

【表紙】	
【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成22年12月15日提出
【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
【電話番号】	03-6259-3801
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	すみしん DCマイセレクション75
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	上限3,000億円
【縦覧に供する場所】	該当ありません。

第一部【証券情報】**(1)【ファンドの名称】**

すみしん DCマイセレクション75

（以下「本ファンド」または「当ファンド」ということがあります。）

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の振替内国投資信託受益権（以下「受益権」といいます。）です。

本ファンドは、格付は取得していません。

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

(3)【発行（売出）価額の総額】

3,000億円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額 とします。

「基準価額」とは、ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額（純資産総額）をそのときの受益権総口数で除した1口当たりの純資産価額をいいます。基準価額は、組み入れる有価証券等の値動きにより、日々変動します。なお、基準価額は、翌日の日本経済新聞に掲載されます（表示は1万口当たりに換算した価額で行われます。）。また、委託者、指定販売会社（委託者の指定する金融商品取引法第28条第1項に規定する第一種金融商品取引業を行う者および委託者の指定する金融商品取引法第2条第11項に規定する登録金融機関をいいます。以下同じ。）で入手できますので、委託者、指定販売会社（以下「販売会社」ということがあります。）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。）

(5)【申込手数料】

ありません。

(6)【申込単位】

1円以上1円単位

(7)【申込期間】

継続募集期間

平成22年12月16日から平成23年12月15日まで

継続募集を行う期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を関東財務局長に提出することによって更新されます。

(8)【申込取扱場所】

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「(4)発行（売出）価格」に記載されている先と同じです。

(9)【払込期日】

取得申込者は、取得申込みに係る金額を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、各取得申込受付日の発行価額の総額は、追加信託が行われる日に住信アセットマネジメント株式会社（以下「委託者」または「委託会社」ということがあります。）の指定する口座を経由して、住友信託銀行株式会社（以下「受託者」または「受託会社」ということがあります。）の指定するファンド口座に払い込まれます。

(10)【払込取扱場所】

申込みの指定販売会社とします。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「(4)発行（売出）価格」に記載されている先と同じです。

(11)【振替機関に関する事項】

本ファンドの受益権に係る振替機関は、下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12)【その他】

振替受益権について

本ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、前記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業に係る業務規程等の規則にしたがって取り扱われるものとし、

本ファンドの分配金、償還金、換金代金は、社振法および前記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

投資信託振替制度においては、ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステムの帳簿（振替口座簿）への記載・記録によって行われますので、やむを得ない事情等がある場合を除き、受益証券は発行されません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

1. 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。



マザーファンドの運用にあたっては、企業年金の運用等で国内外から定評のある住友信託銀行からモデルポートフォリオの提示等の投資助言を受けます。

? 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。

2. 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株式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。

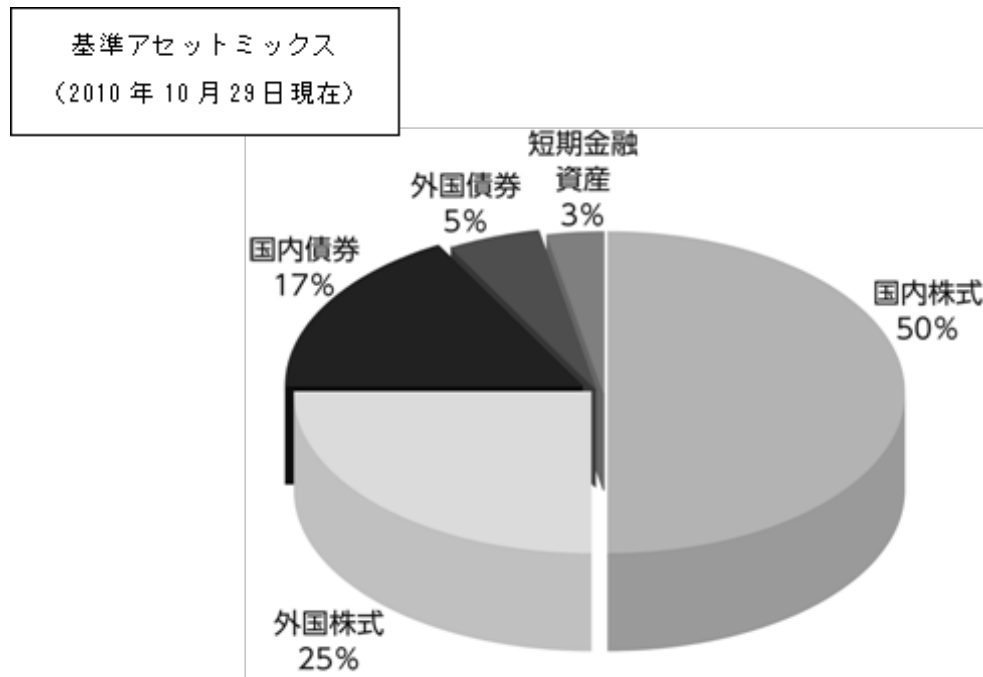
4 「シティグループ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）」とは、シティグループ・グローバル・マーケッツ・インク（CGMI社）が開発した日本を除く世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均した債券インデックス（円ベースの指数）です。

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50%、外国株式25%、国内債券17%、外国債券5%、短期金融資産3%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。



4. 毎決算時に分配を行います。

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85%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40%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、上記のような運用ができない場合があります。

[ファンドの商品分類]

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きましては、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 ()
	年2回	日本		
	年4回	北米		
	年6回 (隔月)	欧州		
	年12回 (毎月)	アジア オセアニア		
	日々	中近東 (中東)		
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	その他 ()	エマージング	ファンド・オブ・ファンズ	なし
不動産投信				
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)))				
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型				

(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(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

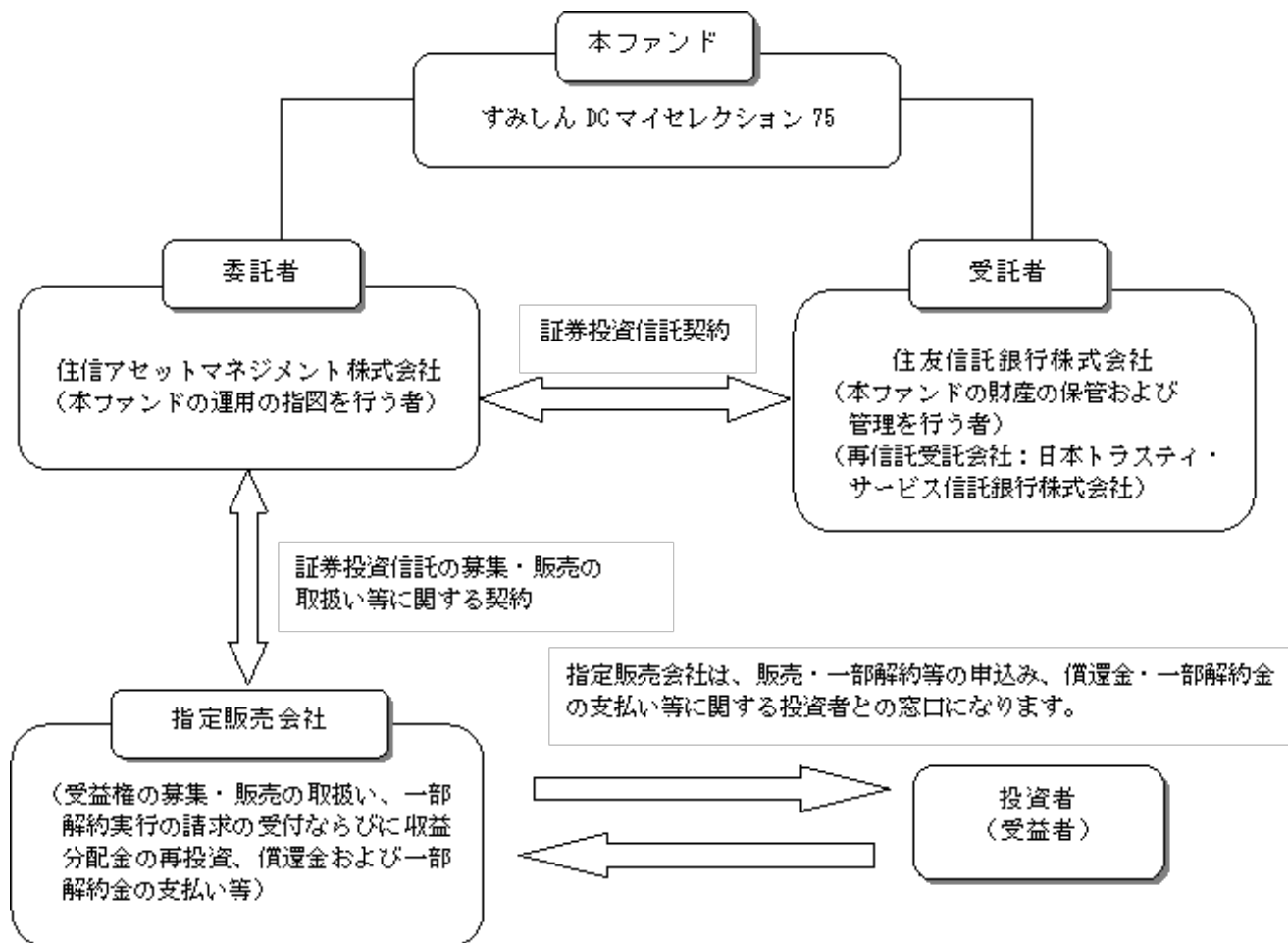
本ファンドの主要投資対象である「住信 国内株式インデックス マザーファンド」、「住信 国内債券インデックス マザーファンド」、「住信 外国株式インデックス マザーファンド」および「住信 外国債券インデックス マザーファンド」の投資信託契約締結、設定、運用開始

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22年10月29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22年10月29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 マザーファンド受益証券」、「住信 国内債券インデックス マザーファンド受益証券」、「住信 外国株式インデックス マザーファンド受益証券」、「住信 外国債券インデックス マザーファンド受益証券」（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50%、国内債券17%、外国株式25%、外国債券5%および短期金融資産3%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、金利先渡取引および為替先渡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、）

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券

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. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
 22. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 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。

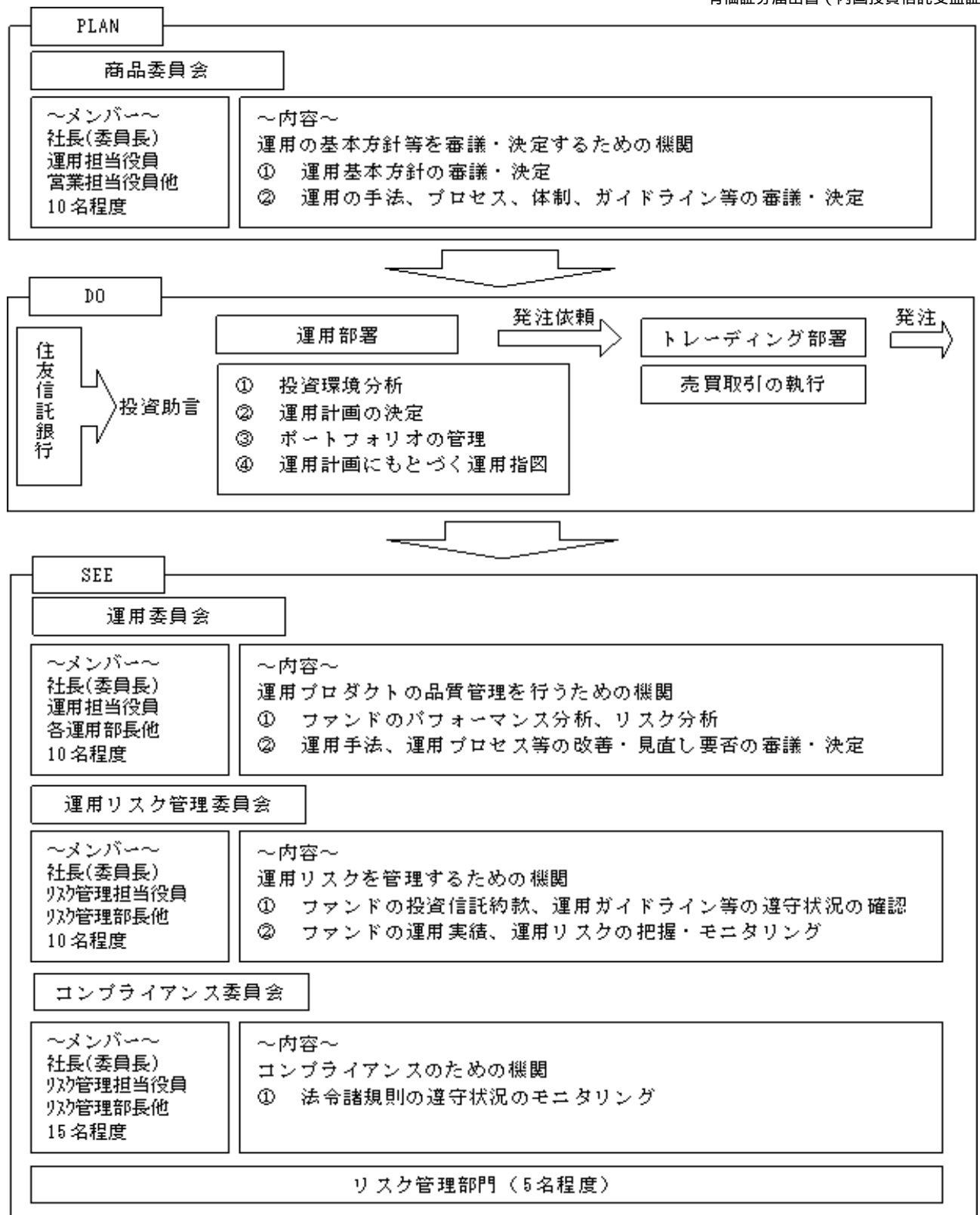
(八) 委託者は、信託金を、前記(ロ)に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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85%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40%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ます。（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、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ます。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償還金の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 、 、 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】

(1)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、投資元本が保証されているものではなく、これを割り込むことがあります。本ファンドの運用による損益は、すべて本ファンドの受益者に帰属します。

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。

4)インデックスと乖離するリスク

本ファンドは、各投資対象資産ごとに各々のインデックスの値動きに連動することを目指しますが、本ファンドへの入出金、組入比率、本ファンドの銘柄ごとの組入比率と指数の構成銘柄比率に差異が生ずること、売買コストや信託報酬等の影響などから、各インデックスと連動しないことがあります。

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場合があります。
- 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。

(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みます。）。
- ・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0.3360% (税抜 0.32%)	純資産総額に対して 年率0.1785% (税抜 0.17%)	純資産総額に対して 年率0.1260% (税抜 0.12%)	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22年10月29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	7,769,662,163	48.50
住信 国内債券インデックス マザーファンド	日本	2,839,223,799	17.72
住信 外国株式インデックス マザーファンド	日本	4,152,303,976	25.92
住信 外国債券インデックス マザーファンド	日本	746,909,730	4.66
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		511,776,121	3.19
合計(純資産総額)		16,019,875,789	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22年10月29日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	121,928,167,460	97.66
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		2,922,468,545	2.34
合計(純資産総額)		124,850,636,005	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22年10月29日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	119,556,410,500	74.11
	ポーランド	99,512,000	0.06
	小計	119,655,922,500	74.17
地方債証券	日本	10,263,403,876	6.36
特殊債券	日本	16,817,375,284	10.42
社債券	日本	12,173,158,350	7.55
	アメリカ	809,030,000	0.50
	オーストラリア	305,556,000	0.19
	オランダ	103,354,000	0.06
	イギリス	100,681,000	0.06
	小計	13,491,779,350	8.36

現金・預金・その他の資産(負債控除後)	1,092,022,006	0.68
合計(純資産総額)	161,320,503,016	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22年10月29日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	58,969,634,945	49.24
	イギリス	11,443,412,669	9.55
	カナダ	6,323,560,351	5.28
	フランス	5,652,277,272	4.72
	スイス	5,114,024,857	4.27
	ドイツ	4,886,864,201	4.08
	オーストラリア	4,714,410,425	3.94
	オランダ	2,736,634,999	2.29
	スペイン	2,253,716,198	1.88
	スウェーデン	1,784,304,771	1.49
	イタリア	1,694,042,199	1.41
	香港	1,259,983,773	1.05
	シンガポール	904,479,244	0.76
	フィンランド	680,775,755	0.57
	アイルランド	651,799,987	0.54
	バミューダ	611,952,855	0.51
	デンマーク	604,509,489	0.50
	ベルギー	581,176,501	0.49
	アンティル	528,929,555	0.44
	イスラエル	470,352,705	0.39
	ノルウェー	429,771,312	0.36
	ルクセンブルグ	291,051,606	0.24
	オーストリア	201,596,015	0.17
	ポルトガル	170,469,931	0.14
	ギリシャ	164,963,895	0.14
	ジャージー	80,169,799	0.07
	ケイマン島	73,952,098	0.06
ニュージーランド	60,830,166	0.05	
マン島	56,249,424	0.05	
ガーンジー	33,660,094	0.03	

	リベリア	30,980,266	0.03
	モーリシャス	19,098,999	0.02
	キプロス	17,767,966	0.01
	小計	113,497,404,322	94.77
投資信託受益証券	カナダ	159,255,967	0.13
	パナマ	110,820,402	0.09
	小計	270,076,369	0.23
投資証券	アメリカ	1,046,865,811	0.87
	オーストラリア	333,228,285	0.28
	フランス	171,423,191	0.14
	イギリス	148,079,070	0.12
	香港	38,113,306	0.03
	シンガポール	32,144,308	0.03
	オランダ	24,402,019	0.02
	カナダ	15,182,699	0.01
	小計	1,809,438,689	1.51
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		4,186,957,521	3.50
合計(純資産総額)		119,763,876,901	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22年10月29日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	96,063,626,460	39.10
	イタリア	24,860,107,065	10.12
	ドイツ	23,981,338,991	9.76
	フランス	23,352,300,730	9.50
	イギリス	18,639,635,908	7.59
	スペイン	10,494,195,087	4.27
	カナダ	6,543,696,458	2.66
	ベルギー	6,538,584,948	2.66
	オランダ	6,104,317,432	2.48
	オーストリア	4,369,662,578	1.78
	ポルトガル	2,368,699,881	0.96
	メキシコ	2,281,661,359	0.93
	デンマーク	2,272,248,661	0.92
	ポーランド	2,244,158,073	0.91

	アイルランド	2,224,292,873	0.91
	スウェーデン	1,599,971,355	0.65
	フィンランド	1,447,055,387	0.59
	スイス	1,241,354,873	0.51
	マレーシア	1,236,769,340	0.50
	シンガポール	903,804,505	0.37
	ノルウェー	631,503,056	0.26
	オーストラリア	503,550,862	0.20
	小計	239,902,535,882	97.64
特殊債券	オーストラリア	1,864,547,990	0.76
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		3,935,287,879	1.60
合計(純資産総額)		245,702,371,751	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22年10月29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 国内株式インデックス マザーファンド	12,499,456,505	0.6354	7,942,922,814	0.6216	7,769,662,163	48.50
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	4,794,808,287	0.8663	4,153,742,420	0.8660	4,152,303,976	25.92
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	2,343,947,659	1.2150	2,847,896,406	1.2113	2,839,223,799	17.72
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	426,951,944	1.8046	770,477,479	1.7494	746,909,730	4.66

(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	96.81
合計	96.81

(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	1,443,800	3,273.32	4,726,019,416	2,859.00	4,127,824,200	3.31
日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	8,394,600	439.76	3,691,616,400	375.00	3,147,975,000	2.52
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	948,200	2,767.02	2,623,689,024	2,937.00	2,784,863,400	2.23
日本	株式	キヤノン	電気機器	698,200	3,738.06	2,609,913,492	3,720.00	2,597,304,000	2.08
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	838,900	2,697.23	2,262,709,500	2,412.00	2,023,426,800	1.62
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	473,500	3,681.88	1,743,370,400	3,655.00	1,730,642,500	1.39
日本	株式	三菱商事	卸売業	888,200	2,045.89	1,817,168,100	1,935.00	1,718,667,000	1.38
日本	株式	ソニー	電気機器	631,000	2,799.60	1,766,550,500	2,690.00	1,697,390,000	1.36
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	440,900	3,796.40	1,673,835,900	3,770.00	1,662,193,000	1.33
日本	株式	東京電力	電気・ガス業	827,300	2,197.47	1,817,971,800	1,925.00	1,592,552,500	1.28
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	13,529,500	154.00	2,083,622,300	117.00	1,582,951,500	1.27
日本	株式	ファナック	電気機器	117,000	9,655.81	1,129,730,600	11,650.00	1,363,050,000	1.09
日本	株式	任天堂	その他製品	64,300	26,724.06	1,718,357,500	20,850.00	1,340,655,000	1.07
日本	株式	パナソニック	電気機器	1,112,800	1,160.35	1,291,244,300	1,183.00	1,316,442,400	1.05
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	491,200	2,194.93	1,078,150,200	2,590.00	1,272,208,000	1.02
日本	株式	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	情報・通信業	9,169	135,302.62	1,240,589,722	135,500.00	1,242,399,500	1.00
日本	株式	三井物産	卸売業	957,400	1,287.86	1,233,000,700	1,265.00	1,211,111,000	0.97
日本	株式	小松製作所	機械	557,700	1,723.87	961,407,000	1,972.00	1,099,784,400	0.88
日本	株式	三菱地所	不動産業	777,000	1,387.94	1,078,433,000	1,410.00	1,095,570,000	0.88
日本	株式	日産自動車	輸送用機器	1,419,800	666.94	946,928,500	710.00	1,008,058,000	0.81
日本	株式	野村ホールディングス	証券、 商品先物取引業	2,337,600	555.98	1,299,660,800	418.00	977,116,800	0.78
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	195,400	5,878.91	1,148,739,014	4,975.00	972,115,000	0.78
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	421,100	2,543.92	1,071,244,712	2,268.00	955,054,800	0.76
日本	株式	関西電力	電気・ガス業	458,600	2,085.01	956,185,674	2,038.00	934,626,800	0.75
日本	株式	日立製作所	電気機器	2,523,000	370.81	935,553,630	364.00	918,372,000	0.74
日本	株式	東芝	電気機器	2,218,000	466.25	1,034,142,500	403.00	893,854,000	0.72
日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	464,000	2,094.19	971,706,940	1,873.00	869,072,000	0.70
日本	株式	三菱電機	電気機器	1,124,000	744.39	836,701,000	755.00	848,620,000	0.68
日本	株式	信越化学工業	化学	196,000	4,560.35	893,829,400	4,075.00	798,700,000	0.64
日本	株式	三井不動産	不動産業	523,000	1,395.78	729,995,000	1,521.00	795,483,000	0.64

(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	97.66
合計	97.66

(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	0.51
		建設業	1.91
		食料品	2.98
		繊維製品	0.87
		パルプ・紙	0.37
		化学	5.73
		医薬品	4.24
		石油・石炭製品	0.80
		ゴム製品	0.60
		ガラス・土石製品	1.17
		鉄鋼	2.28
		非鉄金属	1.31
		金属製品	0.64
		機械	4.65
		電気機器	14.75
		輸送用機器	9.57
		精密機器	1.39
		その他製品	2.07
		電気・ガス業	5.11
		陸運業	3.67
		海運業	0.61
		空運業	0.37
		倉庫・運輸関連業	0.23
		情報・通信業	5.63
		卸売業	5.12
		小売業	3.45
銀行業	8.90		
証券、商品先物取引業	1.39		
保険業	2.43		

	その他金融業	0.69
	不動産業	2.46
	サービス業	1.66
合計		97.66

(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	365	2,999,450,120	2,941,900,000	2,941,900,000	2.36

(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288回利付国債 (10年)	1,970,000,000	106.50	2,098,050,000	108.26	2,132,820,500	1.7	2017/09/20	1.32
日本	国債 証券	第89回利付国債 (5年)	1,900,000,000	100.51	1,909,813,000	100.52	1,909,956,000	0.4	2015/06/20	1.18
日本	国債 証券	第305回利付国債 (10年)	1,820,000,000	100.93	1,836,961,400	104.20	1,896,585,600	1.3	2019/12/20	1.18
日本	国債 証券	第87回利付国債 (5年)	1,840,000,000	100.46	1,848,629,600	101.00	1,858,400,000	0.5	2014/12/20	1.15
日本	国債 証券	第296回利付国債 (10年)	1,730,000,000	104.24	1,803,518,000	106.88	1,849,179,700	1.5	2018/09/20	1.15
日本	国債 証券	第88回利付国債 (5年)	1,700,000,000	100.42	1,707,250,000	100.97	1,716,524,000	0.5	2015/03/20	1.06
日本	国債 証券	第306回利付国債 (10年)	1,580,000,000	101.26	1,599,908,000	104.86	1,656,867,000	1.4	2020/03/20	1.03
日本	国債 証券	第84回利付国債 (5年)	1,610,000,000	101.55	1,635,050,000	101.78	1,638,658,000	0.7	2014/06/20	1.02
日本	国債 証券	第63回利付国債 (5年)	1,590,000,000	101.87	1,619,733,000	101.47	1,613,516,100	1.2	2012/03/20	1.00
日本	国債 証券	第289回利付国債 (10年)	1,500,000,000	104.87	1,573,050,000	106.99	1,604,865,000	1.5	2017/12/20	0.99
日本	国債 証券	第85回利付国債 (5年)	1,570,000,000	101.48	1,593,236,000	101.80	1,598,338,500	0.7	2014/09/20	0.99

日本	国債証券	第284回利付国債 (10年)	1,440,000,000	106.66	1,535,904,000	107.87	1,553,328,000	1.7	2016/12/20	0.96
日本	国債証券	第61回利付国債 (5年)	1,530,000,000	101.63	1,554,939,000	101.22	1,548,666,000	1.2	2011/12/20	0.96
日本	国債証券	第285回利付国債 (10年)	1,430,000,000	106.80	1,527,317,400	108.01	1,544,557,300	1.7	2017/03/20	0.96
日本	国債証券	第235回利付国債 (10年)	1,490,000,000	101.93	1,518,876,200	101.44	1,511,530,500	1.4	2011/12/20	0.94
日本	国債証券	第69回利付国債 (5年)	1,410,000,000	101.80	1,435,380,000	101.61	1,432,701,000	0.9	2012/12/20	0.89
日本	国債証券	第309回利付国債 (10年)	1,400,000,000	100.99	1,413,910,000	101.90	1,426,684,000	1.1	2020/06/20	0.88
日本	国債証券	第273回利付国債 (10年)	1,280,000,000	105.53	1,350,900,000	105.81	1,354,470,400	1.5	2015/09/20	0.84
日本	国債証券	第300回利付国債 (10年)	1,250,000,000	104.04	1,300,521,500	106.62	1,332,775,000	1.5	2019/03/20	0.83
日本	国債証券	第81回利付国債 (5年)	1,290,000,000	101.95	1,315,155,000	102.06	1,316,586,900	0.8	2014/03/20	0.82
日本	国債証券	第269回利付国債 (10年)	1,250,000,000	104.13	1,301,625,000	104.47	1,305,912,500	1.3	2015/03/20	0.81
日本	国債証券	第256回利付国債 (10年)	1,240,000,000	104.00	1,289,686,800	103.84	1,287,616,000	1.4	2013/12/20	0.80
日本	国債証券	第70回利付国債 (5年)	1,200,000,000	101.65	1,219,878,000	101.54	1,218,576,000	0.8	2013/03/20	0.76
日本	国債証券	第237回利付国債 (10年)	1,190,000,000	102.41	1,218,679,000	101.89	1,212,502,900	1.5	2012/03/20	0.75
日本	国債証券	第303回利付国債 (10年)	1,140,000,000	102.01	1,162,914,000	105.36	1,201,161,000	1.4	2019/09/20	0.74
日本	国債証券	第240回利付国債 (10年)	1,170,000,000	102.30	1,196,985,500	101.90	1,192,288,500	1.3	2012/06/20	0.74
日本	国債証券	第286回利付国債 (10年)	1,090,000,000	107.46	1,171,404,200	108.82	1,186,181,600	1.8	2017/06/20	0.74
日本	国債証券	第298回利付国債 (10年)	1,060,000,000	102.20	1,083,320,000	105.21	1,115,321,400	1.3	2018/12/20	0.69
日本	国債証券	第264回利付国債 (10年)	1,060,000,000	104.91	1,112,141,000	104.87	1,111,717,400	1.5	2014/09/20	0.69
日本	国債証券	第66回利付国債 (5年)	1,070,000,000	102.11	1,092,577,000	101.80	1,089,324,200	1.1	2012/09/20	0.68

(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	74.17
地方債証券	6.36
特殊債券	10.42
社債券	8.36
合計	99.32

(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	349,521	4,880.09	1,705,695,230	5,356.53	1,872,221,749	1.56
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	62,403	20,755.56	1,295,209,528	24,690.86	1,540,783,961	1.29
アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	540,918	2,078.87	1,124,499,825	2,125.78	1,149,877,642	0.96
スイス	株式	NESTLE SA - REGISTERED	食品・飲料・タバコ	237,799	4,306.14	1,023,996,974	4,404.66	1,047,424,932	0.87
イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC (GB)	銀行	1,202,138	809.26	972,852,896	850.57	1,022,504,081	0.85
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品・ パーソナル用品	197,502	4,935.90	974,851,662	5,111.43	1,009,519,445	0.84
アメリカ	株式	INTL BUSINESS MACHINES CORP	ソフトウェア・サービス	87,943	10,126.61	890,565,263	11,397.40	1,002,321,636	0.84
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	189,147	4,715.07	891,842,877	5,141.36	972,474,408	0.81
アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	732,190	1,313.65	961,844,029	1,300.71	952,367,733	0.80
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	137,752	5,960.78	821,109,931	6,830.35	940,894,593	0.79
アメリカ	株式	AT&T INC	電気通信サービス	406,818	1,969.67	801,297,820	2,305.36	937,863,978	0.78
アメリカ	株式	GOOGLE INC-CL A	ソフトウェア・サービス	16,843	39,060.16	657,890,328	50,036.93	842,772,116	0.70
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	各種金融	273,513	3,187.87	871,925,227	3,034.18	829,888,741	0.69
イギリス	株式	VODAFONE GROUP PLC	電気通信サービス	3,612,111	178.11	643,376,930	220.32	795,829,288	0.66
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	553,171	1,230.33	680,586,693	1,421.23	786,187,258	0.66
オースト ラリア	株式	BHP BILLITON LTD	素材	230,158	3,072.68	707,203,356	3,318.46	763,772,349	0.64
アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	テクノロジー・ハード ウェアおよび機器	391,668	1,864.51	730,270,665	1,875.83	734,706,148	0.61
アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	340,261	2,301.32	783,049,614	2,098.28	713,965,096	0.60
アメリカ	株式	COCA-COLA CO	食品・飲料・タバコ	142,395	4,162.59	592,733,341	4,951.27	705,037,074	0.59
イギリス	株式	BP PLC	エネルギー	1,288,520	629.86	811,589,268	545.96	703,488,239	0.59
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	144,709	4,316.81	624,682,415	4,663.27	674,818,585	0.56
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	275,365	1,823.26	502,062,155	2,374.93	653,972,709	0.55

アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	各種金融	689,710	1,263.50	871,449,826	932.66	643,266,101	0.54
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	213,848	2,730.84	583,986,040	2,988.07	638,994,204	0.53
フランス	株式	TOTAL SA	エネルギー	144,948	4,285.93	621,237,938	4,398.54	637,560,532	0.53
アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	381,576	1,719.72	656,204,412	1,655.81	631,820,523	0.53
オランダ	株式	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	エネルギー	243,160	2,343.91	569,945,447	2,564.62	623,613,218	0.52
スペイン	株式	TELEFONICA	電気通信サービス	281,697	1,770.22	498,668,254	2,189.13	616,673,719	0.51
アメリカ	株式	WAL-MART STORES	食品・生活必需品小売り	139,923	4,084.94	571,577,759	4,374.53	612,097,529	0.51
アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	127,001	3,577.76	454,379,694	4,793.54	608,784,551	0.51

(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	94.77
投資信託受益証券	0.23
投資証券	1.51
合計	96.50

(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	10.69
		素材	7.56
		資本財	7.18
		商業・専門サービス	0.77
		運輸	1.78
		自動車・自動車部品	1.22
		耐久消費財・アパレル	1.22
		消費者サービス	1.41
		メディア	2.55
		小売	2.50
		食品・生活必需品小売り	2.41
		食品・飲料・タバコ	6.19
		家庭用品・パーソナル用品	1.72
		ヘルスケア機器・サービス	2.56
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	7.14
		銀行	8.36
各種金融	5.32		
保険	3.98		

	不動産	0.68
	ソフトウェア・サービス	5.31
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.46
	電気通信サービス	4.34
	公益事業	3.90
	半導体・半導体製造装置	1.55
合計		94.77

(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	82	23,635,756	24,175,650	1,955,568,328	1.63
	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	55	3,089,800	3,116,025	402,185,346	0.34
	S&P/TSE 60	モントリオール取引所	買建	カナダドル	18	2,599,011	2,585,880	204,749,978	0.17
	SPI 200 FUTU	シドニー先物取引所	買建	オーストラリア ドル	27	3,131,641	3,160,350	249,762,460	0.21
	DJ EURO STOXX	ユーレックス・ドイツ 金融先物取引所	買建	ユーロ	216	5,935,338	6,130,080	690,308,308	0.58
	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	1,707,666	1,753,380	143,952,498	0.12

(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	8,261.35	2,230,565,105	8,310.18	2,243,749,570	1.750	2015/07/31	0.91
アメリカ	国債 証券	T 0.625% 06/30/12	26,000,000	8,089.80	2,103,350,314	8,128.18	2,113,327,084	0.625	2012/06/30	0.86
アメリカ	国債 証券	T 3.125% 05/15/19	24,600,000	8,020.74	1,973,104,269	8,544.00	2,101,825,537	3.125	2019/05/15	0.86
アメリカ	国債 証券	T 1.375% 01/15/13	23,000,000	8,142.08	1,872,679,334	8,258.36	1,899,423,590	1.375	2013/01/15	0.77
アメリカ	国債 証券	T 1.75% 08/15/12	22,000,000	8,249.51	1,814,893,540	8,295.01	1,824,903,678	1.750	2012/08/15	0.74

アメリカ	国債証券	T 3.375% 11/15/19	18,300,000	8,145.87	1,490,695,267	8,643.85	1,581,825,436	3.375	2019/11/15	0.64
アメリカ	国債証券	T 0.875% 01/31/12	18,000,000	8,115.54	1,460,797,565	8,149.66	1,466,940,150	0.875	2012/01/31	0.60
アメリカ	国債証券	T 2.25% 05/31/14	17,000,000	8,245.09	1,401,665,718	8,518.72	1,448,183,781	2.250	2014/05/31	0.59
アメリカ	国債証券	T 2.75% 05/31/17	16,000,000	8,265.19	1,322,430,695	8,544.00	1,367,041,000	2.750	2017/05/31	0.56
アメリカ	国債証券	T 2.875% 01/31/13	15,800,000	8,471.96	1,338,570,247	8,549.06	1,350,751,776	2.875	2013/01/31	0.55
アメリカ	国債証券	T 1.125% 12/15/12	16,200,000	8,099.11	1,312,056,022	8,214.12	1,330,688,528	1.125	2012/12/15	0.54
アメリカ	国債証券	T 1.875% 06/30/15	15,900,000	8,210.69	1,305,501,167	8,360.73	1,329,357,634	1.875	2015/06/30	0.54
アメリカ	国債証券	T 1% 12/31/11	16,100,000	8,133.23	1,309,451,111	8,158.51	1,313,520,889	1.000	2011/12/31	0.53
アメリカ	国債証券	T 3.375% 06/30/13	15,000,000	8,603.40	1,290,511,476	8,718.42	1,307,763,796	3.375	2013/06/30	0.53
アメリカ	国債証券	T 2.375% 02/28/15	14,500,000	8,221.71	1,192,147,972	8,551.58	1,239,980,504	2.375	2015/02/28	0.50
イタリア	国債証券	BTPS 4.75% 02/01/13	10,300,000	11,962.67	1,232,155,309	11,927.20	1,228,501,678	4.750	2013/02/01	0.50
フランス	国債証券	FRTR 4.25% 04/25/19	9,650,000	12,574.03	1,213,394,145	12,577.18	1,213,698,418	4.250	2019/04/25	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.75% 11/30/16	14,000,000	8,119.33	1,136,706,725	8,599.61	1,203,946,537	2.750	2016/11/30	0.49
アメリカ	国債証券	T 3.25% 07/31/16	13,500,000	8,408.76	1,135,183,717	8,861.24	1,196,268,306	3.250	2016/07/31	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.25% 01/31/15	14,000,000	8,177.47	1,144,846,281	8,512.40	1,191,737,203	2.250	2015/01/31	0.49
アメリカ	国債証券	T 2.75% 02/15/19	14,100,000	7,829.89	1,104,015,789	8,345.57	1,176,725,788	2.750	2019/02/15	0.48
アメリカ	国債証券	T 3.5% 05/15/20	13,350,000	8,388.37	1,119,848,487	8,688.09	1,159,860,223	3.500	2020/05/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 4.25% 08/15/15	12,500,000	8,914.88	1,114,360,862	9,265.69	1,158,212,089	4.250	2015/08/15	0.47
アメリカ	国債証券	T 4.0% 02/15/15	12,700,000	8,811.95	1,119,118,205	9,107.70	1,156,678,971	4.000	2015/02/15	0.47
イギリス	国債証券	UKT 5% 03/07/12	8,400,000	13,839.01	1,162,477,215	13,654.01	1,146,937,548	5.000	2012/03/07	0.47
ドイツ	国債証券	DBR 4.25% 07/04/14	9,150,000	12,588.55	1,151,853,175	12,381.24	1,132,883,851	4.250	2014/07/04	0.46
アメリカ	国債証券	T 2.625% 08/15/20	14,000,000	8,168.41	1,143,578,741	8,064.98	1,129,098,009	2.625	2020/08/15	0.46
イタリア	国債証券	BTPS 3.75% 08/01/16	9,600,000	11,620.11	1,115,530,875	11,730.92	1,126,168,466	3.750	2016/08/01	0.46
アメリカ	国債証券	T 4.25% 08/15/13	12,600,000	8,827.12	1,112,217,277	8,937.08	1,126,072,217	4.250	2013/08/15	0.46
アメリカ	国債証券	T 1.375% 03/15/12	13,500,000	8,195.16	1,106,347,696	8,214.12	1,108,907,106	1.375	2012/03/15	0.45

(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	97.64
特殊債券	0.76
合計	98.40

(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)	5,550,485	(分配付)	0.9170
	(分配落)	5,550,485	(分配落)	0.9170
第2期計算期間末 (平成15年 9月30日)	(分配付)	112,669,375	(分配付)	0.9985
	(分配落)	112,669,375	(分配落)	0.9985
第3期計算期間末 (平成16年 9月30日)	(分配付)	1,360,963,665	(分配付)	1.0924
	(分配落)	1,360,963,665	(分配落)	1.0924
第4期計算期間末 (平成17年 9月30日)	(分配付)	3,832,378,778	(分配付)	1.3072
	(分配落)	3,832,378,778	(分配落)	1.3072
第5期計算期間末 (平成18年10月 2日)	(分配付)	9,683,741,259	(分配付)	1.4861
	(分配落)	9,683,741,259	(分配落)	1.4861
第6期計算期間末 (平成19年10月 1日)	(分配付)	14,820,213,543	(分配付)	1.5717
	(分配落)	14,820,213,543	(分配落)	1.5717
第7期計算期間末 (平成20年 9月30日)	(分配付)	13,376,901,179	(分配付)	1.1770
	(分配落)	13,376,901,179	(分配落)	1.1770
第8期計算期間末 (平成21年 9月30日)	(分配付)	14,737,407,779	(分配付)	1.0647
	(分配落)	14,737,407,779	(分配落)	1.0647
第9期計算期間末 (平成22年 9月30日)	(分配付)	16,131,827,028	(分配付)	1.0338
	(分配落)	16,131,827,028	(分配落)	1.0338
平成21年10月末日		14,878,770,125		1.0613
11月末日		14,369,318,914		1.0214
12月末日		15,566,855,056		1.0857
平成22年 1月末日		15,389,054,689		1.0605
2月末日		15,362,023,323		1.0554

3月末日	16,991,480,902	1.1417
4月末日	17,229,159,461	1.1547
5月末日	15,869,790,918	1.0503
6月末日	15,413,456,068	1.0127
7月末日	15,988,794,498	1.0342
8月末日	15,406,640,409	0.9908
9月末日	16,131,827,028	1.0338
10月末日	16,019,875,789	1.0201

【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

【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）	8.3
第2期計算期間（平成14年10月 1日～平成15年 9月30日）	8.9
第3期計算期間（平成15年10月 1日～平成16年 9月30日）	9.4
第4期計算期間（平成16年10月 1日～平成17年 9月30日）	19.7
第5期計算期間（平成17年10月 1日～平成18年10月 2日）	13.7
第6期計算期間（平成18年10月 3日～平成19年10月 1日）	5.8
第7期計算期間（平成19年10月 2日～平成20年 9月30日）	25.1
第8期計算期間（平成20年10月 1日～平成21年 9月30日）	9.5
第9期計算期間（平成21年10月 1日～平成22年 9月30日）	2.9

(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。

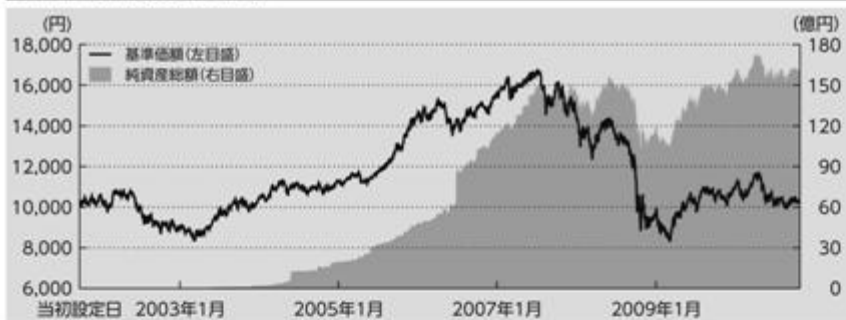
(注2)小数第2位を四捨五入しております。

（参考情報）

当初設定日：2001年10月 1日

作成基準日：2010年10月29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	10,201円
純資産総額	160億円

