,600	4,225.00	496,860,000	
ユーシン	15,700	633.00	9,938,100	
双葉電子工業	19,200	1,599.00	30,700,800	
日東電工	96,700	3,090.00	298,803,000	
北陸電気工業	45,000	122.00	5,490,000	
東海理化電機製作所	26,200	1,406.00	36,837,200	
ニチコン	35,300	943.00	33,287,900	
日本ケミコン	69,000	281.00	19,389,000	
K O A	14,100	843.00	11,886,300	
三井造船	434,000	131.00	56,854,000	
日立造船	473,000	116.00	54,868,000	
佐世保重工業	73,000	128.00	9,344,000	
三菱重工業	1,878,000	329.00	617,862,000	
川崎重工業	872,000	200.00	174,400,000	
I H I	767,000	173.00	132,691,000	
日本車輛製造	41,000	333.00	13,653,000	
日本輸送機	13,000	215.00	2,795,000	
近畿車輛	17,000	279.00	4,743,000	
日産自動車	1,415,600	693.00	981,010,800	
いすゞ自動車	649,000	336.00	218,064,000	
トヨタ自動車	1,439,600	2,688.00	3,869,644,800	
日野自動車	140,000	466.00	65,240,000	
三菱自動車工業	2,312,000	103.00	238,136,000	
エフテック	3,900	985.00	3,841,500	
武蔵精密工業	10,900	1,877.00	20,459,300	
トヨタ車体	20,400	1,216.00	24,806,400	
日産車体	44,000	636.00	27,984,000	

関東自動車工業	17,000	671.00	11,407,000
新明和工業	50,000	290.00	14,500,000
極東開発工業	20,800	453.00	9,422,400
日信工業	22,800	1,162.00	26,493,600
トピー工業	92,000	188.00	17,296,000
ティラド	41,000	297.00	12,177,000
曙ブレーキ工業	52,000	403.00	20,956,000
タチエス	14,600	1,376.00	20,089,600
NOK	54,200	1,408.00	76,313,600
フタバ産業	31,700	601.00	19,051,700
カヤバ工業	70,000	439.00	30,730,000
シロキ工業	25,000	251.00	6,275,000
市光工業	27,000	139.00	3,753,000
大同メタル工業	17,000	897.00	15,249,000
プレス工業	52,000	350.00	18,200,000
カルソニックカンセイ	57,000	474.00	27,018,000
太平洋工業	23,000	441.00	10,143,000
ケーヒン	23,200	1,341.00	31,111,200
河西工業	14,000	469.00	6,566,000
アイシン精機	92,300	2,606.00	240,533,800
富士機工	13,000	241.00	3,133,000
マツダ	867,000	158.00	136,986,000
ダイハツ工業	119,000	1,409.00	167,671,000
愛知機械工業	25,000	246.00	6,150,000
今仙電機製作所	7,600	1,085.00	8,246,000
本田技研工業	945,400	2,299.00	2,173,474,600
スズキ	234,200	1,722.00	403,292,400
富士重工業	354,000	458.00	162,132,000
ヤマハ発動機	182,500	1,036.00	189,070,000
ショーワ	23,800	463.00	11,019,400
小糸製作所	56,000	1,233.00	69,048,000
T B K	11,000	346.00	3,806,000
エクセディ	13,500	2,948.00	39,798,000
ミツバ	21,000	633.00	13,293,000
豊田合成	31,700	1,482.00	46,979,400
愛三工業	13,500	686.00	9,261,000
ヨロズ	6,700	2,012.00	13,480,400
エフ・シー・シー	16,500	1,618.00	26,697,000
新家工業	25,000	126.00	3,150,000
シマノ	42,400	4,125.00	174,900,000
タカタ	17,400	1,775.00	30,885,000

テイ・エス テック	21,300	1,144.00	24,367,200
小野建	9,700	712.00	6,906,400
はるやま商事	5,300	387.00	2,051,100
佐島電機	8,200	496.00	4,067,200
カッパ・クリエイト	8,150	1,730.00	14,099,500
エコートレーディング	2,800	719.00	2,013,200
伯東	6,800	744.00	5,059,200
コンドーテック	3,900	923.00	3,599,700
中山福	6,400	595.00	3,808,000
ライトオン	8,300	469.00	3,892,700
ナガイレーベン	14,700	1,180.00	17,346,000
ジーンズメイト	3,500	179.00	626,500
三菱食品	10,700	2,235.00	23,914,500
良品計画	12,700	4,290.00	54,483,000
三城ホールディングス	13,700	730.00	10,001,000
松田産業	8,100	1,179.00	9,549,900
メディパルホールディングス	102,100	787.00	80,352,700
アドヴァン	6,600	739.00	4,877,400
S P K	2,400	1,350.00	3,240,000
アズワン	7,200	1,618.00	11,649,600
スズデン	3,600	533.00	1,918,800
尾家産業	3,600	880.00	3,168,000
シモジマ	7,600	1,120.00	8,512,000
ドウシシャ	5,200	2,240.00	11,648,000
コナカ	13,100	313.00	4,100,300
高速	6,600	688.00	4,540,800
ハウス オブ ローゼ	1,100	1,250.00	1,375,000
G - 7ホールディングス	2,900	396.00	1,148,400
イオン北海道	8,100	360.00	2,916,000
コジマ	13,500	550.00	7,425,000
コーナン商事	11,300	1,372.00	15,503,600
黒田電気	14,800	925.00	13,690,000
ネットワンシステムズ	272	204,900.00	55,732,800
エコス	3,800	469.00	1,782,200
ワタミ	13,100	1,915.00	25,086,500
マルシェ	3,000	706.00	2,118,000
ドン・キホーテ	21,400	2,783.00	59,556,200
丸文	8,800	324.00	2,851,200
メガネトップ	17,400	810.00	14,094,000
西松屋チェーン	24,300	624.00	15,163,200
ゼンショー	42,200	1,093.00	46,124,600

ハピネット	3,000	1,315.00	3,945,000
幸楽苑	6,800	1,168.00	7,942,400
トーメンエレクトロニクス	4,500	944.00	4,248,000
ハークスレイ	3,100	526.00	1,630,600
サイゼリヤ	16,400	1,403.00	23,009,200
エクセル	5,400	775.00	4,185,000
マルカキカイ	3,600	646.00	2,325,600
アルゴグラフィックス	4,000	1,011.00	4,044,000
ガリバーインターナショナル	2,990	3,410.00	10,195,900
日本エム・ディ・エム	9,400	178.00	1,673,200
ポプラ	4,200	448.00	1,881,600
ユナイテッドアローズ	10,500	1,489.00	15,634,500
進和	6,600	900.00	5,940,000
エスケイジャパン	2,800	246.00	688,800
ダイトエレクトロン	5,100	628.00	3,202,800
ハイデイ日高	4,900	1,250.00	6,125,000
シークス	7,100	1,016.00	7,213,600
京都きもの友禅	7,100	936.00	6,645,600
コロワイド	36,500	504.00	18,396,000
田中商事	3,500	428.00	1,498,000
オーハシテクニカ	6,200	617.00	3,825,400
壱番屋	4,500	2,424.00	10,908,000
マクニカ	5,100	1,665.00	8,491,500
白銅	3,600	790.00	2,844,000
トップカルチャー	4,100	390.00	1,599,000
スギホールディングス	17,600	2,178.00	38,332,800
島津製作所	134,000	659.00	88,306,000
JMS	17,000	272.00	4,624,000
クボテック	24	23,690.00	568,560
長野計器	7,300	812.00	5,927,600
ブイ・テクノロジー	16	305,000.00	4,880,000
スター精密	20,100	768.00	15,436,800
東京計器	39,000	122.00	4,758,000
愛知時計電機	12,000	249.00	2,988,000
日本電産トーソク	6,700	963.00	6,452,100
東京精密	21,600	1,361.00	29,397,600
ニコン	195,300	1,843.00	359,937,900
トプコン	25,800	387.00	9,984,600
オリンパス	132,200	2,417.00	319,527,400
理研計器	9,100	605.00	5,505,500
大日本スクリーン製造	125,000	482.00	60,250,000

