

【表紙】

【提出書類】 有価証券報告書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成21年7月3日提出

【計算期間】 第7期特定期間（自 平成20年10月15日 至 平成21年4月14日）

【ファンド名】 住信 毎月分配パッケージファンド
（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。）

【発行者名】 住信アセットマネジメント株式会社

【代表者の役職氏名】 取締役社長 平 田 誠 一

【本店の所在の場所】 東京都中央区八重洲2丁目3番1号

【事務連絡者氏名】 投信業務部長 橋 詰 廣 志

【連絡場所】 東京都中央区八重洲2丁目3番1号

【電話番号】 03-6259-3801

【縦覧に供する場所】 該当ありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

本ファンドは、投資対象となる投資信託証券の具体的な投資対象地域および投資手法等を考慮のうえ、投資信託証券への投資を通じて、外国債券と内外の株式に投資し、インカムゲイン（利子・配当収益等）を確保しつつ、分散投資を行うことでリスクの低減に努め、投資信託財産の中長期的な成長をはかることを目指して運用を行います。

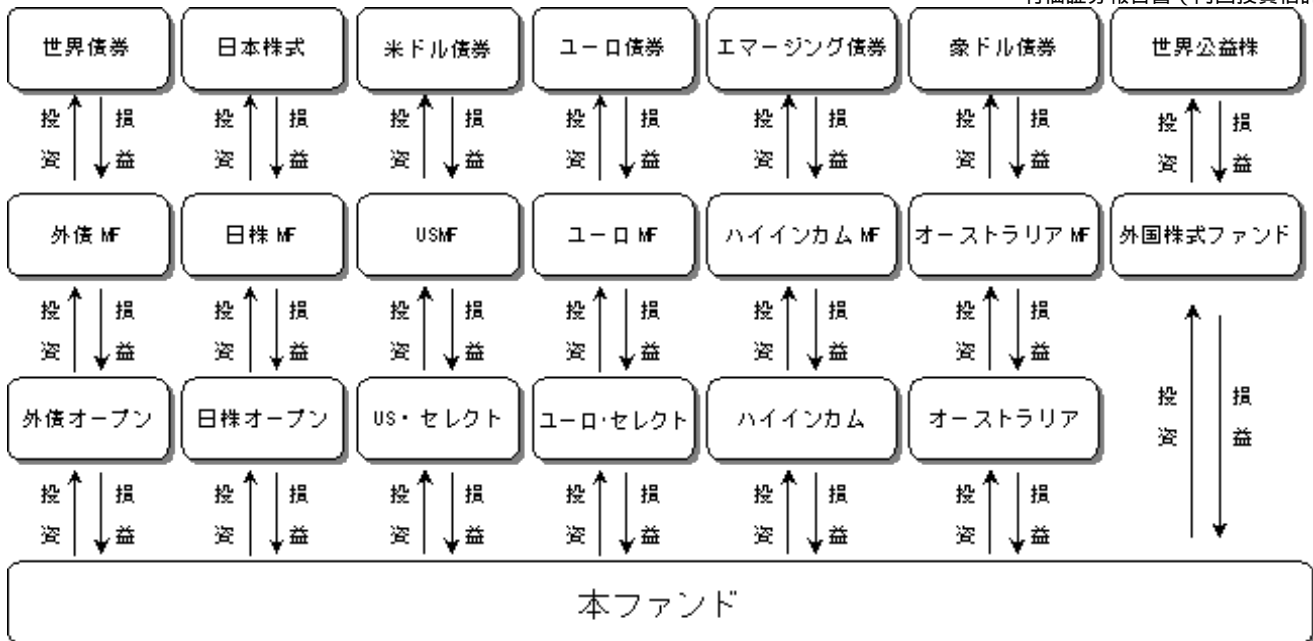
なお、信託金の限度額は、5,000億円とします。ただし、委託者は、受託者と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

[ファンドの特色]

外国の債券と内外の株式への投資は、以下の投資対象投資信託証券への投資を通じて行います。

1. 住信 FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）
2. 住信 FOFs用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）
3. JPM・US・セレクト（適格機関投資家専用）
4. ピクテ・ユーロ・セレクト・インカム（適格機関投資家専用）
5. ピクテ・ハイインカム・ソブリン・ファンド（適格機関投資家専用）
6. LM・オーストラリア毎月分配型ファンド（適格機関投資家専用）
7. ピクテ・グローバル・セレクション・ファンド - グローバル・ユーティリティーズ・エクイティ・ファンド クラスSAM分配型受益証券（以下「グローバル・ユーティリティーズ・エクイティ・ファンド」ということがあります。）
 - 1 「1.」～「7.」のそれぞれを「ファンド」ということがあります。
 - 2 「1.」～「6.」は国内契約型の私募投資信託です。本書においては、「（適格機関投資家専用）」を省略してファンド名を表記することがあります。
 - 3 「7.」はルクセンブルグ籍の外国証券投資信託です。
 - 4 各ファンドの概要は後記「投資対象投資信託証券の概要」をご覧ください。
 - 5 今後、上記の投資対象投資信託証券が除外もしくは新たに追加される場合があります。名称等が変更となることもあります。
 - 6 実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。

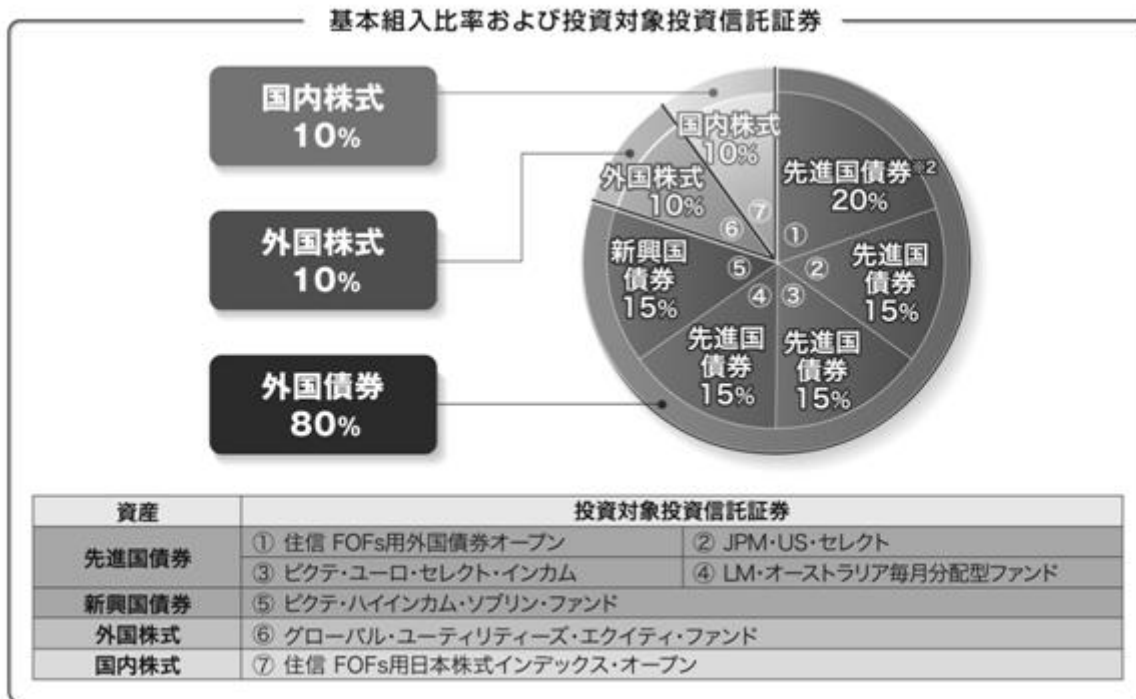
< スキーム図 >



- 1 上記の「外債オープン」は「住信 FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）」、「外債MF」は当該ファンドのマザーファンドです。
- 2 上記の「日株オープン」は「住信 FOFs用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）」、「日株MF」は当該ファンドのマザーファンドです。
- 3 上記の「US・セレクト」は「JPM・US・セレクト（適格機関投資家専用）」、「USMF」は当該ファンドのマザーファンドです。
- 4 上記の「ユーロ・セレクト」は「ピクテ・ユーロ・セレクト・インカム（適格機関投資家専用）」、「ユーロMF」は当該ファンドのマザーファンドです。
- 5 上記の「ハイインカム」は「ピクテ・ハイインカム・ソブリン・ファンド（適格機関投資家専用）」、「ハイインカムMF」は当該ファンドのマザーファンドです。
- 6 上記の「オーストラリア」は「LM・オーストラリア毎月分配型ファンド（適格機関投資家専用）」、「オーストラリアMF」は当該ファンドのマザーファンドです。
- 7 上記の「外国株式ファンド」は「グローバル・ユーティリティーズ・エクイティ・ファンド」です。

外国の債券と国内外の株式に分散投資します。

- ・主として、投資対象投資信託証券への投資を通じて、外国の債券と国内外の株式に投資し、安定したインカムゲインの確保と投資信託財産の中長期的な成長を目指します。
- ・実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
- ・本ファンドはファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。
- ・基本組入比率¹および投資対象投資信託証券は以下の通りです。



1 基本組入比率には一定の変動幅を設けます。また、基本組入比率は市場環境の変化等に応じて見直しを行うことがあります。なお、見直しにあたっては住友信託銀行株式会社の助言を受けます。

2 には短期金融資産を含みます。

毎月の安定分配を目指します。

・毎月14日（休業日の場合は翌営業日）に決算を行い、インカムゲインを中心に安定した分配を目指します。



* 分配金額は収益分配方針にもとづき委託者が決定します。市場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。また、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。

[ファンドの商品分類]

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

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

商品分類表

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

(注) 本ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

[分類における定義]

分類項目	該当分類	分類の定義
単位型・追加型	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	内外	目論見書または投資信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産 (収益の源泉)	資産複合	目論見書または投資信託約款において、株式、債券、不動産投信、その他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
--------	------	--------	------	-------

株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (日本を含む)	ファミリーファンド	あり ()
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年2回	日本		
不動産投信	年4回	北米		
その他資産 (投資信託証券(資産複 合(株式、債券、短期金 融資産)、(資産配分固 定型)))	年6回 (隔月)	欧州		
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型	年12回 (毎月)	アジア	ファンド・オブ・ファンズ	なし
	日々	オセアニア		
	その他 ()	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(資産複合(株式、債券、短期金融資産)、(資産配分固定型)))	目論見書または投資信託約款において、組入れている資産が主として投資信託証券であり(投資形態がファミリーファンドまたはファンド・オブ・ファンズのものを含みます。)、実質的に複数資産(本ファンドにおいては、株式、債券、短期金融資産)を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいいます。
決算頻度	年12回(毎月)	目論見書または投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいいます。
投資対象地域	グローバル (日本を含む)	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界(日本を含みます。)の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファンド・オブ・ファンズ	「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいいます。
為替ヘッジ	なし	目論見書または投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。

(ご参考) 投資対象投資信託証券の概要

「グローバル・ユーティリティーズ・エクイティ・ファンド」はルクセンブルグ籍の外国投資信託です。それ以外の各投資対象投資信託証券は、国内籍の契約型株式投資信託 / 適格機関投資家向け私募投資信託であ

り、ファミリーファンド方式 で運用されます。

「ファミリーファンド方式」とは、ベビーファンド（各投資対象投資信託証券）の資金を主としてマザーファンド（各投資対象投資信託証券における各投資対象マザーファンド）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仕組みです。

以下の内容は、本書提出日現在、委託者が知り得る情報にもとづいて作成しておりますが、今後、記載内容が変更となることがあります。

1. 住信 FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）

委託会社	住信アセットマネジメント株式会社
主な投資対象	「住信 外国債券インデックス マザーファンド」（本概要において、以下「マザーファンド」または「マザーファンド受益証券」といいます。）を通じて、主として日本を除く世界主要国（シティグループ世界国債インデックス採用国）の公社債に投資します。
運用の基本方針	マザーファンドを通じて、日本を除く世界主要国の公社債からなる債券市場全体の動きを捉えつつ、安定分配を行うことを目指して運用を行います。
ベンチマーク	ありません。
投資態度	主として、マザーファンド受益証券に投資し、日本を除く世界主要国の国債等からなる債券市場全体の動きを捉える運用を行います。 外国の債券および短期金融資産に直接投資する場合があります。 債券の実質投資比率は、原則90%以上とします。 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。
主な投資制限	株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 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。 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。 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。 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。 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。 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
決算・分配方針	毎月決算を行い、分配対象額の範囲内で分配します。ただし分配対象額が少額の場合は分配を行わないことがあります。
信託報酬率	純資産総額に対して年率0.3675%（税抜0.35%）

2. 住信 FOFs用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）

委託会社	住信アセットマネジメント株式会社
------	------------------

主な投資対象	「住信 国内株式インデックス マザーファンド」（本概要において、以下「マザーファンド」または「マザーファンド受益証券」といいます。）を通じて、主として、わが国の取引所に上場されている株式へ投資します。
運用の基本方針	マザーファンドを通じて、東証株価指数（以下「TOPIX」といいます。）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
ベンチマーク	TOPIX
投資態度	<p>主として、マザーファンド受益証券に投資し、TOPIXと連動する投資成果を目標として運用を行います。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の投資信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の投資信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資は、原則として投資信託財産総額の50%以下とします。</p> <p>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。</p> <p>国内外において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引を行うことができます。</p>
主な投資制限	<p>株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>外貨建資産への投資は、行いません。</p> <p>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。</p> <p>同一銘柄の株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
決算・分配方針	毎月決算を行い、分配対象額の範囲内で分配します。ただし分配対象額が少額の場合は分配を行わないことがあります。
信託報酬率	純資産総額に対して年率0.2415%（税抜0.23%）

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

- 1) TOPIXの指数値およびTOPIXの商標は、(株)東京証券取引所の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利およびTOPIXの商標に関するすべての権利は(株)東京証券取引所が有しています。
- 2) (株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標の変更もしくは使用の停止を行うことができます。
- 3) (株)東京証券取引所は、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの指数の引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。
- 4) (株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値およびそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任

を負いません。

- 5) 「住信 FOFs用日本株式インデックス・オープン」が主要投資対象とする「住信 国内株式インデックス マザーファンド」は、TOPIXの指数値に連動した投資成果を目標として運用しますが、当該ファンドの基準価額とTOPIXの指数値が著しく乖離することがあります。
- 6) 「住信 FOFs用日本株式インデックス・オープン」および「住信 国内株式インデックス マザーファンド」は、(株)東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではありません。
- 7) (株)東京証券取引所は、「住信 国内株式インデックス マザーファンド」を投資対象とする「住信 FOFs用日本株式インデックス・オープン」の購入者または公衆に対し、「住信 FOFs用日本株式インデックス・オープン」および「住信 国内株式インデックス マザーファンド」の説明、投資のアドバイスをする義務はありません。
- 8) (株)東京証券取引所は、委託者または「住信 国内株式インデックス マザーファンド」を投資対象とする「住信 FOFs用日本株式インデックス・オープン」の購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。
- 9) 上記の項目に限らず、(株)東京証券取引所は「住信 FOFs用日本株式インデックス・オープン」および「住信 国内株式インデックス マザーファンド」の発行または売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

3. JPM・US・セレクト（適格機関投資家専用）

委託会社	JPモルガン・アセット・マネジメント株式会社
主な投資対象	米ドル建て米国国債（米国財務省証券）を中心に、信用度がそれと同等とみなされる米国政府抵当金庫保証モーゲージ・バック証券（ジニー・メイ・パス・スルー証券）も投資対象とするJPM USトレジャリー・インカム・マザーファンド（本概要において、以下「マザーファンド」といいます。）を主要投資対象とします。
運用の基本方針	マザーファンドを通じて、投資信託財産の中長期的な成長をはかることを目指します。
ベンチマーク	ありません。
投資態度	マザーファンドでは、基本資産配分として、米国国債（米国財務省証券）への投資比率を約80%、米国政府抵当金庫保証モーゲージ・バック証券（ジニー・メイ・パス・スルー証券）への投資比率を約20%程度とし、米国政府抵当金庫保証モーゲージ・バック証券（ジニー・メイ・パス・スルー証券）への投資比率は40%を超えません。 （上記の基本資産配分は市場動向等により、変更する場合があります。） マザーファンドの組入債券全体の平均格付は米国国債（米国財務省証券）と同等とします。 原則為替ヘッジは行いません。
主な投資制限	株式への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 投資信託証券（マザーファンドの受益証券を除く）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。 外貨建資産（外貨建有価証券、外国通貨表示の預金その他の資産をいいます。）への投資割合は、制限を設けません。 デリバティブ取引（有価証券先物取引等、スワップ取引、金利先渡取引および為替先渡取引をいいます。）の利用はヘッジ目的に限定しません。
決算・分配方針	毎月決算を行い、分配対象額の範囲内で分配します。ただし分配対象額が少額の場合は分配を行わないことがあります。
信託報酬率	純資産総額に対して年率0.4095%（税抜0.39%）

4. ピクテ・ユーロ・セレクト・インカム（適格機関投資家専用）

委託会社	ピクテ投信投資顧問株式会社
主な投資対象	ピクテ・ユーロ最高格付国債ファンド・マザーファンド（マザーファンドは、質の高いユーロ通貨採用国の国債を主要投資対象とします。）（本概要において、以下「マザーファンド」といいます。）
運用の基本方針	マザーファンドを通じて、質の高いユーロ通貨採用国の国債に投資し、安定的かつより優れた分配金原資の獲得を目的として運用を行います。
ベンチマーク	ありません。
投資態度	<p>マザーファンドへの投資を通じて、原則として最高格付のユーロ通貨採用国の国債に投資し、利金等収益の確保と売買益の獲得を目指します。</p> <p>最高格付とは、ユーロ通貨採用国内での最高格付を意味します。各国の格付けは指定格付機関が付与した中での最良の格付けを参考とします。</p> <p>ユーロ通貨採用国の中で、国債発行残高比率の高い主要国については、その格付けが最高格付でなくなった場合でも、ファンドの流動性と分散の確保を目的として当該国債に投資することもあります。</p> <p>実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。</p> <p>有価証券先物取引等を行うことができます。</p> <p>スワップ取引を行うことができます。</p>
主な投資制限	<p>株式への投資は、転換社債を転換ならびに転換社債型新株予約権付社債の新株予約権を行使したものに限り、株式への実質投資割合は投資信託財産の純資産総額の30%以内とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p> <p>投資信託証券（親投資信託受益証券を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以内とします。</p>
決算・分配方針	毎月決算を行い、分配対象額の範囲内で分配します。ただし分配対象額が少額の場合は分配を行わないことがあります。
信託報酬率	純資産総額に対して年率0.4515%（税抜0.43%）

5. ピクテ・ハイインカム・ソブリン・ファンド（適格機関投資家専用）

委託会社	ピクテ投信投資顧問株式会社
主な投資対象	ピクテ・エマージング・ソブリン債券ファンド・マザーファンド（マザーファンドは、ドル建てのソブリン債券および準ソブリン債券を主要投資対象とします。）（本概要において、以下「マザーファンド」または「マザーファンド受益証券」といいます。）
運用の基本方針	マザーファンドを通じて、主としてドル建てのソブリン債券および準ソブリン債券に投資し、利子等収益の確保と売買益の獲得を目指します。
ベンチマーク	ありません。
投資態度	<p>ピクテ・エマージング・ソブリン債券ファンド・マザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてエマージング・カントリーのドル建てソブリン債券および準ソブリン債券に投資し、利子等収益の確保と売買益の獲得を目指します。</p> <p>債券の実質組入比率については、原則として高位を保ちます。</p> <p>実質的な外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。</p> <p>資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。</p>

主な投資制限	<p>株式への投資は、転換社債を転換ならびに転換社債型新株予約権付社債の新株予約権を行使したものに限り、株式への実質投資割合は投資信託財産の純資産総額の30%以内とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>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5%以内とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p> <p>投資信託証券（親投資信託を除きます。）への実質投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以内とします。</p>
決算・分配方針	毎月決算を行い、分配対象額の範囲内で分配します。ただし分配対象額が少額の場合は分配を行わないことがあります。
信託財産留保金	解約時に基準価額の0.3%が差し引かれます。
信託報酬率	純資産総額に対して年率0.735%（税抜0.70%）

6.LM・オーストラリア毎月分配型ファンド（適格機関投資家専用）

委託会社	レグ・メイソン・アセット・マネジメント株式会社
主な投資対象	LM・豪ドル債券マザーファンド受益証券（本概要において、以下「マザーファンド」または「マザーファンド受益証券」といいます。）を主要投資対象とします。 マザーファンドは、豪ドル建の公社債を主要投資対象とします。
運用の基本方針	マザーファンドを通じて、主として豪ドル建の公社債に投資を行い、投資信託財産の成長と毎月の安定した分配を目指します。
ベンチマーク	ありません。
投資態度	<p>UBSオーストラリア債券インデックス（為替ヘッジなし、円換算ベース）を参考指標として運用を行います。</p> <p>豪ドル建の国債、州政府債、国際機関債、社債、モーゲージ証券および資産担保証券等を主要投資対象とします。投資を行う公社債は、取得時において、原則として格付機関からA - / A3以上の格付を付与されたものとします。</p> <p>デュレーション・コントロール、セクター配分、銘柄選定の3つの戦略により超過収益の獲得を目指します。</p> <p>シナリオ・ディペンデント・オプティマイゼーション（SD0）を活用したデュレーション・コントロールを行います。ポートフォリオの平均デュレーションは、原則として参考指標のデュレーション±1年とします。</p> <p>外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。したがって、基準価額は、円と豪ドルとの為替変動の影響を受けます。</p> <p>ウエスタン・アセット・マネジメント・カンパニー・ピーティーワイ・リミテッドに、マザーファンドの運用の指図に関する権限を委託します。</p> <p>（為替ヘッジなし、円換算ベース）とは、委託者が同インデックスを円ベースに換算したものです。</p>