〈基準価額の騰落率〉

1ヶ月	-1.33%
3ヶ月	-1.36%
6ヶ月	-11.66%
1年	-3.88%
3年	-35.60%
5年	-22.73%
設定来	2.01%

※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

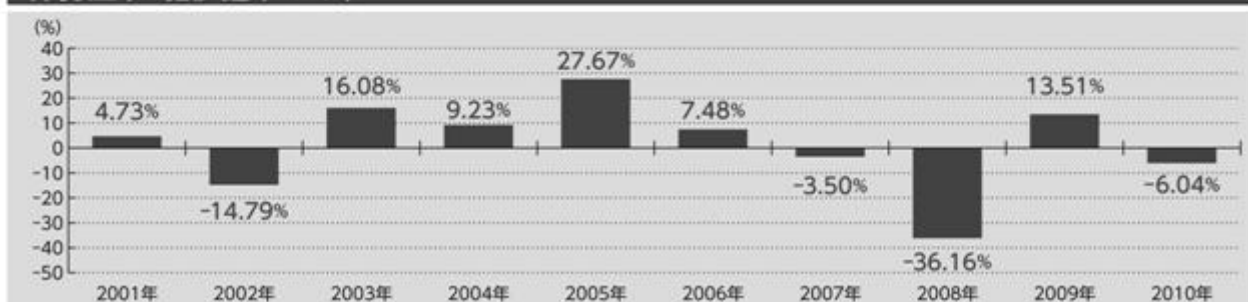
決算期	2006年10月	2007年10月	2008年9月	2009年9月	2010年9月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円

※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 国内株式 インデックス マザーファンド	48.5%	トヨタ自動車	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.6%
		三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	株式	銀行業	-	-	1.2%
		本田技研工業	日本	株式	輸送用機器	-	-	1.1%
住信 外国株式 インデックス マザーファンド	25.9%	EXXON MOBIL	米国	株式	エネルギー	-	-	0.4%
		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%
		MICROSOFT CORP	米国	株式	ソフトウェア・サービス	-	-	0.2%
住信 国内債券 インデックス マザーファンド	17.7%	第288回利付国債(10年)	日本	国債証券	-	1.7%	2017/9/20	0.2%
		第89回利付国債(5年)	日本	国債証券	-	0.4%	2015/6/20	0.2%
		第305回利付国債(10年)	日本	国債証券	-	1.3%	2019/12/20	0.2%
住信 外国債券 インデックス マザーファンド	4.7%	T 1.75% 07/31/15	米国	国債証券	-	1.750%	2015/7/31	0.0%
		T 0.625% 06/30/12	米国	国債証券	-	0.625%	2012/6/30	0.0%
		T 3.125% 05/15/19	米国	国債証券	-	3.125%	2019/5/15	0.0%

年間収益率の推移(暦年ベース)



※2001年は当初設定日から年末までの収益率です。また、2010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)	6,052,895		6,052,895
第2期計算期間 (平成14年10月1日～平成15年9月30日)	107,089,141	303,499	112,838,537

第3期計算期間 (平成15年10月 1日～平成16年 9月30日)	1,155,730,146	22,767,738	1,245,800,945
第4期計算期間 (平成16年10月 1日～平成17年 9月30日)	1,885,857,059	199,872,844	2,931,785,160
第5期計算期間 (平成17年10月 1日～平成18年10月 2日)	4,169,238,791	584,702,097	6,516,321,854
第6期計算期間 (平成18年10月 3日～平成19年10月 1日)	4,003,156,930	1,089,928,632	9,429,550,152
第7期計算期間 (平成19年10月 2日～平成20年 9月30日)	3,302,454,022	1,366,571,750	11,365,432,424
第8期計算期間 (平成20年10月 1日～平成21年 9月30日)	3,420,020,723	943,488,620	13,841,964,527
第9期計算期間 (平成21年10月 1日～平成22年 9月30日)	2,824,764,190	1,062,037,170	15,604,691,547

(注)当該計算期間中において、本邦外における設定又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、）を行うものとし、

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せん。

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に係る期中収益分配金、ご解約による収益の分配、償還による収益の分配のいずれも非課税であるため、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きましては、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きましては、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。ただし、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5億口を下回る場合となった場合には、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(イ)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、原則として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、当該投資信託財産に係る知れてい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）（以下「財務諸表等規則」という。）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）（以下「投資信託財産計算規則」という。）に基づいて作成しております。

財務諸表等規則は、平成20年8月7日付内閣府令第50号附則第2条第1項第1号により改正されておりますが、第8期計算期間（平成20年10月1日から平成21年9月30日まで）については、改正前の財務諸表等規則に基づき、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）については、改正後の財務諸表等規則に基づいて作成しております。

投資信託財産計算規則は、平成21年6月24日付内閣府令第35号附則第16条第2項により改正されておりますが、第8期計算期間（平成20年10月1日から平成21年9月30日まで）については、改正前の投資信託財産計算規則に基づき、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）については、改正後の投資信託財産計算規則に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第8期計算期間（平成20年10月1日から平成21年9月30日まで）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、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）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りました。

1【財務諸表】

すみしん D Cマイセレクション75

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第8期 (平成21年9月30日現在)	第9期 (平成22年9月30日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	505,379,966	533,882,890
親投資信託受益証券	14,257,299,300	15,660,075,440
未収入金	6,520,000	-
未収利息	1,100	1,394
流動資産合計	14,769,200,366	16,193,959,724
資産合計		
	14,769,200,366	16,193,959,724
負債の部		
流動負債		
未払解約金	7,879,942	34,100,326
未払受託者報酬	2,180,252	2,550,580
未払委託者報酬	21,075,685	24,655,587
その他未払費用	656,708	826,203
流動負債合計	31,792,587	62,132,696
負債合計		
	31,792,587	62,132,696
純資産の部		
元本等		
元本	13,841,964,527	15,604,691,547
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	895,443,252	527,135,481
(分配準備積立金)	-	1,140,157,389
元本等合計	14,737,407,779	16,131,827,028
純資産合計		
	14,737,407,779	16,131,827,028
負債純資産合計		
	14,769,200,366	16,193,959,724

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第8期 (自 平成20年10月1日 至 平成21年9月30日)	第9期 (自 平成21年10月1日 至 平成22年9月30日)
営業収益		
受取利息	479,798	347,910
有価証券売買等損益	1,018,066,905	424,843,860
営業収益合計	1,017,587,107	424,495,950
営業費用		
受託者報酬	3,940,925	4,957,952
委託者報酬	38,095,529	47,926,775
その他費用	656,708	826,203
営業費用合計	42,693,162	53,710,930
営業利益又は営業損失()	1,060,280,269	478,206,880
経常利益又は経常損失()	1,060,280,269	478,206,880
当期純利益又は当期純損失()	1,060,280,269	478,206,880
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()	154,197,203	429,825
期首剰余金又は期首欠損金()	2,011,468,755	895,443,252
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	179,421,096
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	179,421,096
剰余金減少額又は欠損金増加額	209,942,437	69,092,162
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	143,025,059	69,092,162
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	66,917,378	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金()	895,443,252	527,135,481

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	第 8 期 (自 平成20年10月 1日 至 平成21年 9月30日)	第 9 期 (自 平成21年10月 1日 至 平成22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 8 期 (平成21年9月30日現在)	第 9 期 (平成22年9月30日現在)
1. 期首元本額	11,365,432,424円	13,841,964,527円
期中追加設定元本額	3,420,020,723円	2,824,764,190円
期中一部解約元本額	943,488,620円	1,062,037,170円
期末元本額	13,841,964,527円	<u>15,604,691,547円</u>
2. 計算期間末日における受益権の総数	13,841,964,527口	15,604,691,547口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

	第 8 期 (自 平成20年10月 1日 至 平成21年 9月30日)	第 9 期 (自 平成21年10月 1日 至 平成22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(4,665,560,089円)及び分配準備積立金(1,225,131,990円)により、分配対象収益は5,890,692,079円(1万口当たり4,255円67銭)であります。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(5,500,693,315円)及び分配準備積立金(1,140,157,389円)により、分配対象収益は6,640,850,704円(1万口当たり4,255円67銭)であります。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)

(追加情報)

当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 平成20年3月10日)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。

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)
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。

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、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。 ・ 価格変動リスク ・ 為替変動リスク
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。
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。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価に関する事項

項目	第 9 期 (平成22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。
2. 時価の算定方法	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。 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。

(有価証券に関する注記)

第8期（平成21年9月30日現在）

売買目的有価証券の貸借対照表計上額及び当計算期間の損益に含まれた評価差額

種 類	貸借対照表計上額（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	14,257,299,300	826,474,243
合 計	14,257,299,300	826,474,243

(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。

第9期（平成22年9月30日現在）

売買目的有価証券

種 類	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	417,018,108
合 計	417,018,108

（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）

取引の状況に関する事項

<p>第 8 期 （自 平成20年10月 1日 至 平成21年 9月30日）</p>
該当事項はありません。

取引の時価等に関する事項

<p>第 8 期 （平成21年9月30日現在）</p>
該当事項はありません。

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

<p>第 9 期 （平成22年9月30日現在）</p>
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

<p>第 8 期 （自 平成20年10月 1日 至 平成21年 9月30日）</p>	<p>第 9 期 （自 平成21年10月 1日 至 平成22年 9月30日）</p>
<p>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。</p>	同左

（1口当たり情報）

<p>第 8 期 （平成21年9月30日現在）</p>	<p>第 9 期 （平成22年9月30日現在）</p>
1口当たり純資産額 = 1.0647円	1口当たり純資産額 = 1.0338円

（4）【附属明細表】（平成22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 国内株式インデックス マザーファンド	12,343,313,134	7,845,409,827
	住信 外国株式インデックス マザーファンド	4,825,143,404	4,180,504,245
	住信 国内債券インデックス マザーファンド	2,353,586,626	2,860,078,467
	住信 外国債券インデックス マザーファンド	428,902,317	774,082,901
合計		19,950,945,481	15,660,075,440

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75」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、すべて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21年9月30日現在)	(平成22年9月30日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,814,385,289	2,412,947,709
株式	125,893,906,760	124,571,617,290
新株予約権証券	2,079,000	
派生商品評価勘定	1,371,520	41,496,480
未収入金	3,316,000	35,067,360
未収配当金	877,773,776	1,055,211,493
未収利息	8,306	6,303
前払金	184,034,000	
差入委託証拠金	190,800,000	131,355,000
流動資産合計	130,967,674,651	128,247,701,635
資産合計	130,967,674,651	128,247,701,635
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	153,459,400	21,072,720

前受金		120,089,000
未払金	33,356,000	42,281,941
未払解約金	32,920,515	53,135,194
流動負債合計	219,735,915	236,578,855
負債合計	219,735,915	236,578,855
純資産の部		
元本等		
元本	191,683,384,340	201,400,845,672
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	60,935,445,604	73,389,722,892
元本等合計	130,747,938,736	128,011,122,780
純資産合計	130,747,938,736	128,011,122,780
負債純資産合計	130,967,674,651	128,247,701,635

(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75」の計算期間とは異なっております。上記の表は、平成21年9月30日及び平成22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20年10月 1日 至 平成21年 9月30日)	(自 平成21年10月 1日 至 平成22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) 新株予約権証券 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) 先物取引 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) 先物取引 同左</p>

2. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 受取配当金は、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21年9月30日現在)	(平成22年9月30日現在)
1. 期首元本額	164,766,241,169円	191,683,384,340円
期中追加設定元本額	70,240,878,133円	36,452,789,185円
期中一部解約元本額	43,323,734,962円	26,735,327,853円
期末元本額	191,683,384,340円	201,400,845,672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）	11,945,936,467円	7,185,082,746円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	481,710,451円	700,981,494円
SBI資産設計オープン（分配型）	48,432,597円	41,140,168円
STAM TOPIXインデックス・オープン	3,231,633,352円	4,371,405,750円
世界経済インデックスファンド	19,633,188円	56,721,278円
住信 国内バランス30	754,999,856円	640,092,692円
住信 国内バランス60	645,169,937円	506,420,847円
すみしん マイセレクション25	190,206,912円	157,304,680円
すみしん マイセレクション50	372,331,025円	369,474,260円
すみしん マイセレクション75	294,730,215円	292,422,992円
すみしん 日本株式インデックス・オープン	20,724,756,220円	18,868,118,143円
すみしん DC マイセレクション25	3,376,759,532円	3,954,050,003円
すみしん DC マイセレクション50	12,211,968,349円	13,946,536,058円
すみしん DC マイセレクション75	10,702,542,588円	12,343,313,134円
すみしん DC日本株式インデックス・オープン	2,337,326,895円	2,775,004,815円
すみしん DC マイセレクションS25	147,719,835円	329,262,863円
すみしん DC マイセレクションS50	838,850,754円	1,548,946,134円
すみしん DC マイセレクションS75	655,093,582円	1,168,203,214円
すみしん DC 日本株式インデックス・オープンス	366,430,165円	487,667,580円
すみしん DC ターゲット・イヤール ファンド2015	19,435,593円	22,720,104円
すみしん DC ターゲット・イヤール ファンド2025	24,415,161円	89,142,069円
すみしん DC ターゲット・イヤール ファンド2035	18,600,963円	75,916,744円
すみしん DC ターゲット・イヤール ファンド2045	5,639,585円	31,779,386円
STAM 日本株式インデックス・オープン（SMA専用）	1,739,631,736円	3,963,633,533円
住信 国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	537,738,752円	469,417,569円
すみしん マイセレクション50VA1 （適格機関投資家専用）	991,368,592円	981,615,573円
すみしん マイセレクション75VA1 （適格機関投資家専用）	435,819,849円	437,410,701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）	4,048,646,235円	3,774,038,589円
住信 国内バランス 30VA2（適格機関投資家専用）	20,295,697円	20,372,794円
住信 国内バランス 60VA2（適格機関投資家専用）	85,515,345円	83,413,467円

すみしん マイセクション50VA2 (適格機関投資家専用)	7,713,517円	5,484,542円
すみしん バランス30VA1(適格機関投資家専用)	2,129,727,830円	2,093,706,657円
すみしん バランス50VA1(適格機関投資家専用)	7,685,348,149円	7,753,642,440円
すみしん バランス25VA2(適格機関投資家専用)	20,585,340,402円	20,829,077,674円
すみしん バランス50VA2(適格機関投資家専用)	5,975,553,194円	6,063,164,847円
すみしん バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	12,611,834,078円	12,621,242,968円
すみしん バランスB(37.5)VA1 (適格機関投資家専用)	2,626,913,809円	2,622,847,679円
すみしん バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	14,718,719,960円	14,184,726,621円
すみしん 世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	5,656,303,453円	6,069,317,753円
すみしん 世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	4,416,235,343円	4,731,796,249円
すみしん バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	3,649,862,393円	3,442,811,953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)	5,771,112,326円	5,897,632,153円
すみしん バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,165,627,478円	2,128,986,313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
すみしん 国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)		212,375,516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)	23,904,324,522円	27,549,180,512円
住信 グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,628,151,748円	3,089,412,501円
住信 日本株式ファンド・シリーズ2	877,276,710円	875,023,001円
2.元本の欠損	純資産額は、元本を 60,935,445,604円下回ってお ります。	純資産額は、元本を 73,389,722,892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	191,683,384,340口	201,400,845,672口

(金融商品に関する注記)

(追加情報)

当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 平成20年3月10日)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。

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)
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。
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っております。 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

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。
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。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価に関する事項

項目	（平成22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。
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 1. 原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。 2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。 3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。</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>

（有価証券に関する注記）

（平成21年9月30日現在）

売買目的有価証券の貸借対照表計上額及び当計算期間の損益に含まれた評価差額

種 類	貸借対照表計上額（円）	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
株 式	125,893,906,760	1,709,989,196
新株予約権証券	2,079,000	2,079,000
合 計	125,895,985,760	1,712,068,196

（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。

（平成22年9月30日現在）

売買目的有価証券

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）

株 式	7,333,766,752
合 計	7,333,766,752

(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)

取引の状況に関する事項

(自 平成20年10月 1日 至 平成21年 9月30日)	
1. 取引の内容、取引に対する取組方法及び取引の利用目的	当ファンドは、約款に基づき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、わが国の金融商品取引所における市場デリバティブ取引ならびに外国金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。
2. 取引に係るリスクの内容及びリスクの管理体制	デリバティブ取引には、市場リスクがあります。当ファンドが利用するデリバティブ取引は、約款に基づき、取引所取引のみであり、信用リスクはないものと考えられます。なお、デリバティブ取引の執行は、取引権限を定めた社内ルールに従い行っており、市場リスクの管理については、ポジションやリスク評価額を日々算出し、リスクをコントロールする体制としています。
3. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

取引の時価等に関する事項

株式関連

区分	種 類	(平成21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	5,020,519,000		4,868,500,000	152,019,000
合 計		5,020,519,000		4,868,500,000	152,019,000

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

		うち1年超	(円)	(円)
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。

(関連当事者との取引に関する注記)

(自 平成20年10月 1日 至 平成21年 9月30日)	(自 平成21年10月 1日 至 平成22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21年9月30日現在)	(平成22年9月30日現在)
1口当たり純資産額 = 0.6821円	1口当たり純資産額 = 0.6356円

(3) 附属明細表（平成22年9月30日現在）

1) 有価証券明細表

株式

銘柄	株数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	52,000	176.00	9,152,000	
日本水産	133,000	275.00	36,575,000	
マルハニチロホールディングス	263,000	139.00	36,557,000	
ハウスイ	16,000	108.00	1,728,000	
サカタのタネ	18,300	1,111.00	20,331,300	
ホクト	13,500	1,869.00	25,231,500	
ショーボンドホールディングス	11,800	1,819.00	21,464,200	
住石ホールディングス	34,800	66.00	2,296,800	
日鉄鉱業	34,000	298.00	10,132,000	
三井松島産業	72,000	129.00	9,288,000	
国際石油開発帝石	924	393,000.00	363,132,000	
日本海洋掘削	2,700	2,480.00	6,696,000	
関東天然瓦斯開発	14,000	441.00	6,174,000	
石油資源開発	21,100	3,145.00	66,359,500	
ダイセキ環境ソリューション	27	62,400.00	1,684,800	

間組	51,700	70.00	3,619,000
東急建設	43,350	242.00	10,490,700
コムシスホールディングス	53,900	765.00	41,233,500
ミサワホーム	15,700	389.00	6,107,300
高松コンストラクショングループ	10,100	1,114.00	11,251,400
東建コーポレーション	6,220	2,464.00	15,326,080
ヤマウラ	18,000	196.00	3,528,000
大成建設	618,000	172.00	106,296,000
大林組	357,000	332.00	118,524,000
清水建設	359,000	309.00	110,931,000
長谷工コーポレーション	777,500	67.00	52,092,500
松井建設	24,000	345.00	8,280,000
鹿島建設	567,000	201.00	113,967,000
鉄建建設	75,000	70.00	5,250,000
安藤建設	41,000	101.00	4,141,000
太平工業	17,000	297.00	5,049,000
三井住友建設	73,000	63.00	4,599,000
前田建設工業	108,000	226.00	24,408,000
奥村組	119,000	283.00	33,677,000
東鉄工業	17,000	490.00	8,330,000
戸田建設	151,000	273.00	41,223,000
熊谷組	101,000	53.00	5,353,000
青木あすなる建設	9,000	377.00	3,393,000
三井ホーム	23,000	378.00	8,694,000
矢作建設工業	16,000	544.00	8,704,000
大東建託	52,100	4,990.00	259,979,000
新日本建設	38,900	222.00	8,635,800
N I P P O	26,000	558.00	14,508,000
東亜道路工業	33,000	125.00	4,125,000
前田道路	35,000	620.00	21,700,000
日本道路	41,000	171.00	7,011,000
東亜建設工業	108,000	83.00	8,964,000
五洋建設	146,000	125.00	18,250,000
大林道路	23,000	148.00	3,404,000
住友林業	93,300	585.00	54,580,500
日本基礎技術	20,200	183.00	3,696,600
巴コーポレーション	18,100	270.00	4,887,000
パナホーム	44,000	483.00	21,252,000
大和ハウス工業	314,000	840.00	263,760,000
ライト工業	32,400	188.00	6,091,200
積水ハウス	375,000	750.00	281,250,000
北陸電気工事	11,000	230.00	2,530,000
コミュニューチャ	13,000	422.00	5,486,000
ユアテック	24,000	313.00	7,512,000
西部電気工業	14,000	315.00	4,410,000

四電工	12,000	338.00	4,056,000
中電工	16,800	939.00	15,775,200
関電工	53,000	500.00	26,500,000
大明	15,900	535.00	8,506,500
きんでん	79,000	754.00	59,566,000
東京エネシス	16,000	578.00	9,248,000
トーエネック	20,000	461.00	9,220,000
住友電設	10,800	320.00	3,456,000
日本電設工業	25,000	810.00	20,250,000
協和エクシオ	43,500	751.00	32,668,500
新日本空調	14,500	526.00	7,627,000
日本工営	42,000	231.00	9,702,000
東電通	27,000	127.00	3,429,000
日本電話施設	23,000	269.00	6,187,000
九電工	25,000	455.00	11,375,000
三機工業	31,000	608.00	18,848,000
日揮	125,000	1,449.00	181,125,000
中外炉工業	55,000	279.00	15,345,000
ヤマト	23,000	317.00	7,291,000
太平電業	17,000	586.00	9,962,000
高砂熱学工業	35,400	654.00	23,151,600
三晃金属工業	15,000	150.00	2,250,000
N E C ネットズエスアイ	9,400	1,056.00	9,926,400
朝日工業社	22,000	354.00	7,788,000
アタカ大機	13,000	229.00	2,977,000
大気社	20,200	1,337.00	27,007,400
ダイダン	22,000	391.00	8,602,000
日比谷総合設備	17,600	752.00	13,235,200
東芝プラントシステム	20,000	1,114.00	22,280,000
日本製粉	77,000	430.00	33,110,000
日清製粉グループ本社	120,500	1,097.00	132,188,500
日東富士製粉	12,000	310.00	3,720,000
昭和産業	55,000	253.00	13,915,000
鳥越製粉	11,600	751.00	8,711,600
協同飼料	46,000	101.00	4,646,000
中部飼料	14,000	531.00	7,434,000
日本配合飼料	37,000	95.00	3,515,000
東洋精糖	28,000	97.00	2,716,000
日本甜菜製糖	68,000	195.00	13,260,000
三井製糖	47,000	335.00	15,745,000
ネクスト	36	70,800.00	2,548,800
日本M & A センター	25	280,600.00	7,015,000
アコーディア・ゴルフ	324	78,600.00	25,466,400
パソナグループ	116	58,800.00	6,820,800
リンクアンドモチベーション	29	40,900.00	1,186,100

テンブホールディングス	17,000	761.00	12,937,000	
森永製菓	131,000	199.00	26,069,000	
中村屋	31,000	449.00	13,919,000	
江崎グリコ	48,000	1,081.00	51,888,000	
名糖産業	5,900	1,210.00	7,139,000	
不二家	76,000	162.00	12,312,000	
山崎製パン	98,000	1,018.00	99,764,000	
モロゾフ	20,000	280.00	5,600,000	
森永乳業	114,000	358.00	40,812,000	
ヤクルト本社	71,400	2,578.00	184,069,200	
明治ホールディングス	39,500	3,930.00	155,235,000	
雪印メグミルク	26,200	1,567.00	41,055,400	
プリマハム	73,000	88.00	6,424,000	
日本ハム	93,000	1,022.00	95,046,000	
伊藤ハム	82,000	280.00	22,960,000	
丸大食品	54,000	260.00	14,040,000	
米久	10,500	660.00	6,930,000	
S Foods	7,000	685.00	4,795,000	
学情	6,200	297.00	1,841,400	
スタジオアリス	5,800	756.00	4,384,800	
シミック	260	26,310.00	6,840,600	
システナ	127	61,500.00	7,810,500	
NECフィールドディング	10,100	926.00	9,352,600	
新日鉄ソリューションズ	10,000	1,534.00	15,340,000	
総合警備保障	41,500	864.00	35,856,000	
日本駐車場開発	2,062	3,740.00	7,711,880	
コア	4,900	667.00	3,268,300	
カカクコム	75	483,500.00	36,262,500	
ルネサンス	9,200	299.00	2,750,800	
新日本科学	9,100	367.00	3,339,700	
エムスリー	48	369,500.00	17,736,000	
ディー・エヌ・エー	43,300	2,629.00	113,835,700	
博報堂DYホールディングス	15,790	4,040.00	63,791,600	
ぐるなび	72	108,900.00	7,840,800	
一休	97	41,500.00	4,025,500	
ジャパンベストレスキューシステム	42	71,800.00	3,015,600	
ジェイコムホールディングス	21	89,100.00	1,871,100	
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	284	53,200.00	15,108,800	
サッポロホールディングス	191,000	391.00	74,681,000	
アサヒビール	249,900	1,670.00	417,333,000	
麒麟ホールディングス	545,000	1,185.00	645,825,000	
宝ホールディングス	104,000	469.00	48,776,000	
オエノンホールディングス	41,000	185.00	7,585,000	
メルシャン	39,000	164.00	6,396,000	
養命酒製造	10,000	810.00	8,100,000	

三国コカ・コーラボトリング	15,800	729.00	11,518,200
コカ・コーラウエスト	41,000	1,408.00	57,728,000
コカ・コーラ セントラル ジャパン	15,000	1,123.00	16,845,000
ダイドードリンコ	5,500	2,887.00	15,878,500
伊藤園	31,800	1,371.00	43,597,800
伊藤園(優)	1,900	1,023.00	1,943,700
キーコーヒー	10,800	1,518.00	16,394,400
ジャパンフーズ	2,400	809.00	1,941,600
日清オイリオグループ	51,000	381.00	19,431,000
不二製油	32,300	1,252.00	40,439,600
J - オイルミルズ	51,000	233.00	11,883,000
ローソン	33,600	3,825.00	128,520,000
インターニックス	6,600	363.00	2,395,800
サンエー	4,000	3,175.00	12,700,000
麒麟堂	5,000	386.00	1,930,000
ダイユーエイト	1,800	544.00	979,200
カワチ薬品	7,300	1,474.00	10,760,200
エービーシー・マート	11,100	2,570.00	28,527,000
ハードオフコーポレーション	5,000	386.00	1,930,000
高千穂交易	4,700	881.00	4,140,700
アスクル	8,500	1,687.00	14,339,500
ゲオ	194	92,800.00	18,003,200
ポイント	10,560	3,790.00	40,022,400
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	10,000	106.00	1,060,000
伊藤忠食品	2,900	2,880.00	8,352,000
くらコーポレーション	6,200	1,399.00	8,673,800
キャンドウ	53	94,100.00	4,987,300
エレマテック	8,000	1,034.00	8,272,000
パル	3,100	2,961.00	9,179,100
JALUX	4,200	649.00	2,725,800
エディオン	47,000	613.00	28,811,000
サーラコーポレーション	11,000	507.00	5,577,000
トーマンデバイス	1,700	1,671.00	2,840,700
パルス	51	92,500.00	4,717,500
あみやき亭	21	238,500.00	5,008,500
双日	785,400	150.00	117,810,000
アルフレッサ ホールディングス	28,700	3,560.00	102,172,000
ハニーズ	10,640	1,060.00	11,278,400
キッコーマン	101,000	921.00	93,021,000
味の素	336,000	817.00	274,512,000
キュービー	68,900	1,080.00	74,412,000
ハウス食品	49,100	1,269.00	62,307,900
カゴメ	47,800	1,616.00	77,244,800
焼津水産化学工業	6,300	1,024.00	6,451,200
アリアケジャパン	10,900	1,276.00	13,908,400

ニチレイ	138,000	354.00	48,852,000
横浜冷凍	25,300	582.00	14,724,600
東洋水産	57,000	1,721.00	98,097,000
日清食品ホールディングス	43,400	3,015.00	130,851,000
永谷園	12,000	871.00	10,452,000
フジッコ	13,000	1,033.00	13,429,000
ロック・フィールド	6,500	1,309.00	8,508,500
日本たばこ産業	2,769	277,900.00	769,505,100
わらべや日洋	7,000	939.00	6,573,000
なとり	5,800	786.00	4,558,800
片倉工業	15,500	857.00	13,283,500
グンゼ	85,000	287.00	24,395,000
昭栄	21,400	610.00	13,054,000
神栄	15,000	163.00	2,445,000
山下医科器械	1,400	1,176.00	1,646,400
ラサ商事	6,000	290.00	1,740,000
アルペン	9,000	1,298.00	11,682,000
ビックカメラ	286	31,550.00	9,023,300
D C Mホールディングス	58,900	397.00	23,383,300
MonotaRO	2,800	760.00	2,128,000
あいホールディングス	26,100	280.00	7,308,000
ユニバース	1,800	1,344.00	2,419,200
J . フロント リテイリング	277,000	388.00	107,476,000
ドトール・日レスホールディングス	18,700	1,098.00	20,532,600
マツモトキヨシホールディングス	19,800	1,502.00	29,739,600
ココカラファインホールディングス	11,300	1,841.00	20,803,300
三越伊勢丹ホールディングス	204,000	867.00	176,868,000
東洋紡績	422,000	134.00	56,548,000
ユニチカ	264,000	70.00	18,480,000
富士紡ホールディングス	56,000	115.00	6,440,000
日清紡ホールディングス	80,000	837.00	66,960,000
倉敷紡績	125,000	132.00	16,500,000
ダイワボウホールディングス	108,000	183.00	19,764,000
シキボウ	76,000	111.00	8,436,000
日東紡績	102,000	190.00	19,380,000
トヨタ紡織	34,700	1,389.00	48,198,300
クリエイトSDホールディングス	4,100	1,821.00	7,466,100
バイタルケーエスケー・ホールディングス	15,900	566.00	8,999,400
U K Cホールディングス	7,200	822.00	5,918,400
日本毛織	43,000	641.00	27,563,000
ダイドーリミテッド	15,800	708.00	11,186,400
野村不動産ホールディングス	58,000	1,185.00	68,730,000
ヒューリック	36,700	567.00	20,808,900
帝国繊維	14,000	474.00	6,636,000
ブックオフコーポレーション	5,100	731.00	3,728,100

日本コークス工業	100,500	123.00	12,361,500
ミタチ産業	3,800	460.00	1,748,000
J F E 商事ホールディングス	79,000	340.00	26,860,000
あさひ	4,900	1,255.00	6,149,500
サークルKサンクス	22,300	1,116.00	24,886,800
日本調剤	1,610	3,070.00	4,942,700
コスモス薬品	5,200	2,334.00	12,136,800
シップヘルスケアホールディングス	13,700	728.00	9,973,600
セブン&アイ・ホールディングス	458,100	1,956.00	896,043,600
ツルハホールディングス	8,800	3,515.00	30,932,000
サンマルクホールディングス	3,400	3,125.00	10,625,000
フェリシモ	3,000	1,240.00	3,720,000
トリドール	30	146,000.00	4,380,000
帝人	437,000	276.00	120,612,000
東レ	887,000	465.00	412,455,000
クラレ	169,700	1,054.00	178,863,800
旭化成	673,000	460.00	309,580,000
稲葉製作所	6,100	740.00	4,514,000
三協・立山ホールディングス	144,000	103.00	14,832,000
トーカロ	8,100	1,321.00	10,700,100
アルファC o	7,400	812.00	6,008,800
S U M C O	67,900	1,302.00	88,405,800
住江織物	31,000	153.00	4,743,000
日本フェルト	7,200	394.00	2,836,800
日本バイリーン	18,000	388.00	6,984,000
芦森工業	47,000	126.00	5,922,000
アツギ	119,000	100.00	11,900,000
ダイニック	22,000	143.00	3,146,000
共和レザー	7,200	312.00	2,246,400
セーレン	30,400	507.00	15,412,800
小松精練	26,000	334.00	8,684,000
ワコールホールディングス	69,000	1,127.00	77,763,000
ホギメディカル	5,500	4,035.00	22,192,500
サンエー・インターナショナル	8,300	951.00	7,893,300
レナウン	21,100	216.00	4,557,600
クラウディア	2,700	1,094.00	2,953,800
I Tホールディングス	36,100	902.00	32,562,200
グリー	19,500	1,357.00	26,461,500
コーエーテクモホールディングス	23,700	548.00	12,987,600
特種東海製紙	78,000	205.00	15,990,000
ドワンゴ	68	167,300.00	11,376,400
ベリサーブ	11	116,300.00	1,279,300
マクロミル	59	134,000.00	7,906,000
ティーガイア	97	120,500.00	11,688,500
G M O ペイメントゲートウェイ	30	173,400.00	5,202,000

ザッパラス	67	111,100.00	7,443,700	
インターネットイニシアティブ	73	220,700.00	16,111,100	
ソネットエンタテインメント	58	222,900.00	12,928,200	
S R Aホールディングス	6,000	767.00	4,602,000	
J B I Sホールディングス	14,400	354.00	5,097,600	
朝日ネット	10,000	287.00	2,870,000	
王子製紙	511,000	369.00	188,559,000	
三菱製紙	164,000	88.00	14,432,000	
北越紀州製紙	77,500	401.00	31,077,500	
中越パルプ工業	53,000	149.00	7,897,000	
大王製紙	54,000	585.00	31,590,000	
日本製紙グループ本社	51,700	2,089.00	108,001,300	
レンゴー	92,000	539.00	49,588,000	
トーモク	44,000	207.00	9,108,000	
ザ・バック	8,800	1,578.00	13,886,400	
コープケミカル	19,000	105.00	1,995,000	
昭和電工	832,000	160.00	133,120,000	
住友化学	795,000	366.00	290,970,000	
日本化成	23,000	155.00	3,565,000	
住友精化	23,000	340.00	7,820,000	
日産化学工業	77,100	941.00	72,551,100	
クレハ	74,000	439.00	32,486,000	
テイカ	20,000	278.00	5,560,000	
石原産業	209,000	58.00	12,122,000	
片倉チッカリン	8,000	271.00	2,168,000	
日本曹達	75,000	342.00	25,650,000	
東ソー	290,000	225.00	65,250,000	
トクヤマ	195,000	424.00	82,680,000	
セントラル硝子	119,000	332.00	39,508,000	
東亜合成	127,000	353.00	44,831,000	
ダイソー	50,000	235.00	11,750,000	
関東電化工業	29,000	570.00	16,530,000	
電気化学工業	243,000	359.00	87,237,000	
イビデン	78,000	2,119.00	165,282,000	
信越化学工業	191,400	4,065.00	778,041,000	
堺化学工業	43,000	350.00	15,050,000	
エア・ウォーター	93,000	992.00	92,256,000	
太陽日酸	164,000	710.00	116,440,000	
日本化学工業	49,000	194.00	9,506,000	
日本パーカラライジング	27,000	1,088.00	29,376,000	
高圧ガス工業	19,000	494.00	9,386,000	
四国化成工業	18,000	491.00	8,838,000	
戸田工業	21,000	789.00	16,569,000	
ステラ ケミファ	6,100	2,907.00	17,732,700	
保土谷化学工業	30,000	262.00	7,860,000	

日本触媒	77,000	726.00	55,902,000
大日精化工業	45,000	377.00	16,965,000
カネカ	155,000	501.00	77,655,000
協和発酵キリン	149,000	827.00	123,223,000
三菱瓦斯化学	196,000	485.00	95,060,000
三井化学	455,000	225.00	102,375,000
J S R	113,400	1,421.00	161,141,400
東京応化工業	20,700	1,487.00	30,780,900
三菱ケミカルホールディングス	756,500	424.00	320,756,000
日本合成化学工業	29,000	498.00	14,442,000
ダイセル化学工業	148,000	562.00	83,176,000
住友ベークライト	107,000	421.00	45,047,000
積水化学工業	239,000	505.00	120,695,000
日本ゼオン	108,000	692.00	74,736,000
アイカ工業	31,000	952.00	29,512,000
宇部興産	522,000	185.00	96,570,000
積水樹脂	16,000	845.00	13,520,000
タキロン	29,000	277.00	8,033,000
旭有機材工業	40,000	194.00	7,760,000
日立化成工業	53,900	1,558.00	83,976,200
ニチバン	14,000	300.00	4,200,000
リケンテクノス	22,000	234.00	5,148,000
大倉工業	30,000	224.00	6,720,000
積水化成成品工業	32,000	369.00	11,808,000
群栄化学工業	33,000	221.00	7,293,000
タイガースポリマー	6,100	333.00	2,031,300
日本カーリット	10,900	409.00	4,458,100
日本化薬	88,000	814.00	71,632,000
イーピーエス	67	213,000.00	14,271,000
パナソニック電工インフォメーションシステムズ	2,500	2,036.00	5,090,000
アミューズ	3,100	920.00	2,852,000
野村総合研究所	66,600	1,569.00	104,495,400
ドリームインキュベータ	60	53,100.00	3,186,000
サイバネットシステム	116	23,940.00	2,777,040
T A C	6,400	362.00	2,316,800
電通	113,000	1,934.00	218,542,000
インテージ	3,600	1,599.00	5,756,400
シンプレクス・テクノロジー	166	50,600.00	8,399,600
イオンファンタジー	4,800	840.00	4,032,000
メディカルシステムネットワーク	1,900	644.00	1,223,600
日本精化	10,400	546.00	5,678,400
A D E K A	49,800	847.00	42,180,600
日油	102,000	367.00	37,434,000
ミヨシ油脂	47,000	141.00	6,627,000
ハリマ化成	11,000	431.00	4,741,000

花王	319,000	2,034.00	648,846,000
第一工業製薬	21,000	224.00	4,704,000
三洋化成工業	35,000	651.00	22,785,000
武田薬品工業	437,300	3,835.00	1,677,045,500
アステラス製薬	241,900	3,015.00	729,328,500
大日本住友製薬	88,100	699.00	61,581,900
塩野義製薬	168,500	1,528.00	257,468,000
田辺三菱製薬	104,000	1,360.00	141,440,000
わかもと製薬	13,000	291.00	3,783,000
あすか製薬	14,000	562.00	7,868,000
日本新薬	29,000	1,160.00	33,640,000
中外製薬	124,000	1,534.00	190,216,000
科研製薬	53,000	870.00	46,110,000
エーザイ	142,300	2,919.00	415,373,700
ロート製薬	52,000	1,040.00	54,080,000
小野薬品工業	58,000	3,635.00	210,830,000
久光製薬	35,100	3,410.00	119,691,000
有機合成薬品工業	9,000	218.00	1,962,000
持田製薬	45,000	857.00	38,565,000
大正製薬	100,000	1,689.00	168,900,000
参天製薬	35,300	2,891.00	102,052,300
扶桑薬品工業	42,000	250.00	10,500,000
日本ケミファ	18,000	278.00	5,004,000
ツムラ	34,000	2,596.00	88,264,000
テルモ	85,600	4,430.00	379,208,000
みらかホールディングス	23,700	2,955.00	70,033,500
キッセイ薬品工業	23,100	1,622.00	37,468,200
生化学工業	21,600	904.00	19,526,400
栄研化学	8,800	831.00	7,312,800
日水製薬	4,400	692.00	3,044,800
鳥居薬品	7,400	1,555.00	11,507,000
東和薬品	5,700	4,705.00	26,818,500
沢井製薬	7,500	7,510.00	56,325,000
ゼリア新薬工業	18,000	1,013.00	18,234,000
第一三共	366,400	1,698.00	622,147,200
キョーリン製薬ホールディングス	30,000	1,297.00	38,910,000
大幸薬品	3,200	1,181.00	3,779,200
大日本塗料	80,000	85.00	6,800,000
日本ペイント	108,000	563.00	60,804,000
関西ペイント	141,000	711.00	100,251,000
中国塗料	33,000	597.00	19,701,000
日本特殊塗料	11,000	348.00	3,828,000
藤倉化成	14,600	519.00	7,577,400
太陽インキ製造	9,100	2,336.00	21,257,600
D I C	441,000	147.00	64,827,000

サカタインクス	26,000	375.00	9,750,000
東洋インキ製造	112,000	328.00	36,736,000
アルプス技研	5,900	648.00	3,823,200
ダイオーズ	2,300	463.00	1,064,900
日本空調サービス	2,900	723.00	2,096,700
オリエンタルランド	30,200	7,780.00	234,956,000
ダスキン	34,900	1,500.00	52,350,000
パーク24	56,400	889.00	50,139,600
明光ネットワークジャパン	10,600	695.00	7,367,000
ファルコSDホールディングス	8,000	733.00	5,864,000
クレスコ	3,800	431.00	1,637,800
フジ・メディア・ホールディングス	1,222	106,300.00	129,898,600
秀英予備校	4,600	424.00	1,950,400
田谷	2,700	673.00	1,817,100
ラウンドワン	25,500	305.00	7,777,500
リゾートトラスト	18,100	1,251.00	22,643,100
オービック	3,680	15,780.00	58,070,400
ティーディーシーソフトウェアエンジニアリング	3,100	750.00	2,325,000
ヤフー	6,438	28,840.00	185,671,920
ビー・エム・エル	6,500	2,095.00	13,617,500
ワタベウェディング	3,800	872.00	3,313,600
トレンドマイクロ	51,900	2,491.00	129,282,900
もしもしホットライン	7,700	2,009.00	15,469,300
東急コミュニティー	2,800	2,310.00	6,468,000
リソー教育	1,388	4,130.00	5,732,440
日本オラクル	18,800	3,975.00	74,730,000
アルファシステムズ	3,400	1,644.00	5,589,600
フューチャーアーキテクト	146	29,510.00	4,308,460
ウェアハウス	6,700	297.00	1,989,900
シーエーシー	7,600	627.00	4,765,200
ソフトバンク・テクノロジー	3,400	683.00	2,322,200
トーセ	3,500	552.00	1,932,000
ユー・エス・エス	15,040	6,230.00	93,699,200
オービックビジネスコンサルタント	3,050	4,490.00	13,694,500
日立ビジネスソリューション	4,600	740.00	3,404,000
伊藤忠テクノソリューションズ	16,700	2,726.00	45,524,200
アイティフォー	14,900	269.00	4,008,100
東京個別指導学院	12,900	255.00	3,289,500
東計電算	2,400	1,148.00	2,755,200
カルチャ・コンビニエンス・クラブ	45,000	358.00	16,110,000
エクスネット	12	130,800.00	1,569,600
テー・オー・ダブリュー	3,200	467.00	1,494,400
大塚商会	9,400	5,540.00	52,076,000
総合メディカル	2,600	2,231.00	5,800,600
サイボウズ	185	23,730.00	4,390,050