キヤノン電子	10,300	2,196.00	22,618,800
タムロン	9,800	2,462.00	24,127,600
HOYA	257,300	1,803.00	463,911,900
ノーリツ鋼機	10,200	384.00	3,916,800
エー・アンド・デイ	11,000	300.00	3,300,000
キヤノン	696,100	3,550.00	2,471,155,000
リコー	337,000	654.00	220,398,000
日本電産コパル	8,800	896.00	7,884,800
日本電産サンキョー	27,000	459.00	12,393,000
シチズンホールディングス	122,000	391.00	47,702,000
リズム時計工業	56,000	111.00	6,216,000
大研医器	1,700	899.00	1,528,300
SRIスポーツ	7,100	860.00	6,106,000
バンダイナムコホールディングス	120,100	1,051.00	126,225,100
共立印刷	19,300	168.00	3,242,400
フランスベッドホールディングス	75,000	128.00	9,600,000
パイロットコーポレーション	98	165,000.00	16,170,000
エイベックス・グループ・ホールディングス	20,900	947.00	19,792,300
トッパン・フォームズ	24,100	621.00	14,966,100
フジシールインターナショナル	11,500	1,523.00	17,514,500
タカラトミー	33,600	606.00	20,361,600
廣済堂	8,700	185.00	1,609,500
レック	3,100	1,570.00	4,867,000
タカノ	5,400	509.00	2,748,600
プロネクサス	12,400	400.00	4,960,000
ウッドワン	19,000	314.00	5,966,000
大建工業	48,000	265.00	12,720,000
きもと	10,500	588.00	6,174,000
凸版印刷	316,000	569.00	179,804,000
大日本印刷	341,000	808.00	275,528,000
図書印刷	22,000	159.00	3,498,000
共同印刷	37,000	193.00	7,141,000
日本写真印刷	20,400	902.00	18,400,800
光村印刷	12,000	264.00	3,168,000
藤森工業	8,400	1,370.00	11,508,000
宝印刷	6,400	616.00	3,942,400
前澤化成工業	8,200	853.00	6,994,600
アシックス	104,400	1,061.00	110,768,400
ツツミ	4,900	1,885.00	9,236,500
JSP	7,700	1,344.00	10,348,800
ニチハ	11,700	873.00	10,214,100

ローランド	11,500	586.00	6,739,000
エフピコ	5,800	5,520.00	32,016,000
小松ウオール工業	4,200	692.00	2,906,400
ヤマハ	89,300	847.00	75,637,100
河合楽器製作所	42,000	163.00	6,846,000
クリナップ	12,300	485.00	5,965,500
ピジョン	7,800	3,185.00	24,843,000
天馬	10,400	702.00	7,300,800
パラマウントベッド	8,800	2,094.00	18,427,200
キングジム	9,400	608.00	5,715,200
リンテック	24,000	1,551.00	37,224,000
信越ポリマー	23,000	420.00	9,660,000
東リ	30,000	149.00	4,470,000
イトーキ	28,000	173.00	4,844,000
任天堂	64,100	11,360.00	728,176,000
三菱鉛筆	9,500	1,435.00	13,632,500
タカラスタンド	52,000	645.00	33,540,000
コクヨ	58,300	623.00	36,320,900
ナカバヤシ	28,000	190.00	5,320,000
ニフコ	22,400	2,003.00	44,867,200
グローブライド	50,000	90.00	4,500,000
岡村製作所	44,000	585.00	25,740,000
日本バルカー工業	49,000	209.00	10,241,000
MUTOHホールディングス	14,000	128.00	1,792,000
伊藤忠商事	772,000	748.00	577,456,000
丸紅	967,000	439.00	424,513,000
スクロール	15,700	260.00	4,082,000
高島	19,000	171.00	3,249,000
F & A アクアホールディングス	8,500	790.00	6,715,000
三陽商会	60,000	183.00	10,980,000
長瀬産業	62,600	963.00	60,283,800
蝶理	75,000	90.00	6,750,000
豊田通商	123,200	1,341.00	165,211,200
オンワードホールディングス	78,000	617.00	48,126,000
三共生興	18,900	267.00	5,046,300
兼松	250,000	67.00	16,750,000
美津濃	56,000	403.00	22,568,000
ツカモトコーポレーション	20,000	81.00	1,620,000
ファミリーマート	37,400	2,968.00	111,003,200
ルック	22,000	168.00	3,696,000
三井物産	954,600	1,134.00	1,082,516,400

日本紙パルプ商事	63,000	294.00	18,522,000
東京エレクトロン	88,000	3,560.00	313,280,000
日立ハイテクノロジーズ	33,600	1,567.00	52,651,200
カメイ	13,000	526.00	6,838,000
東都水産	18,000	127.00	2,286,000
スターゼン	37,000	245.00	9,065,000
セイコーホールディングス	58,000	201.00	11,658,000
山善	42,500	580.00	24,650,000
椿本興業	11,000	209.00	2,299,000
住友商事	609,200	967.00	589,096,400
日本ユニシス	31,400	437.00	13,721,800
内田洋行	26,000	208.00	5,408,000
三菱商事	862,900	1,592.00	1,373,736,800
第一実業	24,000	347.00	8,328,000
キャノンマーケティングジャパン	36,800	948.00	34,886,400
西華産業	41,000	223.00	9,143,000
佐藤商事	9,900	479.00	4,742,100
菱洋エレクトロ	13,500	735.00	9,922,500
東京産業	11,000	258.00	2,838,000
ユアサ商事	113,000	113.00	12,769,000
神鋼商事	28,000	197.00	5,516,000
阪和興業	103,000	352.00	36,256,000
カナデン	11,000	534.00	5,874,000
菱電商事	18,000	471.00	8,478,000
ニプロ	44,600	733.00	32,691,800
フルサト工業	6,600	566.00	3,735,600
岩谷産業	120,000	266.00	31,920,000
すてきナイスグループ	48,000	170.00	8,160,000
昭光通商	40,000	115.00	4,600,000
ニチモウ	16,000	136.00	2,176,000
極東貿易	14,000	199.00	2,786,000
イワキ	17,000	213.00	3,621,000
兼松エレクトロニクス	7,000	813.00	5,691,000
三愛石油	27,000	378.00	10,206,000
稲畑産業	29,600	445.00	13,172,000
G S Iクレオス	30,000	99.00	2,970,000
明和産業	8,700	228.00	1,983,600
ゴールドウイン	26,000	259.00	6,734,000
ユニ・チャーム	64,800	3,725.00	241,380,000
デサント	34,000	444.00	15,096,000
ヤマトインターナショナル	10,600	338.00	3,582,800

東邦ホールディングス	33,800	950.00	32,110,000
サンゲツ	19,600	2,070.00	40,572,000
ミツウロコ	17,900	524.00	9,379,600
シナネン	24,000	360.00	8,640,000
伊藤忠エネクス	24,500	453.00	11,098,500
サンリオ	31,000	3,650.00	113,150,000
サンワテクノス	5,400	714.00	3,855,600
リョーサン	18,000	1,717.00	30,906,000
新光商事	10,400	625.00	6,500,000
トーヨー	23,000	317.00	7,291,000
三信電気	13,800	675.00	9,315,000
東陽テクニカ	16,000	879.00	14,064,000
モスフードサービス	14,500	1,580.00	22,910,000
加賀電子	11,000	830.00	9,130,000
三益半導体工業	9,900	730.00	7,227,000
ソーダニッカ	11,000	355.00	3,905,000
立花エレテック	6,700	680.00	4,556,000
木曽路	12,700	1,460.00	18,542,000
千趣会	20,000	585.00	11,700,000
タカキュー	9,000	138.00	1,242,000
ケーヨー	21,500	487.00	10,470,500
アデランス	13,500	722.00	9,747,000
上新電機	24,000	905.00	21,720,000
日本瓦斯	10,600	1,500.00	15,900,000
ベスト電器	34,500	222.00	7,659,000
マルエツ	23,000	270.00	6,210,000
ロイヤルホールディングス	18,500	890.00	16,465,000
東天紅	8,000	123.00	984,000
いなげや	12,300	940.00	11,562,000
島忠	25,100	1,868.00	46,886,800
チヨダ	14,500	1,304.00	18,908,000
鈴丹	2,700	106.00	286,200
ライフコーポレーション	7,300	1,583.00	11,555,900
カスミ	22,600	523.00	11,819,800
リンガーハット	8,500	1,100.00	9,350,000
MrMax	11,200	320.00	3,584,000
テンアライド	7,400	274.00	2,027,600
AOKIホールディングス	10,300	1,196.00	12,318,800
オークワ	16,000	1,201.00	19,216,000
コメリ	15,200	2,544.00	38,668,800
青山商事	28,200	1,349.00	38,041,800