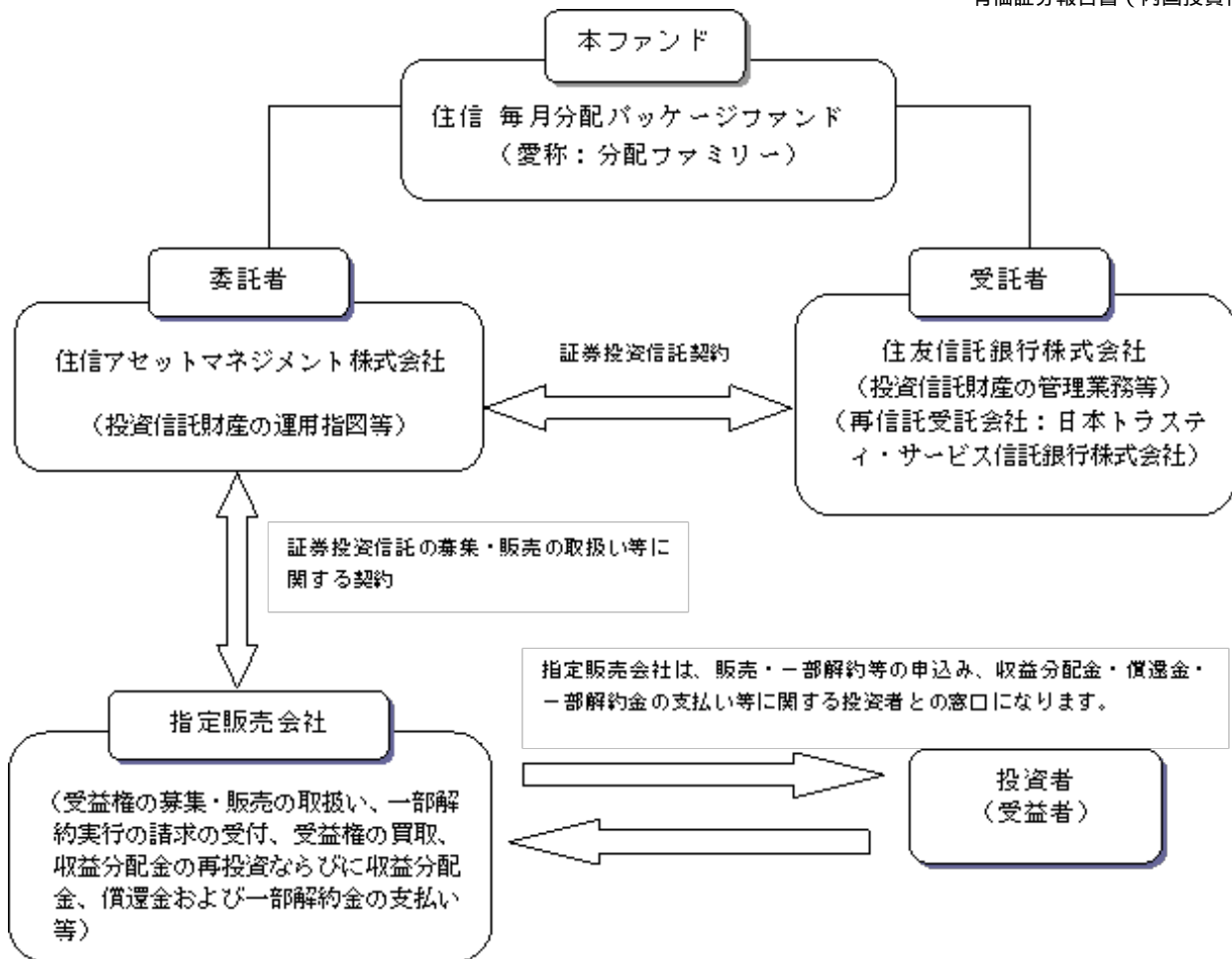
主な投資制限	<p>株式（新株引受権証券等を含みます。）への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の20%以内とします。同一銘柄の株式への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の5%以内とします。</p> <p>新株引受権証券等への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の20%以内とします。同一銘柄の新株引受権証券等への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以内とします。</p> <p>同一銘柄の転換社債等への投資割合は、取得時において投資信託財産の純資産総額の10%以内とします。</p> <p>マザーファンド受益証券以外の投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の5%以内とします。</p> <p>外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。</p>
決算・分配方針	毎月決算を行い、分配対象額の範囲内で分配します。ただし分配対象額が少額の場合は分配を行わないことがあります。
信託報酬率	純資産総額に対して年率0.5565%（税抜0.53%）

7. ピクテ・グローバル・セレクション・ファンド - グローバル・ユーティリティーズ・エクイティ・ファンド クラスSAM分配型受益証券

管理会社	ピクテ・グローバル・セレクション・ファンド・マネジメント（ルクセンブルグ）エス・エイ
主な投資対象	世界の公益企業の発行する高配当利回りの株式
運用の基本方針	主に新興国の企業を含む世界の公益企業の発行する高配当利回りの株式への投資を通じて安定的な収益分配を行うこと、また、長期的な元本の成長を目指すことを目的として運用を行います。
ベンチマーク	ありません。
投資態度	<p>主に高配当利回りの世界（新興国を含めます。）の公益株 に投資し、安定的な収益分配を行うこと、また長期的な元本の成長を目指すことを目的として運用を行います。</p> <p>電力、ガス、水道、電話、通信、運輸、廃棄物処理、石油供給などの企業上場株式への分散投資を基本とします。</p>
主な投資制限	同一発行体の証券のファンド純資産総額に対する投資割合は10%以下としますが、投資顧問会社は通常、同一発行体の証券の投資割合は購入時において5%以下とします。
決算・分配方針	毎月決算を行い、分配対象額の範囲内で分配します。ただし分配対象額が少額の場合は分配を行わないことがあります。
管理報酬率	<p>純資産総額に対して年率0.95%</p> <p>外国投信のため消費税等は課税されません。</p>

(2) 【ファンドの仕組み】

(イ) ファンドの関係法人図



(ロ) 委託会社が関係法人と締結している契約等の概要

受託者との投資信託契約

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

指定販売会社との証券投資信託の募集・販売の取扱い等に関する契約

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

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

なお、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。指定販売会社が引き受ける業務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

(なお、受付時間は営業日の午前9時～午後5時(わが国の取引所が半休日の場合は午前9時～正午)とします。)

(ハ) 委託会社等の概況

資本金

平成21年3月末日現在 3億円

会社の沿革

昭和61年11月1日 住信キャピタルマネジメント株式会社設立

昭和62年 2月20日 投資顧問業の登録

昭和62年 9月 9日 投資一任契約に係る業務の認可

平成 2年10月 1日 住信投資顧問株式会社に商号変更

平成11年 2月15日 住信アセットマネジメント株式会社に商号変更

平成11年 3月25日 証券投資信託委託業の認可

平成19年 9月30日 金融商品取引法施行に伴う金融商品取引業者の登録

大株主の状況（平成21年3月末日現在）

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、投資対象となる投資信託証券の具体的な投資対象地域および投資手法等を考慮のうえ、投資信託証券への投資を通じて、外国の債券と内外の株式に投資し、インカムゲインを確保しつつ、分散投資を行うことでリスクの低減に努め、投資信託財産の中長期的な成長をはかることを目指して運用を行います。

(ロ)運用方法

主たる投資対象

以下の投資信託証券を主要投資対象とします。

- 1.住信 FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）
- 2.住信 FOFs用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）
- 3.JPM・US・セレクト（適格機関投資家専用）
- 4.ピクテ・ユーロ・セレクト・インカム（適格機関投資家専用）
- 5.ピクテ・ハイインカム・ソブリン・ファンド（適格機関投資家専用）
- 6.LM・オーストラリア毎月分配型ファンド（適格機関投資家専用）
- 7.グローバル・ユーティリティーズ・エクイティ・ファンド

投資態度

1)主として、投資対象投資信託証券への投資を通じて、外国の債券と内外の株式への分散投資を行い、インカムゲインを確保しつつ、分散投資を行うことでリスクの低減に努め、投資信託財産の中長期的な成長をはかることを目指して運用を行います。

2)基本資産配分比率は、以下の通りです。

住信 FOFs用外国債券オープン

20%

住信 FOFs用日本株式インデックス・オープン	10%
JPM・US・セレクト	15%
ピクテ・ユーロ・セレクト・インカム	15%
ピクテ・ハイインカム・ソブリン・ファンド	15%
LM・オーストラリア毎月分配型ファンド	15%
グローバル・ユーティリティーズ・エクイティ・ファンド	10%

なお、住信 FOFs用外国債券オープンには、短期金融資産を含みます。また、上記の基本資産配分比率には一定の変動幅を設けます。

- 3)上記の基本資産配分比率は市場環境の変化等に応じて、見直しを行うことがあります。なお基本資産配分比率の見直しにあたっては住友信託銀行株式会社より投資助言を受けます。
- 4)実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジを行いません。
- 5)資金動向や市況動向等の事情によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(2)【投資対象】

(イ)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。

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。）

- イ．有価証券
- ロ．金銭債権
- ハ．約束手形

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、投資対象投資信託証券に投資するほか、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くとともに、本邦通貨表示のものに限ります。）に投資することを指図します。

1. コマーシャル・ペーパーおよび短期社債等
2. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、第1号の証券の性質を有するもの
3. 国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券および短期社債等を除きます。）
4. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
5. 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。）

なお、第3号の証券を以下「公社債」といい、公社債に係る運用の指図は買い現先取引（売戻し条件付の買い入れ）および債券貸借取引（現金担保付き債券借入れ）に限り行うことができるものとします。

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

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

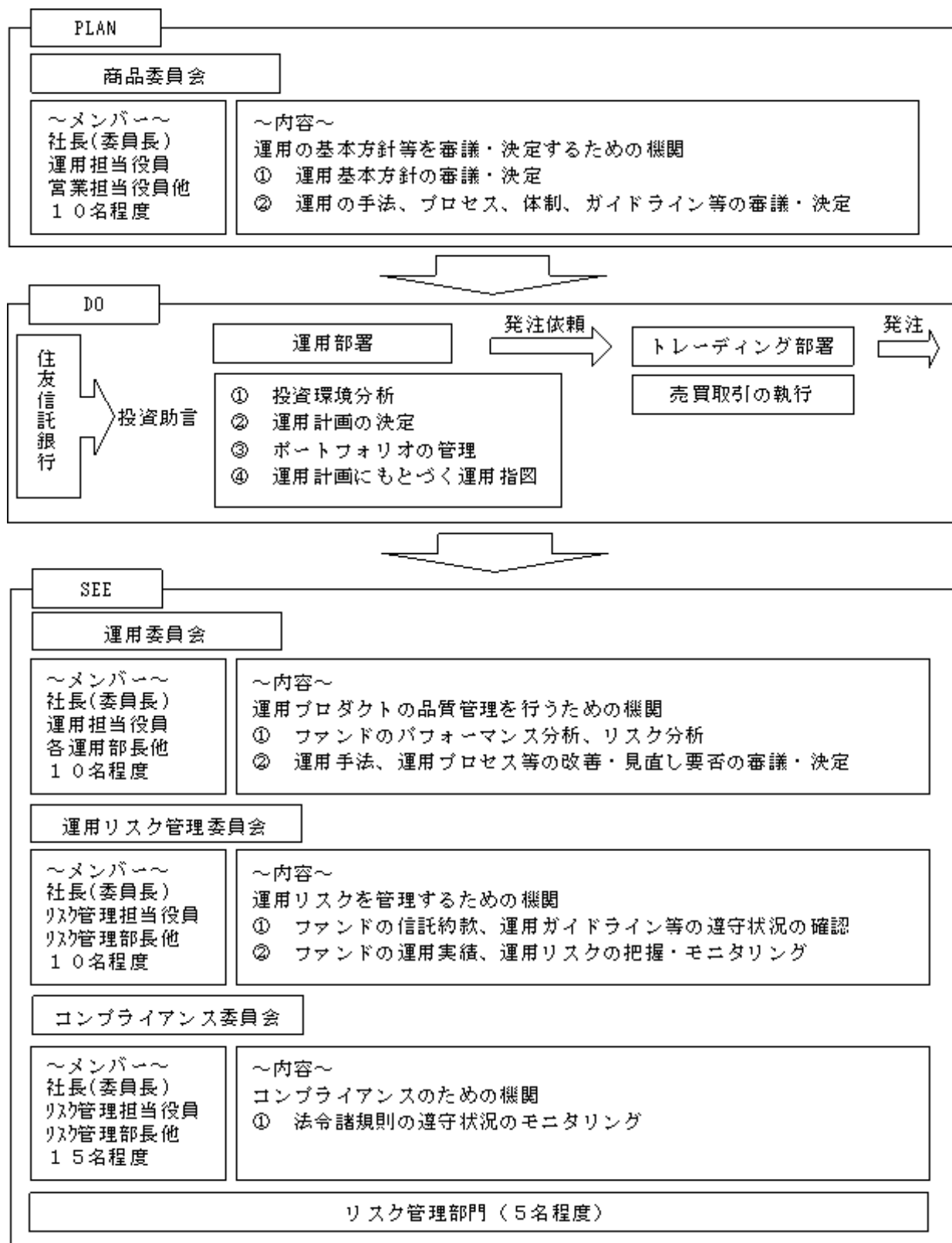
(ニ)上記(ロ)の規定にかかわらず、本ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託者が運用上必要と認めるときは、委託者は、信託金を上記(ハ)に掲げる金融商品により運用することの指図が

できます。

- (ホ) 本ファンドが、本ファンドの純資産総額の10%を超えて投資する可能性のある投資対象ファンドの概要は、「1 ファンドの性格 (1)ファンドの目的及び基本的性格（ご参考）投資対象投資信託証券の概要」に記載されている通りです。

(3) 【運用体制】

本ファンドの運用体制は以下の通りです。記載された体制、会議・部署の名称、人員等は、平成21年6月末日現在のものであり、今後変更されることがあります。



〔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ーコントロールを行います。

また、ファンドの信託約款、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）

(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

経費控除後の繰越分を含めた配当等収益（配当金、利子およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額をいいます。以下同じ。）および売買益（売買損益に評価損益を加減して得た利益金額をいいます。以下同じ。）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、市況動向等を考慮して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は、分配を行わないことがあります。

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) 投資信託財産に属する配当等収益から諸経費、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) 売買益は、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。

（八）収益分配金の支払い

収益分配金は、原則として決算日から起算して5営業日目までに受益者に支払います。

前項の規定にかかわらず、「自動けいぞく投資コース」を選択した受益者については、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。この場合、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、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。

収益分配金の支払いは、指定販売会社の営業所等において行うものとします。

本ファンドの受益権は、平成19年1月4日より振替制度に移行しており、分配金は、決算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（当該収益分配金に係る決算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、当該収益分配金に係る計算期間の末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、）に、原則として決算日から起算して5営業日目までにお支払いします。なお、時効前の収益分配金に係る収益分配金交付票は、なおその効力を有するものとし、その収益分配金交付票と引換えに受益者にお支払いします。「自動けいぞく投資コース」をお申込みの場合は、分配金は税引き後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、振替口座簿に記載または記録されます。

（5）【投資制限】

（イ）投資信託約款にもとづく投資制限

投資信託証券への投資割合には、制限を設けません。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、投資信託財産の純資産総額の50%未満とします。（投資信託約款の「運用の基本方針」）

株式への直接投資は行いません。（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」）

委託者は、投資信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができ、この指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が投資信託財産の純資産総額の範囲内とします。（投資信託約款第24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り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に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、借入れの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31条）

前記における「外貨建資産への実質投資割合」とは、本ファンドの投資信託財産の純資産総額に対する、投資対象投資信託証券の投資信託財産に属する外貨建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投資対象投資信託証券の時価総額に、投資対象投資信託証券の投資信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

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

< デリバティブ取引に係る投資制限 >（金融商品取引業等に関する内閣府令）

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

3【投資リスク】

(1) 本ファンドのもつ主なリスク

投資信託商品はリスク商品であり、投資元本は保証されていません。また、収益や利回り等も未確定の商品です。従いまして、以下に記載する本ファンドのリスク要因を充分にご理解頂いたうえ、本ファンドの受益権への取得申込みを行ってください。

(イ) 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、元本が保証されているものではないために、投資した資産の減少を含むリスクは、本ファンドの受益者に帰属します。

(ロ) 本ファンドの資産価値に影響を及ぼすリスク要因としては、主として次のようなものがあります。

1) 価格変動リスク

・本ファンドは、各投資対象投資信託証券を通じて組み入れた有価証券等の値動きにより基準価額が大きく変動することがあり、投資元本を割り込むことがあります。また、本ファンドの資産を各投資対象投資信託証券以外の有価証券等に直接投資している場合にも、同様のリスクがあります。

(株価変動リスク)

・本ファンドは、各投資対象投資信託証券を通じて株式に投資を行います。組み入れた株式の価格は、発行企業の業績や国内外の経済情勢等により変動します。株式の価格変動により基準価額が変動し、投資元本を割り込むことがあります。

(金利変動リスク)

・本ファンドは、各投資対象投資信託証券を通じて公社債に投資を行います。公社債については、一般的に金利低下局面では値上がりし、金利上昇局面では値下がります。また、残存期間が長期の公社債の価格は、概して短期のものより金利の変動に対応して大きく変動します。このため基準価額が変動し、投資元本を割り込むことがあります。また、本ファンドの資産を公社債に直接投資している場合にも、同様のリスクがあります。

2) 為替リスク

・本ファンドは、各投資対象投資信託証券を通じて外貨建資産に投資を行います。通貨の価格変動等の影響により、基準価額が大きく変動することがあり、投資元本を割り込むことがあります。例えば、各投資対象投資信託証券を通じて組み入れた有価証券等の価格が表示通貨建では値上がりして

も、その通貨に対して円高となった場合は円建の評価額が減価し、基準価額が下落する場合があります。

3)カントリーリスク

- ・各投資対象投資信託証券を通じて外貨建資産への投資を行う場合、当該国・地域の政治・経済、社会制度、対外関係等の変化により、基準価額が大きく変動することがあり、投資元本を割り込むことがあります。

4)信用リスク

- ・各投資対象投資信託証券を通じて組み入れた有価証券等の発行者の経営・財務状況の変化およびそれらに関する外部評価の変化等により基準価額が影響を受け、投資元本を割り込むことがあります。本ファンドの資産を各投資対象投資信託証券以外の有価証券等に直接投資している場合にも、同様のリスクがあります。また、各投資対象投資信託証券および本ファンドの資産をコール・ローン、譲渡性預金等の短期金融商品で運用する場合、債務不履行等により損失が発生することがあり、基準価額が影響を受け、投資元本を割り込むことがあります。

5)その他のリスク

- ・本ファンドは、ファンド・オブ・ファンズ方式で運用を行います。本ファンドが主要投資対象とする各投資対象投資信託証券に対し、他のファンドによる多額の追加設定および一部解約等がなされた場合には、各投資対象投資信託証券における売買ならびに組入比率の変更等により、基準価額が大きく変動し、結果として投資元本を割り込むことがあります。

(2)リスク管理体制

(イ)投資リスクに関する管理基準

基本方針を遵守した運用を行うため、ファンドごとにリスク管理項目を規定しています。

運用の基本方針	投資信託約款等にしがって、ファンド運用上遵守すべき基本事項を定めたもの
運用ガイドライン	運用の基本方針にもとづき、運用目標やリスク管理目標等の、ファンドの運用管理基準を定めたもの

[本ファンドのリスク管理基準]

- ・資産構成比率と基本資産配分比率の乖離幅チェックを日々行います。
- ・分析結果は、月次で運用リスク管理委員会に報告されており、客観的なチェックが行われております。

(ロ)リスク管理体制

明確なPLAN-D0-SEEプロセスにより、投資リスクの管理を行っています。

本ファンドのリスク管理体制は前記「2投資方針 (3)運用体制」に記載されている通りです。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

- (イ) 申込手数料（受益権1口当たり）は、取得申込受付日の翌々営業日の基準価額に、指定販売会社が個別に定める申込手数料率を乗じて得た額とします。本書提出日現在の申込手数料率の上限は3.15%（税抜3.00%）です。

申込手数料については、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

（なお、受付時間は営業日の午前9時～午後5時（わが国の取引所が半休日の場合は午前9時～正午）とします。）

- (ロ) 「償還乗換え」により本ファンドの取得申込みをする場合は、当該償還金額の範囲内（単位型証券投資信託にあっては、当該償還金額とその元本額のいずれか大きい額とします。）で取得する部分については無手数料（本書提出日現在）で申込みを受け付けます。申込金額が償還金額を超える場合、超過部分の金額については、前記（イ）に定める申込手数料率を上限として指定販売会社が定める料率により計算された手数料をお支払いいただきます。指定販売会社によっては「償還乗換え」の取扱いを行わない場合があります。「償還乗換え」の取扱いの詳細については、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（イ）に記載されている先と同じです。
- (ハ) 指定販売会社は、追加型証券投資信託の受益権を保有する受益者が、当該受益権の取得申込みを行った当該指定販売会社で、当該信託の信託終了日の1年前以内で当該指定販売会社が別に定める期間以降、当該信託の受益権の買取に係る売却代金またはご解約金をもって、当該指定販売会社が別に定める期間以内に、本ファンドの受益権の取得申込みをする場合の手数料率を、前記（イ）に定める申込手数料率を上限として独自に定めることができます。指定販売会社によっては当該取扱いを行わない場合があります。当該取扱いの詳細については、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（イ）に記載されている先と同じです。
- (ニ) 自動けいぞく投資契約にもとづき収益分配金を再投資する場合には、申込手数料はかかりません。

(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0.8190% (税抜0.78%)	純資産総額に対して 年率0.2100% (税抜0.20%)	純資産総額に対して 年率0.5775% (税抜0.55%)	純資産総額に対して 年率0.0315% (税抜0.03%)

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、毎計算期末および信託終了のとき、投資信託財産中から支弁するものとします。

なお、上記のほか、投資対象投資信託証券に関しても信託報酬等がかかります。

（参考）投資対象投資信託証券の信託報酬等

投資対象投資信託証券の名称	信託報酬率 (純資産総額に対する年率)
住信 FOFs用外国債券オープン	0.3675% (税抜0.35%)
住信 FOFs用日本株式インデックス・オープン	0.2415% (税抜0.23%)
JPM・US・セレクト	0.4095% (税抜0.39%)
ピクテ・ユーロ・セレクト・インカム	0.4515% (税抜0.43%)
ピクテ・ハイインカム・ソブリン・ファンド	0.735% (税抜0.70%)
LM・オーストラリア毎月分配型ファンド	0.5565% (税抜0.53%)
グローバル・ユーティリティーズ・エクイティ・ファンド	0.95%

上記の信託報酬率は本書提出日現在のものであり、今後変更となる場合もあります。なお、各投資対象投資信託証券について、本書提出日現在、申込手数料はありません。

なお、本ファンドの信託報酬に投資対象投資信託証券の信託報酬を加えた、受益者が実質的に負担する信託報酬について、委託者が試算した概算値は税込みで年率1.34%±0.06%程度です。ただし、この値はあくまでも実質的な信託報酬の目安であり、本ファンドの実際の投資対象投資信託証券の組入状況によっては、実質的な信託報酬は変動します。

(4)【その他の手数料等】

(イ) ご解約時には、解約請求受付日の翌々営業日の基準価額に0.3%の率を乗じて得た額を信託財産留保金として当該基準価額から控除します。

「信託財産留保金」とは、償還時まで投資を続ける投資家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。以下同じ。

(ロ) 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。(投資対象投資信託証券において負担する場合を含みます。)

(ハ) 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。)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。(投資対象投資信託証券において負担する場合を含みます。)

(ニ) 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、計算期間を通じて毎日、投資信託財産の純資産総額に0.00525%(税抜0.005%)を乗じて得た額とし、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。なお、費用の計算方法および支弁時期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。

(5)【課税上の取扱い】

受益者に対する課税については、以下の取扱いとなります。なお、税法が改正された場合は、その内容が変更されることがあります。また、課税上の取扱いの詳細につきましては、税理士等にご確認されることをお勧めいたします。

個人の受益者に対する課税

- ・ 収益分配金のうち配当所得として課税扱いとなる普通分配金については、平成23年12月31日までは10%(所得税7%および地方税3%)、平成24年1月1日以降は20%(所得税15%および地方税5%)の税率により源泉徴収が行われます。原則として確定申告不要ですが、確定申告により総合課税または申告分離課税のいずれかを選択することも可能です。
- ・ ご解約による換金時および償還時の差益(解約価額および償還価額から取得費用(申込手数料および当該申込手数料に係る消費税等相当額を含みます。)を控除した利益)が譲渡所得等として課税対象となり、平成23年12月31日までは10%(所得税7%および地方税3%)、平成24年1月1日以降は20%(所得税15%および地方税5%)の税率による申告分離課税が適用されます。なお、特定口座(源泉徴収選択口座)の利用による申告不要の特例があります。詳しくは指定販売会社にお問い合わせください。
- ・ ご解約による換金時および償還時の差損(譲渡損失)については、確定申告を行うことにより、上場株式等の譲渡益および上場株式等の配当所得(申告分離課税を選択したものに限り、)と通算することができ、また、控除しきれない損失金額については、翌年以降3年間の繰越控除の対象とすることができます。

