

【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外国株式インデックス・オープン
【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外国株式インデックス・オープン

（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、委託者および指定販売会社（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、委託者または指定販売会社（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。）の指定する口座を經由して、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

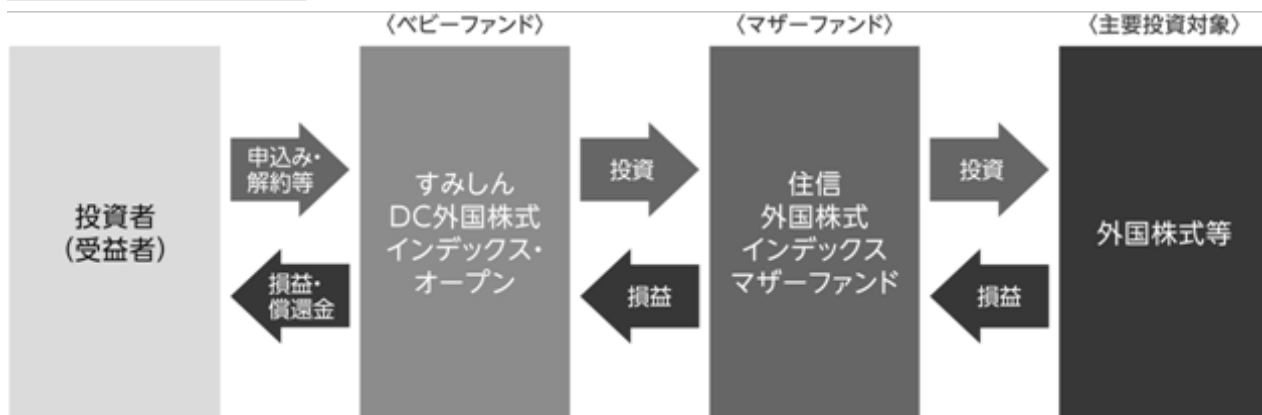
日本を除く世界の主要国の株式市場全体の動きをとらえ、MSCI コクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）に連動する投資成果を目指します。

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. 日本を除く世界の主要国の株式を主要投資対象とし、ファミリーファンド方式で運用を行います。

ファンドのしくみ



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。

〈マザーファンドの概要〉

マザーファンド	主な投資対象・投資地域	運用の基本方針
住信 外国株式インデックスマザーファンド	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	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. 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指します。

? MSCI コクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）とは

インデックスの概要 (2010年10月29日現在)		地域別構成比	
構成国	23ヶ国	北米(59.4%)	米国/カナダ
構成銘柄数	1,315銘柄	欧州(33.6%)	英国/ドイツ/アイルランド/オランダ/フランス ベルギー/ポルトガル/オーストリア/スペイン デンマーク/イタリア/フィンランド/スイス スウェーデン/ギリシャ/ノルウェー
時価総額	約1,686兆円	アジア・オセアニア (6.6%)	香港/シンガポール/オーストラリア ニュージーランド
		中東(0.4%)	イスラエル

(出所)MSCI社のデータをもとに住信アセットマネジメント作成
 ※時価総額は米国ドル建てデータを当該日の三菱東京UFJ銀行の為替データをもとに住信アセットマネジメントが円換算しています。
 ※地域別構成比は端数処理の関係で合計値が100%とならない場合があります。
 ※「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。

3. 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には制限を設けません。
- ・ 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には制限を設けません。

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)	補足分類
単位型投信 追加型投信	国内 海外 内外	株式 債券 不動産投信 その他資産 () 資産複合	インデックス型 特殊型

(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	海外	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産 (収益の源泉)	株式	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
補足分類	インデックス型	目論見書または投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す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	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回 年2回	グローバル (日本を除く) 日本			日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年4回 年6回 (隔月) 年12回 (毎月)	北米 欧州 アジア オセアニア	ファミリー ファンド	あり ()	TOPIX
不動産投信	日々	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	なし	その他 (MSCI コクサイ・インデックス(除く日本、円ベース))
その他資産 (投資信託証券 (株式一般))	その他 ()	アフリカ			
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型		中近東 (中東) エマージング			

(注) 本ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

〔区分における定義〕

区分項目	該当区分	定義
投資対象資産	その他資産 (投資信託証券(株式一般))	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。)、実質的に主として株式一般(大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものを含みます。)に投資する旨の記載があるものを含みます。
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含みます。
投資対象地域	グローバル (日本を除く)	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(日本を除きます。)の資産を源泉とする旨の記載があるものを含みます。
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含みます。
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含みます。
対象インデックス	その他 (MSCI コクサイ・インデックス(除く日本、円ベース))	目論見書または投資信託約款において、日経225またはTOPIXにあてはまらない指数(本ファンドにおいては、MSCI コクサイ・インデックス(除く日本、円ベース))に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものを含みます。