しまむら	11,600	8,160.00	94,656,000
C F Sコーポレーション	11,000	367.00	4,037,000
高島屋	150,000	568.00	85,200,000
松屋	22,400	502.00	11,244,800
エイチ・ツー・オー リテイリング	65,000	620.00	40,300,000
ニッセンホールディングス	22,200	516.00	11,455,200
パルコ	28,800	606.00	17,452,800
丸井グループ	144,100	589.00	84,874,900
クレディセゾン	84,000	1,509.00	126,756,000
原信ナルスホールディングス	6,600	1,262.00	8,329,200
ダイエー	51,200	285.00	14,592,000
イズミヤ	41,000	360.00	14,760,000
イオン	389,900	1,049.00	409,005,100
ユニー	90,500	726.00	65,703,000
イズミ	26,800	1,207.00	32,347,600
東武ストア	15,000	263.00	3,945,000
平和堂	22,400	1,060.00	23,744,000
フジ	12,500	1,861.00	23,262,500
ヤオコー	4,900	2,931.00	14,361,900
ゼビオ	13,400	1,979.00	26,518,600
ケーズホールディングス	25,500	3,055.00	77,902,500
P a l t a c	9,100	1,443.00	13,131,300
O l y m p i c	7,400	630.00	4,662,000
新生銀行	766,000	88.00	67,408,000
あおぞら銀行	402,000	179.00	71,958,000
三菱U F J フィナンシャル・グループ	8,372,000	354.00	2,963,688,000
りそなホールディングス	682,500	372.00	253,890,000
三井住友トラスト・ホールディングス	2,111,000	259.00	546,749,000
三井住友フィナンシャルグループ	843,200	2,206.00	1,860,099,200
第四銀行	144,000	266.00	38,304,000
北越銀行	124,000	168.00	20,832,000
西日本シティ銀行	388,000	240.00	93,120,000
札幌北洋ホールディングス	166,800	276.00	46,036,800
千葉銀行	436,000	539.00	235,004,000
横浜銀行	758,000	391.00	296,378,000
常陽銀行	426,000	362.00	154,212,000
群馬銀行	253,000	434.00	109,802,000
武蔵野銀行	17,800	2,790.00	49,662,000
千葉興業銀行	21,200	475.00	10,070,000
筑波銀行	48,800	289.00	14,103,200
東京都民銀行	20,900	1,017.00	21,255,300

七十七銀行	187,000	353.00	66,011,000
青森銀行	88,000	269.00	23,672,000
秋田銀行	76,000	254.00	19,304,000
山形銀行	67,000	425.00	28,475,000
岩手銀行	7,500	3,885.00	29,137,500
東邦銀行	93,000	216.00	20,088,000
東北銀行	60,000	133.00	7,980,000
みちのく銀行	55,000	169.00	9,295,000
ふくおかフィナンシャルグループ	449,000	327.00	146,823,000
静岡銀行	334,000	815.00	272,210,000
十六銀行	139,000	256.00	35,584,000
スルガ銀行	117,000	758.00	88,686,000
八十二銀行	204,000	477.00	97,308,000
山梨中央銀行	68,000	358.00	24,344,000
大垣共立銀行	148,000	269.00	39,812,000
福井銀行	95,000	258.00	24,510,000
北國銀行	123,000	290.00	35,670,000
清水銀行	3,800	3,465.00	13,167,000
滋賀銀行	104,000	536.00	55,744,000
南都銀行	103,000	467.00	48,101,000
百五銀行	100,000	331.00	33,100,000
京都銀行	198,000	693.00	137,214,000
三重銀行	49,000	202.00	9,898,000
ほくほくフィナンシャルグループ	775,000	170.00	131,750,000
広島銀行	326,000	385.00	125,510,000
山陰合同銀行	66,000	599.00	39,534,000
中国銀行	91,000	1,146.00	104,286,000
鳥取銀行	35,000	176.00	6,160,000
伊予銀行	118,000	794.00	93,692,000
百十四銀行	129,000	356.00	45,924,000
四国銀行	80,000	320.00	25,600,000
阿波銀行	91,000	536.00	48,776,000
鹿児島銀行	71,000	565.00	40,115,000
大分銀行	72,000	260.00	18,720,000
宮崎銀行	74,000	184.00	13,616,000
肥後銀行	87,000	468.00	40,716,000
佐賀銀行	67,000	213.00	14,271,000
十八銀行	71,000	235.00	16,685,000
沖縄銀行	8,400	3,590.00	30,156,000
琉球銀行	23,200	1,058.00	24,545,600
八千代銀行	5,800	2,209.00	12,812,200

みずほフィナンシャルグループ	14,843,900	114.00	1,692,204,600
紀陽ホールディングス	438,000	120.00	52,560,000
山口フィナンシャルグループ	110,000	787.00	86,570,000
芙蓉総合リース	10,600	2,881.00	30,538,600
興銀リース	15,500	1,878.00	29,109,000
東京センチュリーリース	26,100	1,543.00	40,272,300
S B Iホールディングス	13,599	6,810.00	92,609,190
日本証券金融	48,700	397.00	19,333,900
大阪証券金融	26,100	138.00	3,601,800
ポケットカード	17,400	285.00	4,959,000
長野銀行	39,000	179.00	6,981,000
名古屋銀行	100,000	271.00	27,100,000
愛知銀行	3,700	4,895.00	18,111,500
第三銀行	67,000	190.00	12,730,000
中京銀行	45,000	204.00	9,180,000
東日本銀行	58,000	170.00	9,860,000
大光銀行	42,000	244.00	10,248,000
愛媛銀行	70,000	239.00	16,730,000
トマト銀行	43,000	143.00	6,149,000
みなと銀行	114,000	148.00	16,872,000
京葉銀行	91,000	421.00	38,311,000
関西アーバン銀行	154,000	142.00	21,868,000
栃木銀行	56,000	301.00	16,856,000
北日本銀行	3,400	2,150.00	7,310,000
東和銀行	119,000	99.00	11,781,000
福島銀行	136,000	39.00	5,304,000
大東銀行	70,000	59.00	4,130,000
リコーリース	7,700	1,731.00	13,328,700
イオンクレジットサービス	49,300	1,198.00	59,061,400
アコム	22,740	1,500.00	34,110,000
プロミス	56,300	659.00	37,101,700
ジャックス	80,000	254.00	20,320,000
オリエントコーポレーション	152,000	76.00	11,552,000
日立キャピタル	26,200	973.00	25,492,600
オリックス	57,560	6,140.00	353,418,400
三菱UFJリース	28,090	3,125.00	87,781,250
ジャフコ	15,700	1,457.00	22,874,900
トモニホールディングス	85,100	353.00	30,040,300
大和証券グループ本社	1,096,000	292.00	320,032,000
野村ホールディングス	2,329,500	286.00	666,237,000
岡三証券グループ	96,000	263.00	25,248,000

丸三証券	36,400	320.00	11,648,000
東洋証券	48,000	115.00	5,520,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	127,000	237.00	30,099,000
水戸証券	40,000	104.00	4,160,000
いちよし証券	26,500	461.00	12,216,500
松井証券	65,700	353.00	23,192,100
N K S Jホールディングス	231,250	1,727.00	399,368,750
だいこう証券ビジネス	7,800	258.00	2,012,400
マネックスグループ	687	12,130.00	8,333,310
カブドットコム証券	46,000	217.00	9,982,000
極東証券	14,900	547.00	8,150,300
岩井コスモホールディングス	13,400	285.00	3,819,000
フィデアホールディングス	63,600	234.00	14,882,400
池田泉州ホールディングス	414,800	128.00	53,094,400
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	330,500	1,696.00	560,528,000
ソニーフィナンシャルホールディングス	105,900	1,194.00	126,444,600
第一生命保険	5,915	81,200.00	480,298,000
東京海上ホールディングス	419,900	1,984.00	833,081,600
アサックス	15	104,900.00	1,573,500
N E Cキャピタルソリューション	4,800	1,048.00	5,030,400
T & Dホールディングス	403,100	737.00	297,084,700
三井不動産	521,000	1,243.00	647,603,000
三菱地所	774,000	1,268.00	981,432,000
平和不動産	105,500	167.00	17,618,500
東京建物	214,000	238.00	50,932,000
ダイビル	34,100	546.00	18,618,600
サンケイビル	23,900	379.00	9,058,100
東急不動産	225,000	281.00	63,225,000
京阪神不動産	15,400	375.00	5,775,000
住友不動産	265,000	1,507.00	399,355,000
東宝不動産	11,700	415.00	4,855,500
大京	192,000	126.00	24,192,000
テーオーシー	43,200	375.00	16,200,000
東京楽天地	18,000	277.00	4,986,000
フジ住宅	14,100	378.00	5,329,800
空港施設	11,600	321.00	3,723,600
明和地所	6,600	370.00	2,442,000
住友不動産販売	3,990	3,285.00	13,107,150
ゴールドクレスト	10,430	1,444.00	15,060,920
東栄住宅	8,500	806.00	6,851,000