法人の受益者に対する課税

- ・収益分配金のうち、課税扱いとなる普通分配金ならびにご解約による換金時および償還時の個別元本超過額については、平成23年12月31日までは、7%（所得税7%）、平成24年1月1日以降は15%（所得税15%）の税率により源泉徴収されます。（地方税はありません。）源泉徴収された所得税は、所有期間に応じて法人税の額から控除できます。

買取請求によるご換金については、指定販売会社にお問い合わせください。

個別元本について

- 1)追加型株式投資信託について、受益者ごとの信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料に係る消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。
- 2)受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。
- 3)受益者が同一ファンドの受益権を複数の指定販売会社で取得する場合については、各指定販売会社ごとに個別元本の算出が行われます。また、同一指定販売会社であっても複数支店等で同一ファンドの受益権を取得する場合は、当該支店等ごとに個別元本の算出が行われる場合があります。
- 4)受益者が特別分配金を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該特別分配金を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。（「特別分配金」については、下記の「収益分配金の課税について」をご参照ください。）

収益分配金の課税について

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

受益者が収益分配金を受け取る際、a)当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、b)当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が特別分配金となり、当該収益分配金から当該特別分配金を控除した額が普通分配金となります。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

(平成21年5月29日現在)

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資信託受益証券	日本	165,457,135,467	90.41
	ルクセンブルグ	16,639,921,925	9.09
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		907,603,497	0.50
合計(純資産総額)		183,004,660,889	100.00

(注)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。

(2)【投資資産】(平成21年5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	投資信託 受益証券	住信 FOFs用外国債券オープン(適格機関投資家専用)	45,605,089,292	0.8252	37,635,246,891	0.8242	37,587,714,594	20.54
日本	投資信託 受益証券	ピクテ・ユーロ・セレクト・インカム(適格機関投資家専用)	33,994,809,653	0.8659	29,437,711,873	0.8691	29,544,889,069	16.14

日本	投資信託 受益証券	JPM・US・セレクト(適格機関投資家専用)	36,082,311,273	0.8273	29,851,668,312	0.8129	29,331,310,833	16.03
日本	投資信託 受益証券	LM・オーストラリア毎月分配型ファンド (適格機関投資家専用)	34,197,502,557	0.8046	27,516,290,218	0.8123	27,778,631,327	15.18
日本	投資信託 受益証券	ピクテ・ハイインカム・ソブリン・ファン ド(適格機関投資家専用)	33,730,423,769	0.7996	26,972,929,044	0.8048	27,146,245,049	14.83
ルクセン ブルグ	投資信託 受益証券	グローバル・ユーティリティーズ・エク イティ・ファンドクラスSAM分配型受益 証券	1,951,897	8,289.93	16,181,091,885	8,525	16,639,921,925	9.09
日本	投資信託 受益証券	住信 FOFs用日本株式インデックス・ オープン(適格機関投資家専用)	26,700,217,490	0.5228	13,959,330,321	0.5269	14,068,344,595	7.69

(注)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(%)
投資信託受益証券	99.50
合計	99.50

(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。

(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期特定期間末 (平成18年 4月14日)	(分配付)	101,915,158,650	(分配付)	1.0330
	(分配落)	101,520,518,109	(分配落)	1.0290
第2期特定期間末 (平成18年10月16日)	(分配付)	156,621,475,479	(分配付)	1.0627
	(分配落)	156,031,980,251	(分配落)	1.0587
第3期特定期間末 (平成19年 4月16日)	(分配付)	164,709,462,555	(分配付)	1.1039
	(分配落)	163,814,247,787	(分配落)	1.0979
第4期特定期間末 (平成19年10月15日)	(分配付)	169,484,029,531	(分配付)	1.0987
	(分配落)	168,404,190,037	(分配落)	1.0917
第5期特定期間末 (平成20年 4月14日)	(分配付)	174,161,211,800	(分配付)	0.9614
	(分配落)	172,893,161,185	(分配落)	0.9544
第6期特定期間末 (平成20年10月14日)	(分配付)	172,877,582,872	(分配付)	0.7539
	(分配落)	171,272,360,311	(分配落)	0.7469
第7期特定期間末 (平成21年 4月14日)	(分配付)	181,008,315,622	(分配付)	0.7526
	(分配落)	179,565,161,547	(分配落)	0.7466

平成20年 5月末日	187,026,667,834	0.9766
6月末日	192,663,035,688	0.9732
7月末日	200,014,265,512	0.9735
8月末日	203,119,858,915	0.9527
9月末日	202,768,922,075	0.8948
10月末日	169,832,734,598	0.7383
11月末日	166,475,318,300	0.7161
12月末日	168,251,608,099	0.7208
平成21年 1月末日	160,310,897,511	0.6843
2月末日	166,483,451,812	0.7082
3月末日	173,309,858,791	0.7270
4月末日	174,338,949,781	0.7169
5月末日	183,004,660,889	0.7389

【分配の推移】

期 間	1口当たりの分配金(円)
第1期特定期間(平成17年10月21日～平成18年 4月14日)	0.0200
第2期特定期間(平成18年 4月15日～平成18年10月16日)	0.0240
第3期特定期間(平成18年10月17日～平成19年 4月16日)	0.0310
第4期特定期間(平成19年 4月17日～平成19年10月15日)	0.0390
第5期特定期間(平成19年10月16日～平成20年 4月14日)	0.0420
第6期特定期間(平成20年 4月15日～平成20年10月14日)	0.0420
第7期特定期間(平成20年10月15日～平成21年 4月14日)	0.0360

【収益率の推移】

期 間	収益率(%)
第1期特定期間(平成17年10月21日～平成18年 4月14日)	4.9
第2期特定期間(平成18年 4月15日～平成18年10月16日)	5.2
第3期特定期間(平成18年10月17日～平成19年 4月16日)	6.6
第4期特定期間(平成19年 4月17日～平成19年10月15日)	3.0
第5期特定期間(平成19年10月16日～平成20年 4月14日)	8.7
第6期特定期間(平成20年 4月15日～平成20年10月14日)	17.3
第7期特定期間(平成20年10月15日～平成21年 4月14日)	4.8

(注1)収益率とは、各特定期間末の基準価額(分配落)から前特定期間末の基準価額(分配落)を控除した額に特定期間中の分配金累計額を加算し、前特定期間末の基準価額(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。

第二部【ファンドの詳細情報】

第1【ファンドの沿革】

平成17年10月21日 投資信託契約締結、本ファンドの設定、運用開始

第2【手続等】

1【申込（販売）手続等】

1) 申込手続

本ファンドの受益権は、平成19年1月4日より振替制度に移行しており、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ます。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) 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。

(ロ) 取得申込みは、申込期間における毎営業日に、本邦にある指定販売会社の本支店・出張所で受け付けます。

(ハ) 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（わが国の取引所が半休日の場合は午前11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。

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

(ホ) 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。

(ヘ) 取得申込みには、収益の分配がなされた場合に分配金を受領する「一般コース」と、分配金は税金を差し引いた後自動的に無手数料で再投資される「自動けいぞく投資コース」があり、「自動けいぞく投資コース」を選択した場合には、取得申込者は指定販売会社との間で「自動けいぞく投資契約」を別途締結します。なお、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。指定販売会社によって取扱いコースが異なる場合があります。指定販売会社の取扱いコースについては、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

（なお、受付時間は営業日の午前9時～午後5時（わが国の取引所が半休日の場合は午前9時～正午）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。

(ト) 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。

2) 申込単位

申込単位については、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

（なお、受付時間は営業日の午前9時～午後5時（わが国の取引所が半休日の場合は午前9時～正午）とします。）

3) 申込手数料

（イ）申込手数料（受益権1口当たり）は、取得申込受付日の翌々営業日の基準価額に、指定販売会社が個別に定める申込手数料率を乗じて得た額とします。本書提出日現在の申込手数料率の上限は3.15%（税抜3.00%）です。

申込手数料については、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

（なお、受付時間は営業日の午前9時～午後5時（わが国の取引所が半休日の場合は午前9時～正午）とします。）

（ロ）「償還乗換え」により本ファンドの取得申込みをする場合は、当該償還金額の範囲内（単位型証券投資信託にあっては、当該償還金額とその元本額のいずれか大きい額とします。）で取得する部分については無手数料（本書提出日現在）で申込みを受け付けます。申込金額が償還金額を超える場合、超過部分の金額については、前記（イ）に定める申込手数料率を上限として指定販売会社が定める料率により計算された手数料をお支払いいただきます。指定販売会社によっては「償還乗換え」の取扱いを行わない場合があります。「償還乗換え」の取扱いの詳細については、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（イ）に記載されている先と同じです。

（ハ）指定販売会社は、追加型証券投資信託の受益権を保有する受益者が、当該受益権の取得申込みを行った当該指定販売会社で、当該信託の信託終了日の1年前以内で当該指定販売会社が別に定める期間以降、当該信託の受益権の買取に係る売却代金またはご解約金をもって、当該指定販売会社が別に定める期間以内に、本ファンドの受益権の取得申込みをする場合の手数料率を、前記（イ）に定める申込手数料率を上限として独自に定めることができます。指定販売会社によっては当該取扱いを行わない場合があります。当該取扱いの詳細については、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（イ）に記載されている先と同じです。

（ニ）自動けいぞく投資契約にもとづき収益分配金を再投資する場合には、申込手数料はかかりません。

2【換金（解約）手続等】

1) 受益権の買取請求

本ファンドのご換金の方法は、ご解約の請求のほか受益権の買取の方法によることができます。ただし、受益権の買取は指定販売会社によっては行わない場合がありますので、詳細については指定販売会社にお問い合わせください。

2) 受益権のご解約の請求

本ファンドの受益権は、平成19年1月4日より振替制度に移行しており、換金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。

なお、換金の請求を受益者がするとき、振替受益権をもって行うものとし、受益証券をお手許で保有されている場合は、換金のお申込みに際して、個別に振替受益権とするための所要の手続きが必要であり、この手続きには時間を要しますので、ご注意ください。

- (イ) 受益者（指定販売会社を含みます。）は、自己に帰属する受益権につき、委託者にご解約の請求をすることができます。ご解約の請求は、原則として毎営業日受け付けます。なお、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（わが国の取引所が半休日の場合は午前11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。また、解約単位は、指定販売会社によって異なります。
- (ロ) 受益者が前記のご解約の請求をするときは、振替受益権をもって行うものとし、
- (ハ) 委託者は、前記（イ）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。
- (ニ) ご解約の価額は、解約請求受付日の翌々営業日の基準価額から、当該基準価額に0.3%の率を乗じて得た額を信託財産留保金として控除した価額（解約価額）とします。
- $$\begin{aligned} \text{解約価額} &= \text{解約請求受付日の翌々営業日の基準価額} - \text{信託財産留保金} \\ &= \text{解約請求受付日の翌々営業日の基準価額} - (\text{解約請求受付日の翌々営業日の基準価額} \times 0.3\%) \end{aligned}$$
- (ホ) ご解約の受取金額は、解約価額から所得税および地方税を差し引いた額（解約代金）となります。
- (ヘ) 解約代金は、原則として解約請求受付日より起算して7営業日目から指定販売会社において支払います。
- (ト) 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（イ）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。
- (チ) 前記（ト）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（ニ）の規定に準じて計算された価額とします。
- (リ) 解約単位および解約価額に関する投資家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、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

（なお、受付時間は営業日の午前9時～午後5時（わが国の取引所が半休日の場合は午前9時～正午）とします。）

第3【管理及び運営】

1【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額の算出方法

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

〔主要な投資対象である投資信託証券の評価方法〕

原則として、本ファンドの基準価額計算日の前営業日の基準価額で評価します。

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。

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。投資家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、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

（なお、受付時間は営業日の午前9時～午後5時（わが国の取引所が半休日の場合は午前9時～正午）とします。）

なお、基準価額は、翌日の日本経済新聞に表記を「分配ファ」として掲載されます。ただし、表示は1万口当たりに換算した価額で行われます。

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

本ファンドの信託期間は、平成17年10月21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、毎月15日から翌月14日までとします。（第1計算期間は、平成17年10月21日から平成17年12月14日までとします。）ただし、当該計算期間終了の該当日が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。ただし、最終計算期間の終了日は、投資信託約款第4条に定める信託期間の終了日とします。

(5) 【その他】

1) 信託の終了

- (イ) (a) 委託者は、投資信託約款に定める信託終了前に、受益権の残存口数が10億口を下回ることとなった場合もしくは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。
- (b) 委託者は、前項の事項について、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。
- (c) 前項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) 前項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)の投資信託契約の解約をしません。
- (e) 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。
- (f) 前記(c)から(e)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(c)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。

- (ロ) 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。
- (ハ) 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「2)投資信託約款の変更（イ）(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。
- (ニ) 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後、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。

2)投資信託約款の変更

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

3)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。

4)運用報告書

委託者は、6計算期間の末日（4月および10月）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られたる受益者に対して交付します。ただし、第1作成期は、当初の5計算期間とします。

5)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。

2【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。

1) 収益分配金請求権

受益者は、委託者が支払いを決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、原則として決算日から起算して5営業日目までに受益者に支払います。収益分配金の支払いは指定販売会社の営業所等において行います。

上記にかかわらず、「自動けいぞく投資コース」を選択した受益者については、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。この場合、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日に、収益分配金が指定販売会社に支払われ、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。

受益者が収益分配金について支払開始日から5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。

本ファンドの受益権は、平成19年1月4日より振替制度に移行しており、分配金は、決算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（当該収益分配金に係る決算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、当該収益分配金に係る計算期間の末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、原則として決算日から起算して5営業日目までにお支払いします。なお、時効前の収益分配金に係る収益分配金交付票は、なおその効力を有するものとし、その収益分配金交付票と引換えに受益者にお支払いします。「自動けいぞく投資コース」をお申込みの場合は、分配金は税引き後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、振替口座簿に記載または記録されます。

2) 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。

3) 換金請求権

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、または買取を請求することにより換金する権利を有します。

4) 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取るべき旨を請求することができます。

5) 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4【ファンドの経理状況】

(1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

- (2) 当ファンドの計算期間は6ヶ月未満であるため、財務諸表は6ヶ月毎に作成しております。
- (3) 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、前期（平成20年4月15日から平成20年10月14日まで）及び当期（平成20年10月15日から平成21年4月14日まで）の財務諸表について、あずさ監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

住信 毎月分配パッケージファンド

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	前期 (平成20年10月14日現在)	当期 (平成21年4月14日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	2,517,786,964	3,018,013,322
投資信託受益証券	170,796,039,209	178,142,739,204
未収入金	291,216,768	-
未収配当金	73,804,040	75,257,560
未収利息	21,260	5,853
流動資産合計	173,678,868,241	181,236,015,939
資産合計	173,678,868,241	181,236,015,939
負債の部		
流動負債		
未払金	-	39,631,246
未払収益分配金	1,605,222,561	1,443,154,075
未払解約金	678,369,225	73,652,476
未払受託者報酬	4,697,431	4,372,607
未払委託者報酬	117,435,816	109,315,230
その他未払費用	782,897	728,758
流動負債合計	2,406,507,930	1,670,854,392
負債合計	2,406,507,930	1,670,854,392
純資産の部		
元本等		
元本	229,317,508,745	240,525,679,298
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	58,045,148,434	60,960,517,751
元本等合計	171,272,360,311	179,565,161,547
純資産合計	171,272,360,311	179,565,161,547
負債純資産合計	173,678,868,241	181,236,015,939

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前期 (自 平成20年 4月15日 至 平成20年10月14日)	当期 (自 平成20年10月15日 至 平成21年 4月14日)
営業収益		
受取配当金	5,194,956,786	5,812,377,334
受取利息	4,775,881	1,337,542
有価証券売買等損益	42,985,687,952	3,553,346,681
営業収益合計	37,785,955,285	9,367,061,557
営業費用		
受託者報酬	30,311,779	26,092,483
委託者報酬	757,794,503	652,311,955
その他費用	5,051,901	4,348,684
営業費用合計	793,158,183	682,753,122
営業利益又は営業損失()	38,579,113,468	8,684,308,435
経常利益又は経常損失()	38,579,113,468	8,684,308,435
当期純利益又は当期純損失()	38,579,113,468	8,684,308,435
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()	112,302,424	42,186,608
期首剰余金又は期首欠損金()	8,256,926,809	58,045,148,434
剰余金増加額又は欠損金減少額	391,615,968	2,318,750,019
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	391,615,968	2,318,750,019
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,016,219,217	5,413,741,874
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,016,219,217	5,413,741,874
分配金	8,696,807,332	8,462,499,289
期末剰余金又は期末欠損金()	58,045,148,434	60,960,517,751

（参考情報）

当ファンドは、国内投資信託証券である「住信 F0Fs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）」、「住信 F0Fs用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）」、「JPM・US・セレクト（適格機関投資家専用）」、「ピクテ・ユーロ・セレクト・インカム（適格機関投資家専用）」、「ピクテ・ハイインカム・ソブリン・ファンド（適格機関投資家専用）」および「LM・オーストラリア毎月分配型ファンド（適格機関投資家専用）」ならびに外国投資信託証券である「ピクテ・グローバル・セレクション・ファンド - グローバル・ユーティリティーズ・エクイティ・ファンド」の受益証券（振替投資信託受益権を含みます。）を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「投資信託受益証券」はこれらの投資信託証券です。
 なお、以下に、財務諸表を記載しております。

1. 住信 F0Fs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）

（1）当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

（2）当ファンドの計算期間は6ヶ月未満であるため、財務諸表は6ヶ月毎に作成しております。

（3）当ファンドは、前期（平成20年4月8日から平成20年10月7日まで）及び当期（平成20年10月8日から平成21年4月7日まで）の財務諸表について、あずさ監査法人により監査を受けております。

財務諸表

住信 F0Fs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）

（1）貸借対照表

（単位：円）

	前期 （平成20年10月 7日現在）	当期 （平成21年 4月 7日現在）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	250,009,345	
親投資信託受益証券	38,512,615,216	37,685,108,861
未収入金		235,000,000
未収利息	3,127	
流動資産合計	38,762,627,688	37,920,108,861
資産合計	38,762,627,688	37,920,108,861
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	217,592,323	221,120,675

未払受託者報酬	661,575	611,257
未払委託者報酬	10,916,004	10,085,733
その他未払費用	165,383	152,803
流動負債合計	229,335,285	231,970,468
負債合計	229,335,285	231,970,468
純資産の部		
元本等		
元本	43,518,464,714	44,224,135,015
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	4,985,172,311	6,535,996,622
元本等合計	38,533,292,403	37,688,138,393
純資産合計	38,533,292,403	37,688,138,393
負債純資産合計	38,762,627,688	37,920,108,861

(2) 損益及び剰余金計算書

(単位：円)

	前期 (自平成20年4月8日 至平成20年10月7日)	当期 (自平成20年10月8日 至平成21年4月7日)
営業収益		
受取利息	73,034	11,481
有価証券売買等損益	3,200,932,404	31,316,464
営業収益合計	3,200,859,370	31,304,983
営業費用		
受託者報酬	3,974,518	3,680,745
委託者報酬	65,579,471	60,732,315
その他費用	993,564	920,129
営業費用合計	70,547,553	65,333,189
営業利益又は営業損失（ ）	3,271,406,923	96,638,172
経常利益又は経常損失（ ）	3,271,406,923	96,638,172
当期純利益又は当期純損失（ ）	3,271,406,923	96,638,172
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（ ）		3,532,133
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	355,797,161	4,985,172,311
剰余金増加額又は欠損金減少額		15,464,367
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		15,464,367
剰余金減少額又は欠損金増加額	185,612,761	160,670,301
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	185,612,761	160,670,301

分配金	1,172,355,466	1,312,512,338
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	4,985,172,311	6,535,996,622

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	前期 (自 平成20年 4月8日 至 平成20年10月7日)	当期 (自 平成20年10月8日 至 平成21年 4月7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)

	前期 (平成20年10月7日現在)	当期 (平成21年4月7日現在)
1. 期首元本額	34,658,851,953円	43,518,464,714円
期中追加設定元本額	8,859,612,761円	840,670,301円
期中一部解約元本額	- 円	135,000,000円
期末元本額	43,518,464,714円	44,224,135,015円
2. 元本の欠損	純資産額は元本を4,985,172,311 円下回っております。	純資産額は、元本を 6,535,996,622円下回っておりま す。
3. 特定期間末日における受益権の総数	43,518,464,714口	44,224,135,015口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

	前期 (自 平成20年 4月8日 至 平成20年10月7日)	当期 (自 平成20年10月8日 至 平成21年 4月7日)
分配金の計 算過程	平成20年4月8日から平成20年5月7日までの計 算期間末において、経費控除後の配当等収益 (120,448,074円、本ファンドに帰属すべき親 投資信託の配当等収益を含む)、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(716,544,469円)及び分配準備積 立金(1,553,997,800円)により、分配対象収 益は2,390,990,343円(1万口当たり674円17 銭)であり、うち177,327,036円(1万口当た り50円)を分配金額としております。	平成20年10月8日から平成20年11月7日までの 計算期間末において、経費控除後の配当等収益 (120,569,955円、本ファンドに帰属すべき親 投資信託の配当等収益を含む)、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(1,193,680,967円)及び分配準備 積立金(1,160,522,510円)により、分配対象 収益は2,474,773,432円(1万口当たり570円44 銭)であり、うち216,917,323円(1万口当た り50円)を分配金額としております。

<p>平成20年5月8日から平成20年6月9日までの計算期間末において、経費控除後の配当等収益（130,199,565円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、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（818,513,763円）及び分配準備積立金（1,497,118,838円）により、分配対象収益は2,445,832,166円（1万口当たり659円60銭）であり、うち185,401,118円（1万口当たり50円）を分配金額としております。</p> <p>平成20年6月10日から平成20年7月7日までの計算期間末において、経費控除後の配当等収益（125,265,252円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、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（883,111,149円）及び分配準備積立金（1,441,917,285円）により、分配対象収益は2,450,293,686円（1万口当たり642円70銭）であり、うち190,622,721円（1万口当たり50円）を分配金額としております。</p> <p>平成20年7月8日から平成20年8月7日までの計算期間末において、経費控除後の配当等収益（144,773,986円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、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（959,439,452円）及び分配準備積立金（1,376,559,816円）により、分配対象収益は2,480,773,254円（1万口当たり629円70銭）であり、うち196,979,934円（1万口当たり50円）を分配金額としております。</p> <p>平成20年8月8日から平成20年9月8日までの計算期間末において、経費控除後の配当等収益（138,503,241円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、経費控除後繰越欠損補填後の有価証券売買益（0円）、収益調整金（1,047,208,335円）及び分配準備積立金（1,324,353,868円）により、分配対象収益は2,510,065,444円（1万口当たり613円91銭）であり、うち204,432,334円（1万口当たり50円）を分配金額としております。</p>	<p>平成20年11月8日から平成20年12月8日までの計算期間末において、経費控除後の配当等収益（112,239,903円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、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（1,205,468,724円）及び分配準備積立金（1,064,175,142円）により、分配対象収益は2,381,883,769円（1万口当たり546円20銭）であり、うち218,041,210円（1万口当たり50円）を分配金額としております。</p> <p>平成20年12月9日から平成21年1月7日までの計算期間末において、経費控除後の配当等収益（118,178,165円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、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（1,205,468,724円）及び分配準備積立金（958,373,835円）により、分配対象収益は2,282,020,724円（1万口当たり523円30銭）であり、うち218,041,210円（1万口当たり50円）を分配金額としております。</p> <p>平成21年1月8日から平成21年2月9日までの計算期間末において、経費控除後の配当等収益（112,222,157円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、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（1,213,994,723円）及び分配準備積立金（858,510,790円）により、分配対象収益は2,184,727,670円（1万口当たり498円94銭）であり、うち218,933,261円（1万口当たり50円）を分配金額としております。</p> <p>平成21年2月10日から平成21年3月9日までの計算期間末において、経費控除後の配当等収益（109,809,299円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、経費控除後繰越欠損補填後の有価証券売買益（0円）、収益調整金（1,218,756,648円）及び分配準備積立金（751,799,686円）により、分配対象収益は2,080,365,633円（1万口当たり473円97銭）であり、うち219,458,659円（1万口当たり50円）を分配金額としております。</p>
--	---