ソフトブレン	267	5,440.00	1,452,480
アグレックス	2,800	770.00	2,156,000
セントラルスポーツ	4,500	865.00	3,892,500
電通国際情報サービス	8,200	582.00	4,772,400
ウェザーニューズ	3,200	1,267.00	4,054,400
C I J	12,000	273.00	3,276,000
富士フィルムホールディングス	247,000	2,765.00	682,955,000
コニカミノルタホールディングス	255,000	814.00	207,570,000
資生堂	206,700	1,874.00	387,355,800
ライオン	144,000	455.00	65,520,000
高砂香料工業	37,000	401.00	14,837,000
マンダム	11,600	2,247.00	26,065,200
ミルボン	6,000	2,310.00	13,860,000
ファンケル	24,100	1,333.00	32,125,300
コーセー	17,900	1,982.00	35,477,800
ドクターシーラボ	83	286,500.00	23,779,500
エステー	7,600	997.00	7,577,200
コニシ	9,800	1,008.00	9,878,400
長谷川香料	15,800	1,476.00	23,320,800
小林製薬	17,300	3,705.00	64,096,500
荒川化学工業	9,700	991.00	9,612,700
メック	9,000	413.00	3,717,000
日本高純度化学	33	244,000.00	8,052,000
荏原ユージライト	1,600	1,544.00	2,470,400
アース製薬	8,900	2,748.00	24,457,200
イハラケミカル工業	23,000	249.00	5,727,000
北興化学工業	15,000	241.00	3,615,000
大成ラミック	3,300	2,120.00	6,996,000
クミアイ化学工業	28,000	269.00	7,532,000
日本農薬	27,000	480.00	12,960,000
昭和シェル石油	111,300	638.00	71,009,400
コスモ石油	313,000	218.00	68,234,000
富士興産	42,000	65.00	2,730,000
ニチレキ	15,000	341.00	5,115,000
東燃ゼネラル石油	188,000	773.00	145,324,000
ユシロ化学工業	6,200	1,086.00	6,733,200
ビービー・カストロール	5,100	316.00	1,611,600
A O Cホールディングス	28,900	363.00	10,490,700
出光興産	13,300	7,160.00	95,228,000
J Xホールディングス	1,197,600	484.00	579,638,400
横浜ゴム	126,000	419.00	52,794,000
東洋ゴム工業	113,000	174.00	19,662,000
ブリヂストン	390,200	1,521.00	593,494,200
住友ゴム工業	87,400	815.00	71,231,000
藤倉ゴム工業	7,800	332.00	2,589,600

オカモト	48,000	354.00	16,992,000
アキレス	94,000	116.00	10,904,000
フコク	5,200	717.00	3,728,400
ニッタ	11,200	1,285.00	14,392,000
クリエートメディック	3,600	868.00	3,124,800
東海ゴム工業	19,200	905.00	17,376,000
三ツ星ベルト	32,000	405.00	12,960,000
バンドー化学	45,000	310.00	13,950,000
鬼怒川ゴム工業	25,000	368.00	9,200,000
旭硝子	613,000	851.00	521,663,000
日本板硝子	466,000	182.00	84,812,000
有沢製作所	18,000	520.00	9,360,000
日本山村硝子	53,000	216.00	11,448,000
日本電気硝子	202,000	1,138.00	229,876,000
オハラ	4,800	1,171.00	5,620,800
住友大阪セメント	209,000	143.00	29,887,000
太平洋セメント	465,000	98.00	45,570,000
デイ・シイ	20,300	135.00	2,740,500
リゾートソリューション	17,000	161.00	2,737,000
日本ヒューム	11,000	244.00	2,684,000
東海カーボン	116,000	522.00	60,552,000
日本カーボン	61,000	264.00	16,104,000
東洋炭素	6,100	4,260.00	25,986,000
ノリタケカンパニーリミテド	65,000	291.00	18,915,000
TOTO	178,000	572.00	101,816,000
日本碍子	137,000	1,387.00	190,019,000
日本特殊陶業	102,000	1,117.00	113,934,000
MARUWA	3,300	1,843.00	6,081,900
品川リフラクトリーズ	33,000	193.00	6,369,000
黒崎播磨	27,000	318.00	8,586,000
東京窯業	18,000	217.00	3,906,000
ニッカトー	5,600	388.00	2,172,800
フジインコーポレーテッド	11,400	1,288.00	14,683,200
ニチアス	61,000	363.00	22,143,000
新日本製鐵	3,267,000	284.00	927,828,000
住友金属工業	2,129,000	211.00	449,219,000
神戸製鋼所	1,611,000	196.00	315,756,000
日新製鋼	446,000	149.00	66,454,000
中山製鋼所	68,000	118.00	8,024,000
合同製鐵	66,000	178.00	11,748,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	249,500	2,553.00	636,973,500
東京製鐵	57,300	985.00	56,440,500
共英製鋼	11,600	1,109.00	12,864,400
大和工業	29,200	2,022.00	59,042,400
東京製鋼	28,000	177.00	4,956,000

大阪製鐵	7,800	1,275.00	9,945,000
淀川製鋼所	89,000	344.00	30,616,000
東洋鋼板	26,000	424.00	11,024,000
住友鋼管	7,300	454.00	3,314,200
丸一鋼管	34,700	1,600.00	55,520,000
モリ工業	23,000	292.00	6,716,000
大同特殊鋼	193,000	406.00	78,358,000
日本高周波鋼業	56,000	91.00	5,096,000
日本金属工業	85,000	110.00	9,350,000
日本冶金工業	72,500	256.00	18,560,000
山陽特殊製鋼	62,000	410.00	25,420,000
愛知製鋼	66,000	427.00	28,182,000
日立金属	68,000	983.00	66,844,000
日本金属	32,000	126.00	4,032,000
大太平洋金属	87,000	681.00	59,247,000
日本電工	53,000	659.00	34,927,000
日本鑄鉄管	20,000	118.00	2,360,000
日本製鋼所	178,000	786.00	139,908,000
三菱製鋼	79,000	172.00	13,588,000
日亜鋼業	21,000	211.00	4,431,000
日本精線	12,000	456.00	5,472,000
日本軽金属	284,000	156.00	44,304,000
大紀アルミニウム工業所	19,000	213.00	4,047,000
三井金属鉱業	339,000	239.00	81,021,000
東邦亜鉛	60,000	336.00	20,160,000
三菱マテリアル	690,000	240.00	165,600,000
住友金属鉱山	301,000	1,275.00	383,775,000
DOWAホールディングス	137,000	497.00	68,089,000
古河機械金属	209,000	90.00	18,810,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	12,200	3,910.00	47,702,000
東邦チタニウム	20,200	2,305.00	46,561,000
住友軽金属工業	175,000	93.00	16,275,000
古河スカイ	51,000	233.00	11,883,000
古河電気工業	365,000	314.00	114,610,000
住友電気工業	381,000	1,018.00	387,858,000
フジクラ	173,000	418.00	72,314,000
昭和電線ホールディングス	148,000	72.00	10,656,000
タツタ電線	24,000	200.00	4,800,000
日立電線	97,000	218.00	21,146,000
沖電線	13,000	125.00	1,625,000
カナレ電気	1,400	1,212.00	1,696,800
平河ヒューテック	2,800	650.00	1,820,000
リョービ	70,000	310.00	21,700,000
アサヒホールディングス	17,400	1,926.00	33,512,400
東洋製罐	88,000	1,504.00	132,352,000

ホッカホールディングス	36,000	215.00	7,740,000	
コロナ	5,900	777.00	4,584,300	
横河ブリッジホールディングス	26,000	544.00	14,144,000	
三和ホールディングス	117,000	247.00	28,899,000	
文化シャッター	44,000	217.00	9,548,000	
東洋シャッター	2,500	410.00	1,025,000	
住生活グループ	152,600	1,637.00	249,806,200	
日本ファイルコン	15,000	452.00	6,780,000	
ノーリツ	22,600	1,570.00	35,482,000	
長府製作所	13,300	1,909.00	25,389,700	
リンナイ	20,000	4,910.00	98,200,000	
ユニプレス	16,700	1,381.00	23,062,700	
ダイニチ工業	7,700	549.00	4,227,300	
日東精工	26,000	262.00	6,812,000	
三洋工業	16,000	120.00	1,920,000	
岡部	26,800	345.00	9,246,000	
日立ツール	7,900	958.00	7,568,200	
東プレ	24,100	621.00	14,966,100	
高周波熱錬	19,300	641.00	12,371,300	
東京製網	88,000	198.00	17,424,000	
パイオラックス	5,400	1,620.00	8,748,000	
日本発條	81,000	691.00	55,971,000	
中央発條	22,000	310.00	6,820,000	
三浦工業	17,000	1,889.00	32,113,000	
タクマ	45,000	192.00	8,640,000	
ツガミ	37,000	537.00	19,869,000	
オークマ	83,000	461.00	38,263,000	
東芝機械	63,000	288.00	18,144,000	
アマダ	190,000	572.00	108,680,000	
アイダエンジニアリング	31,400	293.00	9,200,200	
牧野フライス製作所	60,000	565.00	33,900,000	
オーエスジー	54,800	816.00	44,716,800	
旭ダイヤモンド工業	31,000	1,610.00	49,910,000	
森精機製作所	56,900	777.00	44,211,300	
ディスコ	11,300	4,800.00	54,240,000	
日東工器	7,300	2,150.00	15,695,000	
豊田自動織機	96,200	2,229.00	214,429,800	
オーエム製作所	14,000	239.00	3,346,000	
津田駒工業	30,000	143.00	4,290,000	
島精機製作所	15,000	1,710.00	25,650,000	
日本スピンドル製造	23,000	168.00	3,864,000	
日阪製作所	14,000	907.00	12,698,000	
やまびこ	4,900	724.00	3,547,600	
ベガサスミシン製造	24,200	198.00	4,791,600	
ナブテスコ	47,000	1,359.00	63,873,000	

三井海洋開発	11,100	1,306.00	14,496,600
レオン自動機	18,000	221.00	3,978,000
S M C	37,100	11,010.00	408,471,000
新川	10,400	866.00	9,006,400
ホソカワミクロン	26,000	273.00	7,098,000
ユニオンツール	7,700	2,093.00	16,116,100
オイレス工業	13,800	1,346.00	18,574,800
サトー	13,400	1,032.00	13,828,800
日本エアータック	6,400	410.00	2,624,000
日精樹脂工業	13,600	232.00	3,155,200
ワイエイシイ	8,600	608.00	5,228,800
小松製作所	516,200	1,938.00	1,000,395,600
住友重機械工業	246,000	430.00	105,780,000
日立建機	50,900	1,805.00	91,874,500
日工	19,000	258.00	4,902,000
巴工業	5,100	1,200.00	6,120,000
井関農機	124,000	228.00	28,272,000
丸山製作所	28,000	169.00	4,732,000
北川鉄工所	62,000	130.00	8,060,000
シンニッタン	14,400	247.00	3,556,800
クボタ	475,000	764.00	362,900,000
荏原実業	3,100	1,203.00	3,729,300
東洋エンジニアリング	94,000	273.00	25,662,000
三菱化工機	35,000	168.00	5,880,000
月島機械	21,000	539.00	11,319,000
帝国電機製作所	5,000	1,638.00	8,190,000
東京機械製作所	37,000	75.00	2,775,000
新東工業	23,100	602.00	13,906,200
澁谷工業	7,300	860.00	6,278,000
アイチ コーポレーション	22,700	330.00	7,491,000
小森コーポレーション	32,900	970.00	31,913,000
鶴見製作所	9,000	540.00	4,860,000
住友精密工業	24,000	277.00	6,648,000
酒井重工業	22,000	126.00	2,772,000
荏原製作所	237,000	370.00	87,690,000
西島製作所	11,200	1,342.00	15,030,400
千代田化工建設	100,000	683.00	68,300,000
ダイキン工業	130,000	3,140.00	408,200,000
オルガノ	23,000	532.00	12,236,000
トーヨーカネツ	68,000	137.00	9,316,000
栗田工業	63,800	2,317.00	147,824,600
椿本チエイン	66,000	343.00	22,638,000
大同工業	32,000	169.00	5,408,000
日機装	36,000	643.00	23,148,000
木村化工機	10,600	551.00	5,840,600

新興プランテック	22,900	758.00	17,358,200
アネスト岩田	24,000	274.00	6,576,000
ダイフク	48,000	424.00	20,352,000
加藤製作所	33,000	156.00	5,148,000
油研工業	20,000	162.00	3,240,000
タダノ	54,000	416.00	22,464,000
フジテック	31,000	412.00	12,772,000
シーケーディ	32,700	556.00	18,181,200
キトー	61	75,600.00	4,611,600
平和	22,100	1,017.00	22,475,700
理想科学工業	10,900	1,121.00	12,218,900
SANKYO	32,400	4,420.00	143,208,000
日本金銭機械	11,200	638.00	7,145,600
マースエンジニアリング	5,200	1,333.00	6,931,600
福島工業	4,300	702.00	3,018,600
オーイズミ	9,400	225.00	2,115,000
ダイコク電機	5,400	942.00	5,086,800
アマノ	33,000	678.00	22,374,000
サンデン	67,000	343.00	22,981,000
ブラザー工業	153,700	1,031.00	158,464,700
マックス	21,000	944.00	19,824,000
モリタホールディングス	17,000	450.00	7,650,000
グローリー	33,000	2,038.00	67,254,000
大和冷機工業	17,000	401.00	6,817,000
セガサミーホールディングス	125,500	1,276.00	160,138,000
日本ピストンリング	43,000	136.00	5,848,000
リケン	49,000	291.00	14,259,000
帝国ピストンリング	18,900	662.00	12,511,800
ホシザキ電機	24,000	1,500.00	36,000,000
大豊工業	13,200	609.00	8,038,800
日本精工	225,000	566.00	127,350,000
NTN	256,000	360.00	92,160,000
ジェイテクト	112,100	769.00	86,204,900
不二越	129,000	230.00	29,670,000
ミネベア	162,000	430.00	69,660,000
日本トムソン	40,000	565.00	22,600,000
THK	74,200	1,564.00	116,048,800
ユーシン精機	5,400	1,577.00	8,515,800
前澤給装工業	4,500	1,006.00	4,527,000
イーグル工業	18,000	667.00	12,006,000
日本ビラー工業	16,000	417.00	6,672,000
キッツ	57,600	341.00	19,641,600
日立製作所	2,546,000	365.00	929,290,000
東芝	2,503,000	404.00	1,011,212,000
三菱電機	1,031,000	718.00	740,258,000

富士電機ホールディングス	303,000	219.00	66,357,000
東洋電機製造	21,000	393.00	8,253,000
安川電機	130,000	673.00	87,490,000
シンフォニアテクノロジー	66,000	170.00	11,220,000
明電舎	111,000	307.00	34,077,000
オリジン電気	19,000	303.00	5,757,000
デンヨー	12,300	600.00	7,380,000
日立工機	31,800	741.00	23,563,800
三櫻工業	13,700	661.00	9,055,700
マキタ	72,400	2,647.00	191,642,800
東芝テック	75,000	306.00	22,950,000
芝浦メカトロニクス	20,000	280.00	5,600,000
マブチモーター	17,000	4,270.00	72,590,000
日本電産	53,600	7,420.00	397,712,000
高岳製作所	47,000	287.00	13,489,000
ダイヘン	61,000	352.00	21,472,000
日新電機	21,000	401.00	8,421,000
大崎電気工業	18,000	677.00	12,186,000
オムロン	132,400	1,896.00	251,030,400
日東工業	18,400	713.00	13,119,200
I D E C	16,400	760.00	12,464,000
エルピーダメモリ	116,900	960.00	112,224,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	214,000	587.00	125,618,000
サクサホールディングス	34,000	126.00	4,284,000
メルコホールディングス	5,900	2,812.00	16,590,800
テクノメディカ	8	285,000.00	2,280,000
日本電気	1,442,000	222.00	320,124,000
富士通	1,146,000	586.00	671,556,000
沖電気工業	405,000	73.00	29,565,000
岩崎通信機	48,000	64.00	3,072,000
電気興業	32,000	370.00	11,840,000
サンケン電気	65,000	269.00	17,485,000
ナカヨ通信機	16,000	173.00	2,768,000
アイホン	7,800	1,322.00	10,311,600
ルネサスエレクトロニクス	44,400	714.00	31,701,600
セイコーエプソン	88,500	1,265.00	111,952,500
ワコム	219	103,500.00	22,666,500
アルバック	21,900	1,486.00	32,543,400
アクセル	4,200	1,669.00	7,009,800
ナナオ	9,300	1,760.00	16,368,000
日本信号	28,000	600.00	16,800,000
京三製作所	26,000	372.00	9,672,000
能美防災	14,000	483.00	6,762,000
ホーチキ	12,000	422.00	5,064,000
マスプロ電工	8,600	802.00	6,897,200

日本無線	43,000	192.00	8,256,000
パナソニック	1,086,700	1,131.00	1,229,057,700
シャープ	533,000	831.00	442,923,000
アンリツ	58,000	528.00	30,624,000
富士通ゼネラル	30,000	423.00	12,690,000
日立国際電気	28,000	633.00	17,724,000
ソニー	593,400	2,581.00	1,531,565,400
T D K	57,400	4,655.00	267,197,000
帝国通信工業	26,000	195.00	5,070,000
三洋電機	1,178,000	138.00	162,564,000
ミツミ電機	35,600	1,280.00	45,568,000
タムラ製作所	32,000	233.00	7,456,000
アルプス電気	94,300	684.00	64,501,200
バイオニア	144,500	291.00	42,049,500
日本電波工業	8,100	1,282.00	10,384,200
日本トリム	1,550	1,899.00	2,943,450
ローランド ディー . ジー .	5,100	1,154.00	5,885,400
フォスター電機	9,900	2,116.00	20,948,400
クラリオン	63,000	145.00	9,135,000
S M K	37,000	374.00	13,838,000
ヨコオ	9,600	487.00	4,675,200
東光	50,000	124.00	6,200,000
ホシデン	29,600	756.00	22,377,600
ヒロセ電機	19,200	8,410.00	161,472,000
日本航空電子工業	24,000	508.00	12,192,000
T O A	16,000	430.00	6,880,000
アルパイン	23,600	1,069.00	25,228,400
スミダコーポレーション	9,400	739.00	6,946,600
アイコム	6,200	2,177.00	13,497,400
船井電機	9,500	2,438.00	23,161,000
横河電機	119,300	568.00	67,762,400
新電元工業	39,000	296.00	11,544,000
山武	30,500	2,091.00	63,775,500
日本光電工業	20,300	1,721.00	34,936,300
チノー	24,000	198.00	4,752,000
共和電業	13,000	270.00	3,510,000
日本電子材料	5,700	510.00	2,907,000
堀場製作所	20,400	2,039.00	41,595,600
アドバンテスト	81,100	1,661.00	134,707,100
小野測器	16,000	223.00	3,568,000
エスベック	12,600	505.00	6,363,000
サンクス	11,700	477.00	5,580,900
キーエンス	22,400	18,160.00	406,784,000
日置電機	5,700	1,730.00	9,861,000
シスメックス	20,900	5,790.00	121,011,000

メガチップス	9,000	1,400.00	12,600,000
O B A R A	8,700	768.00	6,681,600
日本電産コバル電子	12,300	675.00	8,302,500
ミヤチテクノス	8,200	529.00	4,337,800
東京電波	5,000	486.00	2,430,000
澤藤電機	13,000	166.00	2,158,000
デンソー	261,100	2,475.00	646,222,500
コーセル	15,900	1,005.00	15,979,500
日立メディコ	7,000	546.00	3,822,000
新日本無線	7,000	210.00	1,470,000
オブテックス	8,300	1,010.00	8,383,000
千代田インテグレ	6,100	877.00	5,349,700
東光電気	9,000	482.00	4,338,000
スタンレー電気	74,000	1,330.00	98,420,000
岩崎電気	49,000	146.00	7,154,000
ウシオ電機	67,000	1,405.00	94,135,000
岡谷電機産業	7,900	321.00	2,535,900
ヘリオス テクノ ホールディング	11,900	193.00	2,296,700
日本セラミック	7,800	1,379.00	10,756,200
新神戸電機	10,000	727.00	7,270,000
日本デジタル研究所	10,400	836.00	8,694,400
古河電池	7,000	531.00	3,717,000
双信電機	7,500	361.00	2,707,500
図研	8,300	526.00	4,365,800
日本電子	45,000	249.00	11,205,000
カシオ計算機	123,900	619.00	76,694,100
ファナック	114,900	10,630.00	1,221,387,000
日本シイエムケイ	25,500	372.00	9,486,000
エンプラス	6,000	1,162.00	6,972,000
ローム	55,300	5,150.00	284,795,000
浜松ホトニクス	46,400	2,723.00	126,347,200
三井ハイテック	16,300	470.00	7,661,000
新光電気工業	30,000	923.00	27,690,000
京セラ	91,800	7,890.00	724,302,000
協栄産業	18,000	156.00	2,808,000
太陽誘電	45,000	1,002.00	45,090,000
村田製作所	124,800	4,400.00	549,120,000
ユーシン	15,200	695.00	10,564,000
双葉電子工業	20,400	1,387.00	28,294,800
日東電工	96,200	3,265.00	314,093,000
北陸電気工業	44,000	163.00	7,172,000
パナソニック電工	193,000	1,107.00	213,651,000
東海理化電機製作所	27,800	1,412.00	39,253,600
ニチコン	37,500	929.00	34,837,500
日本ケミコン	65,000	344.00	22,360,000

K O A	15,800	794.00	12,545,200
三井造船	460,000	189.00	86,940,000
日立造船	499,500	117.00	58,441,500
佐世保重工業	78,000	168.00	13,104,000
三菱重工業	1,868,000	308.00	575,344,000
川崎重工業	863,000	237.00	204,531,000
I H I	820,000	160.00	131,200,000
日本車輛製造	43,000	407.00	17,501,000
日本輸送機	14,000	189.00	2,646,000
近畿車輛	18,000	379.00	6,822,000
日産自動車	1,335,100	729.00	973,287,900
いすゞ自動車	752,000	322.00	242,144,000
トヨタ自動車	1,527,500	2,998.00	4,579,445,000
日野自動車	148,000	403.00	59,644,000
三菱自動車工業	2,453,000	109.00	267,377,000
エフテック	4,400	1,296.00	5,702,400
武蔵精密工業	11,500	1,956.00	22,494,000
トヨタ車体	21,600	1,271.00	27,453,600
日産車体	46,000	604.00	27,784,000
関東自動車工業	18,000	554.00	9,972,000
新明和工業	49,000	309.00	15,141,000
極東開発工業	20,500	310.00	6,355,000
日信工業	19,400	1,335.00	25,899,000
トピー工業	98,000	184.00	18,032,000
ティラド	36,000	293.00	10,548,000
曙ブレーキ工業	45,900	495.00	22,720,500
タチエス	15,500	1,131.00	17,530,500
N O K	57,500	1,453.00	83,547,500
フタバ産業	36,200	538.00	19,475,600
カヤバ工業	75,000	470.00	35,250,000
シロキ工業	24,000	223.00	5,352,000
市光工業	35,000	156.00	5,460,000
大同メタル工業	17,000	424.00	7,208,000
プレス工業	56,000	294.00	16,464,000
カルソニックカンセイ	81,000	263.00	21,303,000
太平洋工業	25,000	361.00	9,025,000
ケーヒン	21,900	1,718.00	37,624,200
河西工業	16,000	398.00	6,368,000
アイシン精機	97,900	2,604.00	254,931,600
マツダ	723,000	201.00	145,323,000
ダイハツ工業	110,000	1,117.00	122,870,000
愛知機械工業	27,000	283.00	7,641,000
今仙電機製作所	8,800	1,110.00	9,768,000
本田技研工業	937,200	2,963.00	2,776,923,600
スズキ	226,300	1,756.00	397,382,800

富士重工業	376,000	532.00	200,032,000
ヤマハ発動機	180,800	1,253.00	226,542,400
ショーワ	25,300	497.00	12,574,100
小糸製作所	53,000	1,280.00	67,840,000
T B K	14,000	336.00	4,704,000
エクセディ	14,400	2,508.00	36,115,200
ミツバ	22,000	545.00	11,990,000
豊田合成	33,600	1,840.00	61,824,000
愛三工業	12,300	631.00	7,761,300
ヨロズ	7,100	1,394.00	9,897,400
エフ・シー・シー	15,600	1,798.00	28,048,800
新家工業	27,000	124.00	3,348,000
シマノ	49,100	4,420.00	217,022,000
タカタ	18,400	2,101.00	38,658,400
テイ・エス テック	22,600	1,388.00	31,368,800
小野建	10,100	658.00	6,645,800
はるやま商事	6,500	341.00	2,216,500
佐鳥電機	9,400	698.00	6,561,200
カッパ・クリエイト	7,750	1,750.00	13,562,500
エコートレーディング	3,000	840.00	2,520,000
伯東	7,500	741.00	5,557,500
中山福	7,000	574.00	4,018,000
ライトオン	9,500	430.00	4,085,000
ナガイレーベン	6,900	2,074.00	14,310,600
ジーンズメイト	4,400	201.00	884,400
菱食	11,400	1,964.00	22,389,600
良品計画	12,400	2,800.00	34,720,000
三城ホールディングス	14,600	764.00	11,154,400
松田産業	7,500	1,431.00	10,732,500
メディバルホールディングス	117,400	1,061.00	124,561,400
アドヴァン	8,100	603.00	4,884,300
S P K	2,800	1,129.00	3,161,200
アズワン	6,900	1,612.00	11,122,800
スズデン	5,400	531.00	2,867,400
尾家産業	4,100	786.00	3,222,600
シモジマ	8,100	1,163.00	9,420,300
ドウシシャ	5,500	2,068.00	11,374,000
コナカ	15,000	175.00	2,625,000
高速	7,500	740.00	5,550,000
ハウス オブ ローゼ	1,200	1,221.00	1,465,200
G - 7ホールディングス	4,000	535.00	2,140,000
イオン北海道	7,400	271.00	2,005,400
コジマ	15,800	428.00	6,762,400
コーナン商事	10,400	920.00	9,568,000
黒田電気	16,000	973.00	15,568,000

ネットワンシステムズ	226	113,000.00	25,538,000	
エコス	4,200	453.00	1,902,600	
ワタミ	12,300	1,596.00	19,630,800	
マルシェ	2,800	678.00	1,898,400	
ドン・キホーテ	18,600	2,073.00	38,557,800	
丸文	9,300	383.00	3,561,900	
メガネトップ	10,800	790.00	8,532,000	
西松屋チェーン	25,700	769.00	19,763,300	
ゼンショー	44,800	815.00	36,512,000	
ハピネット	3,400	1,056.00	3,590,400	
幸楽苑	6,600	1,197.00	7,900,200	
トーマンエレクトロニクス	3,900	999.00	3,896,100	
ハークスレイ	3,100	535.00	1,658,500	
サイゼリヤ	15,400	1,608.00	24,763,200	
エクセル	5,600	894.00	5,006,400	
マルカキカイ	5,100	611.00	3,116,100	
アルゴグラフィックス	4,500	982.00	4,419,000	
ガリバーインターナショナル	3,050	4,180.00	12,749,000	
ボブラ	4,500	496.00	2,232,000	
ユナイテッドアローズ	12,800	1,124.00	14,387,200	
進和	6,700	979.00	6,559,300	
エスケイジャパン	5,500	254.00	1,397,000	
ダイトエレクトロン	7,000	523.00	3,661,000	
ハイデイ日高	4,700	1,145.00	5,381,500	
シークス	8,400	883.00	7,417,200	
京都きもの友禅	6,800	875.00	5,950,000	
コロワイド	33,500	447.00	14,974,500	
田中商事	6,100	311.00	1,897,100	
オーハシテクニカ	7,400	588.00	4,351,200	
壱番屋	4,100	2,273.00	9,319,300	
マクニカ	5,100	1,633.00	8,328,300	
白銅	4,600	831.00	3,822,600	
トップカルチャー	4,600	401.00	1,844,600	
スギホールディングス	16,400	1,884.00	30,897,600	
島津製作所	131,000	642.00	84,102,000	
JMS	18,000	298.00	5,364,000	
アロカ	7,000	553.00	3,871,000	
長野計器	7,100	629.00	4,465,900	
スター精密	23,100	816.00	18,849,600	
東京計器	49,000	112.00	5,488,000	
愛知時計電機	15,000	238.00	3,570,000	
日本電産トーソク	7,200	955.00	6,876,000	
東京精密	23,400	1,086.00	25,412,400	
ニコン	207,200	1,548.00	320,745,600	
トプコン	24,200	332.00	8,034,400	

オリンパス	130,300	2,186.00	284,835,800
理研計器	10,000	564.00	5,640,000
大日本スクリーン製造	123,000	430.00	52,890,000
キヤノン電子	10,900	2,132.00	23,238,800
タムロン	11,900	1,711.00	20,360,900
H O Y A	257,000	2,035.00	522,995,000
ノーリツ鋼機	10,500	500.00	5,250,000
キヤノン	738,600	3,895.00	2,876,847,000
リコー	330,000	1,177.00	388,410,000
日本電産コバル	12,000	1,372.00	16,464,000
日本電産サンキョー	28,000	628.00	17,584,000
シチズンホールディングス	129,500	501.00	64,879,500
リズム時計工業	59,000	148.00	8,732,000
S R I スポーツ	75	87,400.00	6,555,000
バンダイナムコホールディングス	129,300	774.00	100,078,200
共立印刷	19,200	124.00	2,380,800
フランスベッドホールディングス	80,000	124.00	9,920,000
パイロットコーポレーション	116	152,400.00	17,678,400
エイベックス・グループ・ホールディングス	17,700	1,119.00	19,806,300
トッパン・フォームズ	21,300	776.00	16,528,800
フジシールインターナショナル	11,100	1,736.00	19,269,600
タカラトミー	35,600	670.00	23,852,000
レック	3,500	1,212.00	4,242,000
アロン化成	9,000	346.00	3,114,000
タカノ	6,100	449.00	2,738,900
プロネクサス	13,200	463.00	6,111,600
ウッドワン	22,000	325.00	7,150,000
大建工業	52,000	221.00	11,492,000
きもと	10,100	581.00	5,868,100
凸版印刷	336,000	653.00	219,408,000
大日本印刷	336,000	1,019.00	342,384,000
図書印刷	23,000	140.00	3,220,000
共同印刷	40,000	201.00	8,040,000
日本写真印刷	18,500	1,897.00	35,094,500
光村印刷	13,000	297.00	3,861,000
藤森工業	8,300	1,147.00	9,520,100
宝印刷	4,800	655.00	3,144,000
前澤化成工業	8,800	822.00	7,233,600
コンビ	7,000	715.00	5,005,000
アシックス	103,000	851.00	87,653,000
ツツミ	5,200	2,077.00	10,800,400
J S P	8,100	947.00	7,670,700
ニチハ	14,500	683.00	9,903,500
ローランド	12,200	953.00	11,626,600
エフピコ	5,500	4,520.00	24,860,000

小松ウオール工業	4,100	757.00	3,103,700
ヤマハ	80,100	969.00	77,616,900
河合楽器製作所	44,000	153.00	6,732,000
クリナップ	14,300	525.00	7,507,500
ビジョン	6,700	2,654.00	17,781,800
天馬	8,800	857.00	7,541,600
パラマウントベッド	11,700	2,247.00	26,289,900
キングジム	9,000	641.00	5,769,000
リンテック	25,500	1,839.00	46,894,500
信越ポリマー	21,400	471.00	10,079,400
東リ	30,000	134.00	4,020,000
イトーキ	28,500	241.00	6,868,500
任天堂	62,800	20,860.00	1,310,008,000
三菱鉛筆	10,100	1,483.00	14,978,300
タカラスタンダード	55,000	541.00	29,755,000
コクヨ	61,800	660.00	40,788,000
ナカバヤシ	29,000	182.00	5,278,000
ニフコ	25,800	2,005.00	51,729,000
グローブライド	59,000	96.00	5,664,000
岡村製作所	46,000	455.00	20,930,000
日本バルカー工業	48,000	241.00	11,568,000
MUTOHホールディングス	17,000	191.00	3,247,000
伊藤忠商事	760,600	764.00	581,098,400
丸紅	898,000	472.00	423,856,000
スクロール	15,100	315.00	4,756,500
高島	27,000	123.00	3,321,000
F & A アクアホールディングス	9,500	803.00	7,628,500
三陽商会	62,000	349.00	21,638,000
長瀬産業	61,000	947.00	57,767,000
蝶理	82,000	93.00	7,626,000
豊田通商	104,600	1,230.00	128,658,000
オンワードホールディングス	77,000	655.00	50,435,000
三共生興	22,200	262.00	5,816,400
兼松	250,000	70.00	17,500,000
美津濃	59,000	372.00	21,948,000
ファミリーマート	36,100	2,993.00	108,047,300
三井物産	945,400	1,242.00	1,174,186,800
日本紙パルプ商事	61,000	276.00	16,836,000
東京エレクトロン	93,400	4,185.00	390,879,000
日立ハイテクノロジーズ	35,600	1,540.00	54,824,000
カメイ	16,000	368.00	5,888,000
東都水産	26,000	123.00	3,198,000
スターゼン	40,000	231.00	9,240,000
セイコーホールディングス	41,000	281.00	11,521,000
山善	45,200	322.00	14,554,400

椿本興業	15,000	215.00	3,225,000
住友商事	600,200	1,076.00	645,815,200
日本ユニシス	29,200	552.00	16,118,400
内田洋行	28,000	334.00	9,352,000
三菱商事	877,000	1,981.00	1,737,337,000
第一実業	26,000	253.00	6,578,000
キヤノンマーケティングジャパン	39,100	1,149.00	44,925,900
西華産業	45,000	183.00	8,235,000
佐藤商事	11,700	491.00	5,744,700
菱洋エレクトロ	13,100	761.00	9,969,100
東京産業	12,000	261.00	3,132,000
ユアサ商事	120,000	80.00	9,600,000
神鋼商事	29,000	179.00	5,191,000
阪和興業	118,000	328.00	38,704,000
カナデン	12,000	461.00	5,532,000
菱電商事	17,000	464.00	7,888,000
ニプロ	23,600	1,746.00	41,205,600
フルサト工業	7,000	474.00	3,318,000
岩谷産業	122,000	242.00	29,524,000
すてきなイスグループ	51,000	180.00	9,180,000
昭光通商	44,000	123.00	5,412,000
ニチモウ	17,000	140.00	2,380,000
極東貿易	18,000	126.00	2,268,000
イワキ	16,000	205.00	3,280,000
兼松エレクトロニクス	6,600	805.00	5,313,000
三愛石油	31,000	365.00	11,315,000
稲畑産業	29,600	422.00	12,491,200
明和産業	9,300	225.00	2,092,500
ゴールドウイン	28,000	161.00	4,508,000
東京スタイル	42,000	647.00	27,174,000
ユニ・チャーム	68,700	3,360.00	230,832,000
デサント	35,000	504.00	17,640,000
ヤマトインターナショナル	13,900	370.00	5,143,000
東邦ホールディングス	30,300	1,177.00	35,663,100
サンゲツ	19,700	1,819.00	35,834,300
ミツウロコ	19,400	516.00	10,010,400
シナネン	28,000	342.00	9,576,000
伊藤忠エネクス	26,600	397.00	10,560,200
サンリオ	33,100	1,595.00	52,794,500
リョーサン	17,900	2,088.00	37,375,200
新光商事	11,900	695.00	8,270,500
トーヨー	23,000	292.00	6,716,000
三信電気	12,400	707.00	8,766,800
東陽テクニカ	16,100	810.00	13,041,000
モスフードサービス	15,400	1,517.00	23,361,800

加賀電子	12,000	909.00	10,908,000
三益半導体工業	9,300	838.00	7,793,400
ソーダニッカ	13,000	336.00	4,368,000
立花エレテック	7,900	635.00	5,016,500
木曽路	12,400	1,839.00	22,803,600
千趣会	21,100	476.00	10,043,600
タカキュー	11,500	140.00	1,610,000
ケーヨー	22,200	432.00	9,590,400
ユニヘアー	13,700	1,104.00	15,124,800
上新電機	26,000	807.00	20,982,000
日本瓦斯	12,500	1,363.00	17,037,500
ベスト電器	36,500	209.00	7,628,500
マルエツ	24,000	339.00	8,136,000
ロイヤルホールディングス	18,100	824.00	14,914,400
いなげや	13,000	914.00	11,882,000
島忠	22,800	1,606.00	36,616,800
チヨダ	15,400	900.00	13,860,000
ライフコーポレーション	7,400	1,282.00	9,486,800
カスミ	24,000	445.00	10,680,000
リンガーハット	8,100	966.00	7,824,600
MrMax	12,000	369.00	4,428,000
テンアライド	7,900	303.00	2,393,700
AOKIホールディングス	10,900	1,267.00	13,810,300
オークワ	15,000	755.00	11,325,000
コメリ	14,100	1,865.00	26,296,500
青山商事	27,400	1,348.00	36,935,200
しまむら	12,300	7,750.00	95,325,000
CFSコーポレーション	11,000	442.00	4,862,000
高島屋	147,000	644.00	94,668,000
松屋	23,400	505.00	11,817,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	61,000	523.00	31,903,000
ニッセンホールディングス	24,100	345.00	8,314,500
バルコ	30,500	674.00	20,557,000
丸井グループ	129,400	625.00	80,875,000
クレディセゾン	84,700	1,116.00	94,525,200
原信ナルスホールディングス	6,500	1,035.00	6,727,500
セディナ	103,000	134.00	13,802,000
ダイエー	49,800	341.00	16,981,800
イズミヤ	40,000	305.00	12,200,000
イオン	384,200	896.00	344,243,200
ユニー	89,000	660.00	58,740,000
イズミ	28,700	1,048.00	30,077,600
東武ストア	16,000	250.00	4,000,000
平和堂	21,600	977.00	21,103,200
フジ	13,300	1,708.00	22,716,400

ヤオコー	5,200	2,385.00	12,402,000	
ゼビオ	12,400	1,624.00	20,137,600	
ケーズホールディングス	22,500	1,920.00	43,200,000	
P a l t a c	9,300	1,573.00	14,628,900	
O l y m p i c	7,800	655.00	5,109,000	
新生銀行	532,000	59.00	31,388,000	
あおぞら銀行	366,000	123.00	45,018,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	8,358,400	389.00	3,251,417,600	
りそなホールディングス	314,000	749.00	235,186,000	
中央三井トラスト・ホールディングス	612,000	277.00	169,524,000	
三井住友フィナンシャルグループ	835,200	2,432.00	2,031,206,400	
第四銀行	154,000	281.00	43,274,000	
北越銀行	122,000	150.00	18,300,000	
西日本シティ銀行	382,000	239.00	91,298,000	
札幌北洋ホールディングス	163,000	386.00	62,918,000	
千葉銀行	430,000	487.00	209,410,000	
横浜銀行	754,000	390.00	294,060,000	
常陽銀行	425,000	364.00	154,700,000	
群馬銀行	274,000	437.00	119,738,000	
武蔵野銀行	17,900	2,573.00	46,056,700	
千葉興業銀行	22,500	496.00	11,160,000	
筑波銀行	35,700	263.00	9,389,100	
東京都民銀行	21,000	919.00	19,299,000	
七十七銀行	184,000	423.00	77,832,000	
青森銀行	82,000	211.00	17,302,000	
秋田銀行	81,000	279.00	22,599,000	
山形銀行	67,000	398.00	26,666,000	
岩手銀行	7,900	3,670.00	28,993,000	
東邦銀行	99,000	236.00	23,364,000	
東北銀行	62,000	139.00	8,618,000	
みちのく銀行	60,000	182.00	10,920,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	445,000	334.00	148,630,000	
静岡銀行	338,000	719.00	243,022,000	
十六銀行	143,000	276.00	39,468,000	
スルガ銀行	114,000	736.00	83,904,000	
八十二銀行	223,000	436.00	97,228,000	
山梨中央銀行	74,000	335.00	24,790,000	
大垣共立銀行	157,000	256.00	40,192,000	
福井銀行	102,000	285.00	29,070,000	
北國銀行	125,000	333.00	41,625,000	
清水銀行	4,000	3,530.00	14,120,000	
滋賀銀行	110,000	488.00	53,680,000	
南都銀行	109,000	487.00	53,083,000	
百五銀行	109,000	359.00	39,131,000	
京都銀行	196,000	677.00	132,692,000	

三重銀行	49,000	233.00	11,417,000
ほくほくフィナンシャルグループ	771,000	153.00	117,963,000
広島銀行	323,000	340.00	109,820,000
山陰合同銀行	71,000	598.00	42,458,000
中国銀行	97,000	1,015.00	98,455,000
鳥取銀行	38,000	208.00	7,904,000
伊予銀行	135,000	677.00	91,395,000
百十四銀行	129,000	317.00	40,893,000
四国銀行	85,000	271.00	23,035,000
阿波銀行	98,000	578.00	56,644,000
鹿児島銀行	76,000	510.00	38,760,000
大分銀行	76,000	274.00	20,824,000
宮崎銀行	75,000	228.00	17,100,000
肥後銀行	92,000	438.00	40,296,000
佐賀銀行	68,000	241.00	16,388,000
十八銀行	76,000	230.00	17,480,000
沖縄銀行	9,200	3,115.00	28,658,000
琉球銀行	23,200	1,018.00	23,617,600
住友信託銀行	989,000	418.00	413,402,000
みずほ信託銀行	930,000	70.00	65,100,000
八千代銀行	6,300	1,894.00	11,932,200
みずほフィナンシャルグループ	13,259,900	122.00	1,617,707,800
紀陽ホールディングス	438,000	117.00	51,246,000
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	11,700	2,087.00	24,417,900
興銀リース	18,300	1,634.00	29,902,200
東京センチュリーリース	29,600	1,007.00	29,807,200
S B Iホールディングス	12,592	10,470.00	131,838,240
日本証券金融	53,600	478.00	25,620,800
大阪証券金融	32,600	166.00	5,411,600
ポケットカード	11,100	222.00	2,464,200
長野銀行	43,000	165.00	7,095,000
名古屋銀行	106,000	264.00	27,984,000
愛知銀行	4,300	5,240.00	22,532,000
第三銀行	72,000	252.00	18,144,000
中京銀行	49,000	262.00	12,838,000
東日本銀行	64,000	155.00	9,920,000
愛媛銀行	75,000	222.00	16,650,000
トマト銀行	45,000	166.00	7,470,000
みなと銀行	121,000	133.00	16,093,000
京葉銀行	97,000	414.00	40,158,000
関西アーバン銀行	137,000	126.00	17,262,000
栃木銀行	59,000	352.00	20,768,000
北日本銀行	3,800	2,114.00	8,033,200
福島銀行	144,000	49.00	7,056,000