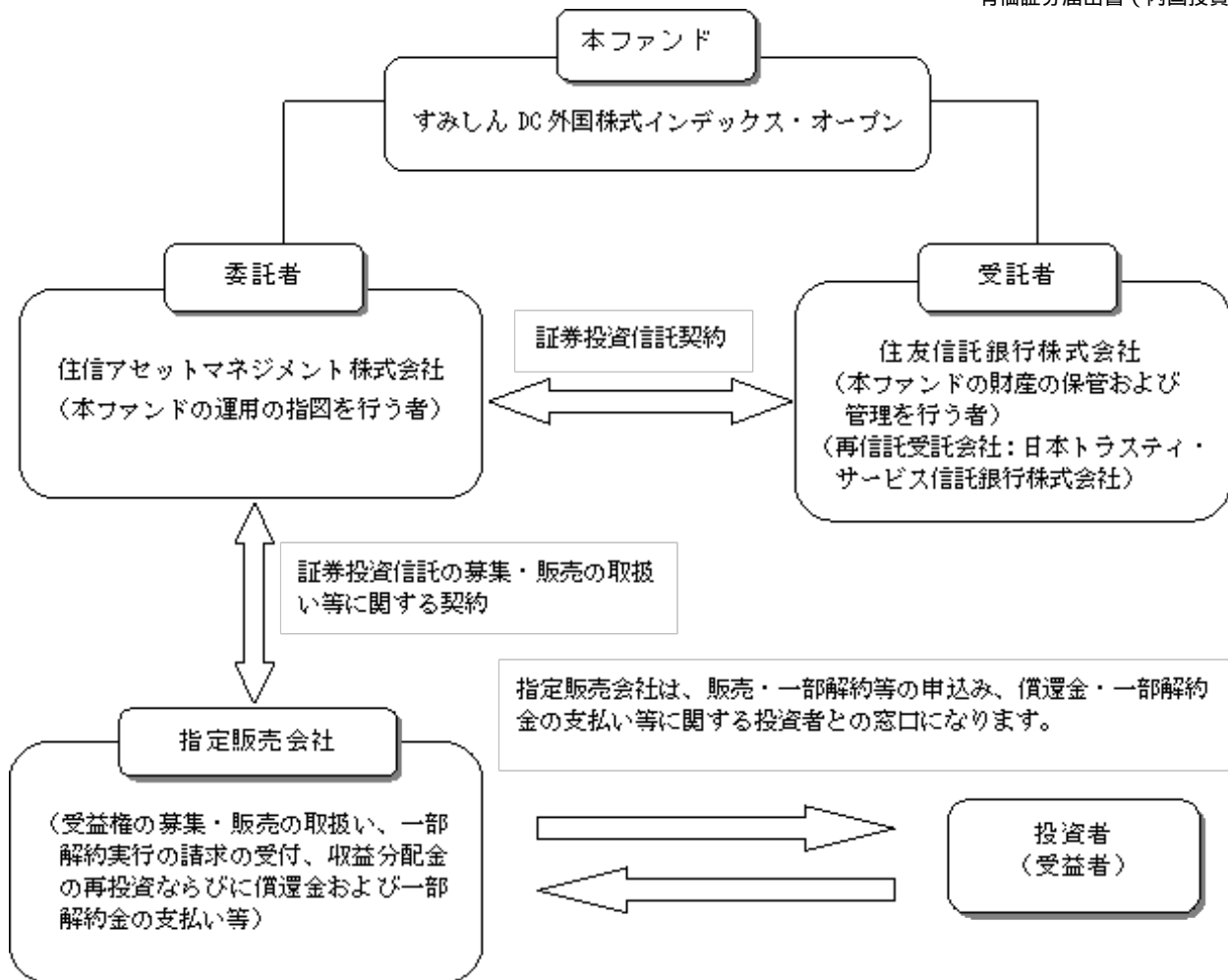
(2) 【ファンドの沿革】

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 外国株式インデックス 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



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 外国株式インデックス マザーファンド（以下「マザーファンド」ということがあります。）の受益証券（以下「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。なお、株式等に直接投資することもあります。

投資態度

- 1)主として、マザーファンド受益証券に投資し、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。
- 2)株式の実質組入比率は、原則として、100%に近い状態を維持します。
- 3)実質組入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。
- 4)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、株式の実質組入総額と株価指数先物取引等の買建玉の実質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。
- 5)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。
- 6)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。
- 7)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。
- 8)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。

（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。

(2) 【投資対象】

(イ) 本ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

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

ハ．金銭債権

ニ．約束手形

2.次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

(ロ)委託者は、信託金を主として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次に掲げる有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1.株券または新株引受権証券