平成20年9月9日から平成20年10月7日までの計算期間末において、経費控除後の配当等収益(123,301,285円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、経費控除後繰越欠損補填後の有価証券売買益(0円)、収益調整金(1,197,395,374円)及び分配準備積立金(1,258,424,775円)により、分配対象収益は2,579,121,434円(1万口当たり592円64銭)であり、うち217,592,323円(1万口当たり50円)を分配金額としております。	平成21年3月10日から平成21年4月7日までの計算期間末において、経費控除後の配当等収益(116,722,484円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む)、経費控除後繰越欠損補填後の有価証券売買益(0円)、収益調整金(1,233,151,417円)及び分配準備積立金(642,150,326円)により、分配対象収益は1,992,024,227円(1万口当たり450円43銭)であり、うち221,120,675円(1万口当たり50円)を分配金額としております。
---	---

(有価証券に関する注記)

前期(平成20年10月7日現在)

売買目的有価証券の貸借対照表計上額及び最終の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)	最終の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	38,512,615,216	3,325,048,394
合計	38,512,615,216	3,325,048,394

当期(平成21年4月7日現在)

売買目的有価証券の貸借対照表計上額及び最終の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)	最終の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	37,685,108,861	1,956,527,986
合計	37,685,108,861	1,956,527,986

(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

前期 (自平成20年4月8日 至平成20年10月7日)	当期 (自平成20年10月8日 至平成21年4月7日)
該当事項はありません。	同左

取引の時価等に関する事項

前期 (平成20年10月7日現在)	当期 (平成21年4月7日現在)
該当事項はありません。	同左

(関連当事者との取引に関する注記)

前期 (自平成20年4月8日 至平成20年10月7日)	当期 (自平成20年10月8日 至平成21年4月7日)

当特定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)

前期 (平成20年10月7日現在)	当期 (平成21年4月7日現在)
1口当たり純資産額 = 0.8854円	1口当たり純資産額 = 0.8522円

(4) 附属明細表（平成21年4月7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 外国債券インデックス マザーファンド	19,506,759,595	37,685,108,861
合計		19,506,759,595	37,685,108,861

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)

「住信 FOFs用外国債券オープン（適格機関投資家専用）」は、「住信 外国債券インデックス マザーファンド」を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、「住信 外国債券インデックス マザーファンド」の受益証券です。

「住信 外国債券インデックス 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 外国債券インデックス マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	(平成20年10月 7日現在)	(平成21年 4月 7日現在)
資産の部		

流動資産		
預金	848,075,429	201,331,570
コール・ローン	1,341,773,945	1,526,788,360
国債証券	322,578,723,539	285,537,582,272
特殊債券	1,274,591,940	1,340,713,100
未収利息	4,944,745,836	4,387,825,158
前払費用	208,853,422	151,118,034
流動資産合計	331,196,764,111	293,145,358,494
資産合計	331,196,764,111	293,145,358,494
負債の部		
流動負債		
未払金	363,180,363	
未払解約金	679,971,177	244,581,422
流動負債合計	1,043,151,540	244,581,422
負債合計	1,043,151,540	244,581,422
純資産の部		
元本等		
元本	170,982,074,875	151,613,008,951
剰余金		
剰余金又は欠損金()	159,171,537,696	141,287,768,121
元本等合計	330,153,612,571	292,900,777,072
純資産合計	330,153,612,571	292,900,777,072
負債純資産合計	331,196,764,111	293,145,358,494

(注) 「住信 外国債券インデックス マザーファンド」の計算期間は、原則として毎年5月30日から翌年5月29日までであり、「住信 FOFs用外国債券オープン(適格機関投資家専用)」の計算期間とは異なっております。上記の表は平成20年10月7日及び平成21年4月7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 4月8日 至 平成20年10月7日)	(自 平成20年10月8日 至 平成21年 4月7日)
1. 資産の評価基準及び評価方法	(1) 国債証券、特殊債券 移動平均法(買付約定後、最初の 利払日までは個別法)に基づき、 時価評価しております。時価評価 にあたっては、金融商品取引業者 等の提示する価格、価格情報会社 の提供する価格又は業界団体が公 表する売買参考統計値等で評価し ております。	(1) 国債証券、特殊債券 同左

2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>(2) 外国為替予約 個別法に基づき、時価評価しております。</p> <p>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>	<p>(2) 外国為替予約 同左</p> <p>同左</p>
------------------------	---	------------------------------------

(貸借対照表に関する注記)

	(平成20年10月7日現在)	(平成21年4月7日現在)
1. 期首元本額	170,359,584,962円	170,982,074,875円
期中追加設定元本額	13,281,495,888円	10,117,271,005円
期中一部解約元本額	12,659,005,975円	29,486,336,929円
期末元本額	170,982,074,875円	151,613,008,951円
元本額の内訳		
住信 外国債券オープン（毎月決算型）	25,897,690,295円	24,435,998,765円
住信 外国債券オープン（3ヶ月決算型）	851,216,600円	815,370,930円
住信 グローバル・インカム&プラス（毎月決算型）	12,259,771,162円	10,450,050,806円
住信 財産四分法ファンド（毎月決算型）	9,767,481,774円	7,145,945,644円
SBI資産設計オープン（資産成長型）	118,113,047円	132,416,556円
SBI資産設計オープン（分配型）	22,048,850円	16,321,755円
STAM グローバル債券インデックス・オープン	553,371,729円	814,899,910円
世界経済インデックスファンド		2,988,786円
すみしん マイセレクション25	37,891,066円	38,160,076円
すみしん マイセレクション50	17,169,616円	16,705,735円
すみしん マイセレクション75	11,098,058円	9,011,809円
すみしん DCマイセレクション25	534,924,425円	590,000,614円
すみしん DCマイセレクション50	560,208,307円	539,961,255円
すみしん DCマイセレクション75	340,913,013円	327,133,328円
すみしん DC外国債券インデックス・オープン	615,937,902円	710,381,776円
すみしん DCマイセレクションS25	13,358,375円	20,812,965円
すみしん DCマイセレクションS50	22,323,080円	30,849,935円
すみしん DCマイセレクションS75	12,557,196円	16,466,096円
すみしん DCターゲット・イヤール ファンド2015	1,160,981円	1,226,588円
すみしん DCターゲット・イヤール ファンド2025	304,311円	540,565円
すみしん DCターゲット・イヤール ファンド2035	76,337円	363,311円
すみしん DCターゲット・イヤール ファンド2045	38,119円	55,177円
すみしん DCマルチアセット ファンド	67,493円	62,127円
STAM 外国債券インデックス・オープン（SMA専用）	31,551,142円	142,938,290円
すみしん マイセレクション50VA1（適格機関投資家専用）	54,356,252円	48,168,775円
すみしん マイセレクション75VA1（適格機関投資家専用）	17,464,196円	15,639,129円
すみしん 外国債券インデックス・オープンVA1 （適格機関投資家専用）	790,634,086円	764,845,080円
すみしん マイセレクション50VA2（適格機関投資家専用）	543,189円	500,539円
すみしん バランス30VA1（適格機関投資家専用）	1,800,263,930円	1,650,435,832円

すみしん バランス50VA1(適格機関投資家専用)	2,969,680,414円	2,532,632,120円
すみしん バランス25VA2(適格機関投資家専用)	39,441,378,638円	36,205,148,930円
すみしん バランス50VA2(適格機関投資家専用)	3,854,629,845円	3,281,461,135円
すみしん バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	10,790,481,967円	10,566,237,986円
すみしん バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,408,851,504円	1,459,333,478円
すみしん バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	5,065,305,719円	4,728,027,814円
すみしん 世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	5,563,168,474円	4,800,873,243円
すみしん 世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	13,962,762,587円	5,471,304,775円
すみしん バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	990,867,760円	1,352,450,049円
すみしん グローバルバランスファンドVA35 (適格機関投資家専用)	2,882,822,198円	3,497,215,652円
住信 FOFs用外国債券オープン(適格機関投資家専用)	19,945,421,936円	19,506,759,595円
住信 グローバル債券ファンド・シリーズ1 (適格機関投資家専用)	2,975,125,453円	3,136,333,399円
住信 グローバル債券ファンド・シリーズ2 (適格機関投資家専用)	6,451,317,331円	6,030,307,519円
住信 グローバル・バランスファンド・シリーズ1	347,726,518円	306,671,102円
2. 計算期間末日における受益権の総数	170,982,074,875口	151,613,008,951口

(有価証券に関する注記)

当計算期間末(平成20年10月7日現在)

売買目的有価証券の貸借対照表計上額及び当計算期間の損益に含まれた評価差額

種 類	貸借対照表計上額(円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	322,578,723,539	10,739,520,298
特殊債券	1,274,591,940	76,141,624
合 計	323,853,315,479	10,815,661,922

(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特定期間末日までの期間に対応する金額であります。

当計算期間末(平成21年4月7日現在)

売買目的有価証券の貸借対照表計上額及び当計算期間の損益に含まれた評価差額

種 類	貸借対照表計上額(円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
国債証券	285,537,582,272	13,438,225,699
特殊債券	1,340,713,100	92,274,335
合 計	286,878,295,372	13,530,500,034

(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特定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4月8日 至平成20年10月7日)	(自平成20年10月8日 至平成21年4月7日)
-----------------------------	-----------------------------

<p>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、金利に係る市場デリバティブ取引、通貨に係る市場デリバティブ取引ならびに外国金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引)、スワップ取引、金利先渡取引、為替先渡取引、外国為替予約取引であります。</p> <p>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。</p>	<p>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 同左</p> <p>2.取引に係るリスクの内容及びリスクの管理体制 同左</p>
--	---

取引の時価等に関する事項

(平成20年10月7日現在)	(平成21年4月7日現在)
該当事項はありません。	同左

(関連当事者との取引に関する注記)

(自平成20年4月8日 至平成20年10月7日)	(自平成20年10月8日 至平成21年4月7日)
当計算期間中に利害関係人との間で、一般の取引条件と同様のもの以外の取引は行っておりません。 また、当ファンドの関連当事者である受託会社及び投資信託委託業者と財務諸表上で開示している報酬等の給付以外の取引は行っておりません。	同左

(1口当たり情報)

(平成20年10月7日現在)	(平成21年4月7日現在)
1口当たり純資産額 = 1.9309円	1口当たり純資産額 = 1.9319円

(3) 附属明細表(平成21年4月7日現在)

1) 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	T 0.875% 01/31/11	19,000,000.00	18,994,062.50	
		T 0.875% 02/28/11	16,000,000.00	15,987,500.00	
		T 0.875% 12/31/10	11,700,000.00	11,694,515.62	
		T 1.125% 01/15/12	12,000,000.00	11,940,000.00	
		T 1.125% 12/15/11	5,000,000.00	4,985,156.25	
		T 1.25% 11/30/10	6,000,000.00	6,037,500.00	
		T 1.375% 03/15/12	13,500,000.00	13,511,601.56	
		T 1.75% 03/31/10	300,000.00	303,234.37	
		T 1.75% 11/15/11	8,400,000.00	8,516,812.50	
		T 1.875% 02/28/14	7,800,000.00	7,804,875.00	
		T 2% 09/30/10	10,000,000.00	10,181,250.00	
		T 2.5% 03/31/13	11,800,000.00	12,223,140.62	
		T 2.625% 02/29/16	10,000,000.00	10,087,500.00	
		T 2.75% 02/15/19	1,600,000.00	1,576,250.00	
		T 2.75% 02/28/13	7,000,000.00	7,315,000.00	
		T 2.75% 07/31/10	19,800,000.00	20,325,937.50	
		T 2.75% 10/31/13	1,500,000.00	1,565,859.37	
		T 2.875% 01/31/13	19,000,000.00	19,938,125.00	
		T 2.875% 06/30/10	16,500,000.00	16,938,281.25	
		T 3.125% 08/31/13	3,500,000.00	3,708,906.25	
		T 3.375% 06/30/13	15,000,000.00	16,071,093.75	
		T 3.375% 07/31/13	10,800,000.00	11,574,562.50	
		T 3.375% 11/30/12	6,500,000.00	6,924,531.25	
		T 3.5% 02/15/18	7,700,000.00	8,116,281.25	
		T 3.5% 02/15/39	3,600,000.00	3,454,312.49	
		T 3.625% 05/15/13	7,750,000.00	8,370,000.00	
		T 3.625% 06/15/10	6,900,000.00	7,140,421.87	
		T 3.625% 12/31/12	5,800,000.00	6,241,343.75	
		T 3.75% 11/15/18	18,500,000.00	19,783,437.50	
		T 3.875% 02/15/13	7,400,000.00	8,045,187.50	
		T 3.875% 05/15/10	11,900,000.00	12,322,078.12	
		T 3.875% 05/15/18	6,700,000.00	7,256,937.50	
		T 3.875% 07/15/10	5,800,000.00	6,035,625.00	
		T 3.875% 09/15/10	4,100,000.00	4,286,421.87	
		T 3.875% 10/31/12	3,700,000.00	4,001,203.12	
		T 4% 02/15/14	5,450,000.00	5,999,257.81	
		T 4% 04/15/10	9,400,000.00	9,720,187.50	
		T 4.0% 08/15/18	15,000,000.00	16,357,031.25	
		T 4.0% 02/15/15	15,800,000.00	17,449,125.00	
		T 4.0% 11/15/12	1,700,000.00	1,849,546.87	
		T 4.125% 05/15/15	6,700,000.00	7,462,125.00	
		T 4.125% 08/31/12	5,600,000.00	6,087,375.00	

T 4.25% 01/15/11	5,500,000.00	5,836,015.62	
T 4.25% 08/15/13	12,600,000.00	13,982,062.50	
T 4.25% 08/15/14	11,700,000.00	13,083,890.62	
T 4.25% 08/15/15	18,000,000.00	20,221,875.00	
T 4.25% 09/30/12	6,400,000.00	6,992,000.00	
T 4.25% 10/15/10	5,200,000.00	5,482,750.00	
T 4.25% 11/15/13	5,100,000.00	5,663,390.62	
T 4.25% 11/15/14	10,000,000.00	11,212,500.00	
T 4.25% 11/15/17	9,600,000.00	10,698,000.00	
T 4.375% 02/15/38	7,700,000.00	8,526,546.87	
T 4.375% 08/15/12	4,200,000.00	4,608,187.50	
T 4.375% 12/15/10	8,800,000.00	9,319,750.00	
T 4.5% 02/28/11	8,100,000.00	8,640,421.87	
T 4.5% 05/15/38	2,000,000.00	2,273,125.00	
T 4.5% 02/15/16	7,700,000.00	8,728,671.87	
T 4.5% 02/15/36	9,700,000.00	10,904,921.87	
T 4.5% 03/31/12	4,000,000.00	4,366,875.00	
T 4.5% 04/30/12	8,200,000.00	8,961,062.50	
T 4.5% 05/15/10	10,000,000.00	10,420,312.50	
T 4.5% 05/15/17	3,300,000.00	3,735,187.50	
T 4.5% 09/30/11	13,500,000.00	14,596,875.00	
T 4.5% 11/15/10	5,000,000.00	5,296,875.00	
T 4.5% 11/15/15	11,600,000.00	13,249,375.00	
T 4.5% 11/30/11	6,000,000.00	6,511,875.00	
T 4.625% 02/15/17	5,000,000.00	5,711,718.74	
T 4.625% 02/29/12	1,000,000.00	1,093,906.25	
T 4.625% 08/31/11	7,100,000.00	7,691,296.87	
T 4.625% 10/31/11	5,000,000.00	5,433,593.75	
T 4.625% 11/15/16	7,600,000.00	8,667,562.50	
T 4.625% 12/31/11	7,700,000.00	8,402,625.00	
T 4.75% 01/31/12	8,000,000.00	8,778,750.00	
T 4.75% 02/15/37	6,400,000.00	7,490,000.00	
T 4.75% 03/31/11	6,300,000.00	6,773,484.37	
T 4.75% 05/15/14	8,400,000.00	9,587,812.50	
T 4.75% 05/31/12	6,300,000.00	6,942,796.87	
T 4.75% 08/15/17	9,500,000.00	10,914,609.37	
T 4.875% 02/15/12	8,000,000.00	8,808,750.00	
T 4.875% 04/30/11	6,000,000.00	6,480,937.50	
T 4.875% 05/31/11	4,900,000.00	5,308,843.75	
T 4.875% 06/30/12	5,000,000.00	5,537,500.00	
T 4.875% 07/31/11	2,000,000.00	2,175,312.50	
T 4.875% 08/15/16	5,400,000.00	6,248,812.50	

T 5% 02/15/11	5,000,000.00	5,382,031.25	
T 5.0% 05/15/37	3,600,000.00	4,373,437.50	
T 5.0% 08/15/11	6,140,000.00	6,715,625.00	
T 5.125% 05/15/16	5,800,000.00	6,800,500.00	
T 5.125% 06/30/11	3,500,000.00	3,817,187.50	
T 5.25% 02/15/29	1,350,000.00	1,617,468.75	
T 5.25% 11/15/28	1,900,000.00	2,271,687.50	
T 5.375% 02/15/31	5,410,000.00	6,643,310.93	
T 5.5% 08/15/28	3,700,000.00	4,541,750.00	
T 5.75% 08/15/10	7,500,000.00	8,016,796.87	
T 6.0% 02/15/26	5,200,000.00	6,676,312.50	
T 6.125% 08/15/29	3,500,000.00	4,638,593.75	
T 6.125% 11/15/27	5,220,000.00	6,823,518.75	
T 6.25% 05/15/30	5,780,000.00	7,813,837.50	
T 6.25% 08/15/23	6,390,000.00	8,220,135.93	
T 6.375% 08/15/27	1,900,000.00	2,545,406.25	
T 6.5% 11/15/26	4,110,000.00	5,559,417.18	
T 6.625% 02/15/27	2,850,000.00	3,904,500.00	
T 6.75% 08/15/26	2,000,000.00	2,771,562.50	
T 6.875% 08/15/25	3,100,000.00	4,332,734.37	
T 7.125% 02/15/23	6,000,000.00	8,258,437.50	
T 7.25% 05/15/16	7,650,000.00	9,923,484.37	
T 7.25% 08/15/22	3,700,000.00	5,111,781.25	
T 7.5% 11/15/16	6,100,000.00	8,061,531.25	
T 7.5% 11/15/24	600,000.00	880,500.00	
T 7.625% 02/15/25	3,400,000.00	5,059,625.00	
T 7.875% 02/15/21	900,000.00	1,280,390.62	
T 8.0% 11/15/21	7,810,000.00	11,313,517.18	
T 8.125% 05/15/21	4,100,000.00	5,956,531.25	
T 8.125% 08/15/19	3,000,000.00	4,278,281.25	
T 8.125% 8/15/21	2,900,000.00	4,223,125.00	
T 8.5% 02/15/20	3,400,000.00	4,993,218.75	
T 8.75% 08/15/20	7,900,000.00	11,841,359.37	
T 8.75% 05/15/17	7,800,000.00	11,078,437.50	
T 8.875% 02/15/19	6,700,000.00	9,939,031.25	
T 9.125% 05/15/18	2,000,000.00	2,980,000.00	
小計	843,610,000.00	942,189,518.57 (94,784,265,568)	
カナダドル			
CAN 1.25% 06/01/11	1,500,000.00	1,503,483.56	
CAN 2.75% 12/01/10	2,000,000.00	2,057,449.25	
CAN 3.0% 06/01/14	1,500,000.00	1,580,089.87	
CAN 3.5% 06/01/13	3,900,000.00	4,170,691.20	
CAN 3.75% 06/01/10	2,000,000.00	2,069,312.75	

	CAN 3.75% 06/01/12	2,600,000.00	2,783,011.88	
	CAN 3.75% 06/01/19	800,000.00	853,231.10	
	CAN 3.75% 09/01/11	3,500,000.00	3,705,946.34	
	CAN 4% 06/01/16	3,800,000.00	4,201,722.93	
	CAN 4% 06/01/17	2,700,000.00	2,972,715.01	
	CAN 4% 09/01/10	3,500,000.00	3,654,786.18	
	CAN 4.0% 06/01/41	500,000.00	525,544.06	
	CAN 4.25% 06/01/18	3,800,000.00	4,233,662.88	
	CAN 4.5% 06/01/15	4,500,000.00	5,110,425.27	
	CAN 5% 06/01/14	3,700,000.00	4,258,361.22	
	CAN 5% 06/01/37	3,700,000.00	4,528,765.30	
	CAN 5.25% 06/01/12	3,270,000.00	3,650,211.07	
	CAN 5.25% 06/01/13	4,420,000.00	5,034,754.32	
	CAN 5.5% 06/01/10	1,170,000.00	1,233,917.10	
	CAN 5.75% 06/01/33	4,710,000.00	6,168,262.80	
	CAN 5.75% 06/01/29	5,060,000.00	6,459,523.26	
	CAN 6% 06/01/11	4,020,000.00	4,432,853.75	
	CAN 8% 06/01/23	1,700,000.00	2,552,641.80	
	CAN 8% 06/01/27	2,700,000.00	4,193,827.14	
	CAN 9% 06/01/25	1,850,000.00	3,050,179.86	
小計		72,900,000.00	84,985,369.90 (6,863,418,473)	
イギリスポンド	UKT 3.75% 12/07/11	5,200,000.00	5,368,934.33	
	UKT 4% 03/07/22	1,500,000.00	1,522,345.68	
	UKT 4% 09/07/16	6,700,000.00	7,168,554.45	
	UKT 4.25% 03/07/11	8,100,000.00	8,523,852.75	
	UKT 4.25% 03/07/36	6,100,000.00	5,964,563.22	
	UKT 4.25% 06/07/32	7,110,000.00	7,118,356.91	
	UKT 4.25% 12/07/27	6,800,000.00	6,806,263.65	
	UKT 4.25% 12/07/46	6,400,000.00	6,197,015.99	
	UKT 4.25% 12/07/49	1,500,000.00	1,448,319.93	
	UKT 4.25% 12/07/55	7,500,000.00	7,271,083.12	
	UKT 4.5% 03/07/13	2,600,000.00	2,787,108.02	
	UKT 4.5% 03/07/19	5,800,000.00	6,312,975.20	
	UKT 4.5% 12/07/42	6,600,000.00	6,684,072.45	
	UKT 4.75% 03/07/20	4,300,000.00	4,753,030.25	
	UKT 4.75% 06/07/10	3,400,000.00	3,546,529.36	
	UKT 4.75% 09/07/15	10,000,000.00	11,105,542.50	
	UKT 4.75% 12/07/30	4,600,000.00	4,908,559.37	
	UKT 4.75% 12/07/38	7,600,000.00	8,132,537.69	
	UKT 5% 03/07/12	8,000,000.00	8,620,432.00	
	UKT 5% 03/07/18	4,200,000.00	4,774,905.97	
	UKT 5% 03/07/25	6,370,000.00	6,989,487.27	