大東銀行	75,000	58.00	4,350,000
リコーリース	9,300	2,062.00	19,176,600
イオンクレジットサービス	54,800	899.00	49,265,200
アコム	32,280	1,263.00	40,769,640
プロミス	49,800	626.00	31,174,800
ジャックス	97,000	148.00	14,356,000
日立キャピタル	28,200	1,138.00	32,091,600
オリックス	57,160	6,380.00	364,680,800
三菱UFJリース	29,950	2,935.00	87,903,250
ジャフコ	16,600	1,971.00	32,718,600
トモニホールディングス	72,300	268.00	19,376,400
大和証券グループ本社	1,034,000	337.00	348,458,000
野村ホールディングス	2,197,700	404.00	887,870,800
みずほ証券	304,000	191.00	58,064,000
みずほインベスターズ証券	273,000	80.00	21,840,000
岡三証券グループ	100,000	279.00	27,900,000
丸三証券	36,300	429.00	15,572,700
東洋証券	50,000	125.00	6,250,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	124,000	275.00	34,100,000
水戸証券	37,000	159.00	5,883,000
いちよし証券	24,800	580.00	14,384,000
松井証券	69,600	467.00	32,503,200
NK S Jホールディングス	834,000	524.00	437,016,000
だいこう証券ビジネス	8,200	302.00	2,476,400
マネックスグループ	884	28,100.00	24,840,400
カブドットコム証券	36,100	319.00	11,515,900
極東証券	15,400	662.00	10,194,800
岩井コスモホールディングス	11,300	632.00	7,141,600
フィデアホールディングス	57,400	187.00	10,733,800
池田泉州ホールディングス	464,800	125.00	58,100,000
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	322,600	1,917.00	618,424,200
ソニーフィナンシャルホールディングス	482	272,000.00	131,104,000
第一生命保険	4,707	100,800.00	474,465,600
富士火災海上保険	181,000	113.00	20,453,000
東京海上ホールディングス	445,500	2,252.00	1,003,266,000
N E C キャピタルソリューション	7,300	1,039.00	7,584,700
T & Dホールディングス	201,250	1,740.00	350,175,000
三井不動産	488,000	1,408.00	687,104,000
三菱地所	770,000	1,358.00	1,045,660,000
平和不動産	95,000	199.00	18,905,000
東京建物	250,000	320.00	80,000,000
ダイビル	33,200	618.00	20,517,600
サンケイビル	26,900	455.00	12,239,500
東急不動産	219,000	346.00	75,774,000
京阪神不動産	18,300	376.00	6,880,800

住友不動産	264,000	1,725.00	455,400,000
東宝不動産	18,800	510.00	9,588,000
大京	186,000	113.00	21,018,000
テーオーシー	55,000	365.00	20,075,000
東京楽天地	27,000	330.00	8,910,000
フジ住宅	24,200	302.00	7,308,400
空港施設	18,600	324.00	6,026,400
住友不動産販売	5,200	3,780.00	19,656,000
ゴールドクレスト	9,660	1,574.00	15,204,840
東急リバブル	15,900	895.00	14,230,500
飯田産業	11,300	651.00	7,356,300
アーネストワン	22,300	920.00	20,516,000
サンヨーハウジング名古屋	109	74,000.00	8,066,000
イオンモール	54,300	2,029.00	110,174,700
タクトホーム	91	62,400.00	5,678,400
エヌ・ティ・ティ都市開発	758	70,200.00	53,211,600
東武鉄道	475,000	481.00	228,475,000
相鉄ホールディングス	166,000	370.00	61,420,000
東京急行電鉄	606,000	369.00	223,614,000
京浜急行電鉄	305,000	807.00	246,135,000
小田急電鉄	354,000	772.00	273,288,000
京王電鉄	308,000	574.00	176,792,000
京成電鉄	165,000	536.00	88,440,000
富士急行	32,000	477.00	15,264,000
新京成電鉄	15,000	357.00	5,355,000
東日本旅客鉄道	206,700	5,040.00	1,041,768,000
西日本旅客鉄道	960	299,400.00	287,424,000
東海旅客鉄道	952	614,000.00	584,528,000
アートコーポレーション	2,700	1,386.00	3,742,200
西日本鉄道	154,000	359.00	55,286,000
ハマキョウレックス	3,400	2,118.00	7,201,200
サカイ引越センター	2,200	1,723.00	3,790,600
近畿日本鉄道	1,011,000	282.00	285,102,000
阪急阪神ホールディングス	751,000	401.00	301,151,000
南海電気鉄道	233,000	364.00	84,812,000
京阪電気鉄道	251,000	369.00	92,619,000
名糖運輸	4,500	724.00	3,258,000
名古屋鉄道	391,000	246.00	96,186,000
日本通運	471,000	317.00	149,307,000
ヤマトホールディングス	224,600	1,010.00	226,846,000
山九	132,000	327.00	43,164,000
日新	45,000	189.00	8,505,000
丸運	6,400	214.00	1,369,600
丸全昭和運輸	36,000	282.00	10,152,000
センコー	42,000	254.00	10,668,000

トナミホールディングス	27,000	178.00	4,806,000
日本梱包運輸倉庫	33,000	1,016.00	33,528,000
日本石油輸送	13,000	184.00	2,392,000
福山通運	82,000	430.00	35,260,000
セイノーホールディングス	84,000	505.00	42,420,000
神奈川中央交通	14,000	436.00	6,104,000
日立物流	20,600	1,262.00	25,997,200
日本郵船	817,000	342.00	279,414,000
商船三井	535,000	525.00	280,875,000
川崎汽船	342,000	314.00	107,388,000
新和海運	42,000	227.00	9,534,000
乾汽船	13,600	461.00	6,269,600
飯野海運	59,300	446.00	26,447,800
第一中央汽船	82,000	202.00	16,564,000
全日本空輸	1,585,000	309.00	489,765,000
パスコ	21,000	192.00	4,032,000
三菱倉庫	78,000	1,001.00	78,078,000
三井倉庫	41,000	307.00	12,587,000
住友倉庫	80,000	418.00	33,440,000
澁澤倉庫	31,000	306.00	9,486,000
ヤマタネ	54,000	113.00	6,102,000
東陽倉庫	19,000	182.00	3,458,000
日本トランスシティ	25,000	276.00	6,900,000
ケイヒン	22,000	92.00	2,024,000
安田倉庫	9,200	488.00	4,489,600
東洋埠頭	34,000	147.00	4,998,000
宇徳	7,500	217.00	1,627,500
上組	132,000	620.00	81,840,000
サンリツ	3,100	588.00	1,822,800
キムラユニティー	2,700	683.00	1,844,100
キューソー流通システム	3,700	903.00	3,341,100
郵船航空サービス	9,400	1,188.00	11,167,200
近鉄エクスプレス	9,300	1,968.00	18,302,400
東海運	7,500	192.00	1,440,000
バンテック	55	125,800.00	6,919,000
東京放送ホールディングス	63,700	1,074.00	68,413,800
日本テレビ放送網	10,300	10,730.00	110,519,000
テレビ朝日	297	112,000.00	33,264,000
テレビ東京	4,800	1,556.00	7,468,800
スカパーJ S A Tホールディングス	904	27,580.00	24,932,320
アイ・ティー・シーネットワーク	10,500	446.00	4,683,000
イー・アクセス	674	64,000.00	43,136,000
NECモバイリング	3,900	2,237.00	8,724,300
日本電信電話	462,400	3,645.00	1,685,448,000
K D D I	1,821	399,500.00	727,489,500

光通信	15,200	1,569.00	23,848,800
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	9,700	139,000.00	1,348,300,000
GMOインターネット	35,800	295.00	10,561,000
学研ホールディングス	51,000	168.00	8,568,000
ゼンリン	15,900	903.00	14,357,700
昭文社	7,000	544.00	3,808,000
角川グループホールディングス	10,100	1,830.00	18,483,000
インプレスホールディングス	9,700	132.00	1,280,400
東京電力	699,200	2,036.00	1,423,571,200
中部電力	366,200	2,063.00	755,470,600
関西電力	450,500	2,027.00	913,163,500
中国電力	164,400	1,647.00	270,766,800
北陸電力	113,900	1,906.00	217,093,400
東北電力	278,500	1,846.00	514,111,000
四国電力	120,500	2,395.00	288,597,500
九州電力	245,100	1,906.00	467,160,600
北海道電力	103,300	1,662.00	171,684,600
沖縄電力	7,800	3,885.00	30,303,000
電源開発	73,800	2,510.00	185,238,000
東京瓦斯	1,387,000	379.00	525,673,000
大阪瓦斯	1,195,000	301.00	359,695,000
東邦瓦斯	309,000	413.00	127,617,000
北海道瓦斯	21,000	246.00	5,166,000
西部瓦斯	134,000	243.00	32,562,000
静岡瓦斯	33,500	487.00	16,314,500
アイネット	7,100	455.00	3,230,500
松竹	73,000	569.00	41,537,000
東宝	83,700	1,343.00	112,409,100
エイチ・アイ・エス	12,700	1,638.00	20,802,600
東映	45,000	374.00	16,830,000
葵プロモーション	6,500	448.00	2,912,000
エヌ・ティ・ティ・データ	725	263,900.00	191,327,500
共立メンテナンス	6,100	1,232.00	7,515,200
イチネンホールディングス	15,600	363.00	5,662,800
建設技術研究所	8,000	441.00	3,528,000
アインファーマシーズ	3,500	2,905.00	10,167,500
燦ホールディングス	2,500	1,329.00	3,322,500
スバル興業	9,000	232.00	2,088,000
東京テアトル	41,000	118.00	4,838,000
ホリプロ	3,800	651.00	2,473,800
よみうりランド	28,000	297.00	8,316,000
東京都競馬	85,000	120.00	10,200,000
常磐興産	35,000	128.00	4,480,000
カナモト	18,000	457.00	8,226,000
東京ドーム	91,000	213.00	19,383,000

D T S	11,500	845.00	9,717,500
スクウェア・エニックス・ホールディングス	29,900	1,871.00	55,942,900
シーイーシー	8,300	389.00	3,228,700
カブコン	25,200	1,309.00	32,986,800
日本空港ビルデング	39,200	1,380.00	54,096,000
トランス・コスモス	15,900	683.00	10,859,700
乃村工藝社	27,000	245.00	6,615,000
ジャステック	7,400	520.00	3,848,000
住商情報システム	12,200	1,269.00	15,481,800
藤田観光	32,000	377.00	12,064,000
日本管財	4,600	1,358.00	6,246,800
白洋舎	17,000	252.00	4,284,000
セコム	112,000	3,770.00	422,240,000
日本システムウエア	6,600	327.00	2,158,200
セントラル警備保障	5,000	761.00	3,805,000
アイネス	14,800	533.00	7,888,400
丹青社	17,000	172.00	2,924,000
メイテック	17,100	1,551.00	26,522,100
T K C	8,900	1,605.00	14,284,500
アサツー ディ・ケイ	20,000	1,803.00	36,060,000
富士ソフト	14,800	1,284.00	19,003,200
応用地質	13,100	674.00	8,829,400
船井総合研究所	13,300	500.00	6,650,000
日本システムディベロップメント	24,800	947.00	23,485,600
進学会	8,200	253.00	2,074,600
コナミ	47,800	1,474.00	70,457,200
ベネッセホールディングス	39,300	4,020.00	157,986,000
イオンディライト	12,000	1,562.00	18,744,000
ナック	2,900	974.00	2,824,600
福井コンピュータ	4,300	400.00	1,720,000
ニチイ学館	25,200	758.00	19,101,600
ダイセキ	20,000	1,572.00	31,440,000
日鐵商事	30,000	242.00	7,260,000
元気寿司	3,300	1,000.00	3,300,000
トラスコ中山	13,400	1,165.00	15,611,000
ヤマダ電機	53,520	5,180.00	277,233,600
オートバックスセブン	13,800	3,185.00	43,953,000
アークランドサカモト	7,100	980.00	6,958,000
ニトリホールディングス	21,150	6,980.00	147,627,000
グルメ杵屋	8,000	498.00	3,984,000
愛眼	8,600	454.00	3,904,400
吉野家ホールディングス	318	103,400.00	32,881,200
加藤産業	16,900	1,232.00	20,820,800
富士エレクトロニクス	7,400	992.00	7,340,800
松屋フーズ	5,600	1,262.00	7,067,200

J B C Cホールディングス	10,000	506.00	5,060,000	
J Kホールディングス	12,900	370.00	4,773,000	
サガミチェーン	13,000	493.00	6,409,000	
日伝	4,900	2,539.00	12,441,100	
杉本商事	6,300	717.00	4,517,100	
因幡電機産業	12,100	2,078.00	25,143,800	
住金物産	55,000	169.00	9,295,000	
ブレナス	13,100	1,267.00	16,597,700	
ミニストップ	8,800	1,232.00	10,841,600	
アークス	13,900	1,133.00	15,748,700	
パロー	21,400	635.00	13,589,000	
ミスミグループ本社	39,700	1,750.00	69,475,000	
江守商事	2,900	759.00	2,201,100	
アルテック	5,000	215.00	1,075,000	
ベルク	4,600	855.00	3,933,000	
大庄	6,900	1,007.00	6,948,300	
タキヒヨー	19,000	375.00	7,125,000	
ファーストリテイリング	27,400	11,760.00	322,224,000	
ソフトバンク	479,700	2,731.00	1,310,060,700	
スズケン	41,600	2,763.00	114,940,800	
サンドラッグ	22,300	2,253.00	50,241,900	
ジェコス	9,600	313.00	3,004,800	
ヤマザワ	3,000	1,185.00	3,555,000	
やまや	2,200	751.00	1,652,200	
ペルーナ	15,500	413.00	6,401,500	
合計	168,626,313		124,571,617,290	

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](#)

「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21年 9月30日現在)	(平成22年 9月30日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	1,516,863,604	1,087,290,386
国債証券	108,800,534,100	121,949,865,900
地方債証券	9,399,449,167	10,476,574,653
特殊債券	17,099,060,533	17,007,527,750
社債券	11,992,401,950	13,942,323,080
未収利息	326,311,671	349,903,899
前払費用	21,919,519	10,169,870
流動資産合計	149,156,540,544	164,823,655,538
資産合計	149,156,540,544	164,823,655,538
負債の部		
流動負債		
未払金	1,096,944,200	1,103,171,000
未払解約金	45,310,000	24,209,941
流動負債合計	1,142,254,200	1,127,380,941
負債合計	1,142,254,200	1,127,380,941
純資産の部		
元本等		
元本	126,462,206,194	134,702,024,810
剰余金		
剰余金又は欠損金()	21,552,080,150	28,994,249,787
元本等合計	148,014,286,344	163,696,274,597
純資産合計	148,014,286,344	163,696,274,597
負債純資産合計	149,156,540,544	164,823,655,538

(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75」の計算期間とは異なっております。上記の表は、平成21年9月30日及び平成22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20年10月 1日 至 平成21年 9月30日)	(自 平成21年10月 1日 至 平成22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21年9月30日現在）	（平成22年9月30日現在）
1. 期首元本額	127,492,516,880円	126,462,206,194円
期中追加設定元本額	40,774,691,779円	25,524,327,066円
期中一部解約元本額	41,805,002,465円	17,284,508,450円
期末元本額	126,462,206,194円	134,702,024,810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）	216,744,457円	321,804,503円
SBI資産設計オープン（分配型）	21,599,438円	17,932,042円
STAM 国内債券インデックス・オープン	780,018,621円	1,368,832,717円
世界経済インデックスファンド	9,337,842円	26,291,324円
住信 国内バランス30	619,613,638円	509,962,775円
住信 国内バランス60	122,264,966円	90,350,753円
すみしん マイセクション25	333,331,263円	263,079,910円
すみしん マイセクション50	248,587,925円	231,498,803円
すみしん マイセクション75	58,131,929円	52,694,764円
すみしん DC マイセクション25	5,914,528,106円	6,200,339,300円
すみしん DC マイセクション50	8,202,929,398円	8,657,412,418円
すみしん DC マイセクション75	2,179,362,191円	2,353,586,626円
すみしん DC日本債券インデックス・オープン	309,672,023円	326,887,806円
すみしん DC日本債券インデックス・オープンS	22,006,428,915円	26,465,749,473円
すみしん DC日本債券インデックス・オープンP	5,643,683,930円	6,895,990,906円
すみしん DC マイセクションS25	253,520,919円	524,846,940円
すみしん DC マイセクションS50	553,094,423円	980,677,778円
すみしん DC マイセクションS75	131,235,601円	200,461,384円
すみしん DC ターゲット・イヤー ファンド2015	35,397,616円	34,637,670円
すみしん DC ターゲット・イヤー ファンド2025	28,842,450円	95,773,695円
すみしん DC ターゲット・イヤー ファンド2035	11,198,954円	41,662,199円
すみしん DC ターゲット・イヤー ファンド2045	1,459,618円	8,180,675円
STAM 日本債券インデックス・オープン（SMA専用）	2,617,946,979円	6,800,155,651円
住信 国内バランス60VA1（適格機関投資家専用）	101,710,539円	86,189,049円
すみしん マイセクション50VA1 （適格機関投資家専用）	691,094,269円	617,595,311円
すみしん マイセクション75VA1 （適格機関投資家専用）	84,645,260円	79,905,729円
住信 国内バランス 30VA2（適格機関投資家専用）	15,465,393円	15,015,202円

住信 国内バランス 60VA2 (適格機関投資家専用)	15,762,955円	15,590,336円
すみしん マイセクション50VA2 (適格機関投資家専用)	5,480,030円	3,436,291円
すみしん バランス30VA1 (適格機関投資家専用)	2,419,864,847円	2,177,633,990円
すみしん バランス50VA1 (適格機関投資家専用)	3,761,762,486円	3,277,162,918円
すみしん バランス25VA2 (適格機関投資家専用)	12,223,314,037円	10,410,377,425円
すみしん バランス50VA2 (適格機関投資家専用)	1,034,400,132円	884,783,973円
すみしん バランスA (25) VA1 (適格機関投資家専用)	18,979,705,905円	16,955,722,368円
すみしん バランスB (37.5) VA1 (適格機関投資家専用)	2,103,728,946円	1,844,028,210円
すみしん バランスC (50) VA1 (適格機関投資家専用)	7,201,189,442円	6,583,436,435円
すみしん 世界バランスVA1 (適格機関投資家専用)	4,197,871,532円	3,793,665,867円
すみしん 世界バランスVA2 (適格機関投資家専用)	6,009,197,451円	5,421,120,590円
すみしん バランス D (35) VA1 (適格機関投資家専用)	3,222,409,359円	2,926,880,800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)	2,487,378,787円	2,140,226,545円
すみしん バランスE (25) VA1 (適格機関投資家専用)	2,134,111,821円	3,471,788,084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
すみしん 国内バランス25VA1 (適格機関投資家専用)		320,593,626円
住信 グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,920,041,596円	2,137,156,435円
住信 日本債券ファンド・シリーズ1	7,543,199,285円	6,498,988,912円
2. 計算期間末日における受益権の総数	126,462,206,194口	134,702,024,810口

(金融商品に関する注記)

(追加情報)

当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 平成20年3月10日)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。

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)
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。
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っております。 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
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。

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。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。
----------------------------	---

金融商品の時価に関する事項

項目	(平成22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。
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>

(有価証券に関する注記)

(平成21年9月30日現在)

売買目的有価証券の貸借対照表計上額及び当計算期間の損益に含まれた評価差額

種類	貸借対照表計上額(円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	108,800,534,100	1,178,210,500
地方債証券	9,399,449,167	156,691,545
特殊債券	17,099,060,533	238,709,947
社債券	11,992,401,950	241,916,690
合計	147,291,445,750	1,815,528,682

(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。

(平成22年9月30日現在)

売買目的有価証券

種類	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
地方債証券	158,851,075
特殊債券	230,565,771
社債券	156,980,140
合計	2,709,922,186

(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)

取引の状況に関する事項

（自 平成20年10月 1日 至 平成21年 9月30日）
該当事項はありません。

取引の時価等に関する事項

（平成21年9月30日現在）
該当事項はありません。

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）
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

（自 平成20年10月 1日 至 平成21年 9月30日）	（自 平成21年10月 1日 至 平成22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21年9月30日現在）	（平成22年9月30日現在）
1口当たり純資産額 = 1.1704円	1口当たり純資産額 = 1.2152円

（3）附属明細表（平成22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）	300,000,000	327,462,000	
	第101回利付国債（20年）	160,000,000	179,545,600	
	第102回利付国債（20年）	140,000,000	156,969,400	
	第103回利付国債（20年）	280,000,000	309,604,400	
	第104回利付国債（20年）	270,000,000	290,228,400	
	第105回利付国債（20年）	450,000,000	483,408,000	
	第106回利付国債（20年）	400,000,000	435,912,000	
	第107回利付国債（20年）	190,000,000	203,968,800	
	第108回利付国債（20年）	490,000,000	510,364,400	
	第109回利付国債（20年）	200,000,000	208,102,000	
	第10回利付国債（30年）	120,000,000	105,138,000	

第110回利付国債(20年)	520,000,000	557,440,000	
第111回利付国債(20年)	200,000,000	217,432,000	
第112回利付国債(20年)	530,000,000	567,741,300	
第113回利付国債(20年)	960,000,000	1,026,835,200	
第114回利付国債(20年)	380,000,000	406,125,000	
第115回利付国債(20年)	650,000,000	705,224,000	
第116回利付国債(20年)	180,000,000	195,154,200	
第117回利付国債(20年)	600,000,000	640,704,000	
第118回利付国債(20年)	800,000,000	840,384,000	
第119回利付国債(20年)	180,000,000	183,061,800	
第11回利付国債(30年)	40,000,000	39,386,800	
第121回利付国債(20年)	100,000,000	103,442,000	
第12回利付国債(30年)	120,000,000	127,086,000	
第13回利付国債(30年)	90,000,000	93,636,000	
第14回利付国債(30年)	240,000,000	267,945,600	
第15回利付国債(30年)	170,000,000	193,305,300	
第16回利付国債(30年)	170,000,000	193,317,200	
第17回利付国債(30年)	120,000,000	134,060,400	
第18回利付国債(20年)	80,000,000	87,179,200	
第18回利付国債(30年)	140,000,000	153,713,000	
第19回利付国債(30年)	240,000,000	263,676,000	
第1回利付国債(30年)	40,000,000	47,395,600	
第1回利付国債(40年)	150,000,000	172,644,000	
第20回利付国債(20年)	110,000,000	121,720,500	
第20回利付国債(30年)	190,000,000	216,256,100	
第21回利付国債(30年)	130,000,000	142,880,400	
第22回利付国債(20年)	120,000,000	135,164,400	
第22回利付国債(30年)	220,000,000	250,822,000	
第235回利付国債(10年)	1,490,000,000	1,513,095,000	
第236回利付国債(10年)	440,000,000	447,352,400	
第237回利付国債(10年)	1,190,000,000	1,213,752,400	
第238回利付国債(10年)	410,000,000	417,589,100	
第239回利付国債(10年)	550,000,000	561,891,000	
第23回利付国債(20年)	40,000,000	46,310,800	
第23回利付国債(30年)	120,000,000	136,683,600	
第240回利付国債(10年)	1,170,000,000	1,193,306,400	
第241回利付国債(10年)	630,000,000	644,401,800	
第242回利付国債(10年)	360,000,000	367,524,000	
第243回利付国債(10年)	420,000,000	427,959,000	
第244回利付国債(10年)	320,000,000	326,092,800	
第245回利付国債(10年)	470,000,000	477,914,800	
第246回利付国債(10年)	350,000,000	355,124,000	
第247回利付国債(10年)	400,000,000	406,456,000	
第248回利付国債(10年)	190,000,000	192,601,100	
第249回利付国債(10年)	400,000,000	404,500,000	

第24回利付国債(20年)	20,000,000	23,123,600	
第24回利付国債(30年)	150,000,000	170,995,500	
第250回利付国債(10年)	290,000,000	292,775,300	
第251回利付国債(10年)	560,000,000	571,396,000	
第252回利付国債(10年)	440,000,000	450,142,000	
第253回利付国債(10年)	780,000,000	813,430,800	
第254回利付国債(10年)	550,000,000	570,333,500	
第255回利付国債(10年)	240,000,000	249,580,800	
第256回利付国債(10年)	1,240,000,000	1,289,488,400	
第257回利付国債(10年)	460,000,000	476,886,600	
第258回利付国債(10年)	310,000,000	322,083,800	
第259回利付国債(10年)	640,000,000	669,350,400	
第25回利付国債(20年)	60,000,000	68,145,600	
第25回利付国債(30年)	210,000,000	230,958,000	
第260回利付国債(10年)	290,000,000	305,106,100	
第261回利付国債(10年)	410,000,000	434,374,500	
第262回利付国債(10年)	480,000,000	510,302,400	
第263回利付国債(10年)	810,000,000	854,533,800	
第264回利付国債(10年)	1,060,000,000	1,114,123,600	
第265回利付国債(10年)	550,000,000	579,474,500	
第266回利付国債(10年)	940,000,000	986,454,800	
第267回利付国債(10年)	370,000,000	386,738,800	
第268回利付国債(10年)	520,000,000	549,120,000	
第269回利付国債(10年)	1,350,000,000	1,413,693,000	
第26回利付国債(20年)	20,000,000	23,387,000	
第26回利付国債(30年)	430,000,000	481,845,100	
第270回利付国債(10年)	940,000,000	986,370,200	
第271回利付国債(10年)	230,000,000	240,276,400	
第272回利付国債(10年)	130,000,000	137,321,600	
第273回利付国債(10年)	1,280,000,000	1,358,361,600	
第274回利付国債(10年)	430,000,000	457,279,200	
第275回利付国債(10年)	230,000,000	243,409,000	
第276回利付国債(10年)	430,000,000	459,489,400	
第277回利付国債(10年)	370,000,000	396,240,400	
第278回利付国債(10年)	230,000,000	248,781,800	
第279回利付国債(10年)	340,000,000	371,419,400	
第27回利付国債(20年)	50,000,000	59,463,000	
第27回利付国債(30年)	400,000,000	457,464,000	
第280回利付国債(10年)	730,000,000	795,305,800	
第281回利付国債(10年)	390,000,000	427,077,300	
第282回利付国債(10年)	900,000,000	972,333,000	
第283回利付国債(10年)	450,000,000	488,799,000	
第284回利付国債(10年)	1,740,000,000	1,883,289,000	
第285回利付国債(10年)	1,430,000,000	1,549,891,200	
第285回利付国債(2年)	450,000,000	450,414,000	

第286回利付国債(10年)	1,090,000,000	1,190,051,100	
第286回利付国債(2年)	950,000,000	951,947,500	
第287回利付国債(10年)	500,000,000	549,165,000	
第288回利付国債(10年)	1,970,000,000	2,139,045,700	
第288回利付国債(2年)	560,000,000	560,571,200	
第289回利付国債(10年)	1,700,000,000	1,823,335,000	
第289回利付国債(2年)	960,000,000	961,036,800	
第28回利付国債(20年)	20,000,000	24,217,400	
第28回利付国債(30年)	300,000,000	343,317,000	
第290回利付国債(10年)	710,000,000	756,192,600	
第290回利付国債(2年)	250,000,000	250,287,500	
第291回利付国債(10年)	270,000,000	285,624,900	
第291回利付国債(2年)	600,000,000	600,684,000	
第292回利付国債(10年)	420,000,000	456,712,200	
第292回利付国債(2年)	800,000,000	800,960,000	
第293回利付国債(10年)	410,000,000	448,884,400	
第293回利付国債(2年)	300,000,000	300,354,000	
第294回利付国債(10年)	500,000,000	543,715,000	
第294回利付国債(2年)	700,000,000	700,861,000	
第295回利付国債(10年)	600,000,000	643,326,000	
第295回利付国債(2年)	600,000,000	600,834,000	
第296回利付国債(10年)	1,730,000,000	1,851,774,700	
第297回利付国債(10年)	640,000,000	678,988,800	
第298回利付国債(10年)	1,060,000,000	1,115,862,000	
第299回利付国債(10年)	420,000,000	441,168,000	
第29回利付国債(20年)	60,000,000	71,667,600	
第29回利付国債(30年)	610,000,000	685,719,300	
第2回利付国債(30年)	60,000,000	67,149,600	
第2回利付国債(40年)	300,000,000	328,764,000	
第300回利付国債(10年)	1,050,000,000	1,120,171,500	
第301回利付国債(10年)	970,000,000	1,032,826,900	
第302回利付国債(10年)	370,000,000	390,771,800	
第303回利付国債(10年)	1,240,000,000	1,306,563,200	
第304回利付国債(10年)	190,000,000	198,605,100	
第305回利付国債(10年)	1,820,000,000	1,896,403,600	
第306回利付国債(10年)	1,700,000,000	1,782,603,000	
第308回利付国債(10年)	600,000,000	621,978,000	
第309回利付国債(10年)	1,600,000,000	1,628,560,000	
第30回利付国債(20年)	80,000,000	93,572,000	
第30回利付国債(30年)	310,000,000	341,737,800	
第31回利付国債(20年)	80,000,000	93,922,400	
第31回利付国債(30年)	430,000,000	464,954,700	
第32回利付国債(20年)	50,000,000	59,239,500	
第32回利付国債(30年)	450,000,000	497,619,000	
第33回利付国債(20年)	340,000,000	409,424,600	

第34回利付国債(20年)	50,000,000	59,960,500	
第35回利付国債(20年)	10,000,000	11,865,800	
第36回利付国債(20年)	70,000,000	82,266,100	
第37回利付国債(20年)	70,000,000	82,740,000	
第38回利付国債(20年)	20,000,000	23,203,800	
第39回利付国債(20年)	500,000,000	576,290,000	
第3回利付国債(30年)	120,000,000	132,247,200	
第3回利付国債(40年)	220,000,000	241,135,400	
第40回利付国債(20年)	100,000,000	113,085,000	
第41回利付国債(20年)	330,000,000	351,634,800	
第42回利付国債(20年)	80,000,000	92,428,000	
第43回利付国債(20年)	140,000,000	165,475,800	
第44回利付国債(20年)	170,000,000	195,229,700	
第45回利付国債(20年)	290,000,000	330,347,700	
第46回利付国債(20年)	170,000,000	190,333,700	
第47回利付国債(20年)	90,000,000	100,695,600	
第48回利付国債(20年)	130,000,000	149,171,100	
第49回利付国債(20年)	140,000,000	155,170,400	
第4回利付国債(30年)	110,000,000	132,374,000	
第50回利付国債(20年)	220,000,000	239,316,000	
第51回利付国債(20年)	100,000,000	109,726,000	
第52回利付国債(20年)	110,000,000	121,832,700	
第53回利付国債(20年)	80,000,000	88,645,600	
第54回利付国債(20年)	200,000,000	223,736,000	
第55回利付国債(20年)	140,000,000	153,522,600	
第56回利付国債(20年)	150,000,000	164,427,000	
第57回利付国債(20年)	240,000,000	260,316,000	
第58回利付国債(20年)	200,000,000	216,680,000	
第59回利付国債(20年)	200,000,000	211,888,000	
第5回利付国債(30年)	50,000,000	54,147,500	
第60回利付国債(20年)	270,000,000	276,779,700	
第61回利付国債(20年)	220,000,000	214,766,200	
第61回利付国債(5年)	1,730,000,000	1,752,645,700	
第62回利付国債(20年)	220,000,000	208,799,800	
第62回利付国債(5年)	320,000,000	324,572,800	
第63回利付国債(20年)	80,000,000	85,432,800	
第63回利付国債(5年)	1,790,000,000	1,817,941,900	
第64回利付国債(20年)	470,000,000	506,895,000	
第64回利付国債(5年)	900,000,000	920,997,000	
第65回利付国債(20年)	250,000,000	269,337,500	
第65回利付国債(5年)	280,000,000	286,053,600	
第66回利付国債(20年)	130,000,000	138,418,800	
第66回利付国債(5年)	1,070,000,000	1,090,276,500	
第67回利付国債(20年)	150,000,000	161,415,000	
第67回利付国債(5年)	470,000,000	480,744,200	

第68回利付国債(20年)	140,000,000	155,856,400	
第68回利付国債(5年)	260,000,000	265,522,400	
第69回利付国債(20年)	120,000,000	132,128,400	
第69回利付国債(5年)	1,410,000,000	1,433,744,400	
第6回利付国債(30年)	70,000,000	78,224,300	
第70回利付国債(20年)	230,000,000	261,717,000	
第70回利付国債(5年)	1,000,000,000	1,016,140,000	
第71回利付国債(20年)	290,000,000	322,613,400	
第71回利付国債(5年)	820,000,000	843,263,400	
第72回利付国債(20年)	490,000,000	538,539,400	
第72回利付国債(5年)	630,000,000	653,013,900	
第73回利付国債(20年)	220,000,000	238,612,000	
第73回利付国債(5年)	470,000,000	484,635,800	
第74回利付国債(20年)	190,000,000	208,602,900	
第74回利付国債(5年)	380,000,000	388,759,000	
第75回利付国債(20年)	240,000,000	262,881,600	
第75回利付国債(5年)	440,000,000	452,311,200	
第76回利付国債(20年)	240,000,000	256,584,000	
第76回利付国債(5年)	720,000,000	742,269,600	
第77回利付国債(20年)	120,000,000	129,825,600	
第77回利付国債(5年)	470,000,000	481,839,300	
第78回利付国債(20年)	170,000,000	181,361,100	
第78回利付国債(5年)	390,000,000	399,336,600	
第79回利付国債(20年)	180,000,000	194,475,600	
第79回利付国債(5年)	170,000,000	172,985,200	
第7回利付国債(30年)	190,000,000	209,180,500	
第80回利付国債(20年)	190,000,000	207,867,600	
第80回利付国債(5年)	680,000,000	694,110,000	
第81回利付国債(20年)	70,000,000	75,521,600	
第81回利付国債(5年)	1,490,000,000	1,522,496,900	
第82回利付国債(20年)	540,000,000	590,036,400	
第82回利付国債(5年)	390,000,000	399,843,600	
第83回利付国債(20年)	220,000,000	239,910,000	
第83回利付国債(5年)	220,000,000	225,790,400	
第84回利付国債(20年)	380,000,000	409,100,400	
第84回利付国債(5年)	1,910,000,000	1,945,850,700	
第85回利付国債(20年)	120,000,000	130,671,600	
第85回利付国債(5年)	1,770,000,000	1,804,745,100	
第86回利付国債(20年)	170,000,000	189,799,900	
第86回利付国債(5年)	80,000,000	81,256,800	
第87回利付国債(20年)	230,000,000	253,699,200	
第87回利付国債(5年)	1,840,000,000	1,861,472,800	
第88回利付国債(20年)	420,000,000	468,367,200	
第88回利付国債(5年)	1,700,000,000	1,719,856,000	
第89回利付国債(20年)	280,000,000	308,243,600	

	第89回利付国債(5年)	1,700,000,000	1,711,849,000	
	第8回利付国債(30年)	50,000,000	50,439,000	
	第90回利付国債(20年)	480,000,000	528,024,000	
	第91回利付国債(20年)	290,000,000	323,202,100	
	第92回利付国債(20年)	710,000,000	769,554,800	
	第93回利付国債(20年)	150,000,000	160,108,500	
	第94回利付国債(20年)	440,000,000	476,097,600	
	第95回利付国債(20年)	430,000,000	477,226,900	
	第96回利付国債(20年)	220,000,000	237,633,000	
	第97回利付国債(20年)	510,000,000	557,511,600	
	第98回利付国債(20年)	230,000,000	247,986,000	
	第99回利付国債(20年)	640,000,000	689,222,400	
	第9回ポーランド共和国円貨債券(2009)	100,000,000	98,642,000	
	第9回利付国債(30年)	70,000,000	65,349,900	
	小計	115,740,000,000	121,949,865,900	
地方債証券	第113回福岡北九州高速道路債	100,000,000	108,739,000	
	第116回神奈川県公募債	14,000,000	14,272,860	
	第11回東京都公募債(30年)	100,000,000	104,335,000	
	第124回神奈川県公募債	10,000,000	10,383,600	
	第12回す号名古屋市公募債	100,000,000	107,171,000	
	第144回神奈川県公募債	100,000,000	108,516,000	
	第14回共同発行市場公募地方債	100,200,000	104,682,948	
	第150回神奈川県公募債	100,000,000	107,817,000	
	第15回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,934,000	
	第167回神奈川県公募債	140,000,000	148,003,800	
	第17回東京都公募債(20年)	100,000,000	105,867,000	
	第19回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,285,000	
	第19回東京都公募債(20年)	100,000,000	106,172,000	
	第1回共同発行市場公募地方債	100,000,000	101,211,000	
	第21回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,601,000	
	第247回大阪府公募債(10年)	20,000,000	20,229,400	
	第248回大阪府公募債(10年)	16,550,000	16,847,900	
	第252回大阪府公募債(10年)	100,000,000	101,159,000	
	第262回大阪府公募債(10年)	100,000,000	103,542,000	
	第271回大阪府公募債(10年)	100,000,000	104,919,000	
	第284回大阪府公募債(10年)	100,000,000	105,912,000	
	第28回1号宮城県公募債	116,000,000	117,534,680	
	第291回大阪府公募債(10年)	100,000,000	108,528,000	
	第29回共同発行市場公募地方債	100,000,000	105,160,000	
	第307回大阪府公募債(10年)	100,000,000	108,313,000	
	第33回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,455,000	
	第35回共同発行市場公募地方債	100,000,000	106,574,000	
	第38回共同発行市場公募地方債	100,000,000	108,967,000	
	第3回共同発行市場公募地方債	20,000,000	20,146,600	
	第3回東京都公募債(20年)	100,000,000	111,008,000	

第40回共同発行市場公募地方債	120,000,000	131,670,000	
第41回共同発行市場公募地方債	100,000,000	109,224,000	
第458回名古屋市公募公債(10年)	100,000,000	107,910,000	
第47回大阪府公募公債(5年)	100,000,000	102,984,000	
第4回神奈川県公募公債(30年)	100,000,000	113,200,000	
第52回共同発行市場公募地方債	100,000,000	109,298,000	
第55回共同発行市場公募地方債	158,400,000	172,703,520	
第56回共同発行市場公募地方債	100,000,000	108,161,000	
第587回東京都公募公債	10,000,000	10,198,500	
第588回東京都公募公債	117,000,000	119,430,090	
第591回東京都公募公債	108,000,000	110,064,960	
第593回東京都公募公債	143,000,000	144,947,660	
第5回横浜市公募公債(20年)	100,000,000	108,999,000	
第5回名古屋市公募公債(30年)	100,000,000	110,482,000	
第602回東京都公募公債	20,000,000	20,719,200	
第608回東京都公募公債	100,000,000	104,627,000	
第611回東京都公募公債	40,000,000	42,321,200	
第618回東京都公募公債	100,000,000	104,858,000	
第622回東京都公募公債	100,000,000	104,509,000	
第623回東京都公募公債	100,000,000	104,648,000	
第633回東京都公募公債	129,000,000	140,201,070	
第639回東京都公募公債	50,000,000	54,186,500	
第674回東京都公募公債	100,000,000	104,592,000	
第67回共同発行市場公募地方債	165,700,000	176,162,298	
第6回東京都公募公債(20年)	100,000,000	107,087,000	
第75回共同発行市場公募地方債	200,000,000	213,890,000	
第75回川崎市公募公債	22,000,000	22,466,620	
第77回共同発行市場公募地方債	110,000,000	116,565,900	
第78回共同発行市場公募地方債	100,000,000	104,594,000	
第81回川崎市公募公債	100,000,000	106,483,000	
第82回川崎市公募公債	100,000,000	105,629,000	
第9回東京都公募公債(30年)	100,000,000	108,167,000	
第9回名古屋市公募公債(20年)	100,000,000	105,366,000	
平成13年度第2回京都府公募公債	10,000,000	10,147,200	
平成13年度第2回福岡市公募公債	18,000,000	18,221,580	
平成13年度第5回横浜市公募公債	10,000,000	10,147,200	
平成14年度第1回愛知県公募公債	20,000,000	20,372,400	
平成14年度第1回広島市公募公債	10,000,000	10,168,700	
平成14年度第1回仙台市公募公債	20,000,000	20,424,200	
平成14年度第1回千葉市公募公債	100,100,000	102,214,112	
平成14年度第2回愛知県公募公債	120,000,000	122,655,600	
平成14年度第2回埼玉県公募公債	20,040,000	20,433,986	
平成14年度第3回福岡県公募公債	100,000,000	101,392,000	
平成14年度第8回札幌市公募公債	28,300,000	28,572,812	
平成15年度第1回愛知県公募公債	100,000,000	103,574,000	

平成15年度第5回札幌市公募公債	72,580,000	75,449,087	
平成15年度第5回北海道公募公債	50,000,000	51,616,500	
平成15年度第6回福岡市公募公債	124,600,000	128,954,770	
平成15年度第6回兵庫県公募公債	10,000,000	10,378,700	
平成16年度第1回広島県公募公債	100,000,000	104,302,000	
平成16年度第1回新潟県公募公債	100,000,000	104,883,000	
平成16年度第4回埼玉県公募公債	100,000,000	104,801,000	
平成16年度第4回静岡県公募公債	150,000,000	157,927,500	
平成16年度第4回兵庫県公募公債	200,000,000	209,244,000	
平成16年度第8回千葉県公募公債	100,000,000	104,302,000	
平成17年度第10回大阪市公募公債	100,000,000	105,404,000	
平成17年度第13回神戸市公募公債	100,000,000	106,315,000	
平成17年度第13回兵庫県公募公債	200,000,000	213,588,000	
平成17年度第1回横浜市公募公債	100,000,000	104,363,000	
平成17年度第2回新潟県公募公債	100,000,000	106,278,000	
平成17年度第3回埼玉県公募公債	100,000,000	104,630,000	
平成17年度第6回札幌市公募公債	100,000,000	105,877,000	
平成18年度第1回鹿児島県公募公債	100,000,000	108,652,000	
平成18年度第1回北海道公募公債	100,000,000	107,184,000	
平成18年度第2回埼玉県公募公債	100,000,000	108,987,000	
平成18年度第4回札幌市公募公債	100,000,000	108,072,000	
平成18年度第7回千葉県公募公債	100,000,000	108,435,000	
平成19年度第2回静岡県公募公債	100,000,000	109,467,000	
平成19年度第7回大阪市公募公債	100,000,000	108,020,000	
平成19年度第8回北海道公募公債(5年)	100,000,000	102,258,000	
平成19年度第9回兵庫県公募公債	100,000,000	108,459,000	
平成20年度第14回北海道公募公債	100,000,000	107,078,000	
平成20年度第6回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	107,926,000	
平成21年度第12回千葉県公募公債	100,000,000	104,499,000	
平成21年度第1回横浜市公募公債	200,000,000	213,044,000	
平成21年度第5回愛知県公募公債(20年)	100,000,000	108,385,000	
平成21年度第5回横浜市公募公債	100,000,000	105,839,000	
小計	9,893,470,000	10,476,574,653	
特殊債券			
い第682号農林債	100,000,000	101,503,000	
い第685号農林債	210,000,000	214,544,400	
い第689号農林債	100,000,000	102,417,000	
い第690号農林債	100,000,000	102,090,000	
い第694号農林債	100,000,000	102,022,000	
い第695号農林債	100,000,000	102,088,000	
い第704号商工債	100,000,000	103,508,000	
い第705号商工債	100,000,000	103,748,000	
い第707号農林債	200,000,000	206,934,000	
い第710号農林債	100,000,000	102,312,000	
い第715号農林債	100,000,000	101,209,000	
い第718号商工債	100,000,000	101,260,000	