2.国債証券

3.地方債証券

4.特別の法律により法人の発行する債券

5.社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

6.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。）

7.特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）

8.協同組織金融機関に係る優先出資証券（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。）

9.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。）

10.コマーシャル・ペーパー

11.新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券

12.外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの

13.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。）

14.投資証券もしくは投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）

15.外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）

16.オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）

17.預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）

18.外国法人が発行する譲渡性預金証書

19.指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

20.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。）

21.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

22.外国の者に対する権利で前号の有価証券の性質を有するもの

なお、第1号の証券または証書、第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第6号までの証券および第12号ならびに第17号の証券または証書のうち第2号から第6号までの証券の性質を有するもの、および第14号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13号の証券および第14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。

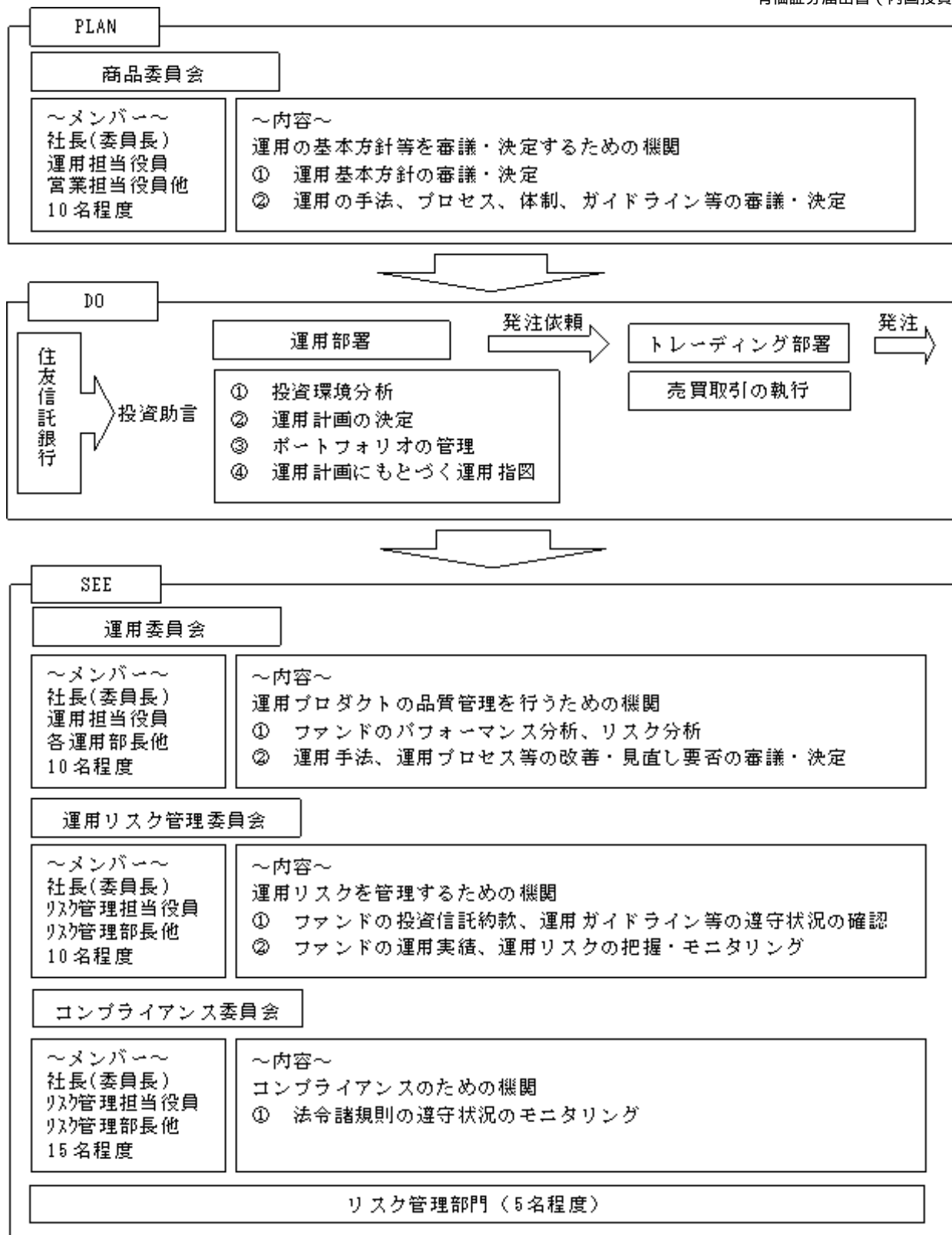
(八) 委託者は、信託金を、前記(ロ)に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

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には制限を設けません。（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には制限を設けません。（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」）