	UKT 5.0% 09/07/14	5,260,000.00	5,894,194.25	
	UKT 5.25% 06/07/12	10,000,000.00	10,874,292.50	
	UKT 6% 12/07/28	5,510,000.00	6,813,095.71	
	UKT 6.25% 11/25/10	6,050,000.00	6,545,436.76	
	UKT 8% 06/07/21	6,340,000.00	9,081,815.42	
	UKT 8% 09/27/13	2,400,000.00	2,936,811.90	
	UKT 8% 12/07/15	2,145,000.00	2,817,935.56	
	UKT 8.75% 08/25/17	5,310,000.00	7,493,226.41	
	UKT 9.0% 07/12/11	1,200,000.00	1,394,764.95	
小計		164,595,000.00	179,856,043.57 (26,557,543,393)	
シンガポールドル	SIGB 1.625% 04/01/13	800,000.00	819,553.30	
	SIGB 2.25% 07/01/13	1,200,000.00	1,258,299.97	
	SIGB 2.5% 10/01/12	700,000.00	738,914.13	
	SIGB 2.625% 04/01/10	1,400,000.00	1,430,345.00	
	SIGB 2.625% 04/01/12	1,100,000.00	1,161,902.50	
	SIGB 3.125% 02/01/11	1,300,000.00	1,360,915.80	
	SIGB 3.125% 09/01/22	1,100,000.00	1,160,564.07	
	SIGB 3.25% 09/01/20	800,000.00	867,800.00	
	SIGB 3.5% 03/01/27	1,400,000.00	1,490,533.27	
	SIGB 3.5% 07/01/12	1,500,000.00	1,629,450.00	
	SIGB 3.625% 07/01/11	1,200,000.00	1,281,099.97	
	SIGB 3.625% 07/01/14	600,000.00	667,575.00	
	SIGB 3.75% 09/01/16	1,600,000.00	1,810,080.00	
	SIGB 4% 09/01/18	1,500,000.00	1,747,200.00	
	SIGB 4.625% 07/01/10	1,400,000.00	1,472,181.63	
小計		17,600,000.00	18,896,414.64 (1,259,823,964)	
マレーシアリングgit	MGS 2.509% 08/27/12	1,600,000.00	1,577,120.00	
	MGS 3.461% 07/31/13	3,100,000.00	3,104,740.09	
	MGS 3.502% 05/31/27	3,200,000.00	2,773,607.20	
	MGS 3.702% 02/25/13	2,500,000.00	2,519,041.56	
	MGS 3.718% 06/15/12	14,300,000.00	14,605,065.47	
	MGS 3.756% 04/28/11	3,000,000.00	3,068,749.87	
	MGS 3.814% 02/15/17	2,000,000.00	1,974,529.37	
	MGS 3.869% 04/13/10	8,300,000.00	8,458,392.01	
	MGS 4.24% 02/07/18	400,000.00	404,316.10	
	MGS 4.262% 09/15/16	11,300,000.00	11,530,144.27	
	MGS 5.094% 04/30/14	3,200,000.00	3,416,000.00	
	MGS 5.248% 09/15/28	1,700,000.00	1,844,426.79	
小計		54,600,000.00	55,276,132.73 (1,553,259,329)	
スウェーデンクローナ	SGB 3% 07/12/16	15,200,000.00	15,279,593.85	

	SGB 3.5% 03/30/39	12,500,000.00	11,629,551.56	
	SGB 3.75% 08/12/17	15,100,000.00	15,860,117.96	
	SGB 4.25% 03/12/19	12,000,000.00	13,020,401.25	
	SGB 4.5% 08/12/15	7,500,000.00	8,254,958.43	
	SGB 5% 12/01/20	20,000,000.00	22,939,776.26	
	SGB 5.25% 03/15/11	15,290,000.00	16,468,619.14	
	SGB 5.5% 10/08/12	20,000,000.00	22,336,658.76	
	SGB 6.75% 05/05/14	24,600,000.00	29,549,215.57	
小計		142,190,000.00	155,338,892.78 (1,932,415,826)	
ノルウェークローネ	NGB 4.25% 05/19/17	8,500,000.00	8,765,625.00	
	NGB 5% 05/15/15	13,000,000.00	14,055,437.50	
	NGB 6% 05/16/11	14,500,000.00	15,638,007.12	
	NGB 6.5% 05/15/13	15,700,000.00	17,808,457.01	
小計		51,700,000.00	56,267,526.63 (857,517,105)	
デンマーククローネ	DGB 4% 11/15/15	21,700,000.00	22,359,557.93	
	DGB 4% 11/15/17	16,700,000.00	17,175,160.92	
	DGB 4% 11/15/10	10,100,000.00	10,421,275.95	
	DGB 4.5% 11/15/39	27,100,000.00	28,382,195.85	
	DGB 5% 11/15/13	19,690,000.00	21,282,217.08	
	DGB 6% 11/15/11	26,500,000.00	28,967,179.81	
	DGB 7% 11/10/24	7,440,000.00	9,796,140.58	
小計		129,230,000.00	138,383,728.12 (2,495,058,618)	
ポーランドズロチ	POLGB 0% 07/25/10	3,900,000.00	3,663,811.12	
	POLGB 0% 07/25/11	2,400,000.00	2,120,888.40	
	POLGB 4.25% 05/24/11	8,100,000.00	7,911,890.66	
	POLGB 4.75% 04/25/12	9,700,000.00	9,466,698.02	
	POLGB 5% 10/24/13	7,100,000.00	6,851,594.07	
	POLGB 5.25% 04/25/13	6,700,000.00	6,556,244.80	
	POLGB 5.25% 10/25/17	8,200,000.00	7,739,965.65	
	POLGB 5.5% 10/25/19	1,900,000.00	1,795,188.40	
	POLGB 5.75% 04/25/14	1,300,000.00	1,287,112.61	
	POLGB 5.75% 09/23/22	7,800,000.00	7,388,565.60	
	POLGB 6% 11/24/10	8,500,000.00	8,605,026.00	
	POLGB 6.25% 10/24/15	8,700,000.00	8,800,099.48	
小計		74,300,000.00	72,187,084.81 (2,189,434,282)	
ユーロ	BGB 3.25% 09/28/16	3,100,000.00	3,008,312.07	
	BGB 3.5% 03/28/11	3,000,000.00	3,088,987.12	
	BGB 3.5% 03/28/15	1,000,000.00	998,933.18	
	BGB 3.75% 09/28/15	4,000,000.00	4,034,578.00	
	BGB 4% 03/28/14	2,300,000.00	2,378,123.52	

BGB 4% 03/28/18	2,500,000.00	2,522,577.65	
BGB 4% 03/28/22	3,400,000.00	3,333,561.87	
BGB 4.0% 03/28/13	3,600,000.00	3,746,797.20	
BGB 4.0% 03/28/17	4,000,000.00	4,056,264.25	
BGB 4.0% 03/28/19	2,000,000.00	2,002,630.24	
BGB 4.25% 09/28/13	4,900,000.00	5,141,145.53	
BGB 4.25% 9/28/14	5,000,000.00	5,234,081.25	
BGB 5% 03/28/35	4,500,000.00	4,747,546.68	
BGB 5% 09/28/12	6,100,000.00	6,571,138.07	
BGB 5.0% 09/28/11	4,600,000.00	4,905,202.52	
BGB 5.5% 03/28/28	3,500,000.00	3,926,314.87	
BGB 5.5% 09/28/17	3,300,000.00	3,700,232.66	
BGB 5.75% 09/28/10	3,600,000.00	3,812,399.09	
BGB 8.0% 03/28/15	2,000,000.00	2,479,505.00	
BKO 1.25% 03/11/11	1,100,000.00	1,094,829.31	
BKO 2.25% 12/10/10	500,000.00	506,591.25	
BKO 4% 09/10/10	7,500,000.00	7,780,874.06	
BKO 4.75% 06/11/10	2,600,000.00	2,707,509.02	
BTNS 2.5% 01/12/14	600,000.00	592,243.87	
BTNS 2.5% 07/12/10	5,100,000.00	5,173,672.68	
BTNS 3% 01/12/11	7,700,000.00	7,892,708.86	
BTNS 3.5% 07/12/11	7,300,000.00	7,573,145.92	
BTNS 3.75% 01/12/12	4,000,000.00	4,180,846.00	
BTNS 3.75% 01/12/13	5,400,000.00	5,642,558.55	
BTNS 3.75% 09/12/10	4,300,000.00	4,442,066.08	
BTNS 4.5% 07/12/12	3,300,000.00	3,529,244.40	
BTNS 4.5% 07/12/13	1,000,000.00	1,073,264.12	
BTPS 2.75% 06/15/10	3,000,000.00	3,041,562.00	
BTPS 3% 03/01/12	1,500,000.00	1,515,767.06	
BTPS 3.5% 03/15/11	8,700,000.00	8,933,583.03	
BTPS 3.75% 02/01/11	7,000,000.00	7,210,882.00	
BTPS 3.75% 08/01/15	7,500,000.00	7,631,818.12	
BTPS 3.75% 08/01/16	9,600,000.00	9,676,989.60	
BTPS 3.75% 08/01/21	5,400,000.00	5,025,449.92	
BTPS 3.75% 09/15/11	5,400,000.00	5,576,402.47	
BTPS 3.75% 12/15/13	2,000,000.00	2,036,050.75	
BTPS 4% 02/01/17	7,500,000.00	7,626,319.68	
BTPS 4% 02/01/37	7,200,000.00	6,018,958.80	
BTPS 4% 04/15/12	5,500,000.00	5,717,709.25	
BTPS 4.25% 02/01/15	7,400,000.00	7,716,345.37	
BTPS 4.25% 02/01/19	7,400,000.00	7,426,967.45	
BTPS 4.25% 04/15/13	1,000,000.00	1,041,912.75	

BTPS 4.25% 08/01/13	11,000,000.00	11,471,345.87	
BTPS 4.25% 08/01/14	8,500,000.00	8,863,904.12	
BTPS 4.25% 09/01/11	800,000.00	834,279.70	
BTPS 4.25% 10/15/12	5,100,000.00	5,331,546.37	
BTPS 4.5% 08/01/10	5,800,000.00	6,016,709.02	
BTPS 4.5% 02/01/18	7,500,000.00	7,786,206.56	
BTPS 4.5% 02/01/20	8,500,000.00	8,553,249.31	
BTPS 4.5% 03/01/19	4,900,000.00	4,960,054.40	
BTPS 4.5% 08/01/18	6,500,000.00	6,668,078.62	
BTPS 4.75% 02/01/13	10,300,000.00	10,940,681.88	
BTPS 4.75% 08/01/23	2,600,000.00	2,592,434.97	
BTPS 5% 02/01/12	8,970,000.00	9,564,207.55	
BTPS 5% 08/01/34	6,200,000.00	6,016,547.42	
BTPS 5.0% 08/01/39	4,300,000.00	4,128,000.53	
BTPS 5.25% 08/01/11	8,360,000.00	8,899,183.42	
BTPS 5.25% 08/01/17	5,540,000.00	6,078,754.61	
BTPS 5.25% 11/01/29	8,300,000.00	8,324,348.05	
BTPS 5.5% 11/01/10	8,800,000.00	9,291,079.60	
BTPS 5.75% 02/01/33	5,500,000.00	5,775,644.18	
BTPS 6% 05/01/31	10,380,000.00	11,198,265.78	
BTPS 6.5% 11/01/27	8,500,000.00	9,742,982.62	
BTPS 7.25% 11/01/26	3,100,000.00	3,856,009.78	
BTPS 9% 11/01/23	4,050,000.00	5,807,538.50	
DBR 3.25% 07/04/15	7,600,000.00	7,810,120.05	
DBR 3.5% 01/04/16	8,000,000.00	8,303,905.00	
DBR 3.75% 01/04/17	6,700,000.00	7,023,787.55	
DBR 3.75% 01/04/19	4,800,000.00	5,010,309.60	
DBR 3.75% 01/04/15	6,200,000.00	6,555,587.05	
DBR 3.75% 07/04/13	8,900,000.00	9,386,695.38	
DBR 4% 01/04/37	7,400,000.00	7,250,777.15	
DBR 4% 07/04/16	8,300,000.00	8,841,662.15	
DBR 4.0% 01/04/18	6,500,000.00	6,933,474.43	
DBR 4.25% 01/04/14	9,200,000.00	9,932,417.75	
DBR 4.25% 07/04/14	9,150,000.00	9,919,971.35	
DBR 4.25% 07/04/17	7,200,000.00	7,792,722.90	
DBR 4.25% 07/04/18	7,800,000.00	8,479,166.46	
DBR 4.25% 07/04/39	4,400,000.00	4,547,888.95	
DBR 4.5% 01/04/13	10,200,000.00	11,010,596.55	
DBR 4.75% 07/04/28	4,100,000.00	4,400,681.18	
DBR 4.75% 07/04/34	6,900,000.00	7,423,078.65	
DBR 4.75% 07/04/40	1,000,000.00	1,117,759.12	
DBR 5.0% 01/04/12	9,280,000.00	10,061,135.88	

DBR 5.0% 07/04/11	9,070,000.00	9,737,356.99	
DBR 5.0% 07/04/12	5,560,000.00	6,064,583.90	
DBR 5.25% 01/04/11	5,480,000.00	5,835,556.78	
DBR 5.25% 07/04/10	6,800,000.00	7,134,282.90	
DBR 5.5% 01/04/31	5,900,000.00	6,891,952.25	
DBR 5.625% 01/04/28	3,270,000.00	3,849,175.04	
DBR 6% 06/20/16	560,000.00	664,999.23	
DBR 6.25% 01/04/24	3,700,000.00	4,643,576.77	
DBR 6.25% 01/04/30	2,400,000.00	3,033,130.50	
DBR 6.5% 07/04/27	4,300,000.00	5,538,024.82	
FRTR 3% 10/25/15	7,700,000.00	7,636,103.47	
FRTR 3.25% 04/25/16	6,700,000.00	6,694,075.52	
FRTR 3.5% 04/25/15	8,500,000.00	8,717,998.43	
FRTR 3.75% 04/25/17	8,900,000.00	9,080,865.80	
FRTR 3.75% 04/25/21	6,700,000.00	6,599,737.85	
FRTR 4% 04/25/14	6,600,000.00	6,958,078.87	
FRTR 4% 04/25/18	7,400,000.00	7,629,313.04	
FRTR 4% 04/25/55	5,000,000.00	4,735,062.50	
FRTR 4% 10/25/13	8,400,000.00	8,859,141.89	
FRTR 4% 10/25/14	3,700,000.00	3,896,675.81	
FRTR 4% 10/25/38	5,300,000.00	5,059,643.00	
FRTR 4.0% 04/25/13	7,500,000.00	7,895,812.50	
FRTR 4.25% 04/25/19	10,200,000.00	10,657,203.52	
FRTR 4.25% 10/25/17	6,200,000.00	6,522,448.05	
FRTR 4.25% 10/25/18	900,000.00	941,447.25	
FRTR 4.25% 10/25/23	4,400,000.00	4,478,686.85	
FRTR 4.75% 04/25/35	5,600,000.00	5,944,981.00	
FRTR 4.75% 10/25/12	9,000,000.00	9,706,329.00	
FRTR 5% 04/25/12	6,100,000.00	6,604,549.30	
FRTR 5% 10/25/16	8,210,000.00	9,096,426.51	
FRTR 5.0% 10/25/11	4,620,000.00	4,969,999.07	
FRTR 5.5% 10/25/10	6,360,000.00	6,750,944.43	
FRTR 5.5% 04/25/29	4,680,000.00	5,383,351.93	
FRTR 5.5% 04/25/10	5,565,000.00	5,818,879.47	
FRTR 5.75% 10/25/32	6,500,000.00	7,805,229.25	
FRTR 6.0% 10/25/25	2,800,000.00	3,412,371.90	
FRTR 6.5% 04/25/11	5,420,000.00	5,942,137.73	
FRTR 8.5% 04/25/23	3,800,000.00	5,593,863.62	
FRTR 8.5% 10/25/19	520,000.00	731,738.93	
GGB 3.1% 04/20/10	3,000,000.00	3,034,941.55	
GGB 3.6% 07/20/16	2,000,000.00	1,815,410.12	
GGB 3.7% 07/20/15	3,100,000.00	2,920,742.50	

GGB 3.8% 03/20/11	3,000,000.00	3,044,421.75	
GGB 3.9% 08/20/11	2,300,000.00	2,328,522.58	
GGB 4% 08/20/13	1,000,000.00	983,356.31	
GGB 4.1% 08/20/12	3,100,000.00	3,105,134.37	
GGB 4.3% 07/20/17	4,300,000.00	4,005,771.69	
GGB 4.5% 05/20/14	3,600,000.00	3,579,841.35	
GGB 4.5% 09/20/37	3,400,000.00	2,787,917.55	
GGB 4.6% 05/20/13	2,600,000.00	2,630,343.95	
GGB 4.6% 07/20/18	2,400,000.00	2,259,399.29	
GGB 4.6% 09/20/40	2,000,000.00	1,629,552.50	
GGB 4.7% 03/20/24	3,300,000.00	2,946,477.60	
GGB 5.25% 05/18/12	3,080,000.00	3,203,184.98	
GGB 5.35% 05/18/11	2,100,000.00	2,191,471.27	
GGB 5.5% 08/20/14	1,100,000.00	1,134,062.05	
GGB 5.9% 10/22/22	2,500,000.00	2,597,348.75	
GGB 6% 05/19/10	2,720,000.00	2,834,252.24	
GGB 6% 07/19/19	2,000,000.00	2,055,572.25	
GGB 6.5% 01/11/14	1,860,000.00	2,023,387.51	
GGB 6.5% 10/22/19	3,070,000.00	3,338,827.81	
IRISH 3.9% 03/05/12	1,300,000.00	1,312,352.76	
IRISH 4% 11/11/11	1,200,000.00	1,222,408.27	
IRISH 4.4% 06/18/19	2,300,000.00	2,151,026.26	
IRISH 4.5% 04/18/20	2,400,000.00	2,232,455.10	
IRISH 4.5% 10/18/18	2,300,000.00	2,206,933.37	
IRISH 4.6% 04/18/16	1,600,000.00	1,587,857.20	
IRISH 5% 04/18/13	3,600,000.00	3,723,291.90	
NETHER 3.25% 07/15/15	2,100,000.00	2,112,990.60	
NETHER 3.75% 07/15/14	5,300,000.00	5,509,776.65	
NETHER 3.75% 01/15/23	2,200,000.00	2,125,038.98	
NETHER 4% 01/15/37	3,900,000.00	3,754,567.53	
NETHER 4% 07/15/16	3,100,000.00	3,219,119.62	
NETHER 4% 07/15/19	1,100,000.00	1,116,670.36	
NETHER 4.0% 01/15/11	3,200,000.00	3,331,734.40	
NETHER 4.0% 07/15/18	2,700,000.00	2,766,487.16	
NETHER 4.25% 07/15/13	4,900,000.00	5,198,940.42	
NETHER 4.5% 07/15/17	4,900,000.00	5,222,925.92	
NETHER 5% 07/15/12	4,200,000.00	4,541,834.32	
NETHER 5% 07/15/11	5,500,000.00	5,880,136.62	
NETHER 5.5% 01/15/28	3,200,000.00	3,676,488.80	
NETHER 5.5% 07/15/10	4,300,000.00	4,520,583.55	
NETHER 7.5% 01/15/23	2,100,000.00	2,847,075.39	
OBL 2.5% 10/08/10	3,700,000.00	3,763,123.85	

OBL 3.25% 04/09/10	7,700,000.00	7,870,274.91	
OBL 3.5% 04/08/11	9,100,000.00	9,442,749.22	
OBL 3.5% 04/12/13	7,300,000.00	7,635,216.90	
OBL 3.5% 10/14/11	5,400,000.00	5,643,504.22	
OBL 4% 04/13/12	5,600,000.00	5,942,631.10	
OBL 4.25% 10/12/12	5,900,000.00	6,320,066.72	
PGB 3.2% 04/15/11	1,900,000.00	1,937,088.35	
PGB 3.35% 10/15/15	2,000,000.00	1,955,724.25	
PGB 3.85% 04/15/21	2,100,000.00	1,992,460.83	
PGB 4.1% 04/15/37	2,100,000.00	1,920,677.06	
PGB 4.2% 10/15/16	1,300,000.00	1,319,273.23	
PGB 4.35% 10/16/17	2,000,000.00	2,026,033.50	
PGB 4.375% 06/16/14	1,300,000.00	1,348,870.33	
PGB 4.45% 06/15/18	2,300,000.00	2,322,202.18	
PGB 4.75% 06/14/19	900,000.00	914,970.82	
PGB 4.95% 10/25/23	1,300,000.00	1,335,701.97	
PGB 5% 06/15/12	2,700,000.00	2,877,532.76	
PGB 5.15% 06/15/11	1,900,000.00	2,014,896.32	
PGB 5.45% 09/23/13	2,100,000.00	2,280,053.73	
PGB 5.85% 05/20/10	1,700,000.00	1,780,905.55	
RAGB 3.5% 07/15/15	3,100,000.00	3,105,667.77	
RAGB 3.5% 09/15/21	3,400,000.00	3,138,525.55	
RAGB 3.8% 10/20/13	4,700,000.00	4,858,051.60	
RAGB 3.9% 07/15/20	2,900,000.00	2,815,371.11	
RAGB 4% 09/15/16	2,700,000.00	2,744,045.10	
RAGB 4.15% 03/15/37	2,000,000.00	1,813,031.87	
RAGB 4.3% 07/15/14	3,400,000.00	3,573,969.50	
RAGB 4.3% 09/15/17	2,100,000.00	2,154,719.96	
RAGB 4.35% 03/15/19	1,600,000.00	1,632,459.00	
RAGB 4.65% 01/15/18	3,900,000.00	4,094,463.26	
RAGB 5.0% 07/15/12	3,100,000.00	3,333,452.08	
RAGB 5.25% 01/04/11	2,500,000.00	2,648,351.71	
RAGB 6.25% 07/15/27	2,000,000.00	2,356,909.62	
RFGB 2.75% 09/15/10	1,100,000.00	1,121,783.98	
RFGB 3.125% 09/15/14	1,600,000.00	1,601,953.20	
RFGB 3.875% 09/15/17	2,000,000.00	2,034,969.12	
RFGB 4.25% 07/04/15	1,500,000.00	1,591,080.65	
RFGB 4.25% 09/15/12	2,000,000.00	2,119,886.00	
RFGB 4.375% 07/04/19	1,300,000.00	1,359,934.71	
RFGB 5.375% 07/04/13	1,900,000.00	2,099,580.03	
RFGB 5.75% 02/23/11	2,300,000.00	2,474,778.58	
SPGB 3.15% 01/31/16	6,100,000.00	5,936,020.55	