第108号商工債（3年）	100,000,000	101,117,000	
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	81,451,000	85,675,048	
第10回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,124,000	
第119号商工債（3年）	100,000,000	100,401,000	
第11回地方公共団体金融機構債券	100,000,000	104,382,000	
第11回日本政策投資銀行債券	100,000,000	108,451,000	
第12回政府保証国民生活債券	179,000,000	186,296,040	
第12回都市再生債券	100,000,000	101,486,000	
第134回政府保証阪神高速道路債券	100,000,000	100,826,000	
第135回政府保証阪神高速道路債券	20,000,000	20,733,800	
第13回政府保証日本政策投資銀行債券	106,000,000	115,977,780	
第13回日本政策投資銀行債券	100,000,000	104,445,000	
第145回政府保証阪神高速道路債券	100,000,000	105,019,000	
第14回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	110,206,000	
第14回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	84,349,000	87,977,693	
第15回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	84,831,000	88,298,891	
第171回政府保証中小企業債券	12,000,000	12,215,640	
第176回政府保証中小企業債券	20,000,000	20,825,000	
第17回公営企業債券	100,000,000	105,973,000	
第182回政府保証中小企業債券	10,000,000	10,490,900	
第190回政府保証首都高速道路債券	100,000,000	104,060,000	
第193回政府保証首都高速道路債券	104,000,000	109,112,640	
第1回公営企業債券（5年）	200,000,000	204,002,000	
第1回政府保証新東京国際空港債券	11,000,000	11,221,210	
第1回政府保証地方公営企業等金融機構債券	202,000,000	217,002,540	
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	106,084,000	
第1回政府保証東日本高速道路債券	100,000,000	106,524,000	
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	106,104,000	
第1回政府保証農林漁業金融公庫債券	12,000,000	12,278,760	
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	64,947,000	68,165,773	
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,887,000	83,365,414	
第1回中日本高速道路株式会社社債（一般担保付）	100,000,000	104,271,000	
第1回日本鉄道建設債券	100,000,000	101,572,000	
第200回政府保証首都高速道路債券	100,000,000	104,885,000	
第203回信金中金債（5年）	100,000,000	101,306,000	
第205回信金中金債（5年）	100,000,000	101,485,000	
第212回信金中金債（5年）	100,000,000	102,477,000	
第214回信金中金債（5年）	100,000,000	102,099,000	
第21回道路債券	100,000,000	112,535,000	
第222回信金中金債（5年）	200,000,000	205,766,000	
第224回信金中金債（5年）	100,000,000	103,200,000	
第226回信金中金債（5年）	100,000,000	103,082,000	
第22回政府保証日本政策投資銀行債券	100,000,000	110,731,000	
第233回信金中金債（5年）	100,000,000	103,577,000	
第237回信金中金債（5年）	100,000,000	102,465,000	

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	107,952,000	
第24回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	101,795,000	
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	90,242,000	96,440,722	
第25回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	106,938,000	
第28回公営企業債券	100,000,000	109,154,000	
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,311,000	97,789,928	
第2回政府保証成田国際空港債券	147,000,000	156,940,140	
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	105,181,000	
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	66,415,000	70,430,450	
第30回公営企業債券	100,000,000	109,987,000	
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	108,087,000	
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	93,749,000	98,331,451	
第30回中小企業債券	40,000,000	40,839,600	
第313回政府保証道路債券	100,000,000	102,221,000	
第315回政府保証道路債券	225,000,000	227,929,500	
第316回政府保証道路債券	120,000,000	121,300,800	
第319回政府保証道路債券	30,000,000	30,608,400	
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	95,345,000	99,338,048	
第322回東京交通債券	10,000,000	11,537,300	
第323回政府保証道路債券	100,000,000	104,161,000	
第327回政府保証道路債券	100,000,000	104,529,000	
第328回政府保証道路債券	114,000,000	119,271,360	
第331回政府保証道路債券	102,000,000	108,145,500	
第333回政府保証道路債券	48,000,000	50,604,960	
第344回東京交通債券	100,000,000	103,947,000	
第346回政府保証道路債券	143,000,000	150,637,630	
第346回東京交通債券	20,000,000	19,477,400	
第347回政府保証道路債券	181,000,000	189,874,430	
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	97,425,000	101,435,987	
第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,436,000	
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	235,480,900	
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	74,163,000	77,283,779	
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	98,399,000	102,391,047	
第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	115,158,000	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,876,000	
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	74,546,000	77,108,146	
第3回公営企業債券	40,000,000	40,840,400	
第3回公営企業債券(20年)	10,000,000	9,673,100	
第3回政府保証首都高速道路株式会社債券	103,000,000	111,290,470	
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	73,954,000	79,110,072	
第44回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	108,265,000	
第44回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,659,000	
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	72,620,000	77,085,403	
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	106,876,000	
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	109,393,000	

第48回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	107,213,000	
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	77,777,000	82,590,618	
第4回国際協力銀行債券	120,000,000	122,238,000	
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	102,140,000	
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	70,678,000	73,958,165	
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	78,880,000	84,201,244	
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	78,787,000	82,738,955	
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	31,854,000	
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	117,842,040	
第5回公営企業債券	100,000,000	101,302,000	
第5回新東京国際空港債券	100,000,000	104,508,000	
第5回政府保証首都高速道路株式会社債券	80,000,000	84,918,400	
第5回政府保証地方公営企業等金融機構債券	100,000,000	104,723,000	
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	106,776,000	
第5回西日本高速道路株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	100,627,000	
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	54,035,000	55,776,548	
第5回東日本高速道路株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	100,635,000	
第5回本州四国連絡橋債券	100,000,000	109,197,000	
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	109,120,000	
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	196,082,730	
第6回公営企業債券	10,000,000	10,098,200	
第6回国際協力銀行債券	100,000,000	101,845,000	
第6回阪神高速道路債券	100,000,000	104,879,000	
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	108,358,000	
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	116,404,000	123,829,411	
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	73,025,000	76,018,294	
第6回都市基盤整備債券	100,000,000	101,589,000	
第7回公営企業債券(20年)	100,000,000	109,882,000	
第7回地方公共団体金融機構債券(20年)	100,000,000	106,588,000	
第7回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	100,000,000	106,385,000	
第808回政府保証公営企業債券	110,000,000	111,433,300	
第810回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,634,000	
第814回政府保証公営企業債券	122,000,000	124,348,500	
第815回政府保証公営企業債券	100,000,000	102,016,000	
第818回政府保証公営企業債券	101,000,000	103,143,220	
第821回政府保証公営企業債券	110,000,000	112,174,700	
第827回政府保証公営企業債券	100,000,000	101,082,000	
第836回政府保証公営企業債券	10,000,000	10,370,500	
第839回政府保証公営企業債券	28,000,000	29,292,760	
第840回政府保証公営企業債券	13,000,000	13,654,290	
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	111,908,000	
第855回政府保証公営企業債券	140,000,000	146,850,200	
第859回政府保証公営企業債券	131,000,000	139,086,630	
第862回政府保証公営企業債券	200,000,000	215,952,000	
第866回政府保証公営企業債券	100,000,000	109,415,000	

	第867回政府保証公営企業債券	100,000,000	108,360,000	
	第872回政府保証公営企業債券	200,000,000	217,382,000	
	第874回政府保証公営企業債券	100,000,000	108,124,000	
	第875回政府保証公営企業債券	312,000,000	337,465,440	
	第876回政府保証公営企業債券	122,000,000	133,621,720	
	第8回一般担保住宅金融支援機構債券	100,000,000	107,670,000	
	第8回公営企業債券(20年)	40,000,000	44,206,800	
	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	106,833,000	
	第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	60,265,000	63,562,700	
	第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	76,907,000	80,885,399	
	第8回独立行政法人福祉医療機構債券	100,000,000	106,233,000	
	第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	111,437,000	
	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	310,998,000	
	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	108,302,000	
	第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	60,545,000	63,981,534	
	第9回都市再生債券	100,000,000	101,451,000	
	小計	16,176,937,000	17,007,527,750	
社債券	第103回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	200,000,000	202,350,000	
	第10回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	100,000,000	101,963,000	
	第11回シティグループ・インク円貨社債(2003)	200,000,000	198,170,000	
	第11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	100,485,000	
	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	102,439,000	
	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	104,927,000	
	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	100,106,000	
	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	101,234,000	
	第13回野村ホールディングス株式会社無担保社債	200,000,000	204,364,000	
	第14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	101,480,000	
	第14回メリルリンチ・アンド・カンパニー・インク円貨社債	100,000,000	101,014,000	
	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	103,703,000	
	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	100,662,000	
	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	105,249,000	
	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	206,178,000	
	第16回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,591,000	
	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	110,835,000	
	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	218,226,000	
	第17回東日本旅客鉄道株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	111,704,000	
	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	103,766,000	
	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	100,000,000	101,683,000	
	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	112,314,000	
	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	102,868,000	
	第1回みずほ信託銀行株式会社無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	106,089,000	
	第1回ラポバンク円貨社債	100,000,000	103,438,000	
	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	101,686,000	
	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	101,194,000	
	第20回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	200,000,000	204,564,000	

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	109,352,000	
第20回三菱重工業株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,208,000	
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	101,466,000	
第21回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	106,980,000	
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	100,988,000	
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	111,692,000	
第248回北陸電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	119,620,000	
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	101,731,000	
第24回ソニー株式会社無担保社債	100,000,000	101,034,000	
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	105,863,000	
第24回三菱重工業株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,315,000	
第257回四国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	104,580,000	
第261回北海道電力株式会社社債(一般担保付)	31,000,000	35,720,990	
第26回日本郵船株式会社無担保社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,236,000	
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	107,621,000	
第285回北海道電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	107,108,000	
第286回北海道電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	104,877,000	
第28回住友化学工業株式会社無担保社債	100,000,000	104,660,000	
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	103,988,000	
第2回三菱信託銀行株式会社無担保社債	100,000,000	105,372,000	
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	103,542,000	
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	106,015,000	
第316回中国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	110,588,000	
第346回九州電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	109,972,000	
第362回中国電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	107,104,000	
第376回東北電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	116,876,000	
第380回東北電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	118,633,000	
第382回東北電力株式会社社債(一般担保付)	20,000,000	23,360,000	
第387回九州電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	106,975,000	
第38回三菱電機株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約付)	100,000,000	102,990,000	
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	102,663,000	
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	107,188,000	
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	101,114,000	
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	108,773,000	
第3回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	101,293,000	
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	105,654,000	
第405回中部電力株式会社社債(一般担保付)	50,000,000	58,566,000	
第408回九州電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	107,031,000	
第408回中部電力株式会社社債(一般担保付)	50,000,000	58,551,500	
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	101,204,000	
第425回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	117,804,000	
第431回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,020,000	
第451回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	108,237,000	
第455回東京電力株式会社社債(一般担保付)	120,000,000	132,798,000	
第459回東京電力株式会社社債(一般担保付)	10,000,000	11,554,600	

第462回中部電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	101,602,000	
第463回中部電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	101,440,000	
第464回中部電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	101,248,000	
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	103,307,000	
第46回日本電信電話株式会社社債電話債券(一般担保付)	100,000,000	101,982,000	
第473回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	107,104,000	
第474回関西電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	107,102,000	
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	204,294,000	
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	107,201,000	
第489回東京電力株式会社社債(一般担保付)	20,000,000	20,260,600	
第498回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	101,873,000	
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	104,215,000	
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	100,671,000	
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	100,238,000	
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	102,903,000	
第4回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	100,000,000	101,497,000	
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	103,328,000	
第501回東京電力株式会社社債(一般担保付)	30,000,000	30,474,300	
第505回東京電力株式会社社債(一般担保付)	30,000,000	30,397,500	
第510回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	103,702,000	
第518回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	104,806,000	
第51回株式会社東京三菱銀行無担保社債	100,000,000	102,315,000	
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	101,052,000	
第521回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	108,717,000	
第528回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	108,990,000	
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	102,551,000	
第536回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	107,641,000	
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	104,198,000	
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	105,181,000	
第542回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	107,136,000	
第544回東京電力株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	110,005,000	
第54回日本電信電話株式会社社債電話債券(一般担保付)	100,000,000	108,682,000	
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	106,871,000	
第5回アフラック・インコーポレーテッド円貨社債(2007)	100,000,000	100,114,000	
第5回日本たばこ産業株式会社社債(一般担保付)	100,000,000	102,839,000	
第69回三菱商事株式会社無担保社債	100,000,000	109,367,000	
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	105,943,000	
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	106,177,000	
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	102,370,000	
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	102,064,000	
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	105,782,000	
第7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	100,405,000	
第7回エーザイ株式会社無担保社債	100,000,000	106,388,000	
第7回キリンホールディングス株式会社無担保社債	100,000,000	105,626,000	
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	101,635,000	

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	206,504,000	
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	103,603,000	
第7回バンク・オブ・アメリカ・コーポレーション円貨社債	100,000,000	101,709,000	
第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	20,000,000	22,105,000	
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	103,874,000	
第8回株式会社三井住友銀行無担保社債	100,000,000	105,825,000	
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	102,690,000	
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	100,858,000	
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	100,108,000	
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	99,974,000	
第9回三井倉庫株式会社無担保社債	100,000,000	102,685,000	
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	100,872,000	
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	21,177,590	
第9回大阪瓦斯株式会社無担保社債	100,000,000	116,444,000	
小計	13,300,000,000	13,942,323,080	
合計	155,110,407,000	163,376,291,383	

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21年9月30日現在)	(平成22年9月30日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	1,784,284,167	3,184,363,077
コール・ローン	123,580,968	91,498,278
株式	114,391,945,390	116,722,352,011
新株予約権証券	510,011	
投資信託受益証券	215,804,940	259,795,974
投資証券	1,474,105,309	1,860,235,128
派生商品評価勘定	8,623,066	24,228,987
未収入金		33,433,539
未収配当金	155,603,271	194,507,465
未収利息	269	239
差入委託証拠金	681,797,044	884,769,536
流動資産合計	118,836,254,435	123,255,184,234
資産合計	118,836,254,435	123,255,184,234
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	12,826,643	9,678,568
未払金		140,438,579
未払解約金	36,733,607	52,702,868
流動負債合計	49,560,250	202,820,015
負債合計	49,560,250	202,820,015
純資産の部		
元本等		
元本	137,441,585,574	142,024,271,866
剰余金		
剰余金又は欠損金()	18,654,891,389	18,971,907,647
元本等合計	118,786,694,185	123,052,364,219
純資産合計	118,786,694,185	123,052,364,219
負債純資産合計	118,836,254,435	123,255,184,234

(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75」の計算期間とは異なっております。上記の表は、平成21年9月30日及び平成22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20年10月 1日 至 平成21年 9月30日）	（自 平成21年10月 1日 至 平成22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）新株予約権証券 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>（4）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>（5）先物取引 個別法に基づき、時価評価しております。</p> <p>（6）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	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
3. 収益及び費用の計上基準	受取配当金 受取配当金は、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21年9月30日現在)	(平成22年9月30日現在)
1. 期首元本額	103,220,867,299円	137,441,585,574円
期中追加設定元本額	84,318,124,033円	26,113,980,149円
期中一部解約元本額	50,097,405,758円	21,531,293,857円
期末元本額	137,441,585,574円	142,024,271,866円
元本額の内訳		
SBI資産設計オープン（資産成長型）	427,603,020円	596,907,264円
SBI資産設計オープン（分配型）	38,617,430円	33,064,350円
STAM グローバル株式インデックス・オープン	8,728,632,321円	12,169,756,947円
世界経済インデックスファンド	109,965,432円	266,477,247円
すみしん マイセクション25	42,997,098円	33,255,194円
すみしん マイセクション50	136,762,135円	126,303,991円
すみしん マイセクション75	122,328,795円	115,239,995円
すみしん 外国株式インデックス・オープン	1,370,810,459円	1,372,242,575円
すみしん DC マイセクション25	734,867,845円	783,775,433円
すみしん DC マイセクション50	4,489,192,809円	4,779,047,450円
すみしん DC マイセクション75	4,242,576,125円	4,825,143,404円
すみしん DC外国株式インデックス・オープン	3,138,818,926円	4,011,911,792円
すみしん DC マイセクションS25	31,878,439円	65,121,358円
すみしん DC マイセクションS50	308,351,845円	533,927,070円
すみしん DC マイセクションS75	274,835,572円	454,056,173円
すみしん DC ターゲット・イヤー ファンド2015	8,183,613円	8,702,419円
すみしん DC ターゲット・イヤー ファンド2025	10,303,300円	34,340,883円
すみしん DC ターゲット・イヤー ファンド2035	7,821,445円	29,323,661円
すみしん DC ターゲット・イヤー ファンド2045	2,385,235円	12,164,312円
すみしん DCマルチアセット ファンド	157,212円	371,236円
STAM 外国株式インデックス・オープン（SMA専用）	2,285,575,423円	6,470,012,102円

すみしん マイセレクション50VA1 (適格機関投資家専用)	359,925,091円	337,690,473円
すみしん マイセレクション75VA1 (適格機関投資家専用)	187,651,383円	176,542,084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)	713,742,558円	629,794,681円
すみしん マイセレクション50VA2 (適格機関投資家専用)	2,783,887円	1,865,163円
すみしん バランス30VA1(適格機関投資家専用)	1,781,087,546円	1,627,695,727円
すみしん バランス50VA1(適格機関投資家専用)	6,418,743,484円	5,990,514,392円
すみしん バランス25VA2(適格機関投資家専用)	17,236,862,551円	16,172,611,936円
すみしん バランス50VA2(適格機関投資家専用)	5,004,073,268円	4,707,873,629円
すみしん バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	7,036,524,679円	6,837,857,935円
すみしん バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,925,301,294円	1,798,038,043円
すみしん バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	12,288,388,192円	10,843,686,556円
すみしん 世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	23,261,698,926円	24,016,966,166円
すみしん 世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	10,913,146,714円	11,223,333,920円
すみしん バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	2,347,392,307円	1,976,807,649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)	1,835,002,100円	1,821,625,106円
すみしん バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	413,711,067円	736,456,607円
住信 グローバル・バランスファンド・シリーズ1	1,492,277,970円	1,669,567,795円
住信 グローバル株式ファンド(適格機関投資家専用)	383,733,128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)	7,483,239,642円	7,966,508,811円
住信 外国株式ファンド・シリーズ1	9,843,635,308円	6,767,690,337円
2.元本の欠損	純資産額は、元本を 18,654,891,389円下回っており ます。	純資産額は、元本を 18,971,907,647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	137,441,585,574口	142,024,271,866口

(金融商品に関する注記)

(追加情報)

当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 平成20年3月10日)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。

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)
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。

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っております。</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
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>
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> <p>デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。</p>

金融商品の時価に関する事項

項目	(平成22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ぬ。

2. 時価の算定方法

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。

b. 先物取引

1. 原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また契約額等および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当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
 - ・ 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、当該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。

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。

（有価証券に関する注記）

（平成21年9月30日現在）

売買目的有価証券の貸借対照表計上額及び当計算期間の損益に含まれた評価差額

種 類	貸借対照表計上額（円）	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
株 式	114,391,945,390	16,544,242,656
新株予約権証券	510,011	311,243
投資信託受益証券	215,804,940	36,779,464
投資証券	1,474,105,309	319,594,160
合 計	116,082,365,650	16,900,927,523

（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。

（平成22年9月30日現在）

売買目的有価証券

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
株 式	6,337,768,372
投資信託受益証券	6,529,645
投資証券	135,504,116
合 計	6,479,802,133

（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）

取引の状況に関する事項

（自 平成20年10月 1日 至 平成21年 9月30日）	
1. 取引の内容、取引に対する取組方法及び取引の利用目的	当ファンドは、約款に基づき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、為替変動リスクを回避するため、デリバティブ取引を行うことができます。 当ファンドの利用することができるデリバティブ取引は、先物取引（わが国の金融商品取引所における市場デリバティブ取引、通貨に係る市場デリバティブ取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引）、スワップ取引、為替先渡取引、外国為替予約取引であります。
2. 取引に係るリスクの内容及びリスクの管理体制	当ファンドのデリバティブ取引には、市場リスクと信用リスクがあります。デリバティブ取引の執行は、取引権限を定めた社内ルールに従い行っており、市場リスクの管理については、ポジションやリスク評価額を日々算出し、リスクをコントロールする体制としています。
3. 取引の時価等に関する事項についての補足説明	取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

取引の時価等に関する事項

株式関連

区分	種 類	（平成21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	1,318,617,613		1,308,360,735	10,256,878
	S&P/TSE 60	228,250,628		225,834,423	2,416,205
	SPI 200 FUTU	156,516,486		159,635,406	3,118,920
	FTSE 100	351,987,306		355,073,928	3,086,621
	SWISS MKT IX	82,382,784		82,482,938	100,154
	DJ EURO STOXX	498,540,442		500,746,752	2,206,311
合 計	2,636,295,259		2,632,134,182	4,161,077	

（注）時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

1. 原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。
2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。また契約額等および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。

通貨関連

区分	種類	（平成21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	45,142,500		45,100,000	42,500
合計		45,142,500		45,100,000	42,500

（注）時価の算定方法

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

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

計算期間末日において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います。

 - ・ 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います。
 - ・ 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います。
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います。

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。

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。

（関連当事者との取引に関する注記）

（自 平成20年10月 1日 至 平成21年 9月30日）	（自 平成21年10月 1日 至 平成22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21年9月30日現在）	（平成22年9月30日現在）

1口当たり純資産額 = 0.8643円

1口当たり純資産額 = 0.8664円

(3) 附属明細表（平成22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	47,751	87.17	4,162,454.67	
	ABBOTT LABORATORIES	108,807	52.49	5,711,279.43	
	ABERCROMBIE & FITCH CO-CL A	6,217	39.29	244,265.93	
	ACCENTURE PLC-CL A	44,904	42.30	1,899,439.20	
	ACE LTD	23,927	57.74	1,381,544.98	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	39,417	11.00	433,587.00	
	ADOBE SYSTEMS INC	37,108	26.04	966,292.32	
	ADVANCE AUTO PARTS	6,162	59.66	367,624.92	
	ADVANCED MICRO DEVICES	39,457	7.28	287,246.96	
	AES CORP	47,657	11.39	542,813.23	
	AETNA INC	29,766	31.17	927,806.22	
	AFLAC	33,176	51.57	1,710,886.32	
	AGCO CORP	6,558	39.73	260,549.34	
	AGILENT TECHNOLOGIES	24,541	32.58	799,545.78	
	AIR PRODUCTS&CHEMICALS	14,969	82.85	1,240,181.65	
	AIRGAS INC	5,590	68.00	380,120.00	
	AKAMAI TECHNOLOGIES, INC	12,133	50.57	613,565.81	
	ALCOA	71,972	12.08	869,421.76	
	ALLEGHENY ENERGY INC	11,711	24.53	287,270.83	
	ALLEGHENY TECHNOLOGIES INC	6,252	46.35	289,780.20	
	ALLERGAN INC	21,677	66.71	1,446,072.67	
	ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	3,761	66.32	249,429.52	
	ALLIANT ENERGY CORPORATION	7,808	36.25	283,040.00	
	ALLSTATE CORP	36,104	31.55	1,139,081.20	
	ALPHA NATURAL RESOURCES INC	8,534	41.99	358,342.66	
	ALTERA CORPORATION	21,264	30.62	651,103.68	
	ALTRIA GROUP INC	146,801	24.25	3,559,924.25	
	AMAZON.COM	25,133	158.99	3,995,895.67	
	AMEREN CORPORATION	16,797	28.44	477,706.68	
	AMERICAN EAGLE OUTFITTERS	14,019	14.91	209,023.29	
	AMERICAN ELECTRIC POWER	33,756	36.46	1,230,743.76	
	AMERICAN EXPRESS	76,385	43.01	3,285,318.85	
	AMERICAN TOWER-A	28,572	51.79	1,479,743.88	
	AMERICAN WATER WORKS CO INC	12,315	23.06	283,983.90	
	AMERIPRISE FINANCIAL INC	18,194	47.92	871,856.48	
	AMERISOURCEBERGEN CORP	19,915	30.76	612,585.40	

AMETEK INC	7,453	47.46	353,719.38
AMGEN	67,526	54.94	3,709,878.44
AMPHENOL CORPORATION	12,234	49.18	601,668.12
ANADARKO PETROLEUM CORP	34,875	57.54	2,006,707.50
ANALOG DEVICES	21,005	31.57	663,127.85
AON CORP	17,132	39.62	678,769.84
APACHE CORP	25,433	98.03	2,493,196.99
APOLLO GROUP INC-CLA	9,598	50.29	482,683.42
APPLE INC	64,142	287.37	18,432,486.54
APPLIED MATERIALS	94,688	11.68	1,105,955.84
ARCH CAPITAL GROUP LTD	3,662	82.76	303,067.12
ARCH COAL INC	11,219	26.62	298,649.78
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	45,329	32.57	1,476,365.53
ARROW ELECTRONICS INC	8,559	26.73	228,782.07
ASSURANT INC	8,230	40.37	332,245.10
AT&T INC	418,493	28.71	12,014,934.03
AUTODESK INC	16,170	31.96	516,793.20
AUTOMATIC DATA PROCESS	35,456	42.12	1,493,406.72
AUTONATION INC	4,577	23.08	105,637.16
AUTOZONE INC	2,015	230.56	464,578.40
AVERY DENNISON CORP	6,965	37.18	258,958.70
AVNET INC	10,554	27.03	285,274.62
AVON PRODUCTS INC	30,198	32.27	974,489.46
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	8,676	32.95	285,874.20
BAKER HUGHES	30,244	42.11	1,273,574.84
BALL CORP	6,173	58.87	363,404.51
BANK NEW YORK CO	85,697	25.79	2,210,125.63
BANK OF AMERICA CORP	708,852	13.11	9,293,049.72
BARD C R INC	6,703	81.52	546,428.56
BAXTER INTERNATIONAL	42,254	47.62	2,012,135.48
BB&T CORP	48,899	24.25	1,185,800.75
BECKMAN COULTER INC	4,825	48.04	231,793.00
BECTON DICKINSON & CO	16,448	74.17	1,219,948.16
BED BATH & BEYOND INC	18,610	43.54	810,279.40
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	58,178	82.44	4,796,194.32
BEST BUY COMPANY INC	25,283	40.37	1,020,674.71
BIOGEN IDEC INC	18,821	55.36	1,041,930.56
BLACKROCK INC	2,500	168.76	421,900.00
BLOCK H & R INC	23,174	12.68	293,846.32
BMC SOFTWARE	12,796	41.05	525,275.80
BOEING CO	48,155	65.97	3,176,785.35
BORGWARNER INC	8,298	51.65	428,591.70
BOSTON SCIENTIFIC CORP	106,887	6.11	653,079.57
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	121,221	27.37	3,317,818.77
BROADCOM CORP-CL A	31,065	35.09	1,090,070.85

BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	5,711	61.49	351,169.39
BUCYRUS INTERNATIONAL INC	5,420	70.59	382,597.80
BUNGE LIMITED	9,654	61.19	590,728.26
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	12,269	69.57	853,554.33
CA INC	28,732	21.24	610,267.68
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	17,721	25.96	460,037.16
CABOT OIL & GAS CORP	7,170	30.20	216,534.00
CALPINE CORP	25,052	12.33	308,891.16
CAMERON INTERNATIONAL CORP	17,214	43.89	755,522.46
CAMPBELL SOUP CO (US)	14,391	36.02	518,363.82
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	32,255	38.93	1,255,687.15
CARDINAL HEALTH	25,523	33.15	846,087.45
CAREFUSION CORP	13,320	25.16	335,131.20
CARMAX INC	15,765	27.68	436,375.20
CATERPILLAR	44,281	79.99	3,542,037.19
CBS CORP-CL B	44,311	15.82	701,000.02
CELANESE CORP-SERIES A	11,037	32.43	357,929.91
CELGENE CORP	32,487	57.43	1,865,728.41
CENTERPOINT ENERGY INC	27,950	15.76	440,492.00
CENTURYLINK INC	21,276	39.62	842,955.12
CEPHALON INC	5,300	63.17	334,801.00
CERNER CORP	4,926	82.51	406,444.26
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	5,009	99.35	497,644.15
CHARLES RIVER LABORATORIES	4,666	33.08	154,351.28
CHESAPEAKE ENERGY CORP	45,883	22.56	1,035,120.48
CHEVRON CORP	141,591	81.28	11,508,516.48
CHUBB CORPORATION	23,087	56.76	1,310,418.12
CHURCH & DWIGHT CO INC	4,997	65.08	325,204.76
CIGNA CORP	19,503	35.34	689,236.02
CIMAREX ENERGY CO	5,913	67.44	398,772.72
CINCINNATI FINANCIAL CORP	10,936	28.69	313,753.84
CINTAS CORP	9,502	27.45	260,829.90
CISCO SYSTEMS	402,583	21.87	8,804,490.21
CIT GROUP INC	13,396	40.77	546,154.92
CITIGROUP	1,740,373	3.92	6,822,262.16
CITRIX SYSTEMS INC	13,094	70.21	919,329.74
CLIFFS NATURAL RESOURCES INC	9,547	64.11	612,058.17
CLOROX COMPANY	9,928	66.96	664,778.88
CME GROUP INC	4,641	259.55	1,204,571.55
COACH INC	21,507	43.13	927,596.91
COCA-COLA CO	146,363	58.76	8,600,289.88
COCA-COLA ENTERPRISES	21,165	31.08	657,808.20
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	21,106	64.76	1,366,824.56
COLGATE-PALMOLIVE CO	34,572	78.31	2,707,333.32
COMCAST CORP-CL A	145,655	18.15	2,643,638.25

COMCAST CORP-SPECIAL A	53,929	17.08	921,107.32
COMERICA INC	12,458	36.52	454,966.16
COMPUTER SCIENCES CORP	10,872	45.88	498,807.36
CONAGRA	31,408	21.96	689,719.68
CONOCOPHILLIPS	99,667	57.36	5,716,899.12
CONSOL ENERGY INC	15,910	36.86	586,442.60
CONSOLIDATED EDISON INC	19,876	48.43	962,594.68
CONSTELLATION BRANDS INC-A	13,688	17.77	243,235.76
CONSTELLATION ENERGY GROUP	13,506	32.52	439,215.12
COOPER INDUSTRIES PLC-CL A	11,809	48.60	573,917.40
CORNING	110,019	18.38	2,022,149.22
COSTCO WHOLESALE CORP	31,052	64.68	2,008,443.36
COVANCE INC	4,422	42.18	186,519.96
COVENTRY HEALTH CARE INCON	10,428	21.28	221,907.84
COVIDIEN PLC	35,335	40.15	1,418,700.25
CREE INC	7,198	55.02	396,033.96
CROWN CASTLE INTL CORP	20,570	44.08	906,725.60
CROWN HOLDINGS INC	11,420	28.55	326,041.00
CSX CORP	27,437	55.66	1,527,143.42
CUMMINS INC	13,432	91.30	1,226,341.60
CVS CAREMARK CORPORATION	96,033	31.29	3,004,872.57
DANAHER CORP	38,904	40.57	1,578,335.28
DARDEN RESTAURANTS INC	9,415	43.06	405,409.90
DAVITA INC	7,324	68.95	504,989.80
DEAN FOODS CO	12,795	10.09	129,101.55
DEERE&CO	29,947	71.73	2,148,098.31
DELL INC	124,226	12.99	1,613,695.74
DELTA AIR LINES INC	13,919	11.59	161,321.21
DENBURY RESOURCES INC	26,736	15.83	423,230.88
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	9,656	31.87	307,736.72
DEVON ENERGY CORPORATION	29,927	64.83	1,940,167.41
DEVRY INC	4,423	46.89	207,394.47
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	4,900	68.88	337,512.00
DIRECTV	62,525	41.99	2,625,424.75
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	38,422	16.58	637,036.76
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	9,584	43.50	416,904.00
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	9,989	38.25	382,079.25
DISH NETWORK CORPORATION-A	14,761	19.34	285,477.74
DOLBY LABORATORIES INC-CL A	3,706	58.86	218,135.16
DOLLAR GENERAL CORP	6,006	29.53	177,357.18
DOLLAR TREE INC	9,332	49.39	460,907.48
DOMINION RESOURCES	42,016	43.95	1,846,603.20
DONNELLEY (RR) & SONS	14,191	17.04	241,814.64
DOVER CORP	13,165	51.88	683,000.20
DOW CHEMICAL CO	81,410	27.39	2,229,819.90

DR HORTON INC	20,187	11.14	224,883.18
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	17,319	35.38	612,746.22
DTE ENERGY COMPANY	11,871	46.16	547,965.36
DU PONT (E.I) DE NEMOURS	63,868	44.53	2,844,042.04
DUKE ENERGY CORP	92,564	17.86	1,653,193.04
DUN & BRADSTREET CORP	3,522	74.53	262,494.66
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	5,100	73.53	375,003.00
EATON CORP	11,224	82.67	927,888.08
EATON VANCE CORP	8,339	28.94	241,330.66
EBAY	82,916	24.99	2,072,070.84
ECOLAB INC	16,451	50.57	831,927.07
EDISON INTL	21,818	34.51	752,939.18
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	7,974	67.94	541,753.56
EL PASO CORP	49,607	12.47	618,599.29
ELECTRONIC ARTS INC	23,239	16.23	377,168.97
EMC CORP	144,901	20.67	2,995,103.67
EMERSON ELECTRIC CO	53,091	52.89	2,807,982.99
ENERGEN CORP	4,814	44.95	216,389.30
ENERGIZER HOLDINGS INC	4,690	67.43	316,246.70
ENERGY CORP	13,344	77.24	1,030,690.56
EOG RESOURCES INC	17,845	93.82	1,674,217.90
EQT CORPORATION	9,635	35.98	346,667.30
EQUIFAX INC	8,925	31.09	277,478.25
ESTEE LAUDER CO-CL A	8,127	64.13	521,184.51
EVEREST RE GROUP LTD	4,180	86.01	359,521.80
EXELON CORP	46,565	42.82	1,993,913.30
EXPEDIA INC	14,589	28.41	414,473.49
EXPEDITORS INTL WASH INC	15,007	46.53	698,275.71
EXPRESS SCRIPTS INC	36,816	48.98	1,803,247.68
EXXON MOBIL	359,261	61.59	22,126,884.99
F5 NETWORKS INC	5,650	104.41	589,916.50
FAMILY DOLLAR STORES	9,079	44.05	399,929.95
FASTENAL CO	9,353	53.65	501,788.45
FEDEX CORP	20,973	86.37	1,811,438.01
FIDELITY NATIONAL FINL-A	15,151	15.68	237,567.68
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	17,551	27.37	480,370.87
FIFTH THIRD BANCORP	56,156	11.90	668,256.40
FIRST SOLAR INC	3,908	149.27	583,347.16
FIRSTENERGY CORP	21,488	38.54	828,147.52
FISERV INC	10,758	53.55	576,090.90
FLEXTRONICS INTL LTD	57,423	6.07	348,557.61
FLIR SYSTEMS INC	10,809	26.00	281,034.00
FLOWSERVE CORP	3,952	109.21	431,597.92
FLUOR CORP	12,599	49.59	624,784.41
FMC CORP	4,868	67.95	330,780.60

FMC TECHNOLOGIES INC	8,571	68.96	591,056.16
FORD MOTOR COMPANY	209,193	12.33	2,579,349.69
FOREST LABORATORIES INC	21,316	31.11	663,140.76
FORTUNE BRANDS INC	10,737	49.13	527,508.81
FOSTER WHEELER AG	8,989	25.24	226,882.36
FRANKLIN RESOURCES INC	11,243	106.79	1,200,639.97
FREEMPORT-MCMOR-B	30,498	86.20	2,628,927.60
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	69,128	8.17	564,775.76
GAMESTOP CORP-CLASS A	10,504	19.70	206,928.80
GAP	32,933	18.77	618,152.41
GARMIN LTD	8,302	30.64	254,373.28
GENERAL DYNAMICS CORP	23,112	63.06	1,457,442.72
GENERAL ELECTRIC CO	752,595	16.36	12,312,454.20
GENERAL MILLS INC	46,774	36.87	1,724,557.38
GENUINE PARTS CO	11,193	44.92	502,789.56
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	34,476	12.26	422,675.76
GENZYME CORP	18,812	71.12	1,337,909.44
GILEAD SCIENCES INC	62,731	35.87	2,250,160.97
GOLDMAN SACHS GROUP INC	34,553	144.42	4,990,144.26
GOODRICH CORP	8,824	74.58	658,093.92
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	16,220	10.78	174,851.60
GOOGLE INC-CL A	17,313	527.69	9,135,896.97
GRAINGER (WW) INC	4,368	119.56	522,238.08
HALLIBURTON CO	63,813	33.40	2,131,354.20
HANSEN NATURAL CORPORATION	5,319	46.82	249,035.58
HARLEY-DAVIDSON	16,597	28.34	470,358.98
HARRIS CORP	9,034	44.78	404,542.52
HARSCO CORP	5,675	24.43	138,640.25
HARTFORD FINANCIAL SVCS	29,729	23.34	693,874.86
HASBRO INC	9,228	45.04	415,629.12
HEINZ (H.J) CO	22,292	47.83	1,066,226.36
HELMERICH & PAYNE	7,453	40.13	299,088.89
HENRY SCHEIN INC	6,441	57.61	371,066.01
HERSHEY FOODS CORPORATION	11,152	47.79	532,954.08
HESS CORP	20,830	58.78	1,224,387.40
HEWLETT-PACKARD CO	165,307	42.53	7,030,506.71
HOLOGIC INC	18,263	16.07	293,486.41
HOME DEPOT	119,365	31.81	3,797,000.65
HONEYWELL INTL INC	51,308	44.04	2,259,604.32
HORMEL FOODS CORP	5,076	44.44	225,577.44
HOSPIRA INC	11,693	57.58	673,282.94
HUDSON CITY BANCORP INC	33,485	12.25	410,191.25
HUMAN GENOME SCIENCES INC	13,206	28.73	379,408.38
HUMANA INC	11,997	50.14	601,529.58
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	6,593	35.30	232,732.90

IHS INC-CLASS A	2,928	68.31	200,011.68
ILLINOIS TOOL WORKS	30,107	46.81	1,409,308.67
ILLUMINA INC	8,585	50.00	429,250.00
INGERSOLL-RAND PLC	22,691	35.72	810,522.52
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	5,429	52.15	283,122.35
INTEL CORP	392,210	19.26	7,553,964.60
INTERCONTINENTALEXCHANGE INC	4,441	105.23	467,326.43
INTERPUBLIC GROUP OF COS	34,492	10.04	346,299.68
INTL BUSINESS MACHINES CORP	90,394	135.48	12,246,579.12
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	5,606	48.71	273,068.26
INT'L GAME TECHNOLOGY	21,013	14.37	301,956.81
INT'L PAPER CO	29,228	21.43	626,356.04
INTUIT INC	21,035	44.45	935,005.75
INTUITIVE SURGICAL INC	2,761	286.98	792,351.78
INVESCO PLC	30,824	21.31	656,859.44
IRON MOUNTAIN INC	12,656	22.20	280,963.20
ITT CORPORATION	12,288	46.92	576,552.96
ITT EDUCATIONAL SERVICES INC	2,379	65.70	156,300.30
J.C. PENNEY CO INC	14,991	27.00	404,757.00
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	8,813	38.64	340,534.32
JEFFERIES GROUP INC (NEW)	7,885	22.42	176,781.70
JM SMUCKER CO	8,397	60.75	510,117.75
JOHNSON & JOHNSON	194,418	62.31	12,114,185.58
JOHNSON CONTROLS INC	47,419	30.62	1,451,969.78
JOY GLOBAL INC	7,256	70.83	513,942.48
JPMORGAN CHASE & CO	281,104	38.41	10,797,204.64
JUNIPER NETWORKS INC	37,088	30.92	1,146,760.96
KBR INC	11,320	24.47	277,000.40
KELLOGG CO	18,783	50.62	950,795.46
KEY CORP	62,114	7.95	493,806.30
KIMBERLY-CLARK CORP	29,181	65.06	1,898,515.86
KINDER MORGAN MANAGEMENT LLC	5,628	59.95	337,398.60
KLA-TENCOR CORP	11,884	35.12	417,366.08
KOHL'S CORP	20,557	52.96	1,088,698.72
KRAFT FOODS INC-A	122,899	31.21	3,835,677.79
KROGER CO	43,183	21.63	934,048.29
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	8,159	72.42	590,874.78
LABORATORY CRP OF AMER	7,356	78.15	574,871.40
LAM RESEARCH CORP	8,853	42.57	376,872.21
LAS VEGAS SANDS CORP	23,274	34.46	802,022.04
LEGG MASON INC	11,554	30.20	348,930.80
LEGGETT & PLATT INC	10,465	22.94	240,067.10
LENDER PROCESSING SERV-W/I	6,684	33.44	223,512.96
LEUCADIA NATIONAL CORP	13,721	23.62	324,090.02
LIBERTY GLOBAL INC-A	9,328	30.84	287,675.52

LIBERTY GLOBAL INC-SERIES C	8,233	30.69	252,670.77
LIBERTY MEDIA-INTERACTIVE A	40,038	13.84	554,125.92
LIFE TECHNOLOGIES CORP	12,872	47.61	612,835.92
LILLY (ELI) & CO	73,157	36.53	2,672,425.21
LIMITED	19,378	27.59	534,639.02
LINCOLN NATIONAL CORP	21,371	23.94	511,621.74
LINEAR TECHNOLOGY CORP	15,800	31.04	490,432.00
LOCKHEED MARTIN CORP	22,395	71.89	1,609,976.55
LOEWS CORP	23,654	37.96	897,905.84
LORILLARD INC	10,775	80.70	869,542.50
LOWES COMPANIES	101,718	22.19	2,257,122.42
LSI CORP	46,074	4.53	208,715.22
LUBRIZOL CORP	4,808	105.00	504,840.00
M & T BANK CORP	5,879	81.81	480,960.99
MACY'S INC	29,754	23.17	689,400.18
MANPOWER INC	5,851	49.33	288,629.83
MARATHON OIL CORP	50,013	33.01	1,650,929.13
MARRIOTT INTL A	20,376	35.87	730,887.12
MARSH & MCLENNAN COS	38,210	24.23	925,828.30
MARSHALL & ILSLEY CORP	34,471	7.00	241,297.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	3,130	77.00	241,010.00
MARVELL TECHNOLOGY GROUP	38,616	17.70	683,503.20
MASCO CORP	24,856	10.89	270,681.84
MASTERCARD INC-CLASS A	7,031	222.63	1,565,311.53
MATTEL INC	25,711	23.55	605,494.05
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	21,049	18.69	393,405.81
MCAFFEE INC	10,960	47.24	517,750.40
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	8,466	41.10	347,952.60
MCDONALD'S CORP	75,834	74.45	5,645,841.30
MCGRAW-HILL COS	22,240	33.11	736,366.40
MCKESSON CORP	19,131	61.96	1,185,356.76
MDU RESOURCES GROUP INC	12,326	19.77	243,685.02
MEAD JOHNSON NUTRITION COMPANY	14,416	56.75	818,108.00
MEADWESTVACO CORP	11,829	24.43	288,982.47
MEDCO HEALTH SOLUTIONS	32,204	51.69	1,664,624.76
MEDTRONIC	77,648	33.29	2,584,901.92
MEMC ELECTRONIC MATERIALS	16,031	11.93	191,249.83
MERCK & CO	219,808	37.12	8,159,272.96
METLIFE INC	63,262	38.79	2,453,932.98
METROPCS COMMUNICATIONS INC	17,510	10.49	183,679.90
MGM RESORTS INTERNATIONAL	18,663	11.23	209,585.49
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	12,987	31.56	409,869.72
MICRON TECHNOLOGY	63,049	7.29	459,627.21
MICROSOFT CORP	555,992	24.50	13,621,804.00
MOHAWK INDUSTRIES INC	4,109	52.37	215,188.33