日本エスリード	6,000	655.00	3,930,000
東急リパブル	11,800	696.00	8,212,800
飯田産業	12,600	658.00	8,290,800
日神不動産	8,500	403.00	3,425,500
アーネストワン	20,600	805.00	16,583,000
タカラレーベン	12,300	345.00	4,243,500
サンヨーハウジング名古屋	47	74,200.00	3,487,400
イオンモール	50,400	1,787.00	90,064,800
フージャースコーポレーション	211	24,800.00	5,232,800
タクトホーム	59	69,200.00	4,082,800
エヌ・ティ・ティ都市開発	812	56,700.00	46,040,400
東武鉄道	584,000	366.00	213,744,000
相鉄ホールディングス	176,000	259.00	45,584,000
東京急行電鉄	615,000	390.00	239,850,000
京浜急行電鉄	288,000	716.00	206,208,000
小田急電鉄	359,000	738.00	264,942,000
京王電鉄	291,000	556.00	161,796,000
京成電鉄	180,000	528.00	95,040,000
富士急行	31,000	497.00	15,407,000
新京成電鉄	14,000	353.00	4,942,000
東日本旅客鉄道	194,800	4,710.00	917,508,000
西日本旅客鉄道	104,400	3,320.00	346,608,000
東海旅客鉄道	972	677,000.00	658,044,000
西日本鉄道	145,000	366.00	53,070,000
ハマキョウレックス	3,200	2,396.00	7,667,200
サカイ引越センター	2,000	1,739.00	3,478,000
近畿日本鉄道	1,012,000	292.00	295,504,000
阪急阪神ホールディングス	752,000	332.00	249,664,000
南海電気鉄道	234,000	341.00	79,794,000
京阪電気鉄道	251,000	372.00	93,372,000
名糖運輸	4,200	638.00	2,679,600
名古屋鉄道	391,000	226.00	88,366,000
日本通運	444,000	332.00	147,408,000
ヤマトホールディングス	228,000	1,419.00	323,532,000
山九	136,000	367.00	49,912,000
日新	42,000	194.00	8,148,000
丸運	6,000	194.00	1,164,000
丸全昭和運輸	38,000	291.00	11,058,000
センコー	45,000	312.00	14,040,000
トナミホールディングス	23,000	173.00	3,979,000
日本梱包運輸倉庫	33,600	970.00	32,592,000

日本石油輸送	13,000	193.00	2,509,000	
福山通運	78,000	472.00	36,816,000	
セイノーホールディングス	87,000	634.00	55,158,000	
神奈川中央交通	13,000	426.00	5,538,000	
日立物流	19,400	1,440.00	27,936,000	
日本郵船	947,000	211.00	199,817,000	
商船三井	546,000	300.00	163,800,000	
川崎汽船	346,000	163.00	56,398,000	
N S ユナイテッド海運	40,000	113.00	4,520,000	
乾汽船	13,500	300.00	4,050,000	
飯野海運	55,800	412.00	22,989,600	
共栄タンカー	16,000	122.00	1,952,000	
第一中央汽船	79,000	99.00	7,821,000	
全日本空輸	1,495,000	243.00	363,285,000	
パスコ	20,000	258.00	5,160,000	
三菱倉庫	80,000	843.00	67,440,000	
三井倉庫	52,000	301.00	15,652,000	
住友倉庫	82,000	359.00	29,438,000	
澁澤倉庫	29,000	247.00	7,163,000	
ヤマタネ	55,000	124.00	6,820,000	
東陽倉庫	18,000	177.00	3,186,000	
日本トランスシティ	23,000	251.00	5,773,000	
ケイヒン	20,000	93.00	1,860,000	
安田倉庫	9,500	494.00	4,693,000	
東洋埠頭	32,000	138.00	4,416,000	
宇徳	8,100	273.00	2,211,300	
上組	124,000	694.00	86,056,000	
サンリツ	2,900	556.00	1,612,400	
キムラユニティー	2,500	696.00	1,740,000	
キューソー流通システム	3,500	885.00	3,097,500	
郵船ロジスティクス	8,800	1,032.00	9,081,600	
近鉄エクスプレス	10,000	2,227.00	22,270,000	
東海運	6,000	194.00	1,164,000	
東京放送ホールディングス	60,000	958.00	57,480,000	
日本テレビ放送網	9,710	11,250.00	109,237,500	
テレビ朝日	280	126,500.00	35,420,000	
スカパー J S A Tホールディングス	840	40,500.00	34,020,000	
テレビ東京ホールディングス	5,100	1,139.00	5,808,900	
アイ・ティー・シーネットワーク	9,400	495.00	4,653,000	
イー・アクセス	636	19,810.00	12,599,160	
N E C モバイリング	4,100	2,800.00	11,480,000	

日本電信電話	415,400	3,730.00	1,549,442,000
KDDI	1,717	536,000.00	920,312,000
光通信	14,200	1,844.00	26,184,800
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	9,114	141,700.00	1,291,453,800
GMOインターネット	34,200	310.00	10,602,000
学研ホールディングス	33,000	171.00	5,643,000
ゼンリン	16,000	769.00	12,304,000
昭文社	6,800	588.00	3,998,400
角川グループホールディングス	10,600	2,700.00	28,620,000
インプレスホールディングス	9,100	91.00	828,100
東京電力	824,800	240.00	197,952,000
中部電力	342,800	1,462.00	501,173,600
関西電力	457,300	1,348.00	616,440,400
中国電力	154,900	1,371.00	212,367,900
北陸電力	109,800	1,441.00	158,221,800
東北電力	279,900	1,080.00	302,292,000
四国電力	111,100	2,138.00	237,531,800
九州電力	247,500	1,253.00	310,117,500
北海道電力	104,900	1,146.00	120,215,400
沖縄電力	6,700	3,470.00	23,249,000
電源開発	69,500	2,292.00	159,294,000
東京瓦斯	1,353,000	361.00	488,433,000
大阪瓦斯	1,087,000	322.00	350,014,000
東邦瓦斯	285,000	510.00	145,350,000
北海道瓦斯	22,000	283.00	6,226,000
西部瓦斯	126,000	210.00	26,460,000
静岡瓦斯	29,000	524.00	15,196,000
アイネット	6,000	468.00	2,808,000
松竹	68,000	730.00	49,640,000
東宝	72,400	1,359.00	98,391,600
エイチ・アイ・エス	12,000	2,289.00	27,468,000
東映	47,000	382.00	17,954,000
葵プロモーション	5,000	419.00	2,095,000
エヌ・ティ・ティ・データ	782	241,400.00	188,774,800
共立メンテナンス	6,300	1,292.00	8,139,600
イチネンホールディングス	15,100	400.00	6,040,000
建設技術研究所	7,200	550.00	3,960,000
アインファーマシーズ	6,100	3,440.00	20,984,000
燦ホールディングス	2,400	1,320.00	3,168,000
スバル興業	9,000	234.00	2,106,000
東京テアトル	45,000	115.00	5,175,000

ホリプロ	3,900	678.00	2,644,200
よみうりランド	30,000	270.00	8,100,000
東京都競馬	91,000	109.00	9,919,000
カナモト	17,000	543.00	9,231,000
東京ドーム	94,000	178.00	16,732,000
D T S	10,600	968.00	10,260,800
スクウェア・エニックス・ホールディングス	36,200	1,403.00	50,788,600
シーイーシー	8,500	377.00	3,204,500
カプコン	23,800	1,948.00	46,362,400
日本空港ビルデング	35,400	1,165.00	41,241,000
トランス・コスモス	15,800	938.00	14,820,400
乃村工藝社	25,000	248.00	6,200,000
ジャステック	7,100	502.00	3,564,200
住商情報システム	24,400	1,244.00	30,353,600
藤田観光	30,000	283.00	8,490,000
日本管財	4,300	1,489.00	6,402,700
トーカイ	5,500	1,775.00	9,762,500
白洋舎	18,000	214.00	3,852,000
セコム	121,800	3,750.00	456,750,000
日本システムウエア	4,300	296.00	1,272,800
セントラル警備保障	5,200	798.00	4,149,600
アイネス	16,100	523.00	8,420,300
丹青社	16,000	222.00	3,552,000
メイテック	17,300	1,488.00	25,742,400
T K C	9,300	1,624.00	15,103,200
アサツー ディ・ケイ	20,400	2,147.00	43,798,800
富士ソフト	15,100	1,276.00	19,267,600
応用地質	12,900	812.00	10,474,800
船井総合研究所	12,000	526.00	6,312,000
N S D	21,400	636.00	13,610,400
進学会	6,500	284.00	1,846,000
コナミ	51,100	2,619.00	133,830,900
ベネッセホールディングス	36,200	3,425.00	123,985,000
イオンディライト	13,200	1,667.00	22,004,400
ナック	2,900	1,514.00	4,390,600
福井コンピュータ	2,200	349.00	767,800
ニチイ学館	21,000	876.00	18,396,000
ダイセキ	17,300	1,542.00	26,676,600
日鐵商事	25,000	219.00	5,475,000
元気寿司	3,400	981.00	3,335,400
トラスコ中山	13,800	1,601.00	22,093,800