		SPGB 3.25% 07/30/10	7,000,000.00	7,172,764.37	
		SPGB 3.8% 01/31/17	4,600,000.00	4,616,768.15	
		SPGB 3.9% 10/31/12	3,200,000.00	3,332,781.60	
		SPGB 4.1% 04/30/11	2,000,000.00	2,086,656.00	
		SPGB 4.1% 07/30/18	5,400,000.00	5,497,494.30	
		SPGB 4.2% 01/31/37	4,700,000.00	4,369,957.77	
		SPGB 4.2% 07/30/13	4,700,000.00	4,931,936.18	
		SPGB 4.25% 01/31/14	600,000.00	629,947.91	
		SPGB 4.4% 01/31/15	4,600,000.00	4,844,226.65	
		SPGB 4.6% 07/30/19	3,700,000.00	3,856,581.68	
		SPGB 4.75% 07/30/14	4,900,000.00	5,260,917.45	
		SPGB 4.8% 01/31/24	700,000.00	723,447.20	
		SPGB 4.9% 07/30/40	2,900,000.00	3,031,221.91	
		SPGB 5% 07/30/12	5,200,000.00	5,596,664.45	
		SPGB 5.35% 10/31/11	5,200,000.00	5,601,403.60	
		SPGB 5.4% 07/30/11	5,200,000.00	5,579,618.20	
		SPGB 5.5% 07/30/17	3,800,000.00	4,255,308.40	
		SPGB 5.75% 07/30/32	4,100,000.00	4,678,863.11	
		SPGB 6.0% 01/31/29	5,200,000.00	6,061,346.84	
		SPGB 6.15% 01/31/13	4,500,000.00	5,039,899.87	
	小計		1,044,975,000.00	1,095,224,532.36 (147,044,845,714)	
国債証券計				(285,537,582,272)	
特殊債券	オーストラリアドル	NSWTC 5.5% 03/01/17	3,200,000.00	3,208,736.00	
		NSWTC 5.5% 08/01/14	800,000.00	816,580.00	
		NSWTC 6% 05/01/12	2,000,000.00	2,091,110.00	
		NSWTC 6% 10/01/09	1,800,000.00	1,824,931.35	
		NSWTC 7% 12/01/10	500,000.00	527,825.00	
		QTC 6% 06/14/11	1,000,000.00	1,042,275.00	
		QTC 6% 08/14/13	2,800,000.00	2,918,818.00	
		QTC 6% 09/14/17	4,700,000.00	4,841,070.50	
		QTC 6% 10/14/15	1,500,000.00	1,556,250.00	
	小計		18,300,000.00	18,827,595.85 (1,340,713,100)	
特殊債券計				(1,340,713,100)	
合計				(286,878,295,372)	

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

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

(注3) 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券時価比率	合計金額に対する比率
アメリカドル	国債証券 120銘柄	100.0%	33.0%

カナダドル	国債証券	25銘柄	100.0%	2.4%
オーストラリアドル	特殊債券	9銘柄	100.0%	0.5%
イギリスポンド	国債証券	30銘柄	100.0%	9.3%
シンガポールドル	国債証券	15銘柄	100.0%	0.4%
マレーシアリングgit	国債証券	12銘柄	100.0%	0.5%
スウェーデンクローナ	国債証券	9銘柄	100.0%	0.7%
ノルウェークローネ	国債証券	4銘柄	100.0%	0.3%
デンマーククローネ	国債証券	7銘柄	100.0%	0.9%
ポーランドズロチ	国債証券	12銘柄	100.0%	0.8%
ユーロ	国債証券	235銘柄	100.0%	51.2%

2) 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

3) デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

[次へ](#)

2. 住信 F0Fs用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）

(1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) 当ファンドの計算期間は6ヶ月未満であるため、財務諸表は6ヶ月毎に作成しております。

(3) 当ファンドは、前期（平成20年4月8日から平成20年10月7日まで）及び当期（平成20年10月8日から平成21年4月7日まで）の財務諸表について、あずさ監査法人により監査を受けております。

財務諸表

住信 F0Fs用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	前期 (平成20年10月 7日現在)	当期 (平成21年 4月 7日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,979,210	1,992,787
親投資信託受益証券	14,152,253,469	12,547,504,529
未収入金		400,000
未収利息	49	3
流動資産合計	14,156,232,728	12,549,897,319
資産合計	14,156,232,728	12,549,897,319
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	261,926	192,990
未払委託者報酬	2,750,189	2,026,388
その他未払費用	65,472	48,237
流動負債合計	3,077,587	2,267,615
負債合計	3,077,587	2,267,615
純資産の部		
元本等		
元本	24,845,972,357	25,564,436,136
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	10,692,817,216	13,016,806,432
元本等合計	14,153,155,141	12,547,629,704

純資産合計	14,153,155,141	12,547,629,704
負債純資産合計	14,156,232,728	12,549,897,319

(2) 損益及び剰余金計算書

(単位:円)

	前期 (自平成20年4月8日 至平成20年10月7日)	当期 (自平成20年10月8日 至平成21年4月7日)
営業収益		
受取利息	269,048	1,459
有価証券売買等損益	4,387,300,890	1,930,855,283
派生商品取引等損益	11,797,300	
営業収益合計	4,398,829,142	1,930,853,824
営業費用		
受託者報酬	1,656,498	1,248,658
委託者報酬	17,393,097	13,110,850
その他費用	414,059	312,105
営業費用合計	19,463,654	14,671,613
営業利益又は営業損失()	4,418,292,796	1,945,525,437
経常利益又は経常損失()	4,418,292,796	1,945,525,437
当期純利益又は当期純損失()	4,418,292,796	1,945,525,437
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()		
期首剰余金又は期首欠損金()	4,641,409,190	10,692,817,216
剰余金増加額又は欠損金減少額		
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,633,115,230	378,463,779
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,633,115,230	378,463,779
分配金		
期末剰余金又は期末欠損金()	10,692,817,216	13,016,806,432

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	前期 (自平成20年4月8日 至平成20年10月7日)	当期 (自平成20年10月8日 至平成21年4月7日)
資産の評価基準及び評価方法	(1) 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

	(2) 先物取引 個別法に基づき、時価評価しております。	
--	---------------------------------	--

(貸借対照表に関する注記)

	前期 (平成20年10月7日現在)	当期 (平成21年4月7日現在)
1. 期首元本額	18,875,857,127円	24,845,972,357円
期中追加設定元本額	5,970,115,230円	718,463,779円
期中一部解約元本額		
期末元本額	24,845,972,357円	25,564,436,136円
2. 元本の欠損	純資産額は、元本を 10,692,817,216円下回っており ます。	純資産額は、元本を 13,016,806,432円下回っており ます。
3. 特定期間末日における受益権の総数	24,845,972,357口	25,564,436,136口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

	前期 (自平成20年4月8日 至平成20年10月7日)	当期 (自平成20年10月8日 至平成21年4月7日)
分配金の計算過程	<p>平成20年4月8日から平成20年5月7日までの計算期間末において、経費控除後の配当等収益（1,850,379円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、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（311,693,356円）及び分配準備積立金（925,511,646円）により、分配対象収益は1,239,055,381円（1万口当たり635円56銭）ですが、分配は見送りとさせていただきます。</p> <p>平成20年5月8日から平成20年6月9日までの計算期間末において、経費控除後の配当等収益（2,790,361円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、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（373,296,030円）及び分配準備積立金（927,362,025円）により、分配対象収益は1,303,448,416円（1万口当たり636円94銭）ですが、分配は見送りとさせていただきます。</p>	<p>平成20年10月8日から平成20年11月7日までの計算期間末において、経費控除後の配当等収益（0円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、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（655,903,369円）及び分配準備積立金（1,058,660,950円）により、分配対象収益は1,714,564,319円（1万口当たり690円07銭）であります。分配は見送りとさせていただきます。</p> <p>平成20年11月8日から平成20年12月8日までの計算期間末において、経費控除後の配当等収益（0円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、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（668,683,039円）及び分配準備積立金（1,058,660,950円）により、分配対象収益は1,727,343,989円（1万口当たり690円07銭）であります。分配は見送りとさせていただきます。</p>

平成20年6月10日から平成20年7月7日までの計算期間末において、経費控除後の配当等収益（6,429,591円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、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（411,789,620円）及び分配準備積立金（930,152,386円）により、分配対象収益は1,348,371,597円（1万口当たり640円02銭）ですが、分配は見送りとさせていただきます。

平成20年7月8日から平成20年8月7日までの計算期間末において、経費控除後の配当等収益（0円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、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（475,593,167円）及び分配準備積立金（936,581,977円）により、分配対象収益は1,412,175,144円（1万口当たり640円03銭）ですが、分配は見送りとさせていただきます。

平成20年8月8日から平成20年9月8日までの計算期間末において、経費控除後の配当等収益（0円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、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（537,734,595円）及び分配準備積立金（936,581,977円）により、分配対象収益は1,474,316,572円（1万口当たり640円04銭）ですが、分配は見送りとさせていただきます。

平成20年9月9日から平成20年10月7日までの計算期間末において、経費控除後の配当等収益（122,078,973円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、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（655,903,369円）及び分配準備積立金（936,581,977円）により、分配対象収益は1,714,564,319円（1万口当たり690円07銭）ですが、分配は見送りとさせていただきます。

平成20年12月9日から平成21年1月7日までの計算期間末において、経費控除後の配当等収益（12,032,718円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、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（668,683,039円）及び分配準備積立金（1,058,660,950円）により、分配対象収益は1,739,376,707円（1万口当たり694円88銭）であります。分配は見送りとさせていただきます。

平成21年1月8日から平成21年2月9日までの計算期間末において、経費控除後の配当等収益（0円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、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（678,872,120円）及び分配準備積立金（1,070,693,668円）により、分配対象収益は1,749,565,788円（1万口当たり694円88銭）であります。分配は見送りとさせていただきます。

平成21年2月10日から平成21年3月9日までの計算期間末において、経費控除後の配当等収益（2,546,327円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、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（685,089,766円）及び分配準備積立金（1,070,693,668円）により、分配対象収益は1,758,329,761円（1万口当たり695円89銭）であります。分配は見送りとさせていただきます。

平成21年3月10日から平成21年4月7日までの計算期間末において、経費控除後の配当等収益（127,843,849円、本ファンドに帰属すべき親投資信託の配当等収益を含む）、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（706,827,647円）及び分配準備積立金（1,073,239,995円）により、分配対象収益は1,907,911,491円（1万口当たり746円31銭）であります。分配は見送りとさせていただきます。

（有価証券に関する注記）

前期（平成20年10月7日現在）

売買目的有価証券の貸借対照表計上額及び最終の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）	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	14,152,253,469	3,226,310,237
合 計	14,152,253,469	3,226,310,237

当期(平成21年4月7日現在)

売買目的有価証券の貸借対照表計上額及び最終の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)	最終の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	12,547,504,529	1,950,619,958
合計	12,547,504,529	1,950,619,958

(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

前期 (自平成20年4月8日 至平成20年10月7日)	当期 (自平成20年10月8日 至平成21年4月7日)
<p>1. 取引の内容、取引に対する取組方法及び取引の利用目的 当ファンドは、約款に基づき投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における市場デリバティブ取引ならびに外国金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。</p> <p>2. 取引に係るリスクの内容及びリスクの管理体制 デリバティブ取引には、市場リスクがあります。当ファンドが利用するデリバティブ取引は、約款に基づき、金融商品取引所取引のみであり、信用リスクはないものと考えられます。なお、デリバティブ取引の執行は、取引権限を定めた社内ルールに従い行っており、市場リスクの管理については、ポジションやリスク評価額を日々算出し、リスクをコントロールする体制としています。</p>	該当事項はありません。

取引の時価等に関する事項

前期 (平成20年10月7日現在)	当期 (平成21年4月7日現在)
該当事項はありません。	同左

(関連当事者との取引に関する注記)

前期 (自平成20年4月8日 至平成20年10月7日)	当期 (自平成20年10月8日 至平成21年4月7日)
当特定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いません。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いません。	同左

(1口当たり情報)

前期 (平成20年10月7日現在)	当期 (平成21年4月7日現在)
1口当たり純資産額 = 0.5696円	1口当たり純資産額 = 0.4908円

(4) 附属明細表（平成21年4月7日現在）

1) 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	総口数(口)	評価額(円)
親投資信託 受益証券	住信 国内株式インデックス マザーファンド	20,234,646,879	12,547,504,529
合計		20,234,646,879	12,547,504,529

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)

「住信 FOFs用日本株式インデックス・オープン（適格機関投資家専用）」は、「住信 国内株式インデックスマザーファンド」を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、「住信 国内株式インデックス マザーファンド」の受益証券です。

「住信 国内株式インデックス 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 国内株式インデックス マザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	(平成20年10月 7日現在)	(平成21年 4月 7日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	9,798,071,957	6,340,503,681
株式	111,038,340,252	115,611,212,520
派生商品評価勘定		664,327,640
未収入金	3,202,308	15,584,394
未収配当金	1,100,027,960	1,285,484,480

未収利息	122,567	10,245
前払金	1,501,501,000	
差入委託証拠金	523,800,000	523,380,000
流動資産合計	123,965,066,044	124,440,502,960
資産合計	123,965,066,044	124,440,502,960
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,686,594,040	
前受金		675,688,000
未払金		3,361,780,947
未払解約金	10,687,723	23,624,300
流動負債合計	1,697,281,763	4,061,093,247
負債合計	1,697,281,763	4,061,093,247
純資産の部		
元本等		
元本	170,106,414,200	194,128,742,346
剰余金		
剰余金又は欠損金()	47,838,629,919	73,749,332,633
元本等合計	122,267,784,281	120,379,409,713
純資産合計	122,267,784,281	120,379,409,713
負債純資産合計	123,965,066,044	124,440,502,960

(注)「住信 国内株式インデックス マザーファンド」の計算期間は、原則として毎年5月30日から翌年5月29日までであり、「住信 FOFs用日本株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)」の計算期間とは異なっております。上記の表は平成20年10月7日及び平成21年4月7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 4月8日 至 平成20年10月7日)	(自 平成20年10月8日 至 平成21年 4月7日)
1. 資産の評価基準及び評価方法	(1) 株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場(最終相場のないものについては、それに準じる価額)、金融商品取引所が発表する基準値段、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。	(1) 株式 同左

2. 収益及び費用の計上基準	(2) 先物取引 個別法に基づき、時価評価しております。	(2) 先物取引 同左
	受取配当金 受取配当金は、原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。	受取配当金 同左

(貸借対照表に関する注記)

	(平成20年10月7日現在)	(平成21年4月7日現在)
1. 期首元本額	152,009,089,742円	170,106,414,200円
期中追加設定元本額	27,310,211,511円	50,630,081,491円
期中一部解約元本額	9,212,887,053円	26,607,753,345円
期末元本額	170,106,414,200円	194,128,742,346円
元本額の内訳		
住信 グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	13,414,745,658円	14,699,623,716円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	255,918,169円	380,245,364円
SBI資産設計オープン(分配型)	45,092,639円	46,856,634円
STAM TOPIXインデックス・オープン	696,079,899円	2,132,908,404円
世界経済インデックスファンド		1,367,927円
住信 国内バランス30	712,019,044円	954,831,393円
住信 国内バランス60	647,559,460円	709,776,224円
すみしん マイセレクション25	179,822,252円	219,309,555円
すみしん マイセレクション50	301,578,818円	357,673,024円
すみしん マイセレクション75	278,184,984円	296,904,934円
すみしん 日本株式インデックス・オープン	16,915,474,096円	20,898,167,965円
すみしん DCマイセレクション25	2,654,195,661円	3,649,535,763円
すみしん DCマイセレクション50	9,431,340,671円	12,230,993,009円
すみしん DCマイセレクション75	8,433,673,199円	9,980,315,163円
すみしん DC日本株式インデックス・オープン	1,629,292,562円	2,041,725,810円
すみしん DCマイセレクションS25	63,578,332円	124,804,458円
すみしん DCマイセレクションS50	388,462,480円	693,130,399円
すみしん DCマイセレクションS75	309,294,344円	514,940,760円
すみしん DC日本株式インデックス・オープンス	148,092,282円	245,299,956円
すみしん DCターゲット・イヤール ファンド2015	11,238,386円	16,265,017円
すみしん DCターゲット・イヤール ファンド2025	3,891,161円	9,410,230円
すみしん DCターゲット・イヤール ファンド2035	1,325,374円	8,743,180円
すみしん DCターゲット・イヤール ファンド2045	828,765円	1,634,935円
STAM 日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	649,634,845円	972,586,138円
住信 国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	513,492,029円	577,641,108円

すみしん マイセレクション50VA1 (適格機関投資家専用)	942,819,146円	1,094,717,144円
すみしん マイセレクション75VA1 (適格機関投資家専用)	436,314,617円	456,196,998円
すみしん 日本株式インデックス・オープンVA1 (適格機関投資家専用)	4,385,766,967円	4,154,545,879円
住信 国内バランス30VA2(適格機関投資家専用)	17,057,250円	23,362,742円
住信 国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	77,080,800円	89,268,131円
すみしん マイセレクション50VA2 (適格機関投資家専用)	9,645,616円	11,177,495円
すみしん バランス30VA1(適格機関投資家専用)	1,908,153,725円	2,196,582,286円
すみしん バランス50VA1(適格機関投資家専用)	7,345,388,673円	8,105,600,321円
すみしん バランス25VA2(適格機関投資家専用)	20,583,998,566円	24,148,007,667円
すみしん バランス50VA2(適格機関投資家専用)	6,034,273,408円	6,568,495,632円
すみしん バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	12,072,430,323円	14,056,566,220円
すみしん バランスB(37.5)VA1 (適格機関投資家専用)	2,260,991,262円	2,791,939,960円
すみしん バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	12,788,385,633円	15,129,155,691円
すみしん 世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	5,573,701,343円	6,148,698,937円
すみしん 世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	9,994,803,711円	5,006,128,083円
すみしん バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,618,006,947円	2,885,696,554円
すみしん グローバルバランスファンドVA35 (適格機関投資家専用)	3,969,489,422円	6,284,066,703円
住信 FOFs用日本株式インデックス・オープン (適格機関投資家専用)	19,688,722,134円	20,234,646,879円
住信 グローバル・バランスファンド・シリーズ1	2,714,569,547円	2,979,197,958円
2.元本の欠損	純資産額は、元本を 47,838,629,919円下回って おります。	純資産額は、元本を 73,749,332,633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	170,106,414,200口	194,128,742,346口

(有価証券に関する注記)

当計算期間末(平成20年10月7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	111,038,340,252	44,638,603,573
合 計	111,038,340,252	44,638,603,573

(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特定期間末日までの期間に対応する金額であります。

当計算期間末(平成21年4月7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	115,611,212,520	60,219,300,219
合 計	115,611,212,520	60,219,300,219

（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特定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 4月8日 至 平成20年10月7日）	（自 平成20年10月8日 至 平成21年 4月7日）
<p>1.取引の内容、取引に対する取組方法及び取引の利用目的 当ファンドは、約款に基づき投資信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における市場デリバティブ取引ならびに外国金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことができます。</p> <p>2.取引に係るリスクの内容及びリスクの管理体制 デリバティブ取引には、市場リスクがあります。当ファンドが利用するデリバティブ取引は、約款に基づき、金融商品取引所取引のみであり、信用リスクはないものと考えられます。なお、デリバティブ取引の執行は、取引権限を定めた社内ルールに従い行っており、市場リスクの管理については、ポジションやリスク評価額を日々算出し、リスクをコントロールする体制としています。</p> <p>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。</p>	<p>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 同左</p> <p>2.取引に係るリスクの内容及びリスクの管理体制 同左</p> <p>3.取引の時価等に関する事項についての補足説明 同左</p>

取引の時価等に関する事項

株式関連

区分	種 類	（平成20年10月 7日現在）		
		契 約 額 等（円）	時 価 （円）	評 価 損 益 （円）
市場取引	株価指数先物取引 買建			
	TOPIX株価指数先物	12,918,913,000	11,232,450,000	1,686,463,000
	合 計	12,918,913,000	11,232,450,000	1,686,463,000

（平成21年 4月 7日現在）		

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引 買建				
	TOPIX先物	4,000,482,000		4,664,855,000	664,373,000
合計		4,000,482,000		4,664,855,000	664,373,000

(注) 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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。

(関連当事者との取引に関する注記)

(自 平成20年 4月8日 至 平成20年10月7日)	(自 平成20年10月8日 至 平成21年 4月7日)
当計算期間中に利害関係人との間で、一般の取引条件と同様のもの以外の取引は行っておりません。 また、当ファンドの関連当事者である受託会社及び投資信託委託業者と財務諸表上で開示している報酬等の給付以外の取引は行っておりません。	同左

(1口当たり情報)

(平成20年10月7日現在)	(平成21年4月7日現在)
1口当たり純資産額 = 0.7188円	1口当たり純資産額 = 0.6201円

(3) 附属明細表（平成21年4月7日現在）

1) 有価証券明細表

株式

銘柄	株数 (株)	評価額		備考
		単価(円)	金額(円)	
極洋	52,000	184.00	9,568,000	
日本水産	140,200	257.00	36,031,400	
マルハニチロホールディングス	212,000	136.00	28,832,000	
サカタのタネ	22,300	1,320.00	29,436,000	
ホクト	11,200	1,719.00	19,252,800	
ショーボンドホールディングス	11,200	1,868.00	20,921,600	
住石ホールディングス	33,700	88.00	2,965,600	
日鉄鉱業	31,000	291.00	9,021,000	
三井松島産業	39,000	116.00	4,524,000	

国際石油開発帝石	557	728,000.00	405,496,000
関東天然瓦斯開発	14,000	529.00	7,406,000
石油資源開発	17,300	4,160.00	71,968,000
間組	50,600	84.00	4,250,400
東急建設	43,190	246.00	10,624,740
コムシスホールディングス	59,000	863.00	50,917,000
ミサワホーム	10,900	236.00	2,572,400
高松コンストラクショングループ	9,200	1,323.00	12,171,600
東建コーポレーション	5,760	2,440.00	14,054,400
ヤマウラ	15,000	165.00	2,475,000
大成建設	550,000	208.00	114,400,000
大林組	342,000	511.00	174,762,000
清水建設	347,000	431.00	149,557,000
長谷工コーポレーション	669,000	53.00	35,457,000
松井建設	20,000	395.00	7,900,000
鹿島建設	512,000	262.00	134,144,000
鉄建建設	58,000	93.00	5,394,000
安藤建設	40,000	124.00	4,960,000
太平工業	11,000	234.00	2,574,000
三井住友建設	63,100	74.00	4,669,400
前田建設工業	83,000	351.00	29,133,000
奥村組	116,000	364.00	42,224,000
東鉄工業	17,000	462.00	7,854,000
戸田建設	136,000	327.00	44,472,000
熊谷組	79,000	56.00	4,424,000
青木あすなる建設	8,000	320.00	2,560,000
三井ホーム	22,000	402.00	8,844,000
矢作建設工業	15,000	556.00	8,340,000
大東建託	54,300	3,590.00	194,937,000
N I P P Oコーポレーション	24,000	755.00	18,120,000
前田道路	35,000	842.00	29,470,000
日本道路	45,000	212.00	9,540,000
東亜建設工業	106,000	117.00	12,402,000
五洋建設	150,000	123.00	18,450,000
大成ロテック	28,000	138.00	3,864,000
大林道路	21,000	140.00	2,940,000
住友林業	84,600	707.00	59,812,200
日本基礎技術	19,700	187.00	3,683,900
巴コーポレーション	16,500	202.00	3,333,000
パナホーム	46,000	601.00	27,646,000
大和ハウス工業	307,000	875.00	268,625,000
ライト工業	28,200	226.00	6,373,200