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（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の発行会社の発行するもの、取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。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ます。（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ます。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。）また、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、ならびに為替変動リスクを回避するため、わが国の取引所における通貨に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。（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（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かか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、ならびに為替変動リスクを回避するため、為替先渡取引を行うことを指図することができます。為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が原則として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。為替先渡取引の指図にあたっては、当該投資信託財産にかか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各号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、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28条）

委託者は、投資信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当（一部解約に伴う支払資金の手当のために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当を目的として、資金の借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図を行うことができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。また、一部解約に伴う支払資金の手当に係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から投資信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行う日における投資信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。また、収益分配金の再投資に係る借入期間は、投資信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。なお、借入金の利息は投資信託財産中より支弁します。（投資信託約款第36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受益証券の時価総額に、マザーファンドの投資信託財産の純資産総額に占める当該各資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。前記 、 および における「投資信託財産に属するとみなした額」も同様です。

（ロ）法律等で規制される取引等

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

<同一の法人の発行する株式への投資制限>（投資信託及び投資法人に関する法律）

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

<デリバティブ取引に係る投資制限>（金融商品取引業等に関する内閣府令）

投資信託財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標に係る変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託者が定めた合理的な方法により算出した額が当該投資信託財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引（新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）を行い、または継続することを受託会社に指図してはならない。

3【投資リスク】

（イ）本ファンドのもつ主なリスク

投資信託商品はリスク商品であり、投資元本は保証されていません。また、収益や利回り等も未確定の商品です。したがって、以下に記載する本ファンドのリスク要因を十分にご理解いただいたうえ、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) 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。

3) インデックスと乖離するリスク

本ファンドは、MSCIコクサイ・インデックス（除く日本、円ベース）の値動きに連動することをめざしますが、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、前記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まれます。）。
- ・モニタリング結果は、原則月1回（必要に応じ随時）開催される運用リスクの管理に関する委員会に報告され、委員会は適切な運用リスク管理に必要な措置を講じることとしています。

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

ありません。

(2) 【換金（解約）手数料】

ありません。

(3) 【信託報酬等】

信託報酬総額	配分		
	委託者	指定販売会社	受託者
純資産総額に対して 年率0.840% (税抜 0.80%)	純資産総額に対して 年率0.273% (税抜 年0.26%)	純資産総額に対して 年率0.504% (税抜 年0.48%)	純資産総額に対して 年率0.063% (税抜 年0.06%)

「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、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 外国株式インデックス マザーファンド	日本	3,535,796,890	100.00
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		29,101	0.00
合計(純資産総額)		3,535,825,991	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 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。

(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 外国株式インデックス マザーファンド	4,082,906,340	0.8662	3,536,723,020	0.8660	3,535,796,890	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	100.00
合計	100.00

(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 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。

(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) (分配落)	550,519 550,519	(分配付) (分配落)	0.8348 0.8348
第2期計算期間末 (平成15年 9月30日)	(分配付) (分配落)	152,732,502 152,732,502	(分配付) (分配落)	0.9346 0.9346
第3期計算期間末 (平成16年 9月30日)	(分配付) (分配落)	239,857,961 239,857,961	(分配付) (分配落)	1.0683 1.0683
第4期計算期間末 (平成17年 9月30日)	(分配付) (分配落)	467,609,293 467,609,293	(分配付) (分配落)	1.2697 1.2697
第5期計算期間末 (平成18年10月 2日)	(分配付) (分配落)	1,019,578,148 1,019,578,148	(分配付) (分配落)	1.5145 1.5145
第6期計算期間末 (平成19年10月 1日)	(分配付) (分配落)	2,421,339,528 2,421,339,528	(分配付) (分配落)	1.7991 1.7991
第7期計算期間末 (平成20年 9月30日)	(分配付) (分配落)	2,217,609,846 2,217,609,846	(分配付) (分配落)	1.1647 1.1647
第8期計算期間末 (平成21年 9月30日)	(分配付) (分配落)	2,713,326,626 2,713,326,626	(分配付) (分配落)	1.0103 1.0103
第9期計算期間末 (平成22年 9月30日)	(分配付) (分配落)	3,476,919,609 3,476,919,609	(分配付) (分配落)	1.0042 1.0042
平成21年10月末日		2,849,843,479		1.0297
11月末日		2,827,764,063		0.9991
12月末日		3,124,489,820		1.0836
平成22年 1月末日		2,985,463,743		1.0049
2月末日		3,033,640,099		1.0025
3月末日		3,450,718,278		1.1165
4月末日		3,580,728,718		1.1404
5月末日		3,168,861,822		0.9880
6月末日		3,039,050,564		0.9275
7月末日		3,311,603,261		0.9838
8月末日		3,129,157,083		0.9192
9月末日		3,476,919,609		1.0042
10月末日		3,535,825,991		1.0031