MOLSON COORS BREWING CO -B	11,418	47.27	539,728.86
MONSANTO CO	38,457	48.00	1,845,936.00
MOODY'S CORP	14,233	25.15	357,959.95
MORGAN STANLEY	88,883	24.48	2,175,855.84
MOSAIC CO/THE	10,989	60.96	669,889.44
MOTOROLA	155,635	8.56	1,332,235.60
MURPHY OIL CORP	12,823	61.26	785,536.98
MYLAN INC	21,771	18.80	409,294.80
NABORS INDUSTRIES LTD	20,105	18.55	372,947.75
NASDAQ OMX GROUP	9,563	19.82	189,538.66
NATIONAL OILWELL VARCO INC	29,537	44.85	1,324,734.45
NATIONAL SEMICONDUCTOR CO	16,414	12.87	211,248.18
NETAPP INC	24,294	50.81	1,234,378.14
NETFLIX INC	3,131	170.63	534,242.53
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	29,227	16.00	467,632.00
NEWELL RUBBERMAID	19,611	17.92	351,429.12
NEWFIELD EXPLORATION CO	9,403	57.31	538,885.93
NEWMONT MINING CORP	34,632	63.90	2,212,984.80
NEWS CORP -CLASS A	128,447	13.21	1,696,784.87
NEWS CORP -CLASS B	30,959	15.28	473,053.52
NEXTERA ENERGY INC	27,769	54.67	1,518,131.23
NII HOLDINGS INC	11,848	41.18	487,900.64
NIKE B	26,499	79.93	2,118,065.07
NISOURCE INC	19,535	17.46	341,081.10
NOBLE CORP	18,034	34.97	630,648.98
NOBLE ENERGY INC	12,309	75.52	929,575.68
NORDSTROM INC	12,295	37.60	462,292.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	26,085	59.77	1,559,100.45
NORTHEAST UTILITIES	12,406	29.87	370,567.22
NORTHERN TRUST CORP	15,379	47.82	735,423.78
NORTHROP GRUMMAN CORP	20,275	60.20	1,220,555.00
NRG ENERGY INC	18,088	20.81	376,411.28
NSTAR	7,529	39.51	297,470.79
NUANCE COMMUNICATIONS INC	16,423	15.77	258,990.71
NUCOR CORP	22,213	38.39	852,757.07
NVIDIA CORP	40,335	11.88	479,179.80
NYSE EURONEXT	18,440	28.73	529,781.20
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	57,250	76.63	4,387,067.50
OLD REPUBLIC INTL CORP	16,178	13.85	224,065.30
OMNICARE INC	8,264	23.80	196,683.20
OMNICOM GROUP	21,637	39.43	853,146.91
ONEOK INC	7,118	44.53	316,964.54
ORACLE CORP	283,039	27.17	7,690,169.63
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	9,736	54.07	526,425.52
OWENS-ILLINOIS INC	11,644	27.92	325,100.48

PACCAR INC	23,150	47.60	1,101,940.00
PACTIV CORPORATION	9,367	32.95	308,642.65
PALL CORP	8,105	41.55	336,762.75
PARKER HANNIFIN CORP	11,352	70.45	799,748.40
PARTNERRE LTD	5,252	79.92	419,739.84
PATTERSON COMPANIES INC	6,490	28.45	184,640.50
PAYCHEX INC	22,929	27.25	624,815.25
PEABODY ENERGY CORP	18,947	49.22	932,571.34
PENTAIR INC	6,813	33.55	228,576.15
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL INC	26,477	13.04	345,260.08
PEPCO HOLDINGS INC	15,734	18.75	295,012.50
PEPSICO INC	113,682	66.75	7,588,273.50
PERRIGO CO	5,797	64.51	373,964.47
PETROHAWK ENERGY CORP	21,299	15.79	336,311.21
PETSMART INC	8,710	35.23	306,853.30
PFIZER	568,587	17.40	9,893,413.80
PG&E CORP	26,247	45.19	1,186,101.93
PHARMACEUTICAL PRODUCT DEVEL	7,934	24.47	194,144.98
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	130,540	56.32	7,352,012.80
PINNACLE WEST CAPITAL	7,645	41.35	316,120.75
PIONEER NATURAL RESOURCES	8,172	65.37	534,203.64
PITNEY BOWES INC	14,629	21.46	313,938.34
PLAINS EXPLORATION & PRODUCT	9,876	26.55	262,207.80
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	37,167	51.80	1,925,250.60
POLO RALPH LAUREN CORP	4,482	90.09	403,783.38
PPG INDUSTRIES INC	11,725	72.90	854,752.50
PPL CORPORATION	33,032	27.41	905,407.12
PRAXAIR INC	21,566	89.73	1,935,117.18
PRECISION CASTPARTS CORP	10,023	129.67	1,299,682.41
PRICE T ROWE GROUP INC	18,339	49.64	910,347.96
PRICELINE.COM INC	3,213	348.13	1,118,541.69
PRIDE INTERNATIONAL INC	12,379	29.81	369,017.99
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	22,590	25.95	586,210.50
PROCTER & GAMBLE CO	203,006	60.25	12,231,111.50
PROGRESS ENERGY INC	20,243	44.58	902,432.94
PROGRESSIVE CORP	44,999	20.80	935,979.20
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	32,783	56.53	1,853,222.99
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE	35,665	32.96	1,175,518.40
PULTE GROUP INC	24,272	8.74	212,137.28
QEP RESOURCES INC	12,311	29.88	367,852.68
QUALCOMM	115,631	44.31	5,123,609.61
QUANTA SERVICES INC	14,838	19.26	285,779.88
QUEST DIAGNOSTICS	10,781	49.62	534,953.22
QWEST COMMUNI. INT'L	110,668	6.28	694,995.04
RALCORP HOLDINGS INC	3,870	57.57	222,795.90

RANGE RESOURCES CORP	11,238	38.75	435,472.50
RAYTHEON COMPANY	26,862	45.54	1,223,295.48
RED HAT INC	13,298	41.03	545,616.94
REGIONS FINL CORP	84,251	7.21	607,449.71
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	4,157	58.95	245,055.15
REPUBLIC SERVICES INC	26,916	30.43	819,053.88
REYNOLDS AMERICAN INC	12,327	59.92	738,633.84
ROBERT HALF INTL INC	10,047	25.39	255,093.33
ROCKWELL AUTOMATION INC	10,052	62.44	627,646.88
ROCKWELL COLLIN	11,095	58.01	643,620.95
ROPER INDUSTRIES INC	6,624	65.27	432,348.48
ROSS STORES INC	8,555	55.66	476,171.30
ROWAN COMPANIES INC	8,066	30.35	244,803.10
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	9,849	31.73	312,508.77
SAFEWAY INC	27,393	21.05	576,622.65
SAIC INC	27,343	15.88	434,206.84
SALESFORCE.COM INC	8,165	113.58	927,380.70
SANDISK CORP	16,212	37.64	610,219.68
SARA LEE CORP	44,283	13.63	603,577.29
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	7,872	40.30	317,241.60
SCANA CORP	8,306	40.32	334,897.92
SCHLUMBERGER	96,324	61.52	5,925,852.48
SCHWAB (CHARLES) CORP	71,676	13.95	999,880.20
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	6,412	47.60	305,211.20
SEAGATE TECHNOLOGY	34,470	12.01	413,984.70
SEALED AIR CORP	10,978	22.59	247,993.02
SEARS HOLDINGS CORPORATION	3,239	72.37	234,406.43
SEI INVESTMENTS COMPANY	9,390	20.24	190,053.60
SEMPRA ENERGY	16,577	53.73	890,682.21
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6,575	75.90	499,042.50
SIGMA-ALDRICH	8,557	60.71	519,495.47
SLM CORP	34,241	11.80	404,043.80
SOUTHERN CO	58,122	37.42	2,174,925.24
SOUTHWEST AIRLINES CO	13,119	13.19	173,039.61
SOUTHWESTERN ENERGY CO	24,403	33.64	820,916.92
SPECTRA ENERGY CORP	45,677	22.50	1,027,732.50
SPRINT NEXTEL CORPORATION	208,647	4.60	959,776.20
SPX CORP	3,517	62.16	218,616.72
ST JUDE MEDICAL INC	23,562	39.26	925,044.12
STANLEY BLACK&DECKER	10,741	60.75	652,515.75
STAPLES INC	51,452	20.65	1,062,483.80
STARBUCKS CORP	52,523	25.80	1,355,093.40
STARWOOD HOTELS & RESORTS	13,358	52.13	696,352.54
STATE STREET CORP	35,447	37.34	1,323,590.98
STERICYCLE INC	5,667	69.75	395,273.25

STRYKER CORP	20,973	50.24	1,053,683.52
SUNOCO INC	8,498	36.26	308,137.48
SUNTRUST BANKS	35,318	25.80	911,204.40
SUPERVALU INC	14,962	11.65	174,307.30
SYMANTEC CORP	56,314	15.61	879,061.54
SYNOPSIS INC	10,560	24.64	260,198.40
SYSCO CORP	41,701	28.98	1,208,494.98
TARGET (DAYTON HUDSON)	49,319	53.54	2,640,539.26
TD AMERITRADE HOLDING CORP	16,323	16.27	265,575.21
TELEPHONE AND DATA SYSTEMS, INC	3,364	32.78	110,271.92
TERADATA CORP	11,637	38.96	453,377.52
TEXAS INSTRUMENTS	86,156	26.84	2,312,427.04
TEXTRON	19,266	20.68	398,420.88
TFS FINANCIAL CORP	6,221	9.05	56,300.05
THE WALT DISNEY CO	131,157	33.01	4,329,492.57
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	28,930	47.85	1,384,300.50
TIFFANY & CO	8,963	46.71	418,661.73
TIME WARNER CABLE-A	24,988	54.42	1,359,846.96
TIME WARNER INC	80,339	30.69	2,465,603.91
TJX COMPANIES INC	28,759	44.95	1,292,717.05
TOLL BROTHERS INC	9,905	19.00	188,195.00
TORCHMARK CORP	5,734	53.36	305,966.24
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	11,828	15.22	180,022.16
TRANSATLANTIC HOLDINGS INC	4,451	50.60	225,220.60
TRANSOCEAN LTD	22,552	65.13	1,468,811.76
TRAVELERS COS INC/THE	34,997	51.99	1,819,494.03
TYCO ELECTRONICS LTD	31,971	29.69	949,218.99
TYCO INTERNATIONAL LTD	36,265	37.14	1,346,882.10
TYSON FOODS INC	20,555	15.42	316,958.10
ULTRA PETROLEUM CORP	10,728	41.71	447,464.88
UNION PACIFIC CORP	35,662	82.25	2,933,199.50
UNITED HEALTHCARE CORP	80,125	35.20	2,820,400.00
UNITED PARCEL SERVICE B	50,777	66.74	3,388,856.98
UNITED STATES STEEL CORP	10,107	44.31	447,841.17
UNITED TECHNOLOGIES CORP	62,485	71.49	4,467,052.65
UNUM GROUP	23,515	22.25	523,208.75
URBAN OUTFITTERS INC	9,552	31.96	305,281.92
URS CORP	5,796	38.34	222,218.64
US BANCORP	135,433	21.67	2,934,833.11
VALERO ENERGY CORP	39,861	17.27	688,399.47
VALIDUS HOLDINGS LTD	5,128	26.58	136,302.24
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	8,708	60.59	527,617.72
VERISIGN INC	12,931	31.61	408,748.91
VERISK ANALYTICS INC-CLASS A	6,951	27.87	193,724.37
VERIZON COMMUNICATIONS	200,198	32.66	6,538,466.68

VERTEX PHARMACEUTICALS INC	14,139	34.94	494,016.66
VF CORP	6,209	80.85	501,997.65
VIACOM INC-CLASS B	39,124	36.28	1,419,418.72
VIRGIN MEDIA INC	22,150	22.88	506,792.00
VISA INC-CLASS A SHARES	34,892	74.41	2,596,313.72
VMWARE INC-CLASS A	4,961	87.80	435,575.80
VULCAN MATERIALS CO	9,001	36.98	332,856.98
WALGREEN CO	68,970	33.63	2,319,461.10
WAL-MART STORES	143,823	53.35	7,672,957.05
WARNER CHILCOTT PLC-CLASS A	7,999	22.47	179,737.53
WASHINGTON POST -CL B	413	390.05	161,090.65
WASTE MANAGEMENT INC	32,346	35.85	1,159,604.10
WATERS CORP	6,552	71.12	465,978.24
WATSON PHARMACEUTICALS INC	7,903	42.69	337,379.07
WEATHERFORD INTL LTD	52,182	17.40	907,966.80
WELLPOINT INC	31,293	56.13	1,756,476.09
WELLS FARGO & CO	349,704	25.04	8,756,588.16
WESTERN DIGITAL CORP	16,155	28.73	464,133.15
WESTERN UNION CO	47,154	17.40	820,479.60
WEYERHAEUSER CO	37,681	16.13	607,794.53
WHIRLPOOL CORP	5,295	80.75	427,571.25
WHITE MOUNTAINS INSURANCE GP	555	310.55	172,355.25
WHOLE FOODS MKT INC	10,273	37.42	384,415.66
WILLIAMS COS	41,186	19.06	785,005.16
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	11,976	30.49	365,148.24
WINDSTREAM CORP	34,228	12.51	428,192.28
WISCONSIN ENERGY CORP	8,240	57.93	477,343.20
WR BERKLEY CORP	9,725	26.83	260,921.75
WYNN RESORTS LTD	5,650	86.48	488,612.00
XCEL ENERGY INC	32,395	23.09	748,000.55
XEROX CORP	97,209	10.29	1,000,280.61
XILINX INC	19,106	27.05	516,817.30
XL GROUP PLC	24,169	21.72	524,950.68
YAHOO	92,752	14.34	1,330,063.68
YUM BRANDS INC	32,950	46.28	1,524,926.00
ZIMMER HOLDINGS INC	14,296	52.15	745,536.40
小計	22,791,107		748,230,012.15 (62,716,639,618)
カナダドル			
AGNICO-EAGLE MINES	11,784	72.93	859,407.12
AGRIUM INC	11,095	79.56	882,718.20
ALIMENTATION COUCHE-TARD -B	8,803	22.85	201,148.55
ATHABASCA OIL SANDS CORP	13,415	10.27	137,772.05
BANK MONTREAL	39,573	59.76	2,364,882.48
BANK NOVA SCOTIA	72,451	54.80	3,970,314.80
BARRICK GOLD CORP	69,433	48.57	3,372,360.81
BCE INC	17,832	33.80	602,721.60

BOMBARDIER B	101,281	4.95	501,340.95
BROOKFIELD ASSEST MANAGEMENT INC, CLASS-A	36,496	29.03	1,059,478.88
BROOKFIELD PROPERTIES CORP	21,261	15.98	339,750.78
CAE INC	17,706	10.74	190,162.44
CAMECO CORP	27,701	28.54	790,586.54
CANADIAN IMPERIAL BANK	27,446	73.96	2,029,906.16
CANADIAN NATL RAILWAY CO	33,173	65.84	2,184,110.32
CANADIAN NATURAL RESOURCES	76,743	35.53	2,726,678.79
CANADIAN TIRE CORP -CL A	5,511	58.06	319,968.66
CANADIAN UTILITIES LTD A	6,050	48.78	295,119.00
CENOVUS ENERGY INC	52,988	29.60	1,568,444.80
CGI GROUP INC - CL A	17,688	15.58	275,579.04
CI FINANCIAL CORP	11,123	20.75	230,802.25
CP RAILWAY LIMITED	11,884	63.49	754,515.16
CRESCENT POINT ENERGY CORP	15,704	37.50	588,900.00
ELDORADO GOLD CORP	37,949	19.68	746,836.32
EMPIRE CO LTD 'A'	2,049	55.18	113,063.82
ENBRIDGE	25,343	53.30	1,350,781.90
ENCANA CORP	52,120	29.91	1,558,909.20
ENSIGN ENERGY SERVICES INC	9,181	12.49	114,670.69
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	1,408	418.71	589,543.68
FINNING INTERNATIONAL INC	12,052	24.25	292,261.00
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	5,681	76.14	432,551.34
FORTIS INC	12,137	32.36	392,753.32
FRANCO-NEVADA CORP	8,037	32.67	262,568.79
GILDAN ACTIVEWEAR INC	8,116	28.72	233,091.52
GOLDCORP INC	51,734	45.55	2,356,483.70
GREAT-WEST LIFECO INC	20,083	25.18	505,689.94
HUSKY ENERGY INC	17,972	25.12	451,456.64
IAMGOLD CORP	24,843	18.36	456,117.48
IGM FINANCIAL INC	8,344	41.75	348,362.00
IMPERIAL OIL	20,912	38.78	810,967.36
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	5,899	31.70	186,998.30
INMET MINING CORPORATION	3,559	57.49	204,606.91
INTACT FINANCIAL CORP	8,157	45.36	370,001.52
IVANHOE MINES LTD	18,673	25.00	466,825.00
KINROSS GOLD CORP	79,985	19.57	1,565,306.45
LOBLAW COMPANIES LTD	7,819	40.52	316,825.88
MAGNA INTERNATIONAL INC	7,503	84.87	636,779.61
MANULIFE FINANCIAL CORP	124,430	13.00	1,617,590.00
METRO INC -A	7,520	44.48	334,489.60
NATIONAL BANK OF CANADA	11,455	65.04	745,033.20
NEXEN INC	36,940	20.63	762,072.20
NIKO RESOURCES LTD	3,228	98.43	317,732.04
ONEX CORP	6,657	28.97	192,853.29

OPEN TEXT CORP	4,002	49.85	199,499.70	
PACIFIC RUBIALES ENERGY CORP	17,605	28.31	498,397.55	
PAN AMERICAN SILVER CORP	7,014	30.28	212,383.92	
PETROBAKKEN ENERGY LTD-A	5,318	22.98	122,207.64	
PETROBANK ENERGY & RESOURCES	7,085	40.51	287,013.35	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	20,886	150.22	3,137,494.92	
POWER CORP OF CANADA	24,567	26.99	663,063.33	
POWER FINANCIAL CORP	17,458	29.14	508,726.12	
PROGRESS ENERGY RESOURCES CO	12,781	11.42	145,959.02	
RESEARCH IN MOTION	35,034	50.04	1,753,101.36	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	6,693	20.88	139,749.84	
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	31,641	38.95	1,232,416.95	
ROYAL BANK OF CANADA	100,428	53.64	5,386,957.92	
SAPUTO INC	10,237	35.00	358,295.00	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	24,565	22.59	554,923.35	
SHERRITT INTERNATIONAL CORP	20,731	8.09	167,713.79	
SHOPPERS DRUG MART CORP	15,327	40.09	614,459.43	
SILVER WHEATON CORP	22,946	27.92	640,652.32	
SINO-FOREST CORPORATION	17,096	17.61	301,060.56	
SNC-LAVALIN GROUP INC	10,643	52.78	561,737.54	
SUN LIFE FINANCIAL INC	40,048	26.64	1,066,878.72	
SUNCOR ENERGY	110,043	33.19	3,652,327.17	
TALTSMAN ENERGY INC	71,811	17.96	1,289,725.56	
TECK RESOURCES LTD-CL B	34,758	41.97	1,458,793.26	
TELUS CORPORATION -NON VOTE	14,577	43.95	640,659.15	
THOMSON REUTERS CORP	26,364	39.07	1,030,041.48	
TIM HORTONS INC	12,377	37.64	465,870.28	
TMX GROUP INC	5,251	31.63	166,089.13	
TORONTO-DOMINION BANK	61,412	74.20	4,556,770.40	
TRANSALTA CORP	15,421	21.91	337,874.11	
TRANSCANADA CORP	48,435	38.36	1,857,966.60	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	18,881	26.29	496,381.49	
VERMILION ENERGY INC	5,924	38.10	225,704.40	
VITERRA INC	25,664	8.93	229,179.52	
WESTON (GEORGE) LTD	3,639	78.17	284,460.63	
YAMANA GOLD INC	52,203	11.98	625,391.94	
小計	2,305,792		80,849,819.53 (6,563,388,349)	

オーストラリアドル	AGL ENERGY LTD	31,726	16.27	516,182.02
	ALUMINA LIMITED	172,011	1.83	315,640.18
	AMCOR	86,092	6.56	564,763.52
	AMP LTD	146,051	5.18	756,544.18
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	26,844	3.55	95,296.20
	ASCIANO GROUP	206,263	1.64	338,271.32
	ASX LTD	12,235	33.16	405,712.60
	AUST AND NZ BANKING GROUP	178,589	24.14	4,311,138.46
	AXA ASIA PACIFIC HOLDINGS	72,855	5.25	382,488.75
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK	25,473	9.28	236,389.44
	BHP BILLITON LTD	236,572	39.37	9,313,839.64
	BILLABONG INTERNATIONAL LTD	13,575	8.02	108,871.50
	BLUESCOPE STEEL LTD	128,527	2.25	289,185.75
	BORAL LIMITED	50,355	4.81	242,207.55
	BRAMBLES LTD	100,248	6.33	634,569.84
	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	9,059	11.99	108,617.41
	COCA-COLA AMATIL LIMITED	39,879	12.29	490,112.91
	COCHLEAR LIMITED	3,986	71.21	283,843.06
	COMMONWEALTH BANK OF AUST	109,171	52.05	5,682,350.55
	COMPUTERSHARE LIMITED	31,335	9.91	310,529.85
	CROWN LTD	31,871	8.41	268,035.11
	CSL LIMITED	40,559	33.28	1,349,803.52
	CSR LIMITED	106,788	1.80	192,752.34
	ENERGY RESOURCES OF AUST	4,480	13.44	60,211.20
	FAIRFAX MEDIA LTD	146,190	1.48	217,092.15
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	87,603	5.15	451,155.45
	FOSTERS GROUP LTD	136,078	6.18	840,962.04
	GOODMAN FIELDER LTD	97,304	1.34	130,387.36
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	37,442	3.81	142,654.02
	INCITEC PIVOT LTD	114,543	3.53	404,336.79
	INSURANCE AUSTRALIA GRP.	146,550	3.69	540,769.50
	INTOLL GROUP	159,431	1.49	238,349.34
	JAMES HARDIE INDUSTRIES NV	30,008	5.59	167,744.72
	LEIGHTON HOLDINGS LIMITED	9,538	33.96	323,910.48
	MACARTHUR COAL LTD	8,534	11.84	101,042.56
	MACQUARIE GROUP LIMITED	24,289	37.00	898,693.00
	METCASH LTD	52,876	4.38	231,596.88
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	149,516	25.90	3,872,464.40
	NEWCREST MINING LIMITED	53,889	40.00	2,155,560.00
	ONESTEEL LIMITED	93,864	2.98	279,714.72
	ORICA LTD	25,456	26.10	664,401.60
ORIGIN ENERGY LIMITED	62,079	15.98	992,022.42	
OZ MINERALS LTD	219,000	1.46	319,740.00	
PALADIN ENERGY LIMITED	48,024	3.70	177,688.80	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	76,654	2.76	211,565.04	

	QBE INSURANCE GROUP	72,962	17.55	1,280,483.10
	RIO TINTO LTD	30,717	77.26	2,373,195.42
	SANTOS	58,743	12.97	761,896.71
	SIMS METAL MANAGEMENT LIMITED	11,243	18.16	204,172.88
	SONIC HEALTHCARE LTD	26,012	11.03	286,912.36
	SP AUSNET	90,764	0.88	79,872.32
	SUNCORP-METWAY LIMITED	90,326	9.19	830,095.94
	TABCORP HOLDINGS	43,184	7.00	302,288.00
	TATTS GROUP LTD	90,365	2.39	215,972.35
	TELSTRA CORP	306,992	2.68	822,738.56
	TOLL HOLDINGS LIMITED	47,068	6.71	315,826.28
	TRANSURBAN GROUP	89,747	5.05	453,222.35
	WESFARMERS LIMITED	70,854	33.57	2,378,568.78
	WESFARMERS LTD-PPS	10,709	33.76	361,535.84
	WESTPAC BANKING	209,868	23.71	4,975,970.28
	WOODSIDE PETROLEUM LTD	38,352	44.44	1,704,362.88
	WOOLWORTHS LTD	87,457	29.26	2,558,991.82
	WORLEYPARSONS LTD	13,502	22.69	306,360.38
小計		5,032,277		60,831,674.42 (4,954,739,881)
イギリスポンド	3I GROUP PLC	68,495	2.85	195,553.22
	ADMIRAL GROUP PLC	14,202	16.57	235,327.14
	AGGREKO PLC	18,355	15.60	286,338.00
	AMEC PLC	22,922	9.90	227,042.41
	ANGLO AMERICAN PLC	92,959	25.31	2,353,257.08
	ANTOFAGASTA PLC	27,797	12.36	343,570.92
	ARM HOLDINGS PLC	92,661	4.02	373,238.50
	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	25,113	10.59	265,946.67
	ASTRAZENECA	101,643	32.37	3,290,692.12
	AUTONOMY CORP PLC	15,330	18.03	276,399.90
	AVIVA PIC	198,009	4.02	795,996.18
	BABCOCK INTL GROUP PLC	24,842	5.75	142,965.71
	BAE SYSTEMS PLC	243,680	3.41	832,167.20
	BALFOUR BEATTY PLC	48,327	2.66	128,743.12
	BARCLAYS	807,587	3.05	2,465,159.31
	BG GROUP	238,355	11.33	2,701,753.92
	BHP BILLITTON PLC	155,573	20.22	3,145,686.06
	BP PLC	1,324,428	4.21	5,575,841.88
	BRITISH AIRWAYS	38,708	2.46	95,221.68
	BRITISH AMERICAN TOBACCO	140,752	23.80	3,350,601.36
	BRITISH SKY BROADCASTING	80,531	7.07	569,354.17
	BT GROUP PLC	546,579	1.41	771,769.54
	BUNZL PLC	22,683	7.67	173,978.61
	BURBERRY GROUP PLC	30,744	10.20	313,588.80
	CABLE & WIRELESS WORLDWIDE	179,320	0.74	133,772.72
	CAIRN ENERGY PLC	98,604	4.58	451,704.92

CAPITA GROUP PLC	43,024	7.84	337,523.28
CARNIVAL PLC	12,249	25.41	311,247.09
CENTRICA PLC	362,690	3.24	1,176,203.67
COBHAM PLC	79,300	2.30	182,469.30
COMPASS GROUP PLC	132,965	5.51	733,301.97
DIAGEO	176,600	10.96	1,935,536.00
EURASIAN NATURAL RESOURCES	18,155	9.04	164,121.20
EXPERIAN PLC	72,232	6.92	499,845.44
FIRSTGROUP PLC	33,912	3.68	124,796.16
FRESNILLO PLC	12,639	12.50	157,987.50
G4S PLC	99,434	2.53	252,065.19
GLAXOSMITHKLINE	366,026	12.51	4,578,985.26
HOME RETAIL GROUP	60,978	2.06	125,980.54
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	1,235,862	6.49	8,020,744.38
ICAP PLC	38,502	4.37	168,561.75
IMPERIAL-TOBACCO GROUP	71,774	18.82	1,350,786.68
INMARSAT PLC	30,151	6.69	201,710.19
INTERCONTINENTAL HOTELS	20,387	11.50	234,450.50
INTERNATIONAL POWER PLC	107,369	3.85	413,585.38
INTERTEK GROUP PLC	11,237	18.36	206,311.32
INVENSYS PLC	56,923	2.98	170,142.84
INVESTEC PLC	34,123	5.09	173,856.68
ITV PLC	261,145	0.59	154,728.41
JOHNSON MATTHEY PLC	14,826	17.78	263,606.28
KAZAKHMYS PLC	15,092	14.57	219,890.44
KINGFISHER PLC	166,935	2.33	390,460.96
LEGAL & GENERAL GROUP	413,962	1.03	430,106.51
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,882,867	0.74	2,141,970.18
LONDON STOCK EXCHANGE PLC	10,152	6.93	70,404.12
LONMIN PLC	11,403	16.67	190,088.01
MAN GROUP PLC	120,860	2.13	257,673.52
MARKS & SPENCER GROUP PLC	111,875	3.83	429,488.12
MORRISON SUPERMARKETS	149,555	3.02	451,805.65
NATIONAL GRID PLC	244,051	5.44	1,327,637.44
NEXT PLC	13,334	22.27	296,948.18
OLD MUTUAL PLC	383,125	1.40	538,290.62
PEARSON	57,364	9.87	566,469.50
PETROFAC LTD	17,903	13.67	244,734.01
PRUDENTIAL	179,208	6.34	1,136,178.72
RANDGOLD RESOURCES LTD	6,367	64.85	412,899.95
RECKITT BENCKISER PLC	43,434	34.69	1,506,725.46
REED ELSEVIER PLC	85,785	5.34	458,520.82
RESOLUTION LTD	102,409	2.47	253,359.86
REXAM	60,557	3.08	186,515.56
RIO TINTO PLC REG	102,183	37.62	3,844,124.46

ROLLS-ROYCE GROUP PLC	130,700	6.12	799,884.00
ROYAL BANK OF SCOTLAND	1,225,856	0.47	587,062.43
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	249,936	19.10	4,775,027.28
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	190,029	18.46	3,508,885.48
RSA INSURANCE GROUP PLC GRP	243,188	1.30	316,630.77
SABMILLER PLC	66,952	20.26	1,356,447.52
SAGE GROUP PLC	90,754	2.76	250,571.79
SAINSBURY (J) PLC	85,389	3.95	337,286.55
SCHRODERS PLC	7,886	14.37	113,321.82
SCOTTISH & SOUTHERN ENERG	65,071	11.18	727,493.78
SERCO GROUP PLC	33,911	6.18	209,739.53
SEVERN TRENT PLC	16,339	13.25	216,491.75
SHIRE PLC	39,624	14.59	578,114.16
SMITH & NEPHEW PLC	62,649	5.73	359,292.01
SMITHS GROUP PLC	27,539	11.96	329,366.44
STANDARD CHARTERED PLC	144,567	18.81	2,719,305.27
STANDARD LIFE PLC	159,503	2.32	370,684.97
TESCO	565,440	4.33	2,449,768.80
THOMAS COOK GROUP PLC	60,665	1.75	106,285.08
TUI TRAVEL PLC	37,617	2.17	81,816.97
TULLOW OIL PLC	62,525	12.83	802,195.75
UNILEVER PLC	90,472	18.44	1,668,303.68
UNITED UTILITIES GROUP PLC	48,042	5.72	274,800.24
VEDANTA RESOURCES PLC	8,422	21.65	182,336.30
VODAFONE GROUP PLC	3,712,774	1.58	5,884,746.79
WHITBREAD PLC	12,182	16.32	198,810.24
WOLSELEY PLC	20,047	15.91	318,947.77
WPP PLC	88,770	7.08	628,491.60
XSTRATA PLC	145,021	12.42	1,801,160.82
小計	20,880,993		98,741,779.83 (13,100,071,930)
スイスフラン			
ABB LTD	155,986	20.80	3,244,508.80
ACTELION LTD-REG	7,188	39.95	287,160.60
ADECCO	8,672	51.25	444,440.00
ARYZTA AG	5,956	42.90	255,512.40
BALOISE HOLDING AG	3,529	88.50	312,316.50
CIE FINANCIERE RICHEMON-BR A	36,896	46.78	1,725,994.88
CREDIT SUISSE GROUP AG	79,506	42.95	3,414,782.70
GAM HOLDING LTD	14,288	14.85	212,176.80
GEBERIT AG-REG	2,744	174.60	479,102.40
GIVAUDAN-REG	586	1,005.00	588,930.00
HOLCIM LTD	17,292	63.45	1,097,177.40
JULIUS BAER GROUP LTD	14,584	36.70	535,232.80
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	3,806	117.70	447,966.20
LINDT & SPRUENGLI AG-PC	60	2,323.00	139,380.00
LINDT & SPRUENGLI AG-REG	8	27,450.00	219,600.00

	LOGITECH INTERNATIONAL-REG	12,571	16.36	205,661.56
	LONZA GROUP AG-REG	3,201	84.20	269,524.20
	NESTLE SA - REGISTERED	244,426	52.45	12,820,143.70
	NOBEL BIOCARE HLDGS AG-REG	8,726	18.22	158,987.72
	NOVARTIS	148,742	56.50	8,403,923.00
	PARGESA HOLDING SA-BR	1,907	72.40	138,066.80
	ROCHE HOLDING GENUSS	49,524	131.50	6,512,406.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	1,518	104.50	158,631.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	3,427	105.00	359,835.00
	SGS SA	386	1,585.00	611,810.00
	SIKA AG-BR	144	1,816.00	261,504.00
	SONOVA HOLDING AG-REG	3,233	121.60	393,132.80
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	551	222.90	122,817.90
	SWATCH GROUP AG(BEARER)	2,180	362.90	791,122.00
	SWATCH GROUP AG/THE-REG	3,069	66.70	204,702.30
	SWISS LIFE HOLDING AG-REG	2,105	112.80	237,444.00
	SWISS RE-REG	24,857	43.75	1,087,493.75
	SWISSCOM	1,643	396.00	650,628.00
	SYNGENTA AG	6,668	248.20	1,654,997.60
	SYNTHES INC	4,184	114.60	479,486.40
	UBS AG-REG	256,865	17.06	4,382,116.90
	ZURICH FINANCIAL SERVICES AG	10,457	231.40	2,419,749.80
小計		1,141,485		55,728,465.91 (4,783,174,229)
香港ドル	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	13,900	70.05	973,695.00
	BANK EAST ASIA	107,360	32.50	3,489,200.00
	BOC HONG KONG HOLDINGS -R	261,000	24.45	6,381,450.00
	CATHAY PACIFIC AIRWAYS	82,000	21.40	1,754,800.00
	CHEUNG KONG HOLDINGS	98,000	114.60	11,230,800.00
	CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	32,000	31.00	992,000.00
	CLP HOLDINGS	135,500	62.20	8,428,100.00
	ESPRIT HOLDINGS LTD	81,774	42.00	3,434,508.00
	FOXCONN INTERNATIONAL HLDGS	151,000	5.69	859,190.00
	HANG LUNG GROUP LTD	57,000	49.85	2,841,450.00
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	147,000	36.80	5,409,600.00
	HANG SENG BANK	53,900	115.80	6,241,620.00
	HENDERSON LAND DEVELOPMEN	76,000	54.70	4,157,200.00
	HONG KONG & CHINA GAS	303,729	19.70	5,983,461.30
	HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	72,200	151.00	10,902,200.00
	HONGKONG ELECTRIC HOLDINGS	98,000	47.35	4,640,300.00
	HOPEWELL HOLDINGS	38,500	25.10	966,350.00
	HUTCHISON WHAMPOA	150,000	70.40	10,560,000.00
	HYSAN DEVELOPMENT CO	44,000	27.65	1,216,600.00
	KERRY PROPERTIES LTD	50,500	42.20	2,131,100.00
	LI & FUNG	160,400	43.90	7,041,560.00
	LIFESTYLE INTL HLDGS LTD	39,500	19.02	751,290.00

	MONGOLIA ENERGY CO LTD	205,000	3.20	656,000.00
	MTR CORP	101,000	29.00	2,929,000.00
	NEW WORLD DEVELOPMENT	180,000	15.06	2,710,800.00
	NWS HOLDINGS LTD	60,000	15.50	930,000.00
	ORIENT OVERSEAS INTERNATIONAL LTD	15,500	63.40	982,700.00
	PCCW LTD	250,000	2.79	697,500.00
	SANDS CHINA LTD	170,000	14.32	2,434,400.00
	SHANGRI-LA ASIA LTD	92,000	17.62	1,621,040.00
	SINO LAND CO	122,000	15.96	1,947,120.00
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	100,000	130.40	13,040,000.00
	SWIRE PACIFIC A	54,500	108.20	5,896,900.00
	TELEVISION BROADCASTS LTD	20,000	43.10	862,000.00
	WHARF HOLDINGS	97,000	49.70	4,820,900.00
	WHEELLOCK & CO LTD	63,000	26.30	1,656,900.00
	WING HANG BANK LIMITED	12,500	96.15	1,201,875.00
	WYNN MACAU LTD	107,600	13.76	1,480,576.00
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	52,500	29.20	1,533,000.00
小計		3,955,863		145,787,185.30 (1,574,501,601)
シンガポールドル	CAPITALAND LTD	180,500	4.11	741,855.00
	CAPITAMALLS ASIA LTD	94,000	2.18	204,920.00
	CITY DEVELOPMENTS LTD	38,000	12.76	484,880.00
	COMFORTDELGRO CORP LTD	132,000	1.55	204,600.00
	COSCO CORP SINGAPORE LTD	68,000	1.84	125,120.00
	DBS GROUP	121,000	14.24	1,723,040.00
	FRASER AND NEAVE LTD	68,000	6.38	433,840.00
	GENTING INTERNATIONAL PLC	429,000	1.90	815,100.00
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	461,000	0.56	260,465.00
	JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	8,000	39.10	312,800.00
	KEPPEL CORP LTD	90,000	9.06	815,400.00
	KEPPEL LAND LTD	50,000	4.05	202,500.00
	NEPTUNE ORIENT LINES LTD	61,000	2.00	122,000.00
	NOBLE GROUP LTD	205,363	1.90	390,189.70
	OCBC BANK	172,000	8.90	1,530,800.00
	OLAM INTERNATIONAL LTD	84,000	3.23	271,320.00
	SEMBCORP INDUSTRIES LTD	68,000	4.36	296,480.00
	SEMBCORP MARINE LTD	59,000	3.95	233,050.00
	SINGAPORE AIRLINES	37,533	16.20	608,034.60
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	60,000	9.04	542,400.00
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	107,000	4.21	450,470.00
	SINGAPORE TECHNOLOGIES ENGINEERING	115,000	3.37	387,550.00
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	561,243	3.17	1,779,140.31
	STARHUB LTD	40,000	2.57	102,800.00
	UNITED OVERSEAS BANK	86,000	18.46	1,587,560.00
	UOL GROUP LIMITED	33,300	4.70	156,510.00
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	135,000	6.06	818,100.00

	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	103,000	1.78	183,340.00	
小計		3,666,939		15,784,264.61 (1,004,352,757)	
ニュージーランドドル	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	64,659	2.07	133,844.13	
	CONTACT ENERGY LTD	20,388	5.71	116,415.48	
	FLETCHER BUILDING LTD	42,784	8.35	357,246.40	
	SKY CITY ENTERTAINMENT GROUP	38,593	2.83	109,218.19	
	TELECOM CORP NEW ZEALAND	135,121	2.08	281,051.68	
小計		301,545		997,775.88 (61,652,571)	
スウェーデンクローナ	ALFA LAVAL AB	23,800	119.10	2,834,580.00	
	ASSA ABLOY B	21,998	171.00	3,761,658.00	
	ATLAS COPCO A	47,336	129.20	6,115,811.20	
	ATLAS COPCO AB-B SHS	27,507	117.50	3,232,072.50	
	BOLIDEN AB	18,890	102.60	1,938,114.00	
	ELECTROLUX AB-SER B	16,955	165.10	2,799,270.50	
	ERICSSON (LM) B	212,289	73.20	15,539,554.80	
	GETINGE AB-B SHS	14,108	156.10	2,202,258.80	
	HENNES & MAURITZ B	72,270	242.30	17,511,021.00	
	HEXAGON AB-B SHS	13,413	144.50	1,938,178.50	
	HOLMEN AB-B SHARES	3,544	210.10	744,594.40	
	HUSQVARNA AB-B SHS	28,208	49.52	1,396,860.16	
	INVESTOR AB-B SHS	32,149	137.20	4,410,842.80	
	KINNEVIK INVESTMENT AB-B	15,321	142.80	2,187,838.80	
	MILLICOM INTL CELLULAR-SDR	5,361	649.00	3,479,289.00	
	MODERN TIMES GROUP-B SHS	3,488	505.00	1,761,440.00	
	NORDEA BANK AB	228,264	69.15	15,784,455.60	
	RATOS AB-B SHS	7,025	229.70	1,613,642.50	
	SANDVIK AB	71,079	104.30	7,413,539.70	
	SCA SV CELLULOSA B	40,391	102.80	4,152,194.80	
	SCANIA AB-B SHS	22,557	150.00	3,383,550.00	
	SECURITAS B	21,625	72.10	1,559,162.50	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN A	99,556	49.83	4,960,875.48	
	SKANSKA B	28,148	123.50	3,476,278.00	
	SKF AB-B	27,469	156.20	4,290,657.80	
	SSAB AB-A SHS	12,471	108.00	1,346,868.00	
	SSAB AB-B SHS	5,581	94.80	529,078.80	
	SVENSKA HANDELSBK A	34,541	221.80	7,661,193.80	
SWEDBANK AB-A	50,412	93.25	4,700,919.00		
SWEDISH MATCH AB	16,468	177.60	2,924,716.80		
TELE2 AB-B SHS	22,203	140.00	3,108,420.00		
TELIASONERA AB	158,268	54.80	8,673,086.40		
VOLVO B	76,702	99.75	7,651,024.50		
小計		1,479,397		155,083,048.14 (1,933,885,610)	

ノルウェークローネ	AKER SOLUTIONS ASA	11,589	84.45	978,691.05
	DNB NOR ASA	68,978	79.95	5,514,791.10
	NORSK HYDRO	62,712	35.34	2,216,242.08
	ORKLA	54,398	54.65	2,972,850.70
	RENEWABLE ENERGY CORP AS	33,457	20.00	669,140.00
	SEADRILL LTD	19,695	164.80	3,245,736.00
	STATOIL ASA	78,669	121.70	9,574,017.30
	TELENOR ASA	58,433	93.10	5,440,112.30
	YARA INTERNATIONAL ASA	13,360	276.00	3,687,360.00
小計		401,291		34,298,940.53 (491,160,828)
デンマーククローネ	A P MOLLER - MAERSK A/S - A	39	45,100.00	1,758,900.00
	A P MOLLER-MAERSK AIS	93	46,710.00	4,344,030.00
	CARLSBERG AS-B	7,540	565.00	4,260,100.00
	COLOPLAST-B	1,573	648.50	1,020,090.50
	DANSKE BANK A/S	32,060	126.90	4,068,414.00
	DSV A/S	14,743	112.40	1,657,113.20
	NOVO NORDISK A/S-B	30,708	542.00	16,643,736.00
	NOVOZYMES A/S	3,251	698.50	2,270,823.50
	TRYG A/S	1,805	331.00	597,455.00
	VESTAS WIND SYSEMS	14,359	201.30	2,890,466.70
	WILLIAM DEMANT HOLDING	1,662	400.60	665,797.20
小計		107,833		40,176,926.10 (615,912,277)
イスラエルシェケル	BANK HAPOLIM BM	69,975	16.67	1,166,483.25
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	83,205	16.92	1,407,828.60
	BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP	122,587	9.08	1,113,089.96
	CELLCOM ISRAEL LTD	3,486	111.20	387,643.20
	DELEK GROUP LTD	265	1,000.00	265,000.00
	DISCOUNT INVESTMENT CORP-REG	1,700	72.72	123,624.00
	ELBIT SYSTEMS LTD	1,653	194.10	320,847.30
	ISRAEL CHEMICALS LTD	31,245	51.38	1,605,368.10
	ISRAEL CORP LIMITED/THE	163	3,480.00	567,240.00
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	36,100	7.22	260,822.50
	MAKHTESHIM-AGAN INDUSTRIES	16,000	13.50	216,000.00
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	8,200	33.75	276,750.00
	NICE SYSTEMS LTD	4,403	112.20	494,016.60
	ORMAT INDUSTRIES LTD	4,000	30.10	120,400.00
	PARTNER COMMUNICATIONS CO	6,005	67.50	405,337.50
	TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	65,726	197.80	13,000,602.80
小計		454,713		21,731,053.81 (499,596,927)
ユーロ	ABERTIS INFRASTRUCTURAS	20,838	13.59	283,188.42
	ACCIONA SA	1,792	62.25	111,552.00
	ACCOR	10,451	26.56	277,630.81
	ACERINOX SA	7,029	13.05	91,763.59