ヤマダ電機	50,450	5,450.00	274,952,500
オートバックスセブン	13,100	3,465.00	45,391,500
アークランドサカモト	6,500	1,540.00	10,010,000
ニトリホールディングス	21,900	7,800.00	170,820,000
グルメ杵屋	8,000	440.00	3,520,000
愛眼	8,900	403.00	3,586,700
吉野家ホールディングス	300	100,400.00	30,120,000
加藤産業	16,000	1,851.00	29,616,000
イノテック	6,700	470.00	3,149,000
イエローハット	10,500	1,033.00	10,846,500
富士エレクトロニクス	6,300	1,160.00	7,308,000
松屋フーズ	5,300	1,497.00	7,934,100
J B C Cホールディングス	9,300	575.00	5,347,500
J Kホールディングス	10,400	374.00	3,889,600
サガミチェーン	13,000	489.00	6,357,000
日伝	4,600	2,710.00	12,466,000
北沢産業	9,500	160.00	1,520,000
杉本商事	6,000	770.00	4,620,000
因幡電機産業	13,000	2,386.00	31,018,000
住金物産	52,000	176.00	9,152,000
ブレナス	13,900	1,260.00	17,514,000
ミニストップ	8,200	1,459.00	11,963,800
アークス	14,200	1,550.00	22,010,000
パロー	22,000	1,333.00	29,326,000
ミスミグループ本社	37,600	1,735.00	65,236,000
江守商事	2,200	867.00	1,907,400
アルテック	5,400	185.00	999,000
ベルク	5,500	1,173.00	6,451,500
大庄	5,200	942.00	4,898,400
タキヒヨー	17,000	445.00	7,565,000
ファーストリテイリング	25,800	13,990.00	360,942,000
ソフトバンク	501,200	2,292.00	1,148,750,400
スズケン	45,800	2,088.00	95,630,400
サンドラッグ	21,000	2,437.00	51,177,000
ジェコス	7,700	331.00	2,548,700
ヤマザワ	2,900	1,365.00	3,958,500
やまや	1,800	778.00	1,400,400
ベルーナ	13,850	670.00	9,279,500
合計	168,662,357		115,071,351,200

株式以外の有価証券

該当事項はありません。

2)信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

3)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

前述の(デリバティブ取引に関する注記)に記載していますので、ここでは省略しております。

[次へ](#)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】(平成23年10月31日現在)

資産総額	29,259,324,838 円
負債総額	20,297,652 円
純資産総額（ - ）	29,239,027,186 円
発行済口数	26,883,181,677 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0876 円

(参考情報)

住信 国内株式インデックス マザーファンド

資産総額	119,774,531,188 円
負債総額	2,180,314,737 円
純資産総額（ - ）	117,594,216,451 円
発行済口数	196,300,863,868 口
1口当たり純資産額（ / ）	0.5991 円

住信 国内債券インデックス マザーファンド

資産総額	179,502,365,267 円
負債総額	1,087,716,981 円
純資産総額（ - ）	178,414,648,286 円
発行済口数	146,211,559,991 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2202 円

住信 外国株式インデックス マザーファンド

資産総額	129,722,885,957 円
負債総額	112,621,477 円
純資産総額（ - ）	129,610,264,480 円
発行済口数	147,915,114,040 口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8762 円

住信 外国債券インデックス マザーファンド

資産総額	210,674,073,078 円
負債総額	81,420,095 円
純資産総額（ - ）	210,592,652,983 円
発行済口数	121,102,114,374 口

1口当たり純資産額 (/)	1.7390 円
-----------------	----------

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(イ) 名義書換

該当事項はありません。

(ロ) 受益者等に対する特典

該当事項はありません。

(ハ) 譲渡制限

該当事項はありません。

(ニ) 振替受益権の取扱い

本ファンドの受益権は、社振法の適用を受けています。

受益証券の不発行

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

なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

受益権の譲渡

- 1) 受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。
- 2) 前記1)の申請のある場合には、前記1)の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、前記1)の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等(当該他の振替機関等の上位機関を含みます。)に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。
- 3) 委託者は、前記1)に規定する振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託者が必要と認めたとときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

受益権の再分割

委託者は、受託者と協議のうえ、社振法に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

償還金

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(償還日以前において一部解約が行われた受益権に係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指定販売会社の名義で記載または記録されている受益権については、原則として取得申込者として)に支払います。

質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金および償還金の支払い等については、投資信託約款の規定に

よるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(イ) 資本金の額

平成23年10月31日現在の資本金の額	3億円
発行可能株式総数	24,000株
発行済株式総数	6,000株
最近5年間にける資本金の額の増減	なし

(ロ) 会社の機構

経営体制

経営の意思決定機関として、取締役会をおきます。3名以上の取締役が、株主総会で選任されます。取締役の選任は、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選任します。取締役の選任については、累積投票にはよりません。

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ときまでとします。増員により、または補欠として選任された取締役の任期は、他の在任取締役の任期の満了するときまでとします。

取締役会は、その決議により、取締役の中から代表取締役若干名を選定します。また、取締役会の決議により、取締役社長1名を置き、必要に応じ取締役会長1名、取締役副社長、専務取締役および常務取締役各若干名を置くことができます。

取締役会は、取締役社長が招集し、その議長となります。取締役社長に事故があるときは、取締役会においてあらかじめ定めた順序により、他の取締役がこれに代わります。取締役会招集の通知は、会日の3日前までに発します。ただし、緊急の場合は、この期間を短縮することができます。

取締役会の決議は、取締役の過半数が出席し、その取締役の過半数をもって行います。

運用体制

[PLAN(計画)]

ファンドの運用基本方針、運用手法、運用プロセス等は、社長を委員長とし、運用担当役員、営業担当役員、投資企画部長、営業企画部長等10名程度で構成される商品委員会において決定されます。

[DO(実行)]

ファンドの運用計画は、商品委員会において決定された運用基本方針、運用手法、運用プロセス、運用ガイドライン等に則り、各運用部において、ファンドマネジャーによって起案され、各運用部長が決定します。ファンドマネジャーは、運用計画に沿って運用の指図を行います。

売買の執行は、運用部署から独立したトレーディング部署が行います。

[CHECK(検証・評価)]

毎月開催される運用委員会において、ファンドのパフォーマンス分析、リスク分析を通じて、運用プロダクトのクオリティーコントロールを行います。

また、ファンドの投資信託約款、運用ガイドライン等の遵守状況の確認、ファンドの運用実績、運用リスクの把握・モニタリングを行う機関として、運用リスク管理委員会を毎月開催します。運用リスク管理委員会は、社長を委員長とし、リスク管理担当役員、運用担当役員、営業担当役員、リスク管理部長、各運用部長等10名程度で構成されます。

また、法令諸規則等遵守状況は、コンプライアンス委員会に報告されます。コンプライアンス委員会は、原則として毎月開催され、社長を委員長とし、リスク管理担当役員、運用担当役員、営業担当役員、リスク管理部長、各運用部長、各営業部長等15名程度で構成されます。

なお、ファンドの運用実績、運用リスクの把握・モニタリング、法令諸規則や投資信託約款等の遵守状況

の確認は、運用部署から独立したリスク管理部が行います。（5名程度）
会社の機構は本書提出日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

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者は、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等の関連する業務を行っています。

平成23年10月31日現在、委託者が運用の指図を行っている証券投資信託は次のとおりです（ただし、親投資信託を除きます。）。

	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
追加型株式投資信託	154	1,295,527
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	0	0
単位型公社債投資信託	0	0
合計	154	1,295,527

3【委託会社等の経理状況】

(イ) 委託者の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という。）第2条に基づき、同規則及び「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）により作成しております。

なお、前事業年度（自平成21年4月1日至平成22年3月31日）は、改正前の財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」に基づき、当事業年度（自平成22年4月1日至平成23年3月31日）は、改正後の財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」に基づいて作成しております。また、財務諸表の金額については、千円未満の端数を切り捨てて記載しております。

(ロ) 委託者は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、前事業年度（自平成21年4月1日至平成22年3月31日）の財務諸表については、あずさ監査法人により監査を受け、また、当事業年度（自平成22年4月1日至平成23年3月31日）の財務諸表については、有限責任あずさ監査法人により監査を受けております。