【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）	16.5
第2期計算期間（平成14年10月 1日～平成15年 9月30日）	12.0
第3期計算期間（平成15年10月 1日～平成16年 9月30日）	14.3
第4期計算期間（平成16年10月 1日～平成17年 9月30日）	18.9
第5期計算期間（平成17年10月 1日～平成18年10月 2日）	19.3
第6期計算期間（平成18年10月 3日～平成19年10月 1日）	18.8
第7期計算期間（平成19年10月 2日～平成20年 9月30日）	35.3
第8期計算期間（平成20年10月 1日～平成21年 9月30日）	13.3
第9期計算期間（平成21年10月 1日～平成22年 9月30日）	0.6

(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。

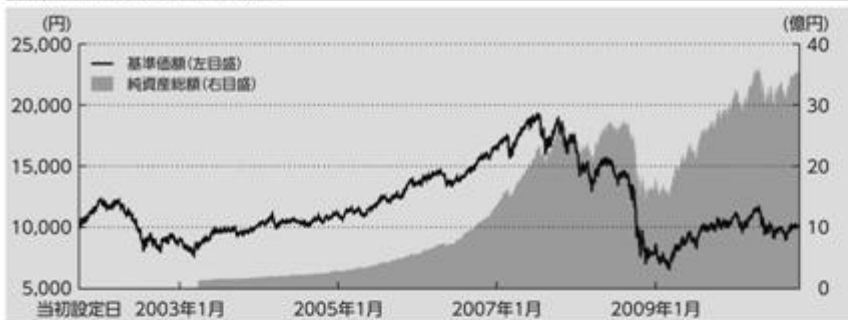
(注2)小数第2位を四捨五入しております。

（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	10,031円
純資産総額	35億円

〈基準価額の騰落率〉

1ヶ月	-0.11%
3ヶ月	1.96%
6ヶ月	-12.04%
1年	-2.58%
3年	-45.29%
5年	-20.17%
設定来	0.31%

※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

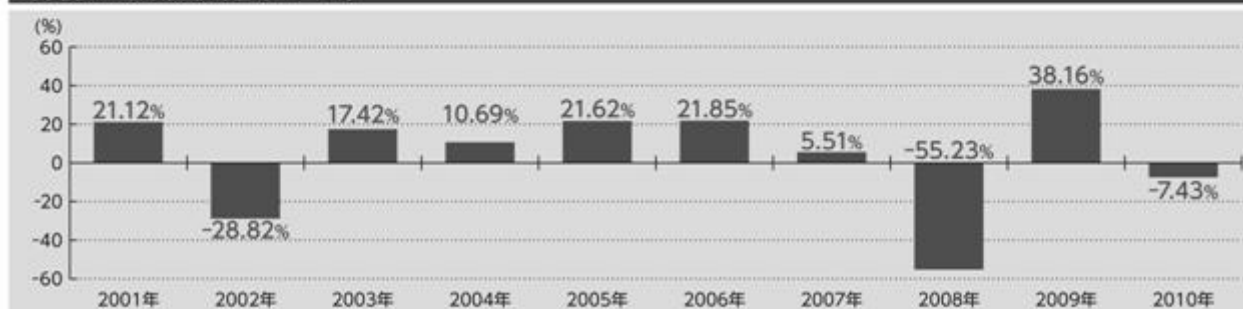
決算期	2006年10月	2007年10月	2008年9月	2009年9月	2010年9月
分配金	0円	0円	0円	0円	0円

※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

銘柄名	国/地域	種類	業種	実質投資比率
EXXON MOBIL	アメリカ	株式	エネルギー	1.6%
APPLE INC	アメリカ	株式	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	1.3%
MICROSOFT CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	1.0%
NESTLE SA - REGISTERED	スイス	株式	食品・飲料・タバコ	0.9%
HSBC HOLDINGS PLC (GB)	イギリス	株式	銀行	0.9%
PROCTER & GAMBLE CO	アメリカ	株式	家庭用品・パーソナル用品	0.8%
INTL BUSINESS MACHINES CORP	アメリカ	株式	ソフトウェア・サービス	0.8%
JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	株式	医薬品・バイオテクノロジー	0.8%
GENERAL ELECTRIC CO	アメリカ	株式	資本財	0.8%
CHEVRON CORP	アメリカ	株式	エネルギー	0.8%

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。

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)	659,490		659,490
第2期計算期間 (平成14年10月1日～平成15年9月30日)	168,999,337	6,237,246	163,421,581