ACS ACTIV. CONST. Y SVCS	9,981	36.57	365,005.17
ADIDAS AG	14,788	45.91	678,991.02
ADP	2,093	59.37	124,261.41
AEGON	110,280	4.46	492,179.64
AEM SPA	77,294	1.12	86,801.16
AGEAS	157,482	2.12	334,649.25
AHOLD (KON.)	84,017	10.04	843,950.76
AIR FRANCE-KLM	9,523	11.32	107,800.36
AIR LIQUIDE	19,938	90.32	1,800,800.16
AKZO NOBEL	16,330	46.00	751,180.00
ALCATEL-LUCENT	163,402	2.46	403,112.73
ALLIANZ SE-REG	32,037	83.68	2,680,856.16
ALPHA BANK	35,778	4.49	160,643.22
ALSTOM RGPT	14,499	37.50	543,712.50
ANGLO IRISH BANK CORP PLC	45,054	0.00	0.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV	50,894	43.58	2,217,960.52
ARCELORMITTAL	60,516	24.32	1,472,051.70
ASML HOLDING NV	30,401	22.30	678,094.30
ASSICURAZIONI GENERALI	82,415	14.68	1,209,852.20
ATLANTIA SPA	16,926	15.20	257,275.20
ATOS ORIGIN	3,195	33.25	106,233.75
AUTOGRILL SPA	7,704	9.21	70,992.36
AXA	121,224	13.02	1,578,336.48
BANCA CARIGE SPA	37,954	1.69	64,256.12
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	152,990	1.01	155,131.86
BANCA POPOLARE DI MILANO	27,830	3.44	95,804.77
BANCO BILBAO VIZCAYA	251,311	9.83	2,470,387.13
BANCO DE SABADELL SA	67,758	3.64	246,977.91
BANCO DE VALENCIA SA	14,641	4.14	60,613.74
BANCO ESPIRITO SANTO-REG	36,302	3.34	121,575.39
BANCO POPOLARE SPA	45,206	4.45	201,392.73
BANCO POPULAR ESPANOL	60,749	4.58	278,716.41
BANCO SANTANDER CENTRAL HISPANO SA	580,953	9.25	5,376,139.06
BANK OF CYPRUS PUBLIC CO LTD	39,295	3.73	146,570.35
BANK OF CYPRUS PUBLIC CO LTD-RIGHTS	39,295	0.48	18,861.60
BANK OF IRELAND	234,664	0.57	133,758.48
BANKINTER SA	20,050	5.11	102,495.60
BASF SE	64,744	46.46	3,008,006.24
BAYER	58,292	51.07	2,976,972.44
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	23,402	51.06	1,194,906.12
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	3,689	33.31	122,880.59
BCP BANCO COMERCIAL NOM	194,771	0.63	123,484.81
BEIERSDORF AG	7,105	44.50	316,172.50
BELGACOM	10,722	28.74	308,150.28
BIOMERIEUX	794	77.12	61,233.28

BNP PARIBAS	66,894	53.11	3,552,740.34
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	4,769	31.04	148,053.60
BOUYGUES ORD	16,266	31.71	515,876.19
BRISA	12,079	4.80	57,979.20
BUREAU VERITAS SA	3,461	51.64	178,726.04
CAP GEMINI SA	10,372	36.63	379,926.36
CARREFOUR	42,236	39.45	1,666,421.38
CASINO GUICHARD PERRACHON	3,890	67.25	261,602.50
CELESIO AG	5,396	16.09	86,821.64
CHRISTIAN DIOR	4,496	94.00	422,624.00
CIE GENERALE DE GEOPHYSIQUE	9,917	16.05	159,167.85
CIMPOR-CIMENTOS DE PORTUGAL	13,528	4.75	64,379.75
CNP ASSURANCES	10,272	13.88	142,575.36
CNP -CIE NATL A PORTEFEUILLE	1,845	38.33	70,718.85
COCA-COLA HELLENIC BOTTLING	12,889	19.00	244,891.00
COLRUYT SA	1,063	193.30	205,477.90
COMMERZBANK AG	50,029	6.02	301,224.60
CONTINENTAL AG	3,463	55.42	191,919.46
CREDIT AGRICOLE SA	65,488	11.87	777,670.00
CRH	49,890	12.13	605,415.15
CRITERIA CAIXACORP SA	59,340	3.84	227,924.94
DAIMLER AG	63,755	46.27	2,950,262.62
DANONE (GROUPE)	41,105	43.93	1,805,948.17
DASSAULT SYSTEMES SA	4,172	53.79	224,411.88
DELHAIZE GROUP	7,128	53.46	381,062.88
DELTA LLOYD NV	5,001	13.67	68,363.67
DEUTSCHE BANK AG RIGHTS	43,821	3.07	134,705.75
DEUTSCHE BANK NAMEN	65,625	39.26	2,576,437.50
DEUTSCHE BOERSE	13,763	49.60	682,644.80
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	16,140	13.55	218,697.00
DEUTSCHE POST AG-REG	59,657	13.40	799,403.80
DEUTSCHE POSTBANK AG	6,052	24.95	150,997.40
DEUTSCHE TELEKOM	199,831	10.12	2,022,289.72
DEXIA	39,097	3.15	123,194.64
E.ON AG	126,947	21.76	2,763,001.45
EDENRED	10,330	14.50	149,836.65
EDP RENOVAVEIS SA	14,634	4.16	60,965.24
EFG EUROBANK ERGASIAS	22,780	4.22	96,131.60
EIFFAGE	2,855	35.34	100,895.70
ELAN CORPORATION PLC	34,324	3.96	135,923.04
ELECTRICITE DE FRANCE	18,246	31.56	575,934.99
ELISA A	9,189	16.60	152,537.40
ENAGAS	12,366	14.78	182,831.31
ENEL	463,994	3.86	1,794,496.79
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	123,237	2.52	311,666.37

ENI	183,521	15.89	2,916,148.69
ERAMET	354	216.00	76,464.00
ERSTE GROUP BANK AG	13,337	29.05	387,439.85
ESSILOR INTERNATIONAL	14,140	50.29	711,100.60
EURAZEO	2,045	49.34	100,910.52
EUROPEAN AERONAUTIC DEFENCE	28,764	18.74	539,181.18
EUTELSAT COMMUNICATIONS	7,001	28.08	196,623.08
EXOR SPA	4,302	16.72	71,929.44
FERROVIAL SA	31,023	6.93	215,144.50
FIAT ORD	54,041	10.97	592,829.77
FINMECCANICA SPA	28,528	8.66	247,052.48
FOMENTO DE CONSTRUC Y CONTRA	2,563	20.04	51,375.33
FORTUM OYJ	31,311	19.20	601,171.20
FRANCE TELECOM	130,695	16.03	2,095,694.32
FRAPORT AG	2,590	44.05	114,089.50
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	13,551	45.51	616,706.01
FRESENIUS SE	1,990	59.44	118,285.60
FRESENIUS SE-PFD	5,681	59.97	340,689.57
FUGRO NV-CVA	4,720	48.88	230,737.20
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	16,308	12.48	203,523.84
GAMESA CORP TECNOLOGICA SA	13,061	5.00	65,344.18
GAS NATURAL SDG SA	15,954	10.98	175,174.92
GDF SUEZ	87,668	26.32	2,307,421.76
GEA GROUP AG	11,661	18.30	213,396.30
GESTEVISION TELECINCO SA	6,639	8.20	54,439.80
GRIFOLS SA	9,762	10.71	104,551.02
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	5,694	61.35	349,326.90
GROUPE EUROTUNNEL SA - REGR	33,629	6.35	213,544.15
HANNOVER RUECKVERSICHERU-REG	4,169	34.20	142,600.64
HEIDELBERGCEMENT AG	9,913	35.46	351,564.54
HEINEKEN HOLDING NV	8,121	32.30	262,308.30
HEINEKEN NV	18,271	37.68	688,542.63
HELLENIC TELECOMMUN ORGANIZA	16,926	5.30	89,707.80
HENKEL AG & CO KGAA	9,157	33.33	305,248.59
HENKEL AG & CO KGAA -PFD	12,559	39.71	498,717.89
HERMES INTERNATIONAL	3,731	163.40	609,645.40
HOCHTIEF AG	3,142	63.03	198,040.26
IBERDROLA RENOVABLES	59,082	2.45	144,750.90
IBERDROLA SA	284,528	5.62	1,599,047.36
IBERIA LINEAS AER DE ESPANA	33,592	2.88	96,744.96
ILIAD SA	1,146	76.00	87,096.00
IMERYS SA	2,659	44.11	117,288.49
IMMOFINANZ AG	69,927	2.70	189,362.31
INDITEX	15,420	58.36	899,911.20
INDRA SISTEMAS SA	6,363	13.81	87,873.03

INFINEON TECHNOLOGIES	76,605	5.03	385,706.17
ING GROEP	270,371	7.71	2,084,830.78
INTESA SANPAOLO	543,625	2.36	1,287,032.18
INTESA SANPAOLO-RNC	65,817	1.88	123,735.96
IPSEN	1,975	24.69	48,772.62
JC DECAUX SA	4,694	19.65	92,260.57
JERONIMO MARTINS	15,526	9.80	152,247.95
K+S AG	10,119	44.58	451,155.61
KBC GROEP NV	11,368	33.00	375,144.00
KERRY GROUP PLC-A	9,881	25.55	252,459.55
KESKO OYJ-B SHS	4,713	34.27	161,514.51
KONE OYJ-B	10,976	37.90	415,990.40
KONINKLIJKE DSM NV	10,870	37.47	407,353.25
KPN (KON.)	114,064	11.39	1,299,759.28
LAFARGE (FRANCE)	14,135	42.50	600,808.17
LAGADERE S.C.A	8,342	28.72	239,623.95
LEGRAND SA	9,273	24.70	229,089.46
LINDE AG	11,906	97.38	1,159,406.28
LOREAL	16,896	82.16	1,388,175.36
LUXOTTICA GROUP SPA	8,044	19.91	160,156.04
LVMH	17,306	106.80	1,848,280.80
M6-METROPOLE TELEVISION	4,339	17.60	76,366.40
MAN SE	7,453	81.10	604,438.30
MAPFRE SA	52,154	2.25	117,555.11
MEDIASET	50,094	5.21	261,240.21
MEDIOBANCA	33,428	6.72	224,803.30
MEDIOLANUM SPA	14,724	3.21	47,300.85
MERCK KGAA	4,555	62.06	282,683.30
METRO STAMM	9,139	47.92	437,986.57
METSO OYJ	9,008	33.75	304,020.00
MICHELIN	10,421	57.65	600,770.65
MOBISTAR SA	1,904	45.17	86,003.68
MUENCHENER RUECKVERSICH.	13,302	101.70	1,352,813.40
NATIONAL BANK OF GREECE	67,356	7.23	486,983.88
NATIXIS	61,578	4.30	264,785.40
NEOPOST SA	2,155	54.65	117,770.75
NESTE OIL OYJ	9,037	11.25	101,666.25
NOKIA CORP	263,984	7.21	1,903,324.64
NOKIAN RENKAAT OYJ	7,641	24.81	189,573.21
OKO BANK-A	9,750	8.75	85,361.25
OMV AG	10,574	27.33	288,987.42
OPAP SA	15,463	11.81	182,618.03
ORION OYJ-CLASS B	6,550	14.77	96,743.50
OUTOKUMPU OYJ	9,028	14.39	129,912.92
PAGESJAUNES GROUPE	8,509	7.70	65,519.30

PARMALAT SPA	121,830	1.88	229,040.40
PERNOD-RICARD	13,951	60.96	850,452.96
PEUGEOT SA	10,753	24.61	264,685.09
PHILIPS ELECTRS (KON.)	69,509	23.06	1,603,225.08
PIRELLI & CO	16,813	5.90	99,280.76
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	6,185	35.56	219,969.52
PORTUGAL TELECOM	41,077	9.69	398,405.82
PPR	5,368	119.40	640,939.20
PRYSMIAN SPA	12,831	13.43	172,320.33
PUBLIC POWER CORP	8,177	11.50	94,035.50
PUBLICIS GROUPE	8,802	34.97	307,805.94
PUMA AG	387	241.10	93,305.70
QIAGEN N.V.	16,381	13.31	218,031.11
RAIFFEISEN INTL BANK HOLDING	3,821	34.93	133,486.63
RANDSTAD HOLDING NV	7,769	33.22	258,125.02
RAUTARUUKKI OYJ	5,933	14.97	88,817.01
RED ELECTRICA CORPORACION SA	7,628	34.41	262,479.48
REED ELSEVIER NV	48,595	9.27	450,475.65
RENAULT SA	13,586	36.94	501,934.77
REPSOL YPF	51,636	18.92	976,953.12
RWE AG-NON VTG PFD	2,693	46.68	125,722.70
RWE STAMM	29,516	49.82	1,470,634.70
SAFRAN SA	11,759	21.06	247,644.54
SAINT-GOBAIN	27,118	32.67	886,080.65
SAIPEM	18,663	29.40	548,692.20
SALZGITTER AG	2,905	46.89	136,215.45
SAMPO OYJ-A SHS	29,653	19.75	585,646.75
SANOFI-AVENTIS SA	73,916	49.46	3,656,254.94
SANOMA OYJ	5,688	15.57	88,562.16
SAP AG	60,497	36.48	2,206,930.56
SBM OFFSHORE NV	11,816	13.84	163,533.44
SCHNEIDER ELECTRIC	16,945	92.50	1,567,412.50
SCOR SE	11,757	17.63	207,334.69
SES	21,182	17.78	376,721.87
SIEMENS	57,999	77.58	4,499,562.42
SNAM RETE GAS	100,682	3.67	370,006.35
SOCIETE BIC SA	1,882	59.21	111,433.22
SOCIETE GENERALE	44,384	43.23	1,918,720.32
SODEXO	6,664	47.60	317,206.40
SOLVAY SA	4,179	78.84	329,472.36
STMICROELECTRONICS	44,918	5.59	251,450.96
STORA ENSO OYJ R	41,009	7.20	295,469.84
SUEDZUCKER AG	4,447	16.21	72,108.10
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	18,986	13.77	261,437.22
TECHNIP S.A.	6,937	58.88	408,450.56

TELECOM ITALIA ORD	660,260	1.03	682,048.58	
TELECOM ITALIA RNC	424,785	0.82	349,173.27	
TELEFONICA	289,547	18.15	5,255,278.05	
TELEKOM AUSTRIA AG	23,421	10.96	256,694.16	
TELEVISION FRANCAISE (T.F.1)	8,296	11.60	96,233.60	
TENARIS SA	33,287	14.08	468,680.96	
TERNA SPA	91,811	3.09	283,695.99	
THALES SA	6,185	26.93	166,592.97	
THYSSEN KRUPP	23,573	23.58	555,969.20	
TNT NV	26,356	19.87	523,693.72	
TOTAL SA	148,988	37.95	5,654,094.60	
UCB (GROUPE)	6,965	25.64	178,617.42	
UMICORE	8,036	32.09	257,915.42	
UNICREDIT SPA	952,243	1.84	1,753,079.36	
UNILEVER NV-CVA	114,829	21.98	2,523,941.42	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SC	42,856	6.94	297,634.92	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	8,459	11.76	99,520.13	
UPM KYMMENE CORP	36,653	12.47	457,062.91	
VALLOUREC	7,672	74.61	572,407.92	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	24,356	19.67	479,082.52	
VERBUND AG	5,243	26.02	136,449.07	
VIENNA INSURANCE GROUP AG WIENER VERSICH	2,710	39.26	106,408.15	
VINCI S.A.	30,729	36.77	1,130,058.97	
VIVENDI	86,892	19.92	1,731,323.10	
VOESTALPINE AG	7,589	27.19	206,382.85	
VOLKSWAGEN AG-PFD	12,026	89.95	1,081,738.70	
VOLKSWAGEN STAMM	2,043	81.35	166,198.05	
VOPAK	4,856	35.45	172,145.20	
WACKER CHEMIE AG	1,081	135.05	145,989.05	
WARTSILA OYJ	5,561	48.25	268,318.25	
WOLTERS KLUWER	21,110	15.36	324,355.15	
ZARDOYA OTIS SA	10,084	13.02	131,293.68	
小計	12,523,650		161,268,167.31 (18,423,275,433)	
合計			(116,722,352,011)	

(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 567銘柄	100.0%	53.8%
カナダドル	株式 89銘柄	100.0%	5.6%
ユーロ	株式 261銘柄	100.0%	15.8%
イギリスポンド	株式 100銘柄	100.0%	11.2%

スイスフラン	株式 37銘柄	100.0%	4.1%
スウェーデンクローナ	株式 33銘柄	100.0%	1.7%
ノルウェークローネ	株式 9銘柄	100.0%	0.4%
デンマーククローネ	株式 11銘柄	100.0%	0.5%
オーストラリアドル	株式 63銘柄	100.0%	4.2%
ニュージーランドドル	株式 5銘柄	100.0%	0.1%
香港ドル	株式 39銘柄	100.0%	1.3%
シンガポールドル	株式 28銘柄	100.0%	0.9%
イスラエルシェケル	株式 16銘柄	100.0%	0.4%

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	32,696.00	1,267,950.88	
	小計		32,696.00	1,267,950.88 (106,279,642)	
	カナダドル	ARC ENERGY TRUST-UNITS	9,654.00	198,293.16	
		BONAVISTA ENERGY TRUST	4,682.00	110,635.66	
		CANADIAN OIL SANDS TRUST	16,733.00	412,970.44	
		ENERPLUS RESOURCES FUND	12,511.00	322,408.47	
		PENN WEST ENERGY TRUST	30,028.00	619,177.36	
		PROVIDENT ENERGY TRUST-UTS	18,696.00	132,554.64	
	小計	YELLOW PAGES INCOME FUND	17,214.00	95,021.28	
		109,518.00	1,891,061.01 (153,516,332)		
投資信託受益証券計				(259,795,974)	
投資証券	アメリカドル	AMB PROPERTY CORP	11,882.00	311,783.68	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	43,789.00	805,717.60	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,863.00	609,752.00	
		BOSTON PROPERTIES	9,822.00	819,940.56	
		DUKE REALTY CORP	17,165.00	198,770.70	
		EQUITY RESIDENTIAL PPTY	19,991.00	947,373.49	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	4,335.00	354,256.20	
		HCP INC	20,769.00	746,437.86	
		HEALTH CARE REIT INC	8,769.00	412,055.31	
		HOST HOTELS AND RESORTS INC	44,591.00	644,339.95	
		KIMCO REALTY CORP	28,658.00	451,363.50	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	8,001.00	252,511.56	
		MACERICH CO/THE	9,145.00	387,930.90	
		PLUM CREEK TIMBER COMMON	11,514.00	405,292.80	
		PROLOGIS	33,595.00	394,741.25	
		PUBLIC STORAGE	10,199.00	989,506.98	
RAYONIER INC	5,665.00	283,193.35			
REGENCY CENTERS CORP	5,779.00	224,282.99			
SIMON PROPERTY GROUP	20,681.00	1,924,160.24			

	VENTAS INC	11,082.00	569,060.70	
	VORNADO REALTY TRUST	11,567.00	987,474.79	
小計		342,862.00	12,719,946.41 (1,066,185,908)	
カナダドル	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	8,399.00	191,497.20	
小計		8,399.00	191,497.20 (15,545,742)	
オーストラリアドル	CFS RETAIL PROPERTY TRUST	121,379.00	233,047.68	
	DEXUS PROPERTY GROUP	339,823.00	287,150.43	
	GOODMAN GROUP	449,008.00	296,345.28	
	GPT GROUP	124,258.00	365,318.52	
	LEND LEASE GROUP	37,106.00	287,942.56	
	MIRVAC GROUP	230,244.00	310,829.40	
	STOCKLAND	167,982.00	646,730.70	
	WESTFIELD GROUP	154,543.00	1,900,878.90	
小計		1,624,343.00	4,328,243.47 (352,535,430)	
イギリスポンド	BRITISH LAND CO PLC	61,661.00	290,978.25	
	CAPITAL SHOPPING CENTRES GROUP PLC	32,917.00	122,517.07	
	HAMMERSON PLC	48,597.00	191,958.15	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	53,795.00	345,632.87	
	SEGRO PLC	52,338.00	143,144.43	
小計		249,308.00	1,094,230.77 (145,171,596)	
香港ドル	LINK REIT	155,000.00	3,510,750.00	
小計		155,000.00	3,510,750.00 (37,916,100)	
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	106,000.00	233,200.00	
	CAPITAMALL TRUST	154,000.00	318,780.00	
小計		260,000.00	551,980.00 (35,122,487)	
ユーロ	CORIO NV	4,175.00	209,668.50	
	FONCIERE DES REGIONS	1,715.00	133,581.35	
	GECINA SA	1,325.00	114,877.50	
	ICADE	1,641.00	126,357.00	
	KLEPIERRE	6,693.00	188,909.92	
	UNIBAIL-RODAMCO SE	6,442.00	1,045,214.50	
小計		21,991.00	1,818,608.77 (207,757,865)	
投資証券計			(1,860,235,128)	
合計			(2,120,031,102)	

(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1銘柄	9.1%		55.3%
	投資証券21銘柄		90.9%	
カナダドル	投資信託受益証券7銘柄	90.8%		8.0%
	投資証券 1銘柄		9.2%	
ユーロ	投資証券 6銘柄		100.0%	9.8%
イギリスポンド	投資証券 5銘柄		100.0%	6.8%
オーストラリアドル	投資証券 8銘柄		100.0%	16.6%
香港ドル	投資証券 1銘柄		100.0%	1.8%
シンガポールドル	投資証券 2銘柄		100.0%	1.7%

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21年 9月30日現在)	(平成22年 9月30日現在)
資産の部		
流動資産		
預金	856,882,951	381,073,630
コール・ローン	1,472,024,167	732,879,567
国債証券	289,193,323,387	249,486,067,349
特殊債券	1,918,567,750	1,926,424,245
派生商品評価勘定	317,840	
未収入金	5,616,903,803	
未収利息	3,824,609,105	3,017,428,799
前払費用	223,512,447	116,107,992
流動資産合計	303,106,141,450	255,659,981,582
資産合計	303,106,141,450	255,659,981,582
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	12,301,340	
未払金	7,832,725,936	
未払解約金	73,016,366	309,404,066
流動負債合計	7,918,043,642	309,404,066
負債合計	7,918,043,642	309,404,066
純資産の部		
元本等		
元本	155,643,938,944	141,483,179,594
剰余金		
剰余金又は欠損金()	139,544,158,864	113,867,397,922
元本等合計	295,188,097,808	255,350,577,516
純資産合計	295,188,097,808	255,350,577,516
負債純資産合計	303,106,141,450	255,659,981,582

(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75」の計算期間とは異なっております。上記の表は、平成21年9月30日及び平成22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20年10月 1日 至 平成21年 9月30日)	(自 平成21年10月 1日 至 平成22年 9月30日)

1.資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 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。</p> <p>(2) 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>国債証券、特殊債券 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

(貸借対照表に関する注記)

	(平成21年9月30日現在)	(平成22年9月30日現在)
1.期首元本額	171,364,485,697円	155,643,938,944円
期中追加設定元本額	22,914,866,546円	13,063,344,127円
期中一部解約元本額	38,635,413,299円	27,224,103,477円
期末元本額	155,643,938,944円	141,483,179,594円
元本額の内訳		
住信 外国債券オープン(毎月決算型)	23,113,412,755円	17,399,727,530円
住信 外国債券オープン(3ヶ月決算型)	774,949,902円	590,424,341円
住信 グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	10,160,175,395円	6,046,425,548円
住信財産四分法ファンド(毎月決算型)	6,598,509,944円	4,818,453,313円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	168,390,002円	248,503,857円
SBI資産設計オープン(分配型)	16,865,019円	14,195,164円
STAM グローバル債券インデックス・オープン	1,244,975,588円	1,856,043,351円
世界経済インデックスファンド	45,656,370円	126,903,864円
すみしん マイセクション25	35,026,029円	29,306,059円
すみしん マイセクション50	18,467,296円	18,990,110円
すみしん マイセクション75	10,027,073円	10,140,889円
すみしん DC マイセクション25	591,622,068円	709,978,550円
すみしん DC マイセクション50	607,505,012円	731,996,573円
すみしん DC マイセクション75	389,914,030円	428,902,317円
すみしん DC外国債券インデックス・オープン	745,909,694円	899,218,546円
すみしん DC マイセクションS25	25,822,564円	60,003,261円
すみしん DC マイセクションS50	41,412,744円	81,615,509円

すみしん DC マイセクションS75	23,090,466円	40,889,492円
すみしん DC ターゲット・イヤー ファンド2015	1,873,162円	2,008,030円
すみしん DC ターゲット・イヤー ファンド2025	1,672,158円	6,265,228円
すみしん DC ターゲット・イヤー ファンド2035	909,534円	3,788,129円
すみしん DC ターゲット・イヤー ファンド2045	191,563円	1,235,111円
すみしん DCマルチアセット ファンド	69,914円	170,560円
STAM 外国債券インデックス・オープン(SMA専用)	485,606,624円	1,136,320,134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
すみしん マイセクション50VA1 (適格機関投資家専用)	51,674,281円	51,585,543円
すみしん マイセクション75VA1 (適格機関投資家専用)	15,368,997円	15,879,408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)	753,533,319円	656,875,083円
すみしん マイセクション50VA2 (適格機関投資家専用)	413,385円	284,680円
すみしん バランス30VA1(適格機関投資家専用)	1,669,655,445円	1,707,921,101円
すみしん バランス50VA1(適格機関投資家専用)	2,676,406,035円	2,710,905,430円
すみしん バランス25VA2(適格機関投資家専用)	36,721,350,476円	35,254,340,313円
すみしん バランス50VA2(適格機関投資家専用)	3,552,769,868円	3,421,702,087円
すみしん バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	10,875,388,914円	10,989,027,506円
すみしん バランスB(37.5)VA1 (適格機関投資家専用)	1,556,674,179円	1,553,616,723円
すみしん バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	5,129,062,839円	5,141,146,213円
すみしん 世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	5,256,601,332円	5,351,328,546円
すみしん 世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	5,744,704,262円	5,841,001,580円
すみしん バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,885,109,094円	1,887,187,976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)	3,792,586,060円	3,692,004,344円
すみしん バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	423,464,176円	781,085,038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
住信 FOFs用外国債券オープン(適格機関投資家専用)	21,438,645,610円	19,825,417,261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)	3,131,933,014円	3,044,925,243円
住信 グローバル債券ファンド・シリーズ2 (適格機関投資家専用)	4,164,754,176円	
住信 グローバル・バランスファンド・シリーズ1	313,548,841円	383,442,278円
住信 外国債券ファンド・シリーズ1	1,388,239,735円	1,332,084,365円
2. 計算期間末日における受益権の総数	155,643,938,944口	141,483,179,594口

(金融商品に関する注記)

(追加情報)

当計算期間より、「金融商品に関する会計基準」(企業会計基準第10号 平成20年3月10日)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。

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)
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。
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っております。 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
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。
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つた場合、当該価額が異なることもあります。 デリバティブ取引に関する契約額等については、その金額自体がデリバティブ取引に係る市場リスクを示すものではありません。

金融商品の時価に関する事項

項目	(平成22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。
2. 時価の算定方法	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。 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。

(有価証券に関する注記)

(平成21年9月30日現在)

売買目的有価証券の貸借対照表計上額及び当計算期間の損益に含まれた評価差額

種 類	貸借対照表計上額 (円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
国債証券	289,193,323,387	6,659,368,944
特殊債券	1,918,567,750	16,819,625
合 計	291,111,891,137	6,676,188,569

(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。

（平成22年9月30日現在）

売買目的有価証券

種 類	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
特殊債券	18,027,247
合 計	5,224,542,011

（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）

取引の状況に関する事項

（自 平成20年10月 1日 至 平成21年 9月30日）	
1.取引の内容、取引に対する取組方法及び取引の利用目的	<p>当ファンドは、約款に基づき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、為替変動リスクを回避するため、デリバティブ取引を行うことができます。</p> <p>当ファンドの利用することができるデリバティブ取引は、先物取引（わが国の金融商品取引所における市場デリバティブ取引、金利に係る市場デリバティブ取引、通貨に係る市場デリバティブ取引ならびに外国金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引）、スワップ取引、金利先渡取引、為替先渡取引及び外国為替予約取引であります。</p>
2.取引に係るリスクの内容及びリスクの管理体制	<p>当ファンドのデリバティブ取引には、市場リスクと信用リスクがあります。デリバティブ取引の執行は、取引権限を定めた社内ルールに従い行っており、市場リスクの管理については、ポジションやリスク評価額を日々算出し、リスクをコントロールする体制としています。</p>
3.取引の時価等に関する事項についての補足説明	<p>取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

取引の時価等に関する事項

通貨関連

区分	種 類	（平成21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	4,189,200,800		4,185,280,000	3,920,800
	イギリスポンド	208,612,660		208,930,500	317,840
	売建				
	カナダドル	116,120,760		116,550,000	429,240
	ユーロ	2,428,683,700		2,436,635,000	7,951,300
	合 計	6,942,617,920		6,947,395,500	11,983,500

（注）時価の算定方法

1. 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しています。
- 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しています。
- 計算期間末日において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います。
- ・ 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います。
 - ・ 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います。
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います。

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）
該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

（自 平成20年10月 1日 至 平成21年 9月30日）	（自 平成21年10月 1日 至 平成22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21年9月30日現在）	（平成22年9月30日現在）
1口当たり純資産額 = 1.8966円	1口当たり純資産額 = 1.8048円

（3）附属明細表（平成22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 0.625% 06/30/12	26,000,000.00	26,101,562.50	
		T 0.875% 01/31/12	18,000,000.00	18,129,375.00	
		T 1% 03/31/12	6,000,000.00	6,059,062.50	
		T 1% 09/30/11	14,500,000.00	14,604,218.75	
		T 1% 12/31/11	16,100,000.00	16,238,359.37	
		T 1.125% 01/15/12	12,000,000.00	12,123,750.00	

T 1.125% 12/15/11	5,000,000.00	5,048,437.50	
T 1.125% 12/15/12	16,200,000.00	16,427,812.50	
T 1.375% 01/15/13	23,000,000.00	23,456,406.25	
T 1.375% 02/15/12	1,500,000.00	1,521,562.50	
T 1.375% 03/15/12	13,500,000.00	13,708,828.12	
T 1.375% 04/15/12	8,200,000.00	8,330,687.50	
T 1.375% 05/15/13	5,000,000.00	5,103,906.25	
T 1.375% 09/15/12	8,000,000.00	8,146,250.00	
T 1.375% 10/15/12	800,000.00	815,000.00	
T 1.375% 11/15/12	10,200,000.00	10,394,437.50	
T 1.5% 12/31/13	12,500,000.00	12,808,593.75	
T 1.75% 03/31/14	6,100,000.00	6,297,296.87	
T 1.75% 07/31/15	27,000,000.00	27,645,468.75	
T 1.75% 08/15/12	22,000,000.00	22,550,000.00	
T 1.75% 11/15/11	8,400,000.00	8,535,187.50	
T 1.875% 02/28/14	7,800,000.00	8,085,187.50	
T 1.875% 06/15/12	9,200,000.00	9,435,750.00	
T 1.875% 06/30/15	15,900,000.00	16,384,453.12	
T 2.25% 01/31/15	14,000,000.00	14,693,437.50	
T 2.25% 05/31/14	17,000,000.00	17,863,281.25	
T 2.375% 02/28/15	14,500,000.00	15,292,968.75	
T 2.375% 08/31/14	12,500,000.00	13,188,476.62	
T 2.375% 09/30/14	6,000,000.00	6,332,812.50	
T 2.375% 10/31/14	12,900,000.00	13,615,546.87	
T 2.5% 03/31/13	11,800,000.00	12,388,156.25	
T 2.5% 03/31/15	10,400,000.00	11,027,250.00	
T 2.625% 02/29/16	10,000,000.00	10,631,250.00	
T 2.625% 04/30/16	9,100,000.00	9,655,953.12	
T 2.625% 12/31/14	8,000,000.00	8,525,000.00	
T 2.75% 02/15/19	14,100,000.00	14,646,375.00	
T 2.75% 02/28/13	6,000,000.00	6,326,250.00	
T 2.75% 05/31/17	16,000,000.00	16,945,000.00	
T 2.75% 10/31/13	1,500,000.00	1,594,921.87	
T 2.75% 11/30/16	14,000,000.00	14,883,750.00	
T 2.875% 01/31/13	15,800,000.00	16,693,687.50	
T 3% 02/28/17	9,500,000.00	10,225,859.37	
T 3% 08/31/16	10,500,000.00	11,331,796.87	
T 3.125% 04/30/17	6,500,000.00	7,040,312.50	
T 3.125% 05/15/19	24,600,000.00	26,179,781.25	
T 3.125% 08/31/13	3,500,000.00	3,753,750.00	
T 3.125% 10/31/16	12,000,000.00	13,031,250.00	
T 3.25% 06/30/16	2,600,000.00	2,847,406.25	
T 3.25% 07/31/16	13,500,000.00	14,780,390.62	
T 3.25% 12/31/16	7,000,000.00	7,644,218.75	
T 3.375% 06/30/13	15,000,000.00	16,153,125.00	
T 3.375% 07/31/13	10,800,000.00	11,655,562.50	
T 3.375% 11/15/19	18,300,000.00	19,738,265.62	
T 3.375% 11/30/12	6,500,000.00	6,914,375.00	

T 3.5% 02/15/18	5,700,000.00	6,302,062.50	
T 3.5% 02/15/39	7,900,000.00	7,645,718.75	
T 3.5% 05/15/20	13,350,000.00	14,509,781.25	
T 3.5% 05/31/13	2,400,000.00	2,589,750.00	
T 3.625% 02/15/20	11,300,000.00	12,408,812.50	
T 3.625% 05/15/13	7,750,000.00	8,385,742.18	
T 3.625% 08/15/19	6,900,000.00	7,597,546.87	
T 3.625% 12/31/12	5,100,000.00	5,460,984.37	
T 3.75% 11/15/18	15,650,000.00	17,501,101.56	
T 3.875% 02/15/13	6,400,000.00	6,918,000.00	
T 3.875% 05/15/18	5,000,000.00	5,650,781.25	
T 3.875% 08/15/40	3,200,000.00	3,309,500.00	
T 3.875% 10/31/12	3,700,000.00	3,966,515.62	
T 4% 02/15/14	5,450,000.00	6,040,984.37	
T 4.0% 02/15/15	12,700,000.00	14,281,546.87	
T 4.0% 08/15/18	10,500,000.00	11,953,593.75	
T 4.0% 11/15/12	1,700,000.00	1,829,625.00	
T 4.125% 05/15/15	6,700,000.00	7,595,078.12	
T 4.125% 08/31/12	5,600,000.00	5,998,125.00	
T 4.25% 05/15/39	6,500,000.00	7,151,015.62	
T 4.25% 08/15/13	12,600,000.00	13,915,125.00	
T 4.25% 08/15/14	11,700,000.00	13,193,578.12	
T 4.25% 08/15/15	12,500,000.00	14,287,109.37	
T 4.25% 09/30/12	6,400,000.00	6,890,000.00	
T 4.25% 11/15/13	5,100,000.00	5,668,171.87	
T 4.25% 11/15/14	10,000,000.00	11,339,062.50	
T 4.25% 11/15/17	5,600,000.00	6,485,500.00	
T 4.375% 02/15/38	5,900,000.00	6,652,250.00	
T 4.375% 05/15/40	6,700,000.00	7,528,078.12	
T 4.375% 08/15/12	4,200,000.00	4,514,343.75	
T 4.375% 11/15/39	10,500,000.00	11,784,609.37	
T 4.5% 02/15/16	7,700,000.00	8,938,015.62	
T 4.5% 02/15/36	9,200,000.00	10,581,437.50	
T 4.5% 03/31/12	4,000,000.00	4,250,000.00	
T 4.5% 04/30/12	8,200,000.00	8,739,406.25	
T 4.5% 05/15/17	3,300,000.00	3,861,000.00	
T 4.5% 05/15/38	2,000,000.00	2,300,312.50	
T 4.5% 08/15/39	9,400,000.00	10,767,406.25	
T 4.5% 09/30/11	9,200,000.00	9,588,125.00	
T 4.5% 11/15/15	11,100,000.00	12,884,671.87	
T 4.5% 11/30/11	6,000,000.00	6,294,375.00	
T 4.625% 02/15/17	5,000,000.00	5,880,468.75	
T 4.625% 02/15/40	8,900,000.00	10,403,265.62	
T 4.625% 02/29/12	1,000,000.00	1,060,781.25	
T 4.625% 08/31/11	4,000,000.00	4,160,000.00	
T 4.625% 10/31/11	5,000,000.00	5,235,156.25	
T 4.625% 12/31/11	7,700,000.00	8,116,281.25	
T 4.75% 01/31/12	8,000,000.00	8,476,250.00	

T 4.75% 02/15/37	5,900,000.00	7,056,031.25	
T 4.75% 05/15/14	8,400,000.00	9,587,812.50	
T 4.75% 05/31/12	5,800,000.00	6,222,312.50	
T 4.75% 08/15/17	1,300,000.00	1,544,968.75	
T 4.875% 02/15/12	8,000,000.00	8,500,000.00	
T 4.875% 06/30/12	3,700,000.00	3,991,953.12	
T 4.875% 08/15/16	2,700,000.00	3,207,093.75	
T 5.0% 05/15/37	3,600,000.00	4,471,875.00	
T 5.125% 05/15/16	5,800,000.00	6,947,312.50	
T 5.25% 02/15/29	2,050,000.00	2,592,289.06	
T 5.25% 11/15/28	1,900,000.00	2,401,718.75	
T 5.375% 02/15/31	2,610,000.00	3,361,598.43	
T 5.5% 08/15/28	3,700,000.00	4,801,906.25	
T 6.0% 02/15/26	2,200,000.00	2,972,406.25	
T 6.125% 08/15/29	3,000,000.00	4,176,562.50	
T 6.125% 11/15/27	4,820,000.00	6,658,378.12	
T 6.25% 05/15/30	2,880,000.00	4,077,450.00	
T 6.25% 08/15/23	3,490,000.00	4,730,585.93	
T 6.375% 08/15/27	1,200,000.00	1,696,312.50	
T 6.5% 11/15/26	2,110,000.00	3,006,420.31	
T 6.625% 02/15/27	1,150,000.00	1,660,492.18	
T 6.75% 08/15/26	2,000,000.00	2,909,062.50	
T 6.875% 08/15/25	1,000,000.00	1,453,437.50	
T 7.25% 05/15/16	7,650,000.00	10,039,429.68	
T 7.25% 08/15/22	2,600,000.00	3,774,062.50	
T 7.5% 11/15/16	6,100,000.00	8,172,093.75	
T 7.5% 11/15/24	600,000.00	909,937.50	
T 7.625% 02/15/25	3,400,000.00	5,222,187.50	
T 7.875% 02/15/21	900,000.00	1,335,375.00	
T 8.0% 11/15/21	7,110,000.00	10,734,989.06	
T 8.125% 05/15/21	2,600,000.00	3,930,875.00	
T 8.125% 08/15/19	2,100,000.00	3,075,515.62	
T 8.125% 08/15/21	2,000,000.00	3,034,375.00	
T 8.5% 02/15/20	3,400,000.00	5,138,781.25	
T 8.75% 05/15/17	4,800,000.00	6,898,500.00	
T 8.75% 08/15/20	2,800,000.00	4,332,562.50	
T 8.875% 02/15/19	6,700,000.00	10,136,890.62	
小計	1,103,270,000.00	1,209,206,406.11 (101,355,680,960)	
カナダドル			
CAN 1% 09/01/11	1,700,000.00	1,695,920.00	
CAN 1.25% 12/01/11	2,400,000.00	2,398,824.00	
CAN 1.5% 03/01/12	2,000,000.00	2,004,840.00	
CAN 1.75% 03/01/13	1,550,000.00	1,559,331.00	
CAN 2% 09/01/12	3,000,000.00	3,034,650.00	
CAN 2% 12/01/14	3,000,000.00	3,022,080.00	
CAN 2.5% 06/01/15	2,000,000.00	2,052,280.00	
CAN 3.0% 06/01/14	3,800,000.00	3,973,128.00	
CAN 3.5% 06/01/13	3,500,000.00	3,680,635.00	
CAN 3.5% 06/01/20	2,900,000.00	3,087,050.00	