積水ハウス	342,000	850.00	290,700,000
北陸電気工事	8,000	329.00	2,632,000
コミュニチュア	11,000	597.00	6,567,000
ユアテック	20,000	527.00	10,540,000
西部電気工業	13,000	398.00	5,174,000
四電工	12,000	476.00	5,712,000
中電工	17,600	1,410.00	24,816,000
関電工	55,000	662.00	36,410,000
大明	17,000	916.00	15,572,000
きんでん	72,000	827.00	59,544,000
東京エネシス	14,000	698.00	9,772,000
トーエネック	17,000	512.00	8,704,000
住友電設	11,100	499.00	5,538,900
日本電設工業	24,000	865.00	20,760,000
協和エクシオ	44,000	774.00	34,056,000
新日本空調	12,400	764.00	9,473,600
日本工営	38,000	224.00	8,512,000
東電通	23,000	167.00	3,841,000
日本電話施設	23,000	281.00	6,463,000
九電工	22,000	653.00	14,366,000
三機工業	32,000	597.00	19,104,000
日揮	123,000	1,238.00	152,274,000
中外炉工業	53,000	240.00	12,720,000
ヤマト	17,000	327.00	5,559,000
太平電業	18,000	871.00	15,678,000
高砂熱学工業	38,000	635.00	24,130,000
日立プラントテクノロジー	39,000	281.00	10,959,000
三晃金属工業	13,000	334.00	4,342,000
NEC ネットエスアイ	10,800	939.00	10,141,200
朝日工業社	21,000	306.00	6,426,000
アタカ大機	11,000	197.00	2,167,000
大気社	18,400	1,092.00	20,092,800
ダイダン	20,000	440.00	8,800,000
日比谷総合設備	17,000	887.00	15,079,000
東芝プラントシステム	21,000	981.00	20,601,000
日本製粉	76,000	398.00	30,248,000
日清製粉グループ本社	110,500	1,099.00	121,439,500
日東富士製粉	10,000	294.00	2,940,000
昭和産業	55,000	278.00	15,290,000
鳥越製粉	10,600	747.00	7,918,200
日本農産工業	31,000	219.00	6,789,000
協同飼料	42,000	99.00	4,158,000

中部飼料	12,000	582.00	6,984,000
日本配合飼料	34,000	98.00	3,332,000
ユニ・チャーム ペットケア	6,900	2,415.00	16,663,500
日本甜菜製糖	67,000	224.00	15,008,000
三井製糖	48,000	281.00	13,488,000
日本M & Aセンター	20	247,900.00	4,958,000
アコーディア・ゴルフ	296	54,100.00	16,013,600
パソナグループ	113	46,700.00	5,277,100
リンクアンドモチベーション	13	46,800.00	608,400
テンプホールディングス	13,300	505.00	6,716,500
森永製菓	128,000	200.00	25,600,000
中村屋	28,000	493.00	13,804,000
江崎グリコ	43,000	990.00	42,570,000
名糖産業	4,900	1,421.00	6,962,900
不二家	66,000	125.00	8,250,000
山崎製パン	82,000	1,042.00	85,444,000
モロゾフ	19,000	311.00	5,909,000
雪印乳業	133,500	276.00	36,846,000
森永乳業	104,000	300.00	31,200,000
ヤクルト本社	65,300	1,839.00	120,086,700
明治ホールディングス	34,880	3,030.00	105,686,400
プリマハム	73,000	126.00	9,198,000
日本ハム	92,000	1,099.00	101,108,000
伊藤ハム	92,000	292.00	26,864,000
丸大食品	40,000	241.00	9,640,000
米久	11,500	953.00	10,959,500
S Foods	6,500	764.00	4,966,000
学情	4,800	370.00	1,776,000
スタジオアリス	5,200	677.00	3,520,400
シミック	180	22,500.00	4,050,000
システムプロ	83	44,000.00	3,652,000
NECフィールドディング	9,200	1,065.00	9,798,000
新日鉄ソリューションズ	7,400	1,082.00	8,006,800
総合警備保障	37,900	883.00	33,465,700
日本駐車場開発	1,367	3,500.00	4,784,500
コア	4,500	628.00	2,826,000
カカクコム	87	299,000.00	26,013,000
ルネサンス	6,000	307.00	1,842,000
新日本科学	7,200	361.00	2,599,200
ソネット・エムスリー	53	276,300.00	14,643,900
ディー・エヌ・エー	148	333,000.00	49,284,000
博報堂DYホールディングス	15,720	4,500.00	70,740,000

ぐるなび	60	200,300.00	12,018,000
一休	84	50,800.00	4,267,200
ジャパンベストレスキューシステム	32	34,800.00	1,113,600
ジェイコム	13	78,700.00	1,023,100
パシフィックゴルフグループインターナショナル ホールディングス	300	43,950.00	13,185,000
サッポロホールディングス	174,000	442.00	76,908,000
アサヒビール	228,300	1,195.00	272,818,500
麒麟ホールディングス	498,000	1,115.00	555,270,000
宝ホールディングス	103,000	509.00	52,427,000
オエノンホールディングス	36,000	193.00	6,948,000
メルシャン	37,000	182.00	6,734,000
養命酒製造	9,000	943.00	8,487,000
三国コカ・コーラボトリング	16,300	766.00	12,485,800
四国コカ・コーラボトリング	5,700	782.00	4,457,400
コカ・コーラウエスト	37,500	1,584.00	59,400,000
コカ・コーラ セントラル ジャパン	13,700	1,327.00	18,179,900
ダイドードリンコ	5,600	2,695.00	15,092,000
伊藤園	27,800	1,217.00	33,832,600
伊藤園(優)	6,100	837.00	5,105,700
キーコーヒー	9,900	1,547.00	15,315,300
ユニカフェ	2,800	1,006.00	2,816,800
ジャパンフーズ	2,300	688.00	1,582,400
日清オイリオグループ	53,000	420.00	22,260,000
不二製油	32,500	1,015.00	32,987,500
J・オイルミルズ	46,000	276.00	12,696,000
ローソン	33,600	3,740.00	125,664,000
インターニックス	6,500	327.00	2,125,500
サンエー	4,100	2,720.00	11,152,000
麒麟堂	4,800	460.00	2,208,000
ダイユーエイト	1,900	613.00	1,164,700
カワチ薬品	7,500	1,563.00	11,722,500
エービーシー・マート	11,300	1,832.00	20,701,600
ハードオフコーポレーション	5,200	371.00	1,929,200
高千穂交易	4,500	1,011.00	4,549,500
アスクル	10,400	1,513.00	15,735,200
ゲオ	202	56,300.00	11,372,600
ポイント	9,640	3,930.00	37,885,200
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	10,000	124.00	1,240,000
伊藤忠食品	2,600	3,340.00	8,684,000
くらコーポレーション	33	137,200.00	4,527,600
キャンドウ	48	92,200.00	4,425,600

高千穂電気	7,500	695.00	5,212,500
JALUX	3,000	1,307.00	3,921,000
エディオン	44,700	285.00	12,739,500
サーラコーポレーション	10,500	542.00	5,691,000
トーメンデバイス	1,500	918.00	1,377,000
バルス	65	70,500.00	4,582,500
あみやき亭	19	126,400.00	2,401,600
双日	665,600	130.00	86,528,000
アルフレッサホールディングス	21,400	3,680.00	78,752,000
ハニーズ	8,680	510.00	4,426,800
キッコーマン	106,000	876.00	92,856,000
味の素	330,000	734.00	242,220,000
キューピー	62,900	1,084.00	68,183,600
ハウス食品	44,900	1,403.00	62,994,700
カゴメ	47,100	1,465.00	69,001,500
焼津水産化学工業	6,200	997.00	6,181,400
アリアケジャパン	10,000	1,356.00	13,560,000
ニチレイ	136,000	372.00	50,592,000
横浜冷凍	25,000	583.00	14,575,000
東洋水産	49,000	2,075.00	101,675,000
日清食品ホールディングス	38,700	2,825.00	109,327,500
永谷園	11,000	826.00	9,086,000
フジッコ	13,000	1,115.00	14,495,000
ロック・フィールド	5,900	1,230.00	7,257,000
日本たばこ産業	2,697	265,300.00	715,514,100
わらべや日洋	6,400	1,192.00	7,628,800
なとり	5,300	763.00	4,043,900
片倉工業	13,800	813.00	11,219,400
ゲンゼ	78,000	297.00	23,166,000
昭栄	19,700	573.00	11,288,100
神栄	13,000	126.00	1,638,000
川島織物セルコン	41,000	82.00	3,362,000
山下医科器械	1,300	1,051.00	1,366,300
ラサ商事	4,700	353.00	1,659,100
アルペン	8,200	1,657.00	13,587,400
ビックカメラ	313	21,600.00	6,760,800
DCM Japanホールディングス	53,800	496.00	26,684,800
あいホールディングス	26,100	301.00	7,856,100
ユニバース	1,400	1,096.00	1,534,400
J.フロントリテイリング	271,000	378.00	102,438,000
ドトール・日レスホールディングス	15,400	1,306.00	20,112,400
マツモトキヨシホールディングス	19,900	1,611.00	32,058,900

ココカラファイン ホールディングス	6,600	889.00	5,867,400
三越伊勢丹ホールディングス	196,200	781.00	153,232,200
東洋紡績	381,000	133.00	50,673,000
ユニチカ	257,000	71.00	18,247,000
富士紡ホールディングス	47,000	82.00	3,854,000
日清紡ホールディングス	81,000	975.00	78,975,000
倉敷紡績	120,000	133.00	15,960,000
大和紡績	80,000	223.00	17,840,000
シキボウ	73,000	96.00	7,008,000
日東紡績	110,000	183.00	20,130,000
トヨタ紡織	38,000	1,099.00	41,762,000
クリエイトSDホールディングス	3,800	1,571.00	5,969,800
バイタルケーエスケー・ホールディングス	13,800	497.00	6,858,600
日本毛織	39,000	612.00	23,868,000
ダイドーリミテッド	16,500	528.00	8,712,000
御幸ホールディングス	11,000	197.00	2,167,000
野村不動産ホールディングス	30,600	1,589.00	48,623,400
ヒューリック	30,100	430.00	12,943,000
帝国繊維	12,000	365.00	4,380,000
ブックオフコーポレーション	5,900	830.00	4,897,000
日本コークス工業	69,500	106.00	7,367,000
ミタチ産業	4,300	405.00	1,741,500
JFE商事ホールディングス	72,000	281.00	20,232,000
あさひ	1,900	1,701.00	3,231,900
サークルKサンクス	26,200	1,412.00	36,994,400
日本調剤	2,140	1,229.00	2,630,060
コスモス薬品	4,600	1,130.00	5,198,000
グリーンホスピタルサプライ	101	35,300.00	3,565,300
セブン&アイ・ホールディングス	427,900	2,180.00	932,822,000
ツルハホールディングス	8,000	2,445.00	19,560,000
サンマルクホールディングス	3,500	2,575.00	9,012,500
フェリシモ	3,100	1,630.00	5,053,000
トリドール	8	393,000.00	3,144,000
帝人	465,000	241.00	112,065,000
東レ	756,000	416.00	314,496,000
三菱レイヨン	285,000	212.00	60,420,000
クラレ	168,000	863.00	144,984,000
旭化成	709,000	387.00	274,383,000
稲葉製作所	5,600	975.00	5,460,000
三協・立山ホールディングス	177,000	74.00	13,098,000
トーカロ	8,600	1,067.00	9,176,200
アルファC o	7,000	549.00	3,843,000

SUMCO	60,900	1,414.00	86,112,600
住江織物	28,000	120.00	3,360,000
日本フェルト	6,500	435.00	2,827,500
イチカワ	9,000	271.00	2,439,000
日本バイリーン	16,000	394.00	6,304,000
芦森工業	45,000	104.00	4,680,000
アツギ	106,000	135.00	14,310,000
ダイニック	22,000	116.00	2,552,000
共和レザー	6,700	404.00	2,706,800
セーレン	29,200	452.00	13,198,400
小松精練	22,000	416.00	9,152,000
ワコールホールディングス	68,000	1,171.00	79,628,000
ホギメディカル	5,500	5,040.00	27,720,000
サンエー・インターナショナル	8,200	721.00	5,912,200
レナウン	19,300	140.00	2,702,000
クラウディア	3,000	1,016.00	3,048,000
ITホールディングス	35,200	1,156.00	40,691,200
コーエーテクモホールディングス	16,700	726.00	12,124,200
特種東海ホールディングス	77,000	253.00	19,481,000
ドワンゴ	57	146,200.00	8,333,400
ベリサーブ	10	129,600.00	1,296,000
マクロミル	64	96,100.00	6,150,400
ティーガイア	89	111,100.00	9,887,900
GMOペイメントゲートウェイ	24	82,200.00	1,972,800
ザッパラス	35	219,500.00	7,682,500
インターネットイニシアティブ	68	106,500.00	7,242,000
ソネットエンタテインメント	62	193,100.00	11,972,200
SRAホールディングス	6,000	617.00	3,702,000
JBISホールディングス	13,700	345.00	4,726,500
朝日ネット	9,000	252.00	2,268,000
王子製紙	467,000	424.00	198,008,000
三菱製紙	168,000	147.00	24,696,000
北越製紙	66,000	432.00	28,512,000
中越パルプ工業	43,000	264.00	11,352,000
大王製紙	49,000	897.00	43,953,000
紀州製紙	38,000	83.00	3,154,000
日本製紙グループ本社	53,300	2,680.00	142,844,000
レンゴー	89,000	509.00	45,301,000
トモク	40,000	197.00	7,880,000
ザ・パックス	7,200	1,224.00	8,812,800
コープケミカル	15,000	198.00	2,970,000
昭和電工	591,000	135.00	79,785,000

住友化学	837,000	373.00	312,201,000
日本化成	21,000	151.00	3,171,000
住友精化	21,000	276.00	5,796,000
日産化学工業	76,000	899.00	68,324,000
ラサ工業	48,000	123.00	5,904,000
クレハ	74,000	408.00	30,192,000
テイカ	19,000	259.00	4,921,000
石原産業	160,000	75.00	12,000,000
片倉チッカリン	9,000	316.00	2,844,000
日本曹達	68,000	301.00	20,468,000
東ソー	306,000	215.00	65,790,000
トクヤマ	139,000	670.00	93,130,000
セントラル硝子	116,000	303.00	35,148,000
東亜合成	125,000	247.00	30,875,000
ダイソー	45,000	212.00	9,540,000
関東電化工業	27,000	329.00	8,883,000
電気化学工業	239,000	202.00	48,278,000
イビデン	76,300	2,485.00	189,605,500
信越化学工業	189,400	4,960.00	939,424,000
堺化学工業	39,000	281.00	10,959,000
エア・ウォーター	81,000	870.00	70,470,000
大陽日酸	177,000	687.00	121,599,000
日本化学工業	41,000	185.00	7,585,000
日本パーカライジング	27,000	891.00	24,057,000
高压ガス工業	17,000	454.00	7,718,000
四国化成工業	16,000	327.00	5,232,000
戸田工業	19,000	362.00	6,878,000
ステラ ケミファ	5,500	1,951.00	10,730,500
保土谷化学工業	28,000	164.00	4,592,000
日本触媒	76,000	638.00	48,488,000
大日精化工業	41,000	229.00	9,389,000
カネカ	142,000	538.00	76,396,000
協和発酵キリン	155,000	869.00	134,695,000
三菱瓦斯化学	196,000	481.00	94,276,000
三井化学	347,000	297.00	103,059,000
J S R	103,500	1,258.00	130,203,000
東京応化工業	22,000	1,510.00	33,220,000
三菱ケミカルホールディングス	660,500	373.00	246,366,500
日本合成化学工業	31,000	305.00	9,455,000
ダイセル化学工業	148,000	398.00	58,904,000
住友ベークライト	115,000	408.00	46,920,000
積水化学工業	255,000	516.00	131,580,000

日本ゼオン	98,000	301.00	29,498,000
アイカ工業	35,400	897.00	31,753,800
宇部興産	478,000	202.00	96,556,000
積水樹脂	16,000	678.00	10,848,000
タキロン	27,000	244.00	6,588,000
旭有機材工業	40,000	264.00	10,560,000
日立化成工業	49,200	1,233.00	60,663,600
ニチバン	13,000	283.00	3,679,000
リケンテクノス	20,000	160.00	3,200,000
大倉工業	27,000	243.00	6,561,000
積水化成成品工業	30,000	285.00	8,550,000
群栄化学工業	30,000	204.00	6,120,000
タイガースポリマー	5,700	347.00	1,977,900
日本カーリット	9,000	341.00	3,069,000
日本化薬	80,000	532.00	42,560,000
イーピーエス	31	374,000.00	11,594,000
パナソニック電工インフォメーションシステムズ	2,400	1,463.00	3,511,200
アミューズ	2,860	991.00	2,834,260
野村総合研究所	53,100	1,627.00	86,393,700
ドリームインキュベータ	53	47,200.00	2,501,600
サイバネットシステム	97	29,600.00	2,871,200
T A C	6,200	416.00	2,579,200
電通	112,600	1,581.00	178,020,600
シンプレクス・テクノロジー	195	31,200.00	6,084,000
イオンファンタジー	4,300	685.00	2,945,500
日本精化	9,700	506.00	4,908,200
A D E K A	48,900	627.00	30,660,300
日油	101,000	344.00	34,744,000
ミヨシ油脂	41,000	136.00	5,576,000
ハリマ化成	10,000	359.00	3,590,000
花王	291,000	1,945.00	565,995,000
第一工業製薬	19,000	191.00	3,629,000
三洋化成工業	36,000	472.00	16,992,000
武田薬品工業	399,300	3,500.00	1,397,550,000
アステラス製薬	254,900	3,220.00	820,778,000
大日本住友製薬	80,500	821.00	66,090,500
塩野義製薬	166,000	1,725.00	286,350,000
田辺三菱製薬	114,000	985.00	112,290,000
わかもと製薬	13,000	404.00	5,252,000
あすか製薬	12,000	860.00	10,320,000
日本新薬	28,000	890.00	24,920,000
中外製薬	151,000	1,726.00	260,626,000

科研製薬	48,000	832.00	39,936,000
エーザイ	140,000	2,915.00	408,100,000
ロート製薬	52,000	881.00	45,812,000
小野薬品工業	57,000	4,310.00	245,670,000
久光製薬	35,300	2,995.00	105,723,500
有機合成薬品工業	9,000	294.00	2,646,000
持田製薬	47,000	970.00	45,590,000
大正製薬	108,000	1,911.00	206,388,000
参天製薬	35,200	2,660.00	93,632,000
エスエス製薬	29,000	520.00	15,080,000
扶桑薬品工業	38,000	277.00	10,526,000
日本ケミファ	18,000	285.00	5,130,000
ツムラ	33,400	2,555.00	85,337,000
テルモ	78,200	3,600.00	281,520,000
みらかホールディングス	21,700	2,120.00	46,004,000
キッセイ薬品工業	23,000	1,961.00	45,103,000
生化学工業	21,700	990.00	21,483,000
栄研化学	7,300	625.00	4,562,500
日水製薬	4,600	728.00	3,348,800
鳥居薬品	6,800	1,341.00	9,118,800
東和薬品	4,600	4,120.00	18,952,000
沢井製薬	7,400	4,590.00	33,966,000
ゼリア新薬工業	16,000	1,073.00	17,168,000
第一三共	334,700	1,841.00	616,182,700
キョーリン	28,000	1,214.00	33,992,000
大日本塗料	68,000	98.00	6,664,000
日本ペイント	125,000	389.00	48,625,000
関西ペイント	129,000	559.00	72,111,000
中国塗料	33,000	614.00	20,262,000
日本特殊塗料	9,700	292.00	2,832,400
藤倉化成	13,300	386.00	5,133,800
太陽インキ製造	8,300	1,552.00	12,881,600
D I C	376,000	157.00	59,032,000
サカタインクス	24,000	280.00	6,720,000
東洋インキ製造	112,000	228.00	25,536,000
アルプス技研	6,400	446.00	2,854,400
ダイオーズ	2,200	423.00	930,600
日本空調サービス	2,600	729.00	1,895,400
オリエンタルランド	32,100	6,210.00	199,341,000
ダスキン	34,100	1,557.00	53,093,700
パーク24	66,000	679.00	44,814,000
明光ネットワークジャパン	10,600	411.00	4,356,600

ファルコバイオシステムズ	6,300	735.00	4,630,500
クレスコ	3,600	524.00	1,886,400
フジ・メディア・ホールディングス	1,116	114,800.00	128,116,800
秀英予備校	3,500	318.00	1,113,000
田谷	1,800	711.00	1,279,800
ラウンドワン	18,300	680.00	12,444,000
リゾートトラスト	19,800	926.00	18,334,800
オービック	3,360	12,990.00	43,646,400
ティーディーシーソフトウェアエンジニアリング	2,700	714.00	1,927,800
ヤフー	7,996	27,800.00	222,288,800
ビー・エム・エル	5,900	1,856.00	10,950,400
ワタベウェディング	3,400	1,585.00	5,389,000
トレンドマイクロ	52,000	2,995.00	155,740,000
もしもしホットライン	8,200	1,711.00	14,030,200
東急コミュニティー	2,900	1,534.00	4,448,600
リソー教育	1,324	2,730.00	3,614,520
日本オラクル	17,100	3,670.00	62,757,000
アルファシステムズ	3,100	1,745.00	5,409,500
フューチャーアーキテクト	137	33,550.00	4,596,350
ウェアハウス	3,900	425.00	1,657,500
シーエーシー	6,800	587.00	3,991,600
ソフトバンク・テクノロジー	3,000	582.00	1,746,000
トーセ	3,200	617.00	1,974,400
ユー・エス・エス	15,440	4,410.00	68,090,400
オービックビジネスコンサルタント	3,400	3,150.00	10,710,000
日立ビジネスソリューション	3,900	556.00	2,168,400
伊藤忠テクノソリューションズ	13,400	2,120.00	28,408,000
アイティフォー	13,400	366.00	4,904,400
東京個別指導学院	9,500	123.00	1,168,500
東計電算	2,400	1,060.00	2,544,000
カルチュア・コンビニエンス・クラブ	52,100	611.00	31,833,100
エックスネット	15	139,900.00	2,098,500
テー・オー・ダブリュー	2,500	513.00	1,282,500
大塚商会	8,600	4,190.00	36,034,000
総合メディカル	2,600	1,909.00	4,963,400
サイボウズ	195	16,090.00	3,137,550
アグレックス	2,500	744.00	1,860,000
セントラルスポーツ	3,500	895.00	3,132,500
電通国際情報サービス	8,200	527.00	4,321,400
ウェザーニューズ	3,400	1,168.00	3,971,200
C I J	11,900	326.00	3,879,400
富士フイルムホールディングス	277,600	2,395.00	664,852,000