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

(1)【貸借対照表】

（単位：千円）

	前事業年度 (平成22年3月31日現在)		当事業年度 (平成23年3月31日現在)	
資産の部				
流動資産				
現金及び預金	2	5,642,056	2	6,223,302
前払金		6,819		-
前払費用		35,081		34,720
未収委託者報酬		942,664		953,916

未収運用受託報酬		48,083		42,516
繰延税金資産		44,119		50,152
その他		129		34
流動資産合計		6,718,954		7,304,641
固定資産				
有形固定資産				
建物		49,765		38,802
器具備品		26,485		27,919
有形固定資産合計	1	76,250	1	66,721
無形固定資産				
ソフトウェア		95,682		91,774
その他無形固定資産		126		1,415
無形固定資産合計		95,808		93,189
投資その他の資産				
投資有価証券		245,516		239,090
敷金・保証金		238,033		228,451
長期前払費用		449		409
繰延税金資産		55,356		80,017
その他の投資		225		195
投資その他の資産合計		539,579		548,164
固定資産合計		711,639		708,076
資産合計		7,430,593		8,012,717

(単位：千円)

	前事業年度 (平成22年3月31日現在)	当事業年度 (平成23年3月31日現在)
負債の部		
流動負債		
預り金	16,838	18,485
未払金	520,453	495,343
未払収益分配金	130	130
未払手数料	2 454,590	2 452,781
その他未払金	65,733	42,432
未払費用	2 126,959	2 135,706
未払法人税等	174,433	220,711
未払消費税等	11,758	25,316
賞与引当金	70,599	79,835

流動負債合計	921,042	975,399
固定負債		
退職給付引当金	122,901	171,115
固定負債合計	122,901	171,115
負債合計	1,043,943	1,146,514
純資産の部		
株主資本		
資本金	300,000	300,000
利益剰余金		
利益準備金	50,500	53,500
その他利益剰余金		
別途積立金	5,100,000	5,100,000
繰越利益剰余金	942,449	1,421,205
利益剰余金合計	6,092,949	6,574,705
株主資本合計	6,392,949	6,874,705
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	6,299	8,501
評価・換算差額等合計	6,299	8,501
純資産合計	6,386,650	6,866,203
負債・純資産合計	7,430,593	8,012,717

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	当事業年度 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	8,637,673	8,619,288
運用受託報酬	108,227	126,038
営業収益合計	8,745,901	8,745,326
営業費用		
支払手数料	1 4,414,750	1 4,301,606
広告宣伝費	123,104	67,247
公告費	2,520	2,744
受益証券発行費	95	-
調査費	835,300	898,998
調査費	85,751	87,937

委託調査費	747,629	809,173
図書費	1,918	1,887
営業雑経費	650,397	640,623
通信費	10,735	11,303
印刷費	164,695	152,354
協会費	9,726	10,102
諸会費	594	594
情報機器関連費	429,265	433,365
その他営業雑経費	35,380	32,903
営業費用合計	6,026,169	5,911,221
一般管理費		
給料	1,313,847	1,315,974
役員報酬	34,470	38,295
給料・手当	1,098,871	1,062,048
賞与	180,505	215,631
退職給付費用	52,327	63,772
役員退職慰労金	1,980	-
福利費	148,136	156,648
交際費	1,771	1,350
旅費交通費	43,688	31,880
租税公課	17,962	17,981
不動産賃借料	238,033	238,033
寄付金	3,745	7,972
減価償却費	58,878	57,385
敷金償却	-	2,804
諸経費	101,459	91,394
一般管理費合計	1,981,829	1,985,197
営業利益	737,901	848,907

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	当事業年度 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	1,046	1,280
有価証券利息	257	-
受取利息	1 6,564	1 14,783
投資有価証券売却益	1,179	756
その他	3,344	1,877

営業外収益合計		12,393	18,697
営業外費用			
投資有価証券売却損		12,836	480
固定資産除却損	2	1,136	-
その他		820	242
営業外費用合計		14,794	722
経常利益		735,501	866,883
特別損失			
資産除去債務会計基準 の適用に伴う影響額		-	6,776
特別損失合計		-	6,776
税引前当期純利益		735,501	860,106
法人税、住民税及び事業税		333,431	377,534
法人税等調整額		30,837	29,183
法人税等合計		302,594	348,350
当期純利益		432,906	511,755

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)
株主資本		
資本金		
前期末残高	300,000	300,000
当期変動額		
当期変動額合計	-	-
当期末残高	300,000	300,000
利益剰余金		
利益準備金		
前期末残高	47,500	50,500
当期変動額		
剰余金の配当に伴う積立	3,000	3,000
当期変動額合計	3,000	3,000
当期末残高	50,500	53,500
その他利益剰余金		
別途積立金		
前期末残高	4,100,000	5,100,000

当期変動額		
別途積立金の積立	1,000,000	-
当期変動額合計	1,000,000	-
当期末残高	5,100,000	5,100,000
繰越利益剰余金		
前期末残高	1,542,542	942,449
当期変動額		
剰余金の配当	33,000	33,000
当期純利益	432,906	511,755
別途積立金の積立	1,000,000	-
当期変動額合計	600,093	478,755
当期末残高	942,449	1,421,205
利益剰余金合計		
前期末残高	5,690,042	6,092,949
当期変動額		
剰余金の配当	30,000	30,000
当期純利益	432,906	511,755
当期変動額合計	402,906	481,755
当期末残高	6,092,949	6,574,705
株主資本合計		
前期末残高	5,990,042	6,392,949
当期変動額		
剰余金の配当	30,000	30,000
当期純利益	432,906	511,755
当期変動額合計	402,906	481,755
当期末残高	6,392,949	6,874,705

(単位：千円)

	前事業年度 (自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	当事業年度 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日)
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金		
前期末残高	24,962	6,299
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	18,662	2,202
当期変動額合計	18,662	2,202
当期末残高	6,299	8,501

評価・換算差額等合計

前期末残高	24,962	6,299
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	18,662	2,202
当期変動額合計	18,662	2,202
当期末残高	6,299	8,501
純資産合計		
前期末残高	5,965,080	6,386,650
当期変動額		
剰余金の配当	30,000	30,000
当期純利益	432,906	511,755
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	18,662	2,202
当期変動額合計	421,569	479,553
当期末残高	6,386,650	6,866,203

重要な会計方針

項目	期別 前事業年度 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)	当事業年度 (自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日)
1 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>其他有価証券 時価のあるもの</p> <p>決算末日の市場価格等に基づく時価法によっております。(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してあります。)</p> <p>時価のないもの</p> <p>移動平均法による原価法によっております。</p>	<p>其他有価証券 時価のあるもの</p> <p>同 左</p> <p>時価のないもの</p> <p>同 左</p>
2 固定資産の減価償却の方法	<p>有形固定資産 定率法によっております。</p> <p>無形固定資産 定額法によっております。</p> <p>ただし、ソフトウェア(自社利用分)については、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>	<p>有形固定資産 同 左</p> <p>無形固定資産 同 左</p>
3 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金</p> <p>従業員の賞与の支給に備えるため、支給見込額に基づき計上してあります。</p> <p>(2) 退職給付引当金</p> <p>従業員の退職に伴う退職金の支給に備えるため、当期末における簡便法による退職給付債務の見込額に基づき、当期末において発生していると認められる額を計上してあります。</p>	<p>(1) 賞与引当金 同 左</p> <p>(2) 退職給付引当金 同 左</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	消費税等の会計処理 消費税及び地方消費税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

前事業年度 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)	当事業年度 (自 平成22年4月 1日 至 平成23年3月31日)
-	資産除去債務に関する会計基準等の適用 当事業年度より、「資産除去債務に関する会計基準」（企業会計基準第18号 平成20年3月31日）及び「資産除去債務に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第21号 平成20年3月31日）を適用しております。 これにより、当事業年度の営業利益及び経常利益が2,804千円減少し、税引前当期純利益が9,581千円減少しております。

注記事項

（貸借対照表関係）

前事業年度 (平成22年3月31日現在)	当事業年度 (平成23年3月31日現在)
1 有形固定資産の減価償却累計額 建 物 38,352千円 器具備品 96,447千円 計 134,799千円	1 有形固定資産の減価償却累計額 建 物 49,316千円 器具備品 113,320千円 計 162,636千円
2 関係会社に対するものは次のとおりであります。 預金 3,498,856千円 未払手数料 353,462千円 未払費用 119,557千円	2 関係会社に対するものは次のとおりであります。 預金 3,477,508千円 未払手数料 333,570千円 未払費用 123,687千円