第3期計算期間 (平成15年10月 1日～平成16年 9月30日)	80,596,350	19,487,339	224,530,592
第4期計算期間 (平成16年10月 1日～平成17年 9月30日)	180,370,659	36,626,429	368,274,822
第5期計算期間 (平成17年10月 1日～平成18年10月 2日)	398,392,824	93,445,361	673,222,285
第6期計算期間 (平成18年10月 3日～平成19年10月 1日)	894,934,442	222,294,287	1,345,862,440
第7期計算期間 (平成19年10月 2日～平成20年 9月30日)	879,668,207	321,508,548	1,904,022,099
第8期計算期間 (平成20年10月 1日～平成21年 9月30日)	1,067,367,697	285,659,994	2,685,729,802
第9期計算期間 (平成21年10月 1日～平成22年 9月30日)	1,267,126,214	490,484,020	3,462,371,996

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

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

(イ) 申込手続

本ファンドの受益権の取得申込者は、指定販売会社に取引口座を開設のうえ、申込みを行います。取得申込みは、申込期間における毎営業日に、指定販売会社の営業所等で受け付けます。ただし、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、フランクフルト証券取引所、ユーロネクスト パリ証券取引所のいずれかの取引所あるいはニューヨークまたはロンドンの銀行の休業日においては、取得の申込みを受け付けないものとし、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、フランクフルト証券取引所、ユーロネクスト パリ証券取引所、ニューヨークおよびロンドンの銀行の休業日については、委託者または指定販売会社にお問い合わせください。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。）

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

のとします。

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「自動けいぞく投資コース」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す。なお、指定販売会社によっては、定時定額で購入する「自動購入サービス」を利用することもできます。当該サービスを利用する場合には指定販売会社との間で「自動購入サービス」に関する取り決め（指定販売会社によっては、当該契約について、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。）を行うものとします。

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

- (ロ) 申込単位
1円以上1円単位
- (ハ) 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。ただし、ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、フランクフルト証券取引所、ユーロネクスト パリ証券取引所のいずれかの取引所あるいはニューヨークまたはロンドンの銀行の休業日においては、ご解約の請求を受け付けられないものとします。ニューヨーク証券取引所、ロンドン証券取引所、フランクフルト証券取引所、ユーロネクスト パリ証券取引所、ニューヨークおよびロンドンの銀行の休業日については、委託者または指定販売会社にお問い合わせください。委託者へのお問い合わせ先は、前記「1申込（販売）手続等（イ）申込手続」に記載されている先と同じです。

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、振替受益権をもって行うものとします。

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

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

「信託財産留保金」（以下「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、前記「1申込（販売）手続等（イ）申込手続」に記載されている先と同じです。

（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「1申込（販売）手続等（イ）申込手続」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である株式の評価方法

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、本ファンドの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。

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。委託者へのお問い合わせ先は、前記「1申込（販売）手続等（イ）申込手続」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1万口当りに換算した価額で

行われます。

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

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

(4) 【計算期間】

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

(5) 【その他】

(イ) 信託の終了

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

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

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

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

(ロ) 投資信託約款の変更

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

旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

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

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

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

(二) 運用報告書

委託者は、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 DC外国株式インデックス・オープン

(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	11,434,863	19,304,152
親投資信託受益証券	2,712,881,197	3,475,920,376
未収利息	24	50
流動資産合計	2,724,316,084	3,495,224,578
資産合計	2,724,316,084	3,495,224,578
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,159,593	4,226,309
未払受託者報酬	729,412	1,043,477
未払委託者報酬	8,996,020	12,869,439
その他未払費用	104,433	165,744
流動負債合計	10,989,458	18,304,969
負債合計	10,989,458	18,304,969
純資産の部		
元本等		
元本	2,685,729,802	3,462,371,996
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	27,596,824	14,547,613
（分配準備積立金）	-	221,096,554
元本等合計	2,713,326,626	3,476,919,609
純資産合計	2,713,326,626	3,476,919,609
負債純資産合計	2,724,316,084	3,495,224,578

(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	6,898	7,169
有価証券売買等損益	151,548,388	1,083,609
営業収益合計	151,541,490	1,090,778
営業費用		
受託者報酬	1,254,640	1,990,453
委託者報酬	15,473,860	24,548,683
その他費用	104,433	165,744
営業費用合計	16,832,933	26,704,880
営業利益又は営業損失（ ）	168,374,423	25,614,102
経常利益又は経常損失（ ）	168,374,423	25,614,102
当期純利益又は当期純損失（ ）	168,374,423	25,614,102
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（ ）	60,549,292	6,981,682
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	313,587,747	27,596,824
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	27,010,714
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	27,010,714
剰余金減少額又は欠損金増加額	178,165,792	7,464,141
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	27,978,299	7,464,141
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	150,187,493	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	27,596,824	14,547,613