	CAN 3.75% 06/01/12	2,600,000.00	2,702,544.00	
	CAN 3.75% 06/01/19	3,800,000.00	4,123,912.00	
	CAN 3.75% 09/01/11	3,700,000.00	3,783,250.00	
	CAN 4% 06/01/16	4,200,000.00	4,620,756.00	
	CAN 4% 06/01/17	2,150,000.00	2,375,793.00	
	CAN 4.0% 06/01/41	2,200,000.00	2,502,368.00	
	CAN 4.25% 06/01/18	3,250,000.00	3,650,757.50	
	CAN 4.5% 06/01/15	4,200,000.00	4,685,604.00	
	CAN 5% 06/01/14	3,700,000.00	4,131,642.00	
	CAN 5% 06/01/37	4,200,000.00	5,432,490.00	
	CAN 5.25% 06/01/12	3,270,000.00	3,479,934.00	
	CAN 5.25% 06/01/13	4,420,000.00	4,850,463.80	
	CAN 5.75% 06/01/29	3,860,000.00	5,174,291.40	
	CAN 5.75% 06/01/33	2,660,000.00	3,675,029.40	
	CAN 8.0% 06/01/23	1,700,000.00	2,586,499.00	
	CAN 8.0% 06/01/27	2,050,000.00	3,303,616.00	
	CAN 9% 06/01/25	350,000.00	589,221.50	
小計		78,160,000.00	88,176,909.60 (7,158,201,521)	
オーストラリアドル	ACGB 4.5% 04/15/20	300,000.00	287,652.00	
	ACGB 4.75% 11/15/12	200,000.00	199,610.00	
	ACGB 5.25% 03/15/19	400,000.00	405,952.00	
	ACGB 5.75% 04/15/12	400,000.00	405,316.00	
	ACGB 5.75% 05/15/21	700,000.00	737,814.00	
	ACGB 5.75% 07/15/22	800,000.00	843,992.00	
	ACGB 6.25% 04/15/15	800,000.00	842,232.00	
	ACGB 6.25% 06/15/14	600,000.00	626,400.00	
	ACGB 6.5% 05/15/13	1,200,000.00	1,248,036.00	
小計		5,400,000.00	5,597,004.00 (455,875,975)	
イギリスポンド	UKT 2.25% 03/07/14	3,550,000.00	3,676,337.40	
	UKT 2.75% 01/22/15	4,450,000.00	4,667,867.55	
	UKT 3.25% 12/07/11	5,100,000.00	5,261,955.60	
	UKT 3.75% 09/07/19	2,500,000.00	2,675,880.00	
	UKT 4% 01/22/60	1,350,000.00	1,388,449.35	
	UKT 4% 03/07/22	3,300,000.00	3,553,077.00	
	UKT 4% 09/07/16	5,950,000.00	6,599,597.20	
	UKT 4.25% 03/07/36	5,450,000.00	5,815,411.60	
	UKT 4.25% 06/07/32	4,810,000.00	5,161,466.70	
	UKT 4.25% 09/07/39	1,000,000.00	1,068,344.00	
	UKT 4.25% 12/07/27	3,850,000.00	4,173,103.55	
	UKT 4.25% 12/07/40	2,200,000.00	2,342,689.80	
	UKT 4.25% 12/07/46	4,750,000.00	5,100,668.75	
	UKT 4.25% 12/07/49	3,100,000.00	3,336,852.40	
	UKT 4.25% 12/07/55	4,850,000.00	5,252,768.25	
	UKT 4.5% 03/07/13	5,300,000.00	5,764,735.80	
	UKT 4.5% 03/07/19	7,100,000.00	8,038,044.90	
	UKT 4.5% 09/07/34	800,000.00	885,291.20	
	UKT 4.5% 12/07/42	5,150,000.00	5,750,083.15	

	UKT 4.75% 03/07/20	6,300,000.00	7,252,371.00	
	UKT 4.75% 09/07/15	4,900,000.00	5,604,531.80	
	UKT 4.75% 12/07/30	4,100,000.00	4,694,126.90	
	UKT 4.75% 12/07/38	5,100,000.00	5,895,350.10	
	UKT 5% 03/07/12	8,400,000.00	8,925,856.80	
	UKT 5% 03/07/18	1,800,000.00	2,107,175.40	
	UKT 5% 03/07/25	3,620,000.00	4,267,791.76	
	UKT 5.0% 09/07/14	4,210,000.00	4,790,297.98	
	UKT 5.25% 06/07/12	5,700,000.00	6,136,221.00	
	UKT 6.0% 12/07/28	3,310,000.00	4,372,615.92	
	UKT 8% 06/07/21	3,040,000.00	4,432,967.52	
	UKT 8% 09/27/13	2,400,000.00	2,896,334.40	
	UKT 8% 12/07/15	2,145,000.00	2,809,686.16	
	UKT 8.75% 08/25/17	2,850,000.00	4,033,884.30	
小計		132,435,000.00	148,731,835.24 (19,732,252,581)	
スイスフラン	SWISS 2.75% 06/10/12	4,300,000.00	4,472,215.00	
	SWISS 4% 02/11/23	4,000,000.00	5,115,160.00	
	SWISS 4.25% 06/05/17	5,100,000.00	6,153,660.00	
小計		13,400,000.00	15,741,035.00 (1,351,053,034)	
シンガポールドル	SIGB 1.625% 04/01/13	800,000.00	823,312.00	
	SIGB 2.25% 07/01/13	1,050,000.00	1,100,463.00	
	SIGB 2.5% 06/01/19	350,000.00	367,549.00	
	SIGB 2.5% 10/01/12	600,000.00	625,164.00	
	SIGB 2.625% 04/01/12	1,100,000.00	1,136,575.00	
	SIGB 2.875% 07/01/15	1,100,000.00	1,201,849.00	
	SIGB 3.125% 09/01/22	1,100,000.00	1,202,894.00	
	SIGB 3.25% 09/01/20	800,000.00	887,488.00	
	SIGB 3.5% 03/01/27	1,500,000.00	1,668,540.00	
	SIGB 3.5% 07/01/12	1,700,000.00	1,792,429.00	
	SIGB 3.625% 07/01/14	800,000.00	888,224.00	
	SIGB 3.75% 09/01/16	1,200,000.00	1,373,472.00	
	SIGB 4% 09/01/18	1,100,000.00	1,285,350.00	
	小計		13,200,000.00	14,353,309.00 (913,301,051)
マレーシアリングット	MGS 2.509% 08/27/12	1,600,000.00	1,582,976.00	
	MGS 3.21% 05/31/13	1,400,000.00	1,402,030.00	
	MGS 3.461% 07/31/13	4,900,000.00	4,933,094.60	
	MGS 3.502% 05/31/27	2,400,000.00	2,244,583.20	
	MGS 3.702% 02/25/13	2,500,000.00	2,531,332.50	
	MGS 3.718% 06/15/12	13,600,000.00	13,759,160.80	
	MGS 3.814% 02/15/17	2,000,000.00	2,032,912.00	
	MGS 3.833% 09/28/11	2,600,000.00	2,623,418.20	
	MGS 4.24% 02/07/18	400,000.00	415,624.40	
	MGS 4.262% 09/15/16	10,100,000.00	10,522,846.60	
	MGS 4.378% 11/29/19	2,800,000.00	2,964,536.40	
	MGS 4.72% 09/30/15	1,600,000.00	1,698,012.80	
	MGS 5.094% 04/30/14	3,200,000.00	3,394,457.60	

	MGS 5.248% 09/15/28	2,600,000.00	3,002,058.80	
小計		51,700,000.00	53,107,043.90 (1,441,856,241)	
スウェーデンクローナ	SGB 3% 07/12/16	13,700,000.00	14,328,145.00	
	SGB 3.5% 03/30/39	11,500,000.00	12,371,700.00	
	SGB 3.75% 08/12/17	15,100,000.00	16,512,454.00	
	SGB 4.25% 03/12/19	16,000,000.00	18,259,840.00	
	SGB 4.5% 08/12/15	4,900,000.00	5,460,707.00	
	SGB 5% 12/01/20	18,300,000.00	22,431,225.00	
	SGB 5.5% 10/08/12	17,600,000.00	19,036,688.00	
	SGB 6.75% 05/05/14	23,900,000.00	27,988,334.00	
小計		121,000,000.00	136,389,093.00 (1,700,771,989)	
ノルウェークローネ	NGB 4.25% 05/19/17	9,000,000.00	9,761,220.00	
	NGB 4.5% 05/22/19	6,400,000.00	7,092,224.00	
	NGB 5% 05/15/15	10,600,000.00	11,707,488.00	
	NGB 6.5% 05/15/13	15,900,000.00	17,566,320.00	
小計		41,900,000.00	46,127,252.00 (660,542,248)	
デンマーククローネ	DGB 4% 11/15/12	3,200,000.00	3,403,072.00	
	DGB 4% 11/15/15	21,100,000.00	23,470,585.00	
	DGB 4% 11/15/17	19,600,000.00	22,126,636.00	
	DGB 4% 11/15/19	13,100,000.00	14,855,138.00	
	DGB 4.5% 11/15/39	24,800,000.00	32,812,136.00	
	DGB 5% 11/15/13	22,190,000.00	24,742,737.60	
	DGB 6% 11/15/11	21,300,000.00	22,542,216.00	
	DGB 7% 11/10/24	6,140,000.00	9,276,741.80	
小計		131,430,000.00	153,229,262.40 (2,349,004,592)	
ポーランドズロチ	POLGB 0% 01/25/12	3,100,000.00	2,927,237.00	
	POLGB 4.75% 04/25/12	13,000,000.00	13,054,210.00	
	POLGB 5% 10/24/13	9,600,000.00	9,634,848.00	
	POLGB 5.25% 04/25/13	12,200,000.00	12,346,400.00	
	POLGB 5.25% 10/25/17	7,450,000.00	7,438,527.00	
	POLGB 5.5% 10/25/19	6,100,000.00	6,128,609.00	
	POLGB 5.75% 04/25/14	7,500,000.00	7,688,475.00	
	POLGB 5.75% 09/23/22	7,800,000.00	7,950,306.00	
	POLGB 6.25% 10/24/15	8,700,000.00	9,123,864.00	
小計		75,450,000.00	76,292,476.00 (2,181,964,813)	
ユーロ	BGB 2% 03/28/12	1,400,000.00	1,419,152.00	
	BGB 3.25% 09/28/16	3,050,000.00	3,177,490.00	
	BGB 3.5% 03/28/15	1,000,000.00	1,059,820.00	
	BGB 3.75% 09/28/15	4,000,000.00	4,281,400.00	
	BGB 3.75% 09/28/20	1,300,000.00	1,368,354.00	
	BGB 4% 03/28/14	2,300,000.00	2,475,697.00	
	BGB 4% 03/28/18	2,500,000.00	2,708,375.00	
	BGB 4% 03/28/22	3,200,000.00	3,428,864.00	
	BGB 4.0% 03/28/13	2,800,000.00	2,980,600.00	
	BGB 4.0% 03/28/17	2,400,000.00	2,599,464.00	

BGB 4.0% 03/28/19	2,300,000.00	2,480,941.00	
BGB 4.25% 03/28/41	800,000.00	873,752.00	
BGB 4.25% 09/28/13	4,700,000.00	5,071,441.00	
BGB 4.25% 09/28/14	4,600,000.00	5,010,412.00	
BGB 5% 03/28/35	4,200,000.00	5,126,058.00	
BGB 5% 09/28/12	4,800,000.00	5,159,856.00	
BGB 5.0% 09/28/11	3,400,000.00	3,536,816.00	
BGB 5.5% 03/28/28	3,800,000.00	4,800,388.00	
BGB 5.5% 09/28/17	2,350,000.00	2,770,321.00	
BGB 8.0% 03/28/15	2,000,000.00	2,503,860.00	
BKO 1% 03/16/12	1,800,000.00	1,808,244.00	
BKO 1.25% 09/16/11	3,400,000.00	3,420,060.00	
BKO 1.25% 12/16/11	5,500,000.00	5,540,040.00	
BTNS 1.5% 09/12/11	1,400,000.00	1,411,032.00	
BTNS 2.5% 01/12/14	2,450,000.00	2,548,637.00	
BTNS 2.5% 01/15/15	900,000.00	935,010.00	
BTNS 3% 07/12/14	6,100,000.00	6,461,669.00	
BTNS 3.75% 01/12/12	4,000,000.00	4,154,160.00	
BTNS 3.75% 01/12/13	6,400,000.00	6,798,144.00	
BTNS 4.5% 07/12/12	5,300,000.00	5,639,995.00	
BTNS 4.5% 07/12/13	1,000,000.00	1,092,230.00	
BTPS 2% 12/15/12	2,800,000.00	2,797,480.00	
BTPS 2.5% 07/01/12	2,600,000.00	2,627,482.00	
BTPS 3% 03/01/12	1,500,000.00	1,524,870.00	
BTPS 3% 04/15/15	4,000,000.00	4,037,120.00	
BTPS 3.5% 06/01/14	4,000,000.00	4,126,440.00	
BTPS 3.75% 08/01/15	7,500,000.00	7,816,275.00	
BTPS 3.75% 08/01/16	9,600,000.00	9,989,088.00	
BTPS 3.75% 08/01/21	7,500,000.00	7,442,775.00	
BTPS 3.75% 09/15/11	5,400,000.00	5,513,400.00	
BTPS 3.75% 12/15/13	7,200,000.00	7,487,280.00	
BTPS 4% 02/01/17	6,300,000.00	6,608,511.00	
BTPS 4% 02/01/37	6,300,000.00	5,687,955.00	
BTPS 4% 04/15/12	7,900,000.00	8,159,673.00	
BTPS 4% 09/01/20	1,800,000.00	1,819,386.00	
BTPS 4.25% 02/01/15	6,300,000.00	6,688,773.00	
BTPS 4.25% 02/01/19	7,400,000.00	7,728,264.00	
BTPS 4.25% 03/01/20	2,950,000.00	3,051,598.00	
BTPS 4.25% 04/15/13	1,800,000.00	1,888,794.00	
BTPS 4.25% 08/01/13	5,800,000.00	6,107,458.00	
BTPS 4.25% 08/01/14	8,500,000.00	9,000,650.00	
BTPS 4.25% 09/01/11	2,600,000.00	2,664,038.00	
BTPS 4.25% 09/01/19	5,500,000.00	5,722,970.00	
BTPS 4.25% 10/15/12	4,000,000.00	4,176,160.00	
BTPS 4.5% 02/01/18	3,900,000.00	4,174,638.00	
BTPS 4.5% 02/01/20	7,800,000.00	8,242,026.00	
BTPS 4.5% 03/01/19	5,250,000.00	5,565,735.00	
BTPS 4.5% 08/01/18	5,100,000.00	5,444,301.00	

BTPS 4.75% 02/01/13	10,300,000.00	10,903,786.00	
BTPS 4.75% 08/01/23	7,200,000.00	7,608,672.00	
BTPS 5% 02/01/12	9,270,000.00	9,663,140.70	
BTPS 5% 03/01/25	2,800,000.00	2,991,100.00	
BTPS 5% 08/01/34	5,700,000.00	5,930,679.00	
BTPS 5% 09/01/40	1,600,000.00	1,656,544.00	
BTPS 5.0% 08/01/39	5,100,000.00	5,300,379.00	
BTPS 5.25% 08/01/17	1,340,000.00	1,498,870.40	
BTPS 5.25% 11/01/29	7,150,000.00	7,696,546.00	
BTPS 5.75% 02/01/33	5,000,000.00	5,684,050.00	
BTPS 6% 05/01/31	6,330,000.00	7,373,563.80	
BTPS 6.5% 11/01/27	7,200,000.00	8,811,144.00	
BTPS 7.25% 11/01/26	3,100,000.00	4,048,321.00	
BTPS 9% 11/01/23	2,050,000.00	3,014,996.50	
DBR 3% 07/04/20	2,700,000.00	2,880,873.00	
DBR 3.25% 01/04/20	4,100,000.00	4,461,620.00	
DBR 3.25% 07/04/15	4,400,000.00	4,771,140.00	
DBR 3.5% 01/04/16	8,000,000.00	8,779,600.00	
DBR 3.5% 07/04/19	8,500,000.00	9,412,305.00	
DBR 3.75% 01/04/15	6,200,000.00	6,824,464.00	
DBR 3.75% 01/04/17	6,700,000.00	7,485,508.00	
DBR 3.75% 01/04/19	5,000,000.00	5,625,450.00	
DBR 3.75% 07/04/13	5,000,000.00	5,385,650.00	
DBR 4% 07/04/16	2,800,000.00	3,158,428.00	
DBR 4.0% 01/04/18	4,500,000.00	5,121,765.00	
DBR 4.0% 01/04/37	3,800,000.00	4,565,852.00	
DBR 4.25% 01/04/14	6,850,000.00	7,552,878.50	
DBR 4.25% 07/04/14	9,150,000.00	10,182,577.50	
DBR 4.25% 07/04/17	3,800,000.00	4,377,030.00	
DBR 4.25% 07/04/18	7,800,000.00	9,040,200.00	
DBR 4.25% 07/04/39	4,000,000.00	5,075,840.00	
DBR 4.5% 01/04/13	8,200,000.00	8,877,320.00	
DBR 4.75% 07/04/28	3,200,000.00	4,056,000.00	
DBR 4.75% 07/04/34	5,300,000.00	6,959,483.00	
DBR 4.75% 07/04/40	5,400,000.00	7,409,394.00	
DBR 5.0% 01/04/12	9,280,000.00	9,788,822.40	
DBR 5.0% 07/04/12	3,200,000.00	3,435,840.00	
DBR 5.5% 01/04/31	4,100,000.00	5,722,698.00	
DBR 5.625% 01/04/28	1,670,000.00	2,306,687.50	
DBR 6% 06/20/16	560,000.00	690,804.80	
DBR 6.25% 01/04/24	3,700,000.00	5,245,675.00	
DBR 6.25% 01/04/30	2,700,000.00	4,057,344.00	
DBR 6.5% 07/04/27	3,700,000.00	5,543,229.00	
FRTR 3% 10/25/15	5,800,000.00	6,142,026.00	
FRTR 3.25% 04/25/16	8,300,000.00	8,896,272.00	
FRTR 3.5% 04/25/15	7,900,000.00	8,547,089.00	
FRTR 3.5% 04/25/20	4,100,000.00	4,399,546.00	
FRTR 3.5% 04/25/26	600,000.00	632,076.00	

FRTR 3.75% 04/25/17	4,600,000.00	5,060,138.00	
FRTR 3.75% 04/25/21	9,200,000.00	10,055,508.00	
FRTR 3.75% 10/25/19	6,000,000.00	6,578,820.00	
FRTR 4% 04/25/14	6,500,000.00	7,106,775.00	
FRTR 4% 04/25/18	6,800,000.00	7,603,148.00	
FRTR 4% 04/25/55	3,650,000.00	4,273,529.50	
FRTR 4% 04/25/60	1,200,000.00	1,415,196.00	
FRTR 4% 10/25/13	7,250,000.00	7,860,160.00	
FRTR 4% 10/25/14	4,500,000.00	4,945,905.00	
FRTR 4% 10/25/38	6,200,000.00	7,055,972.00	
FRTR 4.0% 04/25/13	6,550,000.00	7,036,534.00	
FRTR 4.25% 04/25/19	9,650,000.00	10,974,559.00	
FRTR 4.25% 10/25/17	4,400,000.00	4,980,976.00	
FRTR 4.25% 10/25/18	3,300,000.00	3,750,813.00	
FRTR 4.25% 10/25/23	6,250,000.00	7,167,312.50	
FRTR 4.5% 04/25/41	1,500,000.00	1,852,920.00	
FRTR 4.75% 04/25/35	5,100,000.00	6,377,856.00	
FRTR 4.75% 10/25/12	7,900,000.00	8,511,302.00	
FRTR 5% 04/25/12	5,900,000.00	6,281,789.00	
FRTR 5% 10/25/16	7,410,000.00	8,672,960.40	
FRTR 5.0% 10/25/11	4,620,000.00	4,828,824.00	
FRTR 5.5% 04/25/29	5,230,000.00	6,935,973.70	
FRTR 5.75% 10/25/32	5,300,000.00	7,418,039.00	
FRTR 6.0% 10/25/25	2,800,000.00	3,822,252.00	
FRTR 8.5% 04/25/23	1,000,000.00	1,595,850.00	
FRTR 8.5% 10/25/19	1,120,000.00	1,666,649.60	
FRTR 8.5% 12/26/12	1,500,000.00	1,749,615.00	
IRISH 3.9% 03/05/12	1,300,000.00	1,293,331.00	
IRISH 4% 01/15/14	1,200,000.00	1,144,968.00	
IRISH 4% 11/11/11	1,300,000.00	1,305,135.00	
IRISH 4.4% 06/18/19	2,300,000.00	1,974,274.00	
IRISH 4.5% 04/18/20	4,200,000.00	3,562,692.00	
IRISH 4.5% 10/18/18	1,600,000.00	1,407,840.00	
IRISH 4.6% 04/18/16	2,100,000.00	1,953,546.00	
IRISH 5% 04/18/13	3,100,000.00	3,096,404.00	
IRISH 5.4% 03/13/25	3,300,000.00	2,835,129.00	
IRISH 5.9% 10/18/19	600,000.00	570,696.00	
NETHER 2.5% 01/15/12	2,050,000.00	2,095,633.00	
NETHER 2.75% 01/15/15	1,200,000.00	1,263,360.00	
NETHER 3.25% 07/15/15	1,500,000.00	1,615,035.00	
NETHER 3.5% 07/15/20	1,800,000.00	1,959,786.00	
NETHER 3.75% 01/15/23	2,200,000.00	2,449,458.00	
NETHER 3.75% 01/15/42	1,400,000.00	1,620,150.00	
NETHER 3.75% 07/15/14	5,300,000.00	5,782,724.00	
NETHER 4% 01/15/37	2,800,000.00	3,333,848.00	
NETHER 4% 07/15/16	4,300,000.00	4,812,818.00	
NETHER 4% 07/15/19	3,100,000.00	3,503,124.00	
NETHER 4.0% 07/15/18	3,100,000.00	3,492,305.00	

NETHER 4.25% 07/15/13	4,700,000.00	5,115,997.00	
NETHER 4.5% 07/15/17	4,200,000.00	4,848,060.00	
NETHER 5.0% 07/15/12	7,200,000.00	7,729,488.00	
NETHER 5.5% 01/15/28	2,900,000.00	3,935,184.00	
NETHER 7.5% 01/15/23	1,400,000.00	2,114,728.00	
OBL 2.25% 04/10/15	3,500,000.00	3,639,860.00	
OBL 2.25% 04/11/14	4,500,000.00	4,690,035.00	
OBL 2.5% 02/27/15	4,600,000.00	4,831,196.00	
OBL 2.5% 10/10/14	3,800,000.00	3,995,282.00	
OBL 3.5% 04/12/13	5,350,000.00	5,707,754.50	
OBL 3.5% 10/14/11	5,400,000.00	5,558,490.00	
OBL 4% 04/13/12	5,400,000.00	5,671,836.00	
OBL 4% 10/11/13	600,000.00	654,498.00	
OBL 4.25% 10/12/12	5,900,000.00	6,310,109.00	
PGB 3.35% 10/15/15	3,400,000.00	3,092,470.00	
PGB 3.85% 04/15/21	1,550,000.00	1,249,424.00	
PGB 4.1% 04/15/37	1,750,000.00	1,236,322.50	
PGB 4.2% 10/15/16	1,300,000.00	1,203,982.00	
PGB 4.35% 10/16/17	2,300,000.00	2,097,554.00	
PGB 4.375% 06/16/14	1,300,000.00	1,268,826.00	
PGB 4.45% 06/15/18	2,300,000.00	2,075,543.00	
PGB 4.75% 06/14/19	1,900,000.00	1,708,366.00	
PGB 4.95% 10/25/23	1,600,000.00	1,371,280.00	
PGB 5% 06/15/12	1,900,000.00	1,920,577.00	
PGB 5.45% 09/23/13	2,350,000.00	2,385,109.00	
RAGB 3.2% 02/20/17	300,000.00	317,811.00	
RAGB 3.4% 10/20/14	600,000.00	641,304.00	
RAGB 3.5% 07/15/15	3,700,000.00	3,981,718.00	
RAGB 3.5% 09/15/21	3,400,000.00	3,588,088.00	
RAGB 3.8% 10/20/13	4,250,000.00	4,564,585.00	
RAGB 3.9% 07/15/20	2,900,000.00	3,174,949.00	
RAGB 4% 09/15/16	3,400,000.00	3,764,208.00	
RAGB 4.15% 03/15/37	2,100,000.00	2,399,061.00	
RAGB 4.3% 07/15/14	2,500,000.00	2,751,600.00	
RAGB 4.3% 09/15/17	900,000.00	1,011,978.00	
RAGB 4.35% 03/15/19	1,600,000.00	1,809,168.00	
RAGB 4.65% 01/15/18	4,500,000.00	5,162,580.00	
RAGB 4.85% 03/15/26	1,100,000.00	1,326,809.00	
RAGB 5.0% 07/15/12	2,500,000.00	2,676,600.00	
RAGB 6.25% 07/15/27	2,000,000.00	2,799,380.00	
RFGB 3.125% 09/15/14	1,600,000.00	1,711,584.00	
RFGB 3.375% 04/15/20	900,000.00	966,366.00	
RFGB 3.875% 09/15/17	1,350,000.00	1,505,479.50	
RFGB 4% 07/04/25	1,200,000.00	1,367,268.00	
RFGB 4.25% 07/04/15	1,500,000.00	1,681,335.00	
RFGB 4.25% 09/15/12	1,100,000.00	1,171,709.00	
RFGB 4.375% 07/04/19	1,600,000.00	1,850,080.00	
RFGB 5.375% 07/04/13	1,800,000.00	2,010,474.00	

		SPGB 2.3% 04/30/13	800,000.00	794,176.00	
		SPGB 2.75% 04/30/12	2,900,000.00	2,924,650.00	
		SPGB 3.15% 01/31/16	4,900,000.00	4,836,839.00	
		SPGB 3.8% 01/31/17	4,100,000.00	4,129,848.00	
		SPGB 3.9% 10/31/12	3,500,000.00	3,605,980.00	
		SPGB 4% 04/30/20	3,300,000.00	3,267,957.00	
		SPGB 4.1% 07/30/18	4,400,000.00	4,437,312.00	
		SPGB 4.2% 01/31/37	4,050,000.00	3,582,225.00	
		SPGB 4.2% 07/30/13	5,000,000.00	5,208,450.00	
		SPGB 4.25% 01/31/14	1,400,000.00	1,462,594.00	
		SPGB 4.3% 10/31/19	2,200,000.00	2,235,398.00	
		SPGB 4.4% 01/31/15	6,100,000.00	6,418,115.00	
		SPGB 4.6% 07/30/19	4,400,000.00	4,569,840.00	
		SPGB 4.65% 07/30/25	1,100,000.00	1,096,788.00	
		SPGB 4.7% 07/30/41	1,200,000.00	1,133,964.00	
		SPGB 4.75% 07/30/14	7,900,000.00	8,426,772.00	
		SPGB 4.8% 01/31/24	3,400,000.00	3,511,928.00	
		SPGB 4.85% 10/31/20	1,700,000.00	1,789,913.00	
		SPGB 4.9% 07/30/40	3,300,000.00	3,253,932.00	
		SPGB 5.0% 07/30/12	4,000,000.00	4,189,360.00	
		SPGB 5.35% 10/31/11	4,250,000.00	4,408,440.00	
		SPGB 5.5% 07/30/17	3,500,000.00	3,857,840.00	
		SPGB 5.75% 07/30/32	3,050,000.00	3,387,757.00	
		SPGB 6.0% 01/31/29	5,200,000.00	5,922,332.00	
		SPGB 6.15% 01/31/13	4,100,000.00	4,430,624.00	
	小計		884,430,000.00	964,509,474.30 (110,185,562,344)	
国債証券計				(249,486,067,349)	
特殊債券	オーストラリアドル	NSWTC 5.5% 03/01/17	3,200,000.00	3,233,728.00	
		NSWTC 5.5% 08/01/14	3,300,000.00	3,334,503.00	
		NSWTC 6% 05/01/12	2,850,000.00	2,887,931.00	
		QTC 6% 06/14/21	1,200,000.00	1,255,380.00	
		QTC 6% 08/14/13	2,800,000.00	2,863,588.00	
		QTC 6% 09/14/17	6,450,000.00	6,679,830.50	
		QTC 6% 10/14/15	3,300,000.00	3,396,657.00	
	小計		23,100,000.00	23,651,617.50 (1,926,424,245)	
特殊債券計				(1,926,424,245)	
合計				(251,412,491,594)	

(注1) 各種通貨ごとの小計欄における()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、小計欄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 139銘柄	100.0%	40.3%
カナダドル	国債証券 27銘柄	100.0%	2.8%
ユーロ	国債証券 227銘柄	100.0%	43.9%

イギリスポンド	国債証券 33銘柄	100.0%	7.8%
スイスフラン	国債証券 3銘柄	100.0%	0.5%
スウェーデンクローナ	国債証券 8銘柄	100.0%	0.7%
ノルウェークローネ	国債証券 4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%
ポーランドズロチ	国債証券 9銘柄	100.0%	0.9%
オーストラリアドル	国債証券 9銘柄	19.1%	
	特殊債券 7銘柄	80.9%	0.9%
シンガポールドル	国債証券 13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%	0.6%

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。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】(平成22年10月29日現在)

資産総額	16,034,579,996 円
負債総額	14,704,207 円
純資産総額（ - ）	16,019,875,789 円
発行済口数	15,704,139,874 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0201 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	127,893,681,878 円
負債総額	3,043,045,873 円
純資産総額（ - ）	124,850,636,005 円
発行済口数	200,841,581,362 口
1口当たり純資産額（ / ）	0.6216 円

住信 国内債券インデックス マザーファンド

資産総額	161,349,300,768 円
負債総額	28,797,752 円
純資産総額（ - ）	161,320,503,016 円
発行済口数	133,179,979,470 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2113 円

住信 外国株式インデックス マザーファンド

資産総額	119,808,468,677 円
負債総額	44,591,776 円
純資産総額（ - ）	119,763,876,901 円
発行済口数	138,294,015,397 口
1口当たり純資産額（ / ）	0.8660 円

住信 外国債券インデックス マザーファンド

資産総額	245,830,993,269 円
負債総額	128,621,518 円
純資産総額（ - ）	245,702,371,751 円

発行済口数	140,445,778,576 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7494 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。

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(イ) 資本金の額

平成22年10月29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年間に於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、累積投票にはなりません。

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。

[SEE(検証)]

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22年10月29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	156	1,393,935
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	156	1,393,935

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20年4月1日至平成21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21年4月1日至平成22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20年4月1日至平成21年3月31日）及び当事業年度（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、あずさ監査法人による監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

（単位：千円）

	前事業年度 （平成21年3月31日現在）		当事業年度 （平成22年3月31日現在）	
資産の部				
流動資産				
現金及び預金	2	4,620,293	2	5,642,056
有価証券		324,008		-
前払金		-		6,819
前払費用		33,583		35,081
未収委託者報酬		762,027		942,664
未収運用受託報酬		37,916		48,083
未収還付法人税等		108,554		-

未収消費税等		13,438		-
繰延税金資産		26,084		44,119
その他		4,235		129
流動資産合計		5,930,144		6,718,954
固定資産				
有形固定資産				
建物		63,983		49,765
器具備品		40,445		26,485
有形固定資産合計	1	104,428	1	76,250
無形固定資産				
ソフトウェア		83,031		95,682
その他無形固定資産		146		126
無形固定資産合計		83,178		95,808
投資その他の資産				
投資有価証券		294,353		245,516
敷金・保証金		238,033		238,033
長期前払費用		225		449
繰延税金資産		55,356		55,356
その他の投資		255		225
投資その他の資産合計		588,223		539,579
固定資産合計		775,830		711,639
資産合計		6,705,974		7,430,593

(単位：千円)

	前事業年度 (平成21年3月31日現在)	当事業年度 (平成22年3月31日現在)
負債の部		
流動負債		
預り金	17,703	16,838
未払金	465,995	520,453
未払収益分配金	130	130
未払手数料	2 361,950	2 454,590
その他未払金	103,914	65,733
未払費用	2 85,253	2 126,959
未払法人税等	-	174,433
未払消費税等	-	11,758
賞与引当金	79,979	70,599

流動負債合計	648,932	921,042
固定負債		
退職給付引当金	91,962	122,901
固定負債合計	91,962	122,901
負債合計	740,894	1,043,943
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	47,500	50,500
その他利益剰余金		
別途積立金	4,100,000	5,100,000
繰越利益剰余金	1,542,542	942,449
利益剰余金合計	5,690,042	6,092,949
株主資本合計	5,990,042	6,392,949
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	24,962	6,299
評価・換算差額等合計	24,962	6,299
純資産合計	5,965,080	6,386,650
負債・純資産合計	6,705,974	7,430,593

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	(自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	9,373,528	8,637,673
運用受託報酬	99,489	108,227
営業収益合計	9,473,018	8,745,901
営業費用		
支払手数料	1 4,753,041	1 4,414,750
広告宣伝費	227,750	123,104
公告費	2,934	2,520
受益証券発行費	-	95
調査費	881,688	835,300
調査費	80,845	85,751

委託調査費	798,694	747,629
図書費	2,148	1,918
営業雑経費	650,350	650,397
通信費	10,965	10,735
印刷費	177,337	164,695
協会費	10,450	9,726
諸会費	586	594
情報機器関連費	400,645	429,265
その他営業雑経費	50,366	35,380
営業費用合計	6,515,764	6,026,169
一般管理費		
給料	1,346,925	1,313,847
役員報酬	39,900	34,470
給料・手当	1,127,586	1,098,871
賞与	179,439	180,505
退職給付費用	65,654	52,327
役員退職慰労金	-	1,980
福利費	149,509	148,136
交際費	1,777	1,771
旅費交通費	54,749	43,688
租税公課	16,216	17,962
不動産賃借料	238,033	238,033
寄付金	3,960	3,745
減価償却費	60,600	58,878
諸経費	158,896	101,459
一般管理費合計	2,096,324	1,981,829
営業利益	860,928	737,901

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	2,532	1,046
有価証券利息	1,544	257
受取利息	1 12,425	1 6,564
投資有価証券売却益	291	1,179

その他		5,943		3,344
営業外収益合計		22,737		12,393
営業外費用				
支払保証料	1	64		-
投資有価証券売却損		2,275		12,836
投資有価証券評価損		637		-
固定資産除却損	2	24	2	1,136
その他		1,759		820
営業外費用合計		4,762		14,794
経常利益		878,903		735,501
税引前当期純利益		878,903		735,501
法人税、住民税及び事業税		328,438		333,431
法人税等調整額		29,609		30,837
法人税等合計		358,047		302,594
当期純利益		520,856		432,906

(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20年4月1日 至平成21年3月31日)		(自平成21年4月1日 至平成22年3月31日)	
株主資本				
資本金				
前期末残高		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		44,500		47,500
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		47,500		50,500
その他利益剰余金				
別途積立金				
前期末残高		3,100,000		4,100,000
当期変動額				

別途積立金の積立	1,000,000	1,000,000
当期変動額合計	1,000,000	1,000,000
当期末残高	4,100,000	5,100,000
繰越利益剰余金		
前期末残高	2,054,686	1,542,542
当期変動額		
剰余金の配当	33,000	33,000
当期純利益	520,856	432,906
別途積立金の積立	1,000,000	1,000,000
当期変動額合計	512,143	600,093
当期末残高	1,542,542	942,449
利益剰余金合計		
前期末残高	5,199,186	5,690,042
当期変動額		
剰余金の配当	30,000	30,000
当期純利益	520,856	432,906
当期変動額合計	490,856	402,906
当期末残高	5,690,042	6,092,949
株主資本合計		
前期末残高	5,499,186	5,990,042
当期変動額		
剰余金の配当	30,000	30,000
当期純利益	520,856	432,906
当期変動額合計	490,856	402,906
当期末残高	5,990,042	6,392,949

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22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	2,238	24,962
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	22,724	18,662
当期変動額合計	22,724	18,662
当期末残高	24,962	6,299

評価・換算差額等合計

前期末残高	2,238	24,962
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	22,724	18,662
当期変動額合計	22,724	18,662
当期末残高	24,962	6,299
純資産合計		
前期末残高	5,496,948	5,965,080
当期変動額		
剰余金の配当	30,000	30,000
当期純利益	520,856	432,906
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	22,724	18,662
当期変動額合計	468,132	421,569
当期末残高	5,965,080	6,386,650

重要な会計方針

項目	期別 前事業年度 (自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日)	当事業年度 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)
1 有価証券の評価基準 及び評価方法	<p>その他有価証券 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 ております。）</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>その他有価証券 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おります。</p> <p>(2) 退職給付引当金</p>	<p>(1) 賞与引当金 同 左</p> <p>(2) 退職給付引当金</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おります。	同左
4 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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20年4月 1日 至 平成21年3月31日)	当事業年度 (自 平成21年4月 1日 至 平成22年3月31日)
リース取引に関する会計基準 所有権移転外ファイナンス・リース取引については、従来、賃貸借取引に係る方法に準じた会計処理によっておりましたが、当事業年度より「リース取引に関する会計基準」（企業会計基準第13号（平成5年6月17日（企業会計審議会第一部会）、平成19年3月30日改正））及び「リース取引に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第16号（平成6年1月18日（日本公認会計士協会 会計制度委員会）、平成19年3月30日改正））が適用されたことに伴い、通常の売買取引に係る方法に準じた会計処理によっております。これによる損益に与える影響はありません。	-

注記事項

（貸借対照表関係）

前事業年度 (平成21年3月31日現在)	当事業年度 (平成22年3月31日現在)
1 有形固定資産の減価償却累計額 建 物 24,134千円 器具備品 93,840千円 計 117,974千円	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
2 関係会社に対するものは次のとおりであります。 預金 2,832,577千円 未払手数料 305,246千円 未払費用 80,084千円	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

（損益計算書関係）

前事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22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。	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 4,504,556千円	支払手数料 4,065,257千円
受取利息 5,343千円	受取利息 1,030千円
支払保証料 64千円	
2 固定資産除却損の内容は、次のとおりであります。	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 24千円	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20年4月1日 至 平成21年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数

株式の種類	前期末	当期増加	当期減少	当期末
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. 当期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20年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	5,000	平成20年3月31日	平成20年6月30日

4. 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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21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21年3月31日	平成21年6月29日

当事業年度(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	前期末	当期増加	当期減少	当期末
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. 当期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. 基準日が当期に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌期となるもの

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

(リ - ス取引関係)

前事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
該当事項はありません。	同左

(金融商品関係)

当事業年度（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 その他有価証券	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 その他有価証券」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	-	-	-

（有価証券関係）

前事業年度（平成21年3月31日現在）

1．その他有価証券で時価のあるもの

（単位:千円）

区分	取得原価	貸借対照表 計上額	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
その他	4,000	4,157	157
小計	4,000	4,157	157
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
その他	133,578	90,695	42,883
小計	133,578	90,695	42,883
計	137,578	94,853	42,725

2．当事業年度中に売却したその他有価証券（自 平成20年4月1日 至 平成21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
16,166	291	2,275

3．時価評価されていない主な有価証券

（単位:千円）

区分	貸借対照表計上額
その他有価証券	
非上場株式	199,500
MMF	324,008
計	523,508

4．その他有価証券のうち満期があるもの

該当事項はありません。

当事業年度（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

(デリバティブ取引関係)

前事業年度(自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)

当社はデリバティブ取引を全く行っておりませんので、該当事項はありません。

当事業年度(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。

(退職給付関係)

前事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
<p>1. 採用している退職給付制度の概要</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> <p>退職給付債務 91,962千円</p> <p>退職給付引当金 91,962千円</p> <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> <p>退職給付費用 65,654千円</p> <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12,624千円を含んでおります。</p>	<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> <p>退職給付債務 122,901千円</p> <p>退職給付引当金 122,901千円</p> <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> <p>退職給付費用 52,327千円</p> <p>(1) 同左</p> <p>(2) 金額には確定拠出年金への掛金支払額13,326千円を含んでおります。</p>

4. 退職給付債務等の計算基礎 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、記載していません。	4. 退職給付債務等の計算基礎 同左
--	-----------------------

(税効果会計関係)

前事業年度 (平成21年3月31日現在)	当事業年度 (平成22年3月31日現在)
1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 (繰延税金資産)	1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 (繰延税金資産)
賞与引当金損金算入限度超過額 32,543千円	未払事業税 15,392千円
退職給付引当金損金算入限度超過額 37,419千円	賞与引当金損金算入限度超過額 28,726千円
有価証券評価差額 17,125千円	退職給付引当金損金算入限度超過額 50,008千円
その他 811千円	有価証券評価差額 4,321千円
繰延税金資産 合計 87,900千円	その他 1,025千円
	繰延税金資産 合計 99,475千円
(繰延税金負債)	(繰延税金負債)
未収還付事業税 6,459千円	-
繰延税金負債 合計 6,459千円	
差引 繰延税金資産の純額 81,441千円	
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 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。	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 同左

(持分法損益等)

前事業年度 (平成21年3月31日現在)	当事業年度 (平成22年3月31日現在)
該当事項はありません。	同左

(関連当事者情報)

前事業年度（自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日）

(追加情報)

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

1 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	287,537	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	4,504,556	未払 手数料	305,246
							投資助言 費用の支払	604,558	その他 未払金	223
									未払費用	80,084

(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）

(1株当たり情報)

前事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
1株当たり純資産額 994,180円05銭	1株当たり純資産額 1,064,441円67銭
1株当たり当期純利益 86,809円36銭	1株当たり当期純利益 72,151円14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いません。	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20年4月1日 至 平成21年3月31日)	当事業年度 (自 平成21年4月1日 至 平成22年3月31日)
当期純利益	520,856千円	432,906千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	520,856千円	432,906千円
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20年4月1日	当事業年度 (自 平成21年4月1日

至 平成21年3月31日)	至 平成22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22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。

岡三証券株式会社(指定販売会社)

1) 資本金の額

平成22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22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22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22年4月1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22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与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22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【その他】

- （イ）金融商品取引法第15条第2項本文に規定するあらかじめ又は同時に交付しなければならない目論見書（以下「交付目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（交付目論見書）」、また、金融商品取引法第15条第3項本文に規定する交付の請求があった時に直ちに交付しなければならない目論見書（以下「請求目論見書」といいます。）の名称を「投資信託説明書（請求目論見書）」と記載することがあります。（両者を総称して、以下「目論見書」といいます。）
- （ロ）目論見書の表紙等に、委託者および受託者のロゴ・マーク、本ファンドの図案を記載することがあります。
- （ハ）目論見書の表紙等に投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨の記載をすることがあります。
- （ニ）目論見書の表紙等に当該目論見書の使用開始日を記載することがあります。
- （ホ）有価証券届出書に記載された内容を明瞭に表示するため、目論見書にグラフ、図表等を使用することがあります。
- （ヘ）有価証券届出書に記載された運用実績の参考情報のデータを適時更新し、目論見書に記載することがあります。
- （ト）目論見書は電子媒体、インターネット等に掲載することがあります。
- （チ）交付目論見書の表紙等に本ファンドの投資信託約款が請求目論見書に掲載されている旨の記載をすることがあります。
- （リ）交付目論見書の表紙等に委託者のインターネットホームページのアドレスを掲載し、当該アドレスにアクセスすることにより請求目論見書等を入手できる旨を記載することがあります。また、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含む）も掲載し、当該アドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載することがあります。
- （ヌ）交付目論見書の「手続・手数料等」に、「手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なるので、上限額等を事前に示すことができない」旨の表記を行うことがあります。
- （ル）請求目論見書の巻末に、本ファンドの投資信託約款を添付することがあります。

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75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75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. 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 公認会計士 壁谷 恵嗣 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理の状況」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。

独立監査人の監査報告書

平成21年10月23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、「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75の平成20年10月1日から平成21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75の平成21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21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 白川 芳樹 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20年4月1日から平成21年3月31日までの第23期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者であり、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21年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

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

以 上

上記は、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。