（損益計算書関係）

前事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	当事業年度 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)
1 関係会社に対するものは次のとおりであります。 支払手数料 4,065,257千円 受取利息 1,030千円	1 関係会社に対するものは次のとおりであります。 支払手数料 3,761,890千円 受取利息 6,579千円
2 固定資産除却損の内容は、次のとおりであります。 器具備品 1,136千円	

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数

株式の種類	前事業年度末	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	6,000	-	-	6,000

2. 自己株式の種類及び株式数

該当事項はありません。

3. 当事業年度中に行った剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の総額 （千円）	1株当たり 配当額 （円）	基準日	効力発生日
平成21年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	5,000	平成21年3月31日	平成21年6月29日

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

決議	株式の種類	配当金の総額 （千円）	配当金の 原資	1株当たり 配当額 （円）	基準日	効力発生日
平成22年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益剰余金	5,000	平成22年3月31日	平成22年6月29日

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数

株式の種類	前事業年度末	当事業年度増加	当事業年度減少	当事業年度末
普通株式（株）	6,000	-	-	6,000

2. 自己株式の種類及び株式数

該当事項はありません。

3. 当事業年度中に行った剰余金の配当に関する事項

決議	株式の種類	配当金の総額 （千円）	1株当たり 配当額 （円）	基準日	効力発生日
平成22年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	5,000	平成22年3月31日	平成22年6月29日

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

平成23年6月29日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次の通り提案しております。

- | | |
|--------------|------------|
| (1) 配当金の総額 | 30,000千円 |
| (2) 配当金の原資 | 利益剰余金 |
| (3) 1株当たり配当額 | 5,000円 |
| (4) 基準日 | 平成23年3月31日 |
| (5) 効力発生日 | 平成23年6月29日 |

（リ - ス取引関係）

前事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	当事業年度 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)
該当事項はありません。	同左

（金融商品関係）

前事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

（追加情報）

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

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、資金運用については短期的な預金を中心とする安全性の高い金融資産で運用し、必要な資金については内部留保を充てております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクはきわめて低いものと考えております。また、投資有価証券は非上場株式と投資信託であり、投資信託については四半期ごとに時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク（取引先の契約不履行に係るリスク）の管理

売上債権の管理については、社内規程を定め、随時確認を行うなどの管理を行っております。なお、未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスクはきわめて低いものと考えております。

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

有価証券投資については、社内ガイドラインにて投資限度額や運用ルール（処分基準）を定めており、投資後も適宜時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

当社は、年度事業計画を策定し、これに基づいて必要となる資金を検討し、充足する十分な手元流動性を維持することで、流動性リスクを管理しております。

2. 金融商品の時価に関する事項

平成22年3月31日（当社の決算日）における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません（（注2）を参照ください）。

（単位：千円）

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額

(1)現金及び預金	5,642,056	5,642,056	-
(2)未収委託者報酬	942,664	942,664	-
(3)投資有価証券 其他有価証券	46,016	46,016	-
(4)未払金	(520,453)	(520,453)	-

(*)負債に計上されているものについては、()で示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法及び有価証券取引に関する事項

(1)現金及び預金、及び(2)未収委託者報酬

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

(3)投資有価証券

これらの時価について、投資信託は取引金融機関から提示された価格によっております。

(4)未払金

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

(注2) 非上場株式(貸借対照表計上額199,500千円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(3)投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

(注3) 金銭債権の決算日後の償還予定額

(単位:千円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	5,642,056	-	-	-
未収委託者報酬	942,664	-	-	-

当事業年度(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、資金運用については短期的な預金を中心とする安全性の高い金融資産で運用し、必要な資金については内部留保を充てております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク

未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスク及び流動性リスクはきわめて低いものと考えております。また、投資有価証券は非上場株式と投資信託であり、投資信託については四半期ごとに時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。

未払金については、全て1年以内の支払期日であります。

(3) 金融商品に係るリスク管理体制

信用リスク(取引先の契約不履行に係るリスク)の管理

売上債権の管理については、社内規程を定め、随時確認を行うなどの管理を行っております。なお、未収委託者報酬については、ファンドという相手方の性質上、信用リスクはきわめて低いものと考えております。

市場リスク（為替や金利等の変動リスク）の管理

有価証券投資については、社内ガイドラインにて投資限度額や運用ルール（処分基準）を定めており、投資後も適宜時価を把握し、保有状況を継続的に見直しております。

資金調達に係る流動性リスク（支払期日に支払を実行できなくなるリスク）の管理

当社は、年度事業計画を策定し、これに基づいて必要となる資金を検討し、充足する十分な手元流動性を維持することで、流動性リスクを管理しております。

2. 金融商品の時価に関する事項

平成23年3月31日（当社の決算日）における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません（（注2）を参照ください）。

（単位：千円）

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金及び預金	6,223,302	6,223,302	-
(2)未収委託者報酬	953,916	953,916	-
(3)投資有価証券 其他有価証券	39,590	39,590	-
(4)未払金	(495,343)	(495,343)	-

(*)負債に計上されているものについては、()で示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法及び有価証券取引に関する事項

(1)現金及び預金、及び(2)未収委託者報酬

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

(3)投資有価証券

これらの時価について、投資信託は取引金融機関から提示された価格によっております。

(4)未払金

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

(注2) 非上場株式（貸借対照表計上額199,500千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(3)投資有価証券 其他有価証券」には含めておりません。

(注3) 金銭債権の決算日後の償還予定額

（単位：千円）

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	6,223,302	-	-	-
未収委託者報酬	953,916	-	-	-

(有価証券関係)

前事業年度（平成22年3月31日現在）

1. その他有価証券

（単位:千円）

区分	取得原価	貸借対照表 計上額	差額
貸借対照表計上額が取得原価 を超えるもの			
その他	5,362	6,387	1,025
小計	5,362	6,387	1,025
貸借対照表計上額が取得原価 を超えないもの			
その他	51,275	39,628	11,646
小計	51,275	39,628	11,646
計	56,637	46,016	10,621

（注）非上場株式（貸借対照表計上額 199,500千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

2. 当事業年度中に売却したその他有価証券（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

（単位:千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
74,035	1,179	12,836

当事業年度（平成23年3月31日現在）

1. その他有価証券

（単位:千円）

区分	取得原価	貸借対照表 計上額	差額
貸借対照表計上額が取得原価 を超えるもの			
その他	3,000	3,075	75
小計	3,000	3,075	75
貸借対照表計上額が取得原価 を超えないもの			
その他	50,925	36,515	14,409
小計	50,925	36,515	14,409
計	53,925	39,590	14,334

（注）非上場株式（貸借対照表計上額 199,500千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

2. 当事業年度中に売却したその他有価証券（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

（単位:千円）

売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
7,639	756	480

（デリバティブ取引関係）

前事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

当社はデリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23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）

前事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	当事業年度 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)												
<p>1. 採用している退職給付制度の概要</p> <p>当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、また、確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を採用しております。</p> <p>2. 退職給付債務及びその他に関する事項</p> <table> <tr> <td>退職給付債務</td> <td>122,901千円</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td>122,901千円</td> </tr> </table> <p>(1) 当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。</p> <p>(2) 当社の退職給付債務は退職一時金のみです。</p> <p>3. 退職給付費用に関する事項</p> <table> <tr> <td>退職給付費用</td> <td>52,327千円</td> </tr> </table> <p>(1) 当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。</p> <p>(2) 金額には確定拠出年金への掛金支払額13,326千円を含んでおります。</p> <p>4. 退職給付債務等の計算基礎</p> <p>当社は簡便法を採用しておりますので、基礎率等については、記載しておりません。</p>	退職給付債務	122,901千円	退職給付引当金	122,901千円	退職給付費用	52,327千円	<p>1. 採用している退職給付制度の概要</p> <p>同左</p> <p>2. 退職給付債務及びその他に関する事項</p> <table> <tr> <td>退職給付債務</td> <td>171,115千円</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td>171,115千円</td> </tr> </table> <p>(1) 同左</p> <p>(2) 同左</p> <p>3. 退職給付費用に関する事項</p> <table> <tr> <td>退職給付費用</td> <td>63,772千円</td> </tr> </table> <p>(1) 同左</p> <p>(2) 金額には確定拠出年金への掛金支払額13,307千円を含んでおります。</p> <p>4. 退職給付債務等の計算基礎</p> <p>同左</p>	退職給付債務	171,115千円	退職給付引当金	171,115千円	退職給付費用	63,772千円
退職給付債務	122,901千円												
退職給付引当金	122,901千円												
退職給付費用	52,327千円												
退職給付債務	171,115千円												
退職給付引当金	171,115千円												
退職給付費用	63,772千円												