(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	1,904,022,099円	2,685,729,802円
期中追加設定元本額	1,067,367,697円	1,267,126,214円
期中一部解約元本額	285,659,994円	490,484,020円
期末元本額	2,685,729,802円	<u>3,462,371,996円</u>
2. 計算期間末日における受益権の総数	2,685,729,802口	3,462,371,996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(1,560,820,332円)及び分配準備積立金(259,338,078円)により、分配対象収益は1,820,158,410円(1万口当たり6,777円14銭)ですが、分配は見送りとさせていただきます。	計算期間末における経費控除後の配当等収益(0円)、経費控除後繰越欠損補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(2,125,405,319円)及び分配準備積立金(221,096,554円)により、分配対象収益は2,346,501,873円(1万口当たり6,777円15銭)ですが、分配は見送りとさせていただきます。

(金融商品に関する注記)

(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	2,712,881,197	124,699,879
合 計	2,712,881,197	124,699,879

(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	5,946,789
合 計	5,946,789

（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 = 1.0103円	1口当たり純資産額 = 1.0042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 外国株式インデックス マザーファンド	4,011,911,792	3,475,920,376
合計		4,011,911,792	3,475,920,376

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外国株式インデックス・オープン」は、「住信 外国株式インデックス 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、「住信 外国株式インデックス マザーファンド」の受益証券です。

「住信 外国株式インデックス 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 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外国株式インデックス・オープン」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>（1）株式 同左</p> <p>（2）投資信託受益証券 同左</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>(3) 投資証券 同左</p> <p>(4) 先物取引 同左</p> <p>(5) 外国為替予約 同左</p>
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>投資信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として我が国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p> <p>なお、外貨建資産等の会計処理は「投資信託財産の計算に関する規則（平成12年総理府令第133号）」第60条及び第61条に基づいております。</p>	同左
3. 収益及び費用の計上基準	<p>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。</p>	<p>受取配当金 同左</p>

(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 マイセレクション25	42,997,098円	33,255,194円
すみしん マイセレクション50	136,762,135円	126,303,991円
すみしん マイセレクション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	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。 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	(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 STOX	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	
	AKAMA I 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
ENTERGY 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
FREEMONT-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
SCHRÖDERS 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	
	WHEELOCK & 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 SYSYEMS	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 INFRAESTRUCTURAS	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	
小計		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。

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	3,547,084,185 円
負債総額	11,258,194 円
純資産総額（ - ）	3,535,825,991 円
発行済口数	3,525,021,320 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0031 円

（参考情報）

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

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。

（二）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るときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

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します。）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
単体型株式投資信託	0	0
単体型公社債投資信託	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		当事業年度	
	(自	平成20年4月1日	(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)
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 (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)
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 其他有価証券	46,016	46,016	-
(4)未払金	(520,453)	(520,453)	-

(*)負債に計上されているものについては、()で示しております。

(注1) 金融商品の時価の算定方法及び有価証券取引に関する事項

(1)現金及び預金、及び(2)未収委託者報酬

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

(3)投資有価証券

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

(4)未払金

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

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

(注3) 金銭債権の決算日後の償還予定額

(単位:千円)

	1年以内	1年超5年以内	5年超10年以内	10年超
現金及び預金	5,642,056	-	-	-

未収委託者報酬	942,664	-	-	-
---------	---------	---	---	---

(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> <table> <tr> <td>退職給付債務</td> <td>91,962千円</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td>91,962千円</td> </tr> </table> <p>(1) 当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。</p> <p>(2) 当社の退職給付債務は退職一時金のみです。</p> <p>3. 退職給付費用に関する事項</p> <table> <tr> <td>退職給付費用</td> <td>65,654千円</td> </tr> </table> <p>(1) 当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。</p>	退職給付債務	91,962千円	退職給付引当金	91,962千円	退職給付費用	65,654千円	<p>1. 採用している退職給付制度の概要</p> <p>同左</p> <p>2. 退職給付債務及びその他に関する事項</p> <table> <tr> <td>退職給付債務</td> <td>122,901千円</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金</td> <td>122,901千円</td> </tr> </table> <p>(1) 同左</p> <p>(2) 同左</p> <p>3. 退職給付費用に関する事項</p> <table> <tr> <td>退職給付費用</td> <td>52,327千円</td> </tr> </table> <p>(1) 同左</p>	退職給付債務	122,901千円	退職給付引当金	122,901千円	退職給付費用	52,327千円
退職給付債務	91,962千円												
退職給付引当金	91,962千円												
退職給付費用	65,654千円												
退職給付債務	122,901千円												
退職給付引当金	122,901千円												
退職給付費用	52,327千円												

<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>4. 退職給付債務等の計算基礎</p> <p>当社は簡便法を採用しておりますので、基礎率等については、記載しておりません。</p>	<p>(2) 金額には確定拠出年金への掛金支払額13,326千円を含んでおります。</p> <p>4. 退職給付債務等の計算基礎</p> <p>同左</p>
--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	--------------------------------------------------------------------------------

(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)																										
<p>1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳</p> <p>(繰延税金資産)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">賞与引当金損金算入限度超過額</td> <td style="text-align: right;">32,543千円</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金損金算入限度超過額</td> <td style="text-align: right;">37,419千円</td> </tr> <tr> <td>有価証券評価差額</td> <td style="text-align: right;">17,125千円</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">811千円</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産 合計</td> <td style="text-align: right;">87,900千円</td> </tr> </table> <p>(繰延税金負債)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">未収還付事業税</td> <td style="text-align: right;">6,459千円</td> </tr> <tr> <td>繰延税金負債 合計</td> <td style="text-align: right;">6,459千円</td> </tr> </table> <p>差引 繰延税金資産の純額 81,441千円</p> <p>2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳</p> <p>法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。</p>	賞与引当金損金算入限度超過額	32,543千円	退職給付引当金損金算入限度超過額	37,419千円	有価証券評価差額	17,125千円	その他	811千円	繰延税金資産 合計	87,900千円	未収還付事業税	6,459千円	繰延税金負債 合計	6,459千円	<p>1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳</p> <p>(繰延税金資産)</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 80%;">未払事業税</td> <td style="text-align: right;">15,392千円</td> </tr> <tr> <td>賞与引当金損金算入限度超過額</td> <td style="text-align: right;">28,726千円</td> </tr> <tr> <td>退職給付引当金損金算入限度超過額</td> <td style="text-align: right;">50,008千円</td> </tr> <tr> <td>有価証券評価差額</td> <td style="text-align: right;">4,321千円</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">1,025千円</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産 合計</td> <td style="text-align: right;">99,475千円</td> </tr> </table> <p>(繰延税金負債)</p> <p style="text-align: center;">-</p> <p>2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳</p> <p style="text-align: center;">同左</p>	未払事業税	15,392千円	賞与引当金損金算入限度超過額	28,726千円	退職給付引当金損金算入限度超過額	50,008千円	有価証券評価差額	4,321千円	その他	1,025千円	繰延税金資産 合計	99,475千円
賞与引当金損金算入限度超過額	32,543千円																										
退職給付引当金損金算入限度超過額	37,419千円																										
有価証券評価差額	17,125千円																										
その他	811千円																										
繰延税金資産 合計	87,900千円																										
未収還付事業税	6,459千円																										
繰延税金負債 合計	6,459千円																										
未払事業税	15,392千円																										
賞与引当金損金算入限度超過額	28,726千円																										
退職給付引当金損金算入限度超過額	50,008千円																										
有価証券評価差額	4,321千円																										
その他	1,025千円																										
繰延税金資産 合計	99,475千円																										

(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 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

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。

株式会社北海道銀行（指定販売会社）

1) 資本金の額

平成22年3月末日現在 93,524百万円

2)事業の内容

銀行法にもとづき銀行業を営んでいます。

株式会社三井住友銀行（指定販売会社）

1)資本金の額

平成22年3月末日現在 1,770,996百万円

2)事業の内容

銀行法にもとづき銀行業を営んでいます。

株式会社福岡銀行（指定販売会社）

1)資本金の額

平成22年3月末日現在 82,329百万円

2)事業の内容

銀行法にもとづき銀行業を営んでいます。

損保ジャパンDC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 3,000百万円

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。

株式会社みずほ銀行（指定販売会社）

1)資本金の額

平成22年3月末日現在 700,000百万円

2)事業の内容

銀行法にもとづき銀行業を営んでいます。

2【関係業務の概要】

(イ) 受託者は、以下の業務を行います。

投資信託財産の保管・管理

投資信託財産の計算

投資信託財産に関する報告書の作成

その他前記の業務に付随する業務

(ロ) 指定販売会社は、以下の業務を行います。

受益権の募集・販売の取扱い

追加設定の申込受付事務

受益者に対する収益分配金の再投資事務

受益者に対する一部解約等の事務

受益者に対する一部解約金および償還金の支払事務

受益者に対する運用報告書の交付

その他前記の業務に付随する業務

指定販売会社によって引き受ける業務が異なる場合があります。

3【資本関係】

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

その他の前記関係法人と委託者との間に資本関係はありません。

<再信託受託会社の概要>

名称：日本トラスティ・サービス信託銀行株式会社

設立年月日：平成12年6月20日

資本金の額：51,000百万円（平成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5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外国株式インデックス・オープンの平成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外国株式インデックス・オープンの平成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 公認会計士 壁谷 惠嗣 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、「ファンドの経理状況」に掲げられているすみしん DC外国株式インデックス・オープンの平成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、すみしん DC外国株式インデックス・オープンの平成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。