（税効果会計関係）

前事業年度 (平成22年3月31日現在)	当事業年度 (平成23年3月31日現在)								
<p>1. 繰延税金資産の発生的主要原因別の内訳</p> <p>(繰延税金資産)</p> <table> <tr> <td>未払事業税</td> <td>15,392千円</td> </tr> <tr> <td>賞与引当金損金算入限度超過額</td> <td>28,726千円</td> </tr> </table>	未払事業税	15,392千円	賞与引当金損金算入限度超過額	28,726千円	<p>1. 繰延税金資産の発生的主要原因別の内訳</p> <p>(繰延税金資産)</p> <table> <tr> <td>未払事業税</td> <td>17,667千円</td> </tr> <tr> <td>賞与引当金損金算入限度超過額</td> <td>32,484千円</td> </tr> </table>	未払事業税	17,667千円	賞与引当金損金算入限度超過額	32,484千円
未払事業税	15,392千円								
賞与引当金損金算入限度超過額	28,726千円								
未払事業税	17,667千円								
賞与引当金損金算入限度超過額	32,484千円								

退職給付引当金損金算入限度超過額	50,008千円	退職給付引当金損金算入限度超過額	69,626千円
有価証券評価差額	4,321千円	有価証券評価差額	5,832千円
その他	1,025千円	その他	4,558千円
繰延税金資産 合計	99,475千円	繰延税金資産 合計	130,169千円
2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳		2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳	
法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。		同左	

(持分法損益等)

前事業年度 (平成22年3月31日現在)	当事業年度 (平成23年3月31日現在)
該当事項はありません。	同左

(セグメント情報等)

(セグメント情報)

前事業年度(自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)

当社は資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

当事業年度(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

当社は資産運用に関する事業の単一セグメントであるため記載を省略しております。

(関連情報)

当事業年度(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

1. 製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1) 売上高

内国籍投資信託又は本邦顧客からの営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

(報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報)

当事業年度(自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)

該当事項はありません。

（報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報）

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

該当事項はありません。

（報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報）

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

該当事項はありません。

（追加情報）

当事業年度より、「セグメント情報等の開示に関する会計基準」（企業会計基準第17号 平成21年3月27日）及び「セグメント情報の開示に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第20号 平成20年3月21日）を適用しております。

（関連当事者情報）

前事業年度（自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日）

1 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金(百万円)	事業の内容又は職業	議決権等の被所有割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
親会社	住友信託銀行(株)	大阪市中央区	342,037	信託業務及び銀行業務	直接30%, 間接70%	営業上の取引 役員の兼任	投信販売 代行手数料	4,065,257	未払 手数料	353,462
							投資助言費用 の支払	609,879	未払費用	119,557

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

2．取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

（イ）財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

該当事項はありません。

（ウ）財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

該当事項はありません。

（エ）財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

（1）親会社情報

住友信託銀行株式会社（東京証券取引所及び大阪証券取引所に上場）

当事業年度（自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

1 関連当事者との取引

財務諸表提出会社と関連当事者の取引

（ア）財務諸表提出会社の親会社

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金又は出資金 (百万円)	事業の内容 又は職業	議決権等の被所有 割合	関連 当事者 との関係	取引の 内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
親会社	住友信託 銀行(株)	大阪市 中央区	342,037	信託業務 及び銀行 業務	直接30%, 間接70%	営業上の取引 役員の兼任	投信販売 代行手数料	3,761,890	未払 手数料	333,570
							投資助言費用 の支払	692,451	未払費用	123,687

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

2．取引条件及び取引条件の決定方針等

投信販売代行手数料

ファンド毎の手数料率については、一般取引先に対する取引条件と同様に決定されております。

投資助言費用

各助言案件について、それぞれ合理的な水準にて助言料率を決定しております。

（イ）財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

該当事項はありません。

（ウ）財務諸表提出会社と同一の親会社を持つ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

該当事項はありません。

（エ）財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

該当事項はありません。

2 親会社又は重要な関連会社に関する注記

（1）親会社情報

住友信託銀行株式会社（非上場）

（1株当たり情報）

前事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)		当事業年度 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)	
1株当たり純資産額	1,064,441円67銭	1株当たり純資産額	1,144,367円30銭
1株当たり当期純利益	72,151円14銭	1株当たり当期純利益	85,292円63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。		同左	

（注）1株当たり当期純利益の算定上の基礎は、以下の通りであります。

	前事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	当事業年度 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)
当期純利益	432,906千円	511,755千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	432,906千円	511,755千円
期中平均株式数	6,000株	6,000株

（重要な後発事象）

前事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)	当事業年度 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日)
該当事項はありません。	同左

4【利害関係人との取引制限】

委託者は、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、委託者の親法人等（委託者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（ニ）および（ホ）において同じ。）または子法人等（委託者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）委託者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）前記（ハ）および（ニ）に掲げるもののほか、委託者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）委託者の定款の変更
委託者の定款の変更に関しては、株主総会において株主の決議が必要です。
- （ロ）訴訟事件その他の重要事項

本書提出日現在、委託者および本ファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

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】

住友信託銀行株式会社（受託者および指定販売会社）

1) 資本金の額

平成23年3月末日現在 342,037百万円

2) 事業の内容

銀行法にもと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（兼営法）にもとづき信託業務を営んでいます。

株式会社愛媛銀行（指定販売会社）

1) 資本金の額

平成23年3月末日現在 19,078百万円

2) 事業の内容

銀行法にもとづき銀行業を営んでいます。

岡三証券株式会社（指定販売会社）

1) 資本金の額

平成23年3月末日現在 5,000百万円

2) 事業の内容

金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

株式会社紀陽銀行（指定販売会社）

1) 資本金の額

平成23年3月末日現在 80,096百万円

2) 事業の内容

銀行法にもとづき銀行業を営んでいます。

三井住友海上火災保険株式会社（指定販売会社）

1) 資本金の額

平成23年3月末日現在 139,595百万円

2) 事業の内容

保険業法にもとづき損害保険業を営んでいます。

第一生命保険株式会社（指定販売会社）

1) 資本金の額

平成23年3月末日現在 210,200百万円

2) 事業の内容

保険業法にもとづき生命保険業を営んでいます。

株式会社みずほコーポレート銀行（指定販売会社）

1) 資本金の額

平成23年3月末日現在 1,404,065百万円

2) 事業の内容

銀行法にもとづき、銀行業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

（イ）受託者は、以下の業務を行います。

投資信託財産の保管・管理

投資信託財産の計算

投資信託財産に関する報告書の作成

その他前記の業務に付随する業務

(ロ) 指定販売会社は、以下の業務を行います。

受益権の募集・販売の取扱い

追加設定の申込受付事務

受益者に対する収益分配金の再投資事務

受益者に対する一部解約等の事務

受益者に対する一部解約金および償還金の支払事務

受益者に対する運用報告書の交付

その他前記の業務に付随する業務

指定販売会社によって引き受ける業務が異なる場合があります。

3【資本関係】

受託者および指定販売会社である住友信託銀行株式会社は、委託者である住信アセットマネジメント株式会社の株式を1,800株保有しております。（発行済株式総数に対する比率は30%です。）

その他の前記関係法人と委託者との間に資本関係はありません。

<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

設立年月日：平成12年6月20日

資本金の額：51,000百万円（平成23年3月末日現在）

業務の概要：銀行法にもと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もとづき信託業務を営んでいます。

第3【参考情報】

本ファンドについては、当該計算期間において次の書類を提出しています。

提出年月日	書類名
平成22年12月15日	有価証券報告書
平成22年12月15日	有価証券届出書
平成23年6月21日	半期報告書
平成23年6月21日	有価証券届出書の訂正届出書

独立監査人の監査報告書

平成23年10月28日

住信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 石井 勝也

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 すみしん DCマイセレクション50の平成22年10月1日から平成23年9月30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、すみしん DCマイセレクション50の平成23年9月30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。

住信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

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

[委託会社の監査報告書（当期）へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成23年6月27日

住信アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 羽 太 典 明 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 石 井 勝 也 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理の状況」に掲げられている住信アセットマネジメント株式会社の平成22年4月1日から平成23年3月31日までの第25期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、住信アセットマネジメント株式会社の平成23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22年11月12日

住信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 石井 勝也

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 すみしん DCマイセレクション50の平成21年10月1日から平成22年9月30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、すみしん DCマイセレクション50の平成22年9月30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。

住信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

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

[委託会社の監査報告書（前期）へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成22年6月29日

住信アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

あずさ監査法人

指定社員
業務執行社員 公認会計士 壁谷 恵嗣 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理の状況」に掲げられている住信アセットマネジメント株式会社の平成21年4月1日から平成22年3月31日までの第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、住信アセットマネジメント株式会社の平成22年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以上

上記は、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。