コニカミノルタホールディングス	287,000	790.00	226,730,000
資生堂	194,000	1,460.00	283,240,000
ライオン	131,000	457.00	59,867,000
高砂香料工業	41,000	486.00	19,926,000
マンダム	11,400	1,654.00	18,855,600
ミルボン	4,700	1,997.00	9,385,900
ファンケル	20,200	1,117.00	22,563,400
コーセー	18,400	1,882.00	34,628,800
ドクターシーラボ	76	145,300.00	11,042,800
エステー	8,000	919.00	7,352,000
コニシ	8,900	755.00	6,719,500
長谷川香料	13,000	1,050.00	13,650,000
小林製薬	15,800	3,190.00	50,402,000
荒川化学工業	9,500	654.00	6,213,000
メック	7,700	368.00	2,833,600
日本高純度化学	30	210,100.00	6,303,000
荏原ユーザライト	1,200	1,579.00	1,894,800
アース製薬	8,500	2,485.00	21,122,500
イハラケミカル工業	21,000	284.00	5,964,000
北興化学工業	12,000	320.00	3,840,000
大成ラミック	3,200	1,997.00	6,390,400
クミアイ化学工業	29,000	316.00	9,164,000
日本農薬	26,000	724.00	18,824,000
新日本石油	790,000	495.00	391,050,000
昭和シェル石油	88,900	909.00	80,810,100
コスモ石油	314,000	290.00	91,060,000
富士興産	41,000	80.00	3,280,000
ニチレキ	14,000	301.00	4,214,000
東燃ゼネラル石油	171,000	995.00	170,145,000
ユシロ化学工業	5,600	931.00	5,213,600
ビーピー・カストロール	3,900	226.00	881,400
新日鉱ホールディングス	469,500	427.00	200,476,500
AOCホールディングス	26,400	592.00	15,628,800
出光興産	13,500	7,740.00	104,490,000
横浜ゴム	139,000	444.00	61,716,000
東洋ゴム工業	105,000	168.00	17,640,000
ブリヂストン	356,400	1,544.00	550,281,600
住友ゴム工業	97,600	703.00	68,612,800
藤倉ゴム工業	7,100	303.00	2,151,300
オカモト	47,000	370.00	17,390,000
アキレス	93,000	139.00	12,927,000
フコク	5,300	476.00	2,522,800

ニッタ	10,200	1,026.00	10,465,200
クリエートメディック	3,400	803.00	2,730,200
東海ゴム工業	21,000	851.00	17,871,000
三ツ星ベルト	35,000	413.00	14,455,000
バンドー化学	41,000	219.00	8,979,000
鬼怒川ゴム工業	27,000	129.00	3,483,000
旭硝子	560,000	580.00	324,800,000
日本板硝子	364,000	301.00	109,564,000
有沢製作所	15,400	370.00	5,698,000
日本山村硝子	56,000	195.00	10,920,000
日本電気硝子	185,000	770.00	142,450,000
オハラ	5,300	974.00	5,162,200
住友大阪セメント	217,000	243.00	52,731,000
太平洋セメント	453,000	176.00	79,728,000
デイ・シイ	11,400	358.00	4,081,200
リゾートソリューション	13,000	188.00	2,444,000
日本ヒューム	11,000	280.00	3,080,000
東海カーボン	99,000	441.00	43,659,000
日本カーボン	57,000	230.00	13,110,000
東洋炭素	4,900	3,780.00	18,522,000
ノリタケカンパニーリミテド	59,000	279.00	16,461,000
TOTO	175,000	550.00	96,250,000
日本碍子	137,000	1,624.00	222,488,000
日本特殊陶業	101,000	910.00	91,910,000
MARUWA	3,700	983.00	3,637,100
品川白煉瓦	36,000	164.00	5,904,000
黒崎播磨	32,000	196.00	6,272,000
東京窯業	16,000	245.00	3,920,000
ニッカトー	6,000	402.00	2,412,000
フジインコーポレーテッド	11,500	1,109.00	12,753,500
ニチアス	49,000	215.00	10,535,000
新日本製鐵	2,983,000	291.00	868,053,000
住友金属工業	1,944,000	214.00	416,016,000
神戸製鋼所	1,576,000	143.00	225,368,000
日新製鋼	436,000	179.00	78,044,000
中山製鋼所	65,000	213.00	13,845,000
合同製鐵	70,000	264.00	18,480,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	290,000	2,400.00	696,000,000
東京製鐵	47,100	1,054.00	49,643,400
共英製鋼	9,100	2,000.00	18,200,000
大和工業	26,700	2,420.00	64,614,000
東京鐵鋼	24,000	285.00	6,840,000

大阪製鐵	7,100	1,712.00	12,155,200
淀川製鋼所	83,000	442.00	36,686,000
東洋鋼鈹	24,000	333.00	7,992,000
住友鋼管	8,400	529.00	4,443,600
丸一鋼管	31,700	2,115.00	67,045,500
モリ工業	22,000	219.00	4,818,000
大同特殊鋼	171,000	295.00	50,445,000
日本高周波鋼業	34,000	89.00	3,026,000
日本金属工業	64,000	129.00	8,256,000
日本冶金工業	59,500	260.00	15,470,000
山陽特殊製鋼	56,000	282.00	15,792,000
愛知製鋼	62,000	302.00	18,724,000
日立金属	74,000	750.00	55,500,000
日本金属	29,000	125.00	3,625,000
大平洋金属	79,000	511.00	40,369,000
日本電工	45,000	365.00	16,425,000
日本製鋼所	163,000	1,003.00	163,489,000
三菱製鋼	66,000	207.00	13,662,000
日亜鋼業	20,000	259.00	5,180,000
日本精線	11,000	207.00	2,277,000
日本軽金属	249,000	82.00	20,418,000
大紀アルミニウム工業所	19,000	159.00	3,021,000
三井金属鉱業	330,000	180.00	59,400,000
東邦亜鉛	60,000	301.00	18,060,000
三菱マテリアル	690,000	295.00	203,550,000
住友金属鉱山	294,000	997.00	293,118,000
DOWAホールディングス	144,000	411.00	59,184,000
古河機械金属	191,000	90.00	17,190,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	11,200	2,770.00	31,024,000
東邦チタニウム	18,600	1,262.00	23,473,200
住友軽金属工業	161,000	94.00	15,134,000
古河スカイ	55,000	158.00	8,690,000
古河電気工業	358,000	327.00	117,066,000
住友電気工業	374,800	931.00	348,938,800
フジクラ	171,000	339.00	57,969,000
三菱電線工業	73,000	89.00	6,497,000
昭和電線ホールディングス	135,000	75.00	10,125,000
タツタ電線	26,000	207.00	5,382,000
日立電線	89,000	235.00	20,915,000
沖電線	12,000	143.00	1,716,000
カナレ電気	1,600	992.00	1,587,200
平河ヒューテック	3,600	590.00	2,124,000

リョービ	70,000	192.00	13,440,000
アサヒホールディングス	15,900	1,240.00	19,716,000
東洋製罐	87,700	1,634.00	143,301,800
ホッカンホールディングス	36,000	239.00	8,604,000
コロナ	5,500	960.00	5,280,000
横河ブリッジホールディングス	22,000	773.00	17,006,000
三和ホールディングス	115,000	294.00	33,810,000
文化シャッター	29,000	371.00	10,759,000
東洋シャッター	2,400	586.00	1,406,400
住生活グループ	137,300	1,165.00	159,954,500
日本ファイルコン	11,700	519.00	6,072,300
ノーリツ	18,900	1,315.00	24,853,500
長府製作所	12,200	1,807.00	22,045,400
リンナイ	22,000	3,470.00	76,340,000
ユニプレス	15,100	765.00	11,551,500
ダイニチ工業	7,000	558.00	3,906,000
日東精工	24,000	265.00	6,360,000
三洋工業	15,000	155.00	2,325,000
岡部	24,300	396.00	9,622,800
日立ツール	7,000	598.00	4,186,000
東プレ	23,900	692.00	16,538,800
高周波熱錬	16,800	633.00	10,634,400
東京製網	82,000	245.00	20,090,000
パイオラックス	5,900	1,214.00	7,162,600
日本発條	74,000	423.00	31,302,000
中央発條	19,000	271.00	5,149,000
三浦工業	16,900	2,210.00	37,349,000
タクマ	46,000	153.00	7,038,000
ツガミ	34,000	157.00	5,338,000
オークマ	69,000	403.00	27,807,000
東芝機械	62,000	301.00	18,662,000
アマダ	177,000	544.00	96,288,000
アイダエンジニアリング	29,500	300.00	8,850,000
牧野フライス製作所	54,000	301.00	16,254,000
オーエスジー	47,000	658.00	30,926,000
ダイジェット工業	13,000	162.00	2,106,000
旭ダイヤモンド工業	28,000	481.00	13,468,000
森精機製作所	48,800	1,007.00	49,141,600
ディスコ	10,300	3,070.00	31,621,000
日東工器	6,600	1,655.00	10,923,000
豊田自動織機	87,900	2,470.00	217,113,000
大阪機工	42,000	92.00	3,864,000

東洋機械金属	14,600	133.00	1,941,800
オーエム製作所	9,000	384.00	3,456,000
津田駒工業	36,000	123.00	4,428,000
島精機製作所	13,600	2,125.00	28,900,000
日本スピンドル製造	19,000	153.00	2,907,000
日阪製作所	13,000	940.00	12,220,000
やまびこ	4,100	1,271.00	5,211,100
ペガサスマシン製造	14,600	149.00	2,175,400
ナブテスコ	47,000	754.00	35,438,000
三井海洋開発	8,200	1,583.00	12,980,600
レオン自動機	13,000	215.00	2,795,000
S M C	33,900	10,070.00	341,373,000
新川	10,100	1,060.00	10,706,000
ホソカワミクロン	20,000	320.00	6,400,000
ユニオンツール	6,200	2,445.00	15,159,000
オイレス工業	13,100	1,231.00	16,126,100
サトー	11,900	731.00	8,698,900
日本エアーテック	4,200	411.00	1,726,200
日精樹脂工業	11,200	246.00	2,755,200
ワイエイシイ	7,600	328.00	2,492,800
小松製作所	505,100	1,206.00	609,150,600
住友重機械工業	286,000	381.00	108,966,000
日立建機	58,100	1,360.00	79,016,000
日工	17,000	270.00	4,590,000
巴工業	4,300	892.00	3,835,600
井関農機	117,000	248.00	29,016,000
丸山製作所	25,000	176.00	4,400,000
北川鉄工所	57,000	116.00	6,612,000
シンニッタン	11,000	292.00	3,212,000
クボタ	520,000	592.00	307,840,000
荏原実業	3,200	1,001.00	3,203,200
東洋エンジニアリング	83,000	325.00	26,975,000
三菱化工機	35,000	232.00	8,120,000
月島機械	18,000	496.00	8,928,000
帝国電機製作所	4,600	1,445.00	6,647,000
東京機械製作所	37,000	157.00	5,809,000
新東工業	23,000	643.00	14,789,000
澁谷工業	6,900	786.00	5,423,400
アイチ コーポレーション	19,100	420.00	8,022,000
小森コーポレーション	32,300	911.00	29,425,300
鶴見製作所	9,000	578.00	5,202,000
住友精密工業	20,000	350.00	7,000,000

酒井重工業	24,000	136.00	3,264,000
荏原製作所	244,000	267.00	65,148,000
西島製作所	10,600	1,271.00	13,472,600
千代田化工建設	101,000	629.00	63,529,000
ダイキン工業	118,600	2,855.00	338,603,000
オルガノ	20,000	601.00	12,020,000
トーヨーカネツ	72,000	157.00	11,304,000
栗田工業	62,700	2,175.00	136,372,500
椿本チエイン	61,000	303.00	18,483,000
大同工業	26,000	158.00	4,108,000
T C M	35,000	134.00	4,690,000
日機装	32,000	578.00	18,496,000
木村化工機	10,400	796.00	8,278,400
新興プランテック	22,000	652.00	14,344,000
アネスト岩田	24,000	272.00	6,528,000
ダイフク	46,000	579.00	26,634,000
加藤製作所	27,000	198.00	5,346,000
油研工業	20,000	149.00	2,980,000
タダノ	52,000	421.00	21,892,000
フジテック	32,000	332.00	10,624,000
シーケーディ	31,500	331.00	10,426,500
キトー	25	75,800.00	1,895,000
平和	26,600	894.00	23,780,400
理想科学工業	8,800	925.00	8,140,000
S A N K Y O	29,600	4,360.00	129,056,000
日本金銭機械	12,000	900.00	10,800,000
マースエンジニアリング	5,400	2,840.00	15,336,000
福島工業	4,100	586.00	2,402,600
キャノンファインテック	10,000	1,031.00	10,310,000
オーイズミ	7,100	223.00	1,583,300
ダイコク電機	4,500	1,274.00	5,733,000
アマノ	32,900	802.00	26,385,800
サンデン	66,000	196.00	12,936,000
ブラザー工業	131,000	791.00	103,621,000
マックス	19,000	1,075.00	20,425,000
モリタホールディングス	18,000	389.00	7,002,000
グローリー	33,000	1,752.00	57,816,000
大和冷機工業	17,000	357.00	6,069,000
セガサミーホールディングス	124,100	899.00	111,565,900
日本ピストンリング	53,000	104.00	5,512,000
リケン	50,000	248.00	12,400,000
帝国ピストンリング	16,000	310.00	4,960,000

ホシザキ電機	21,900	898.00	19,666,200
大豊工業	10,400	508.00	5,283,200
日本精工	224,000	449.00	100,576,000
NTN	192,000	315.00	60,480,000
ジェイテクト	108,800	825.00	89,760,000
不二越	113,000	181.00	20,453,000
ミネベア	162,000	394.00	63,828,000
日本トムソン	36,000	398.00	14,328,000
THK	67,700	1,458.00	98,706,600
ユーシン精機	5,200	1,161.00	6,037,200
前澤給装工業	4,400	1,627.00	7,158,800
イーグル工業	16,000	325.00	5,200,000
日本ピラー工業	14,000	318.00	4,452,000
キッツ	51,000	308.00	15,708,000
日立製作所	1,817,000	306.00	556,002,000
東芝	1,637,000	306.00	500,922,000
三菱電機	1,014,000	494.00	500,916,000
富士電機ホールディングス	252,000	134.00	33,768,000
東洋電機製造	23,000	407.00	9,361,000
安川電機	119,000	472.00	56,168,000
シンフォニアテクノロジー	69,000	225.00	15,525,000
明電舎	100,000	272.00	27,200,000
オリジン電気	17,000	246.00	4,182,000
デンヨー	11,600	663.00	7,690,800
日立工機	37,300	782.00	29,168,600
三櫻工業	14,000	420.00	5,880,000
マキタ	66,100	2,310.00	152,691,000
東芝テック	78,000	286.00	22,308,000
芝浦メカトロニクス	21,000	340.00	7,140,000
マブチモーター	16,300	4,220.00	68,786,000
日本電産	53,800	4,830.00	259,854,000
高岳製作所	43,000	245.00	10,535,000
ダイヘン	57,000	295.00	16,815,000
JVC・ケンウッド・ホールディングス	404,800	38.00	15,382,400
日新電機	22,000	366.00	8,052,000
大崎電気工業	17,000	796.00	13,532,000
オムロン	129,000	1,287.00	166,023,000
日東工業	16,400	788.00	12,923,200
IDEC	15,600	550.00	8,580,000
エルピーダメモリ	53,600	818.00	43,844,800
ジーエス・ユアサコーポレーション	174,000	546.00	95,004,000
サクサホールディングス	28,000	99.00	2,772,000

メルコホールディングス	6,300	1,168.00	7,358,400
テクノメディカ	8	224,500.00	1,796,000
日本電気	1,095,000	298.00	326,310,000
富士通	1,117,000	413.00	461,321,000
沖電気工業	346,000	76.00	26,296,000
岩崎通信機	48,000	92.00	4,416,000
電気興業	29,000	521.00	15,109,000
サンケン電気	65,000	306.00	19,890,000
エプソントヨコム	39,000	283.00	11,037,000
ナカヨ通信機	15,000	120.00	1,800,000
アイホン	7,700	1,640.00	12,628,000
NECエレクトロニクス	22,100	797.00	17,613,700
セイコーエプソン	79,500	1,481.00	117,739,500
ワコム	213	127,100.00	27,072,300
アルバック	17,400	1,970.00	34,278,000
ナナオ	9,200	1,561.00	14,361,200
日本信号	27,500	560.00	15,400,000
京三製作所	26,000	307.00	7,982,000
能美防災	14,000	764.00	10,696,000
ホーチキ	11,000	519.00	5,709,000
マスプロ電工	8,300	888.00	7,370,400
日本無線	42,000	185.00	7,770,000
パナソニック	1,157,900	1,242.00	1,438,111,800
シャープ	524,000	866.00	453,784,000
アンリツ	52,000	257.00	13,364,000
富士通ゼネラル	26,000	207.00	5,382,000
日立国際電気	32,000	570.00	18,240,000
ソニー	575,800	2,420.00	1,393,436,000
NEC トーキン	34,000	183.00	6,222,000
TDK	56,800	4,090.00	232,312,000
帝国通信工業	26,000	193.00	5,018,000
三洋電機	1,073,000	147.00	157,731,000
ミツミ電機	38,400	1,555.00	59,712,000
タムラ製作所	35,000	201.00	7,035,000
アルプス電気	93,400	420.00	39,228,000
池上通信機	34,000	89.00	3,026,000
パイオニア	85,000	206.00	17,510,000
日本電波工業	8,700	1,526.00	13,276,200
日本トリム	1,550	1,932.00	2,994,600
ローランド ディー・ジー	4,200	1,329.00	5,581,800
フォスター電機	11,900	641.00	7,627,900
クラリオン	48,000	73.00	3,504,000

S M K	35,000	246.00	8,610,000
ヨコオ	9,200	432.00	3,974,400
東光	52,000	125.00	6,500,000
ホシデン	27,000	989.00	26,703,000
ヒロセ電機	18,900	10,120.00	191,268,000
日本航空電子工業	26,000	535.00	13,910,000
T O A	14,000	455.00	6,370,000
日立マクセル	23,500	761.00	17,883,500
アルパイン	23,600	737.00	17,393,200
スミダコーポレーション	8,900	464.00	4,129,600
アイコム	6,000	2,125.00	12,750,000
船井電機	9,900	2,910.00	28,809,000
横河電機	118,000	491.00	57,938,000
新電元工業	38,000	158.00	6,004,000
山武	27,900	1,744.00	48,657,600
日本光電工業	21,600	1,173.00	25,336,800
チノー	23,000	225.00	5,175,000
共和電業	11,000	270.00	2,970,000
日本電子材料	5,800	514.00	2,981,200
堀場製作所	15,500	1,817.00	28,163,500
アドバンテスト	74,000	1,608.00	118,992,000
小野測器	12,000	363.00	4,356,000
エスペック	10,500	488.00	5,124,000
サンクス	9,600	274.00	2,630,400
キーエンス	22,300	18,470.00	411,881,000
日置電機	5,200	1,720.00	8,944,000
シスメックス	20,700	3,020.00	62,514,000
メガチップス	10,000	1,500.00	15,000,000
O B A R A	7,400	627.00	4,639,800
日本電産コパル電子	11,200	537.00	6,014,400
ミヤチテクノス	7,000	408.00	2,856,000
東京電波	4,400	454.00	1,997,600
澤藤電機	9,000	156.00	1,404,000
デンソー	238,500	2,330.00	555,705,000
コーセル	14,500	776.00	11,252,000
日立メディコ	8,000	780.00	6,240,000
新日本無線	10,000	220.00	2,200,000
オブテックス	7,500	854.00	6,405,000
千代田インテグレ	6,700	1,005.00	6,733,500
東光電気	8,000	224.00	1,792,000
スタンレー電気	76,200	1,236.00	94,183,200
岩崎電気	42,000	180.00	7,560,000

ウシオ電機	61,200	1,388.00	84,945,600
岡谷電機産業	6,800	280.00	1,904,000
ヘリオス テクノ ホールディング	13,700	186.00	2,548,200
日本セラミック	8,000	1,004.00	8,032,000
新神戸電機	11,000	704.00	7,744,000
日本デジタル研究所	10,400	864.00	8,985,600
古河電池	8,000	920.00	7,360,000
双信電機	5,300	293.00	1,552,900
図研	7,600	629.00	4,780,400
日本電子	40,000	281.00	11,240,000
カシオ計算機	103,500	778.00	80,523,000
ファナック	105,000	7,480.00	785,400,000
日本シイエムケイ	22,900	371.00	8,495,900
エンプラス	6,400	919.00	5,881,600
ローム	56,100	5,150.00	288,915,000
浜松ホトニクス	39,500	1,956.00	77,262,000
三井ハイテック	14,300	740.00	10,582,000
新光電気工業	31,900	973.00	31,038,700
京セラ	96,800	6,770.00	655,336,000
協栄産業	17,000	206.00	3,502,000
太陽誘電	53,000	791.00	41,923,000
村田製作所	121,500	3,770.00	458,055,000
ユーシン	16,100	297.00	4,781,700
双葉電子工業	19,200	1,614.00	30,988,800
日東電工	99,600	2,190.00	218,124,000
北陸電気工業	50,000	157.00	7,850,000
パナソニック電工	177,000	765.00	135,405,000
東海理化電機製作所	28,600	1,138.00	32,546,800
ニチコン	34,200	800.00	27,360,000
日本ケミコン	59,000	238.00	14,042,000
K O A	15,400	531.00	8,177,400
三井造船	392,000	182.00	71,344,000
日立造船	483,000	89.00	42,987,000
佐世保重工業	66,000	192.00	12,672,000
三菱重工業	1,934,000	334.00	645,956,000
川崎重工業	901,000	211.00	190,111,000
I H I	749,000	123.00	92,127,000
日本車輛製造	49,000	343.00	16,807,000
日本輸送機	13,000	211.00	2,743,000
近畿車輛	19,000	470.00	8,930,000
日産自動車	1,371,700	464.00	636,468,800
いすゞ自動車	515,000	142.00	73,130,000

トヨタ自動車	1,395,000	3,740.00	5,217,300,000
日野自動車	155,000	256.00	39,680,000
三菱自動車工業	2,427,000	148.00	359,196,000
武蔵精密工業	10,600	1,183.00	12,539,800
トヨタ車体	23,700	1,583.00	37,517,100
日産車体	37,000	613.00	22,681,000
関東自動車工業	16,500	1,032.00	17,028,000
新明和工業	44,000	239.00	10,516,000
極東開発工業	21,600	357.00	7,711,200
日信工業	19,900	1,014.00	20,178,600
トピー工業	98,000	152.00	14,896,000
ティラド	33,000	150.00	4,950,000
曙ブレーキ工業	30,200	500.00	15,100,000
タチエス	14,200	570.00	8,094,000
N O K	58,400	969.00	56,589,600
フタバ産業	23,600	390.00	9,204,000
カヤバ工業	75,000	177.00	13,275,000
シロキ工業	22,000	202.00	4,444,000
市光工業	35,000	122.00	4,270,000
大同メタル工業	19,000	431.00	8,189,000
プレス工業	43,000	134.00	5,762,000
カルソニックカンセイ	65,000	170.00	11,050,000
太平洋工業	23,000	264.00	6,072,000
ケーヒン	25,000	1,199.00	29,975,000
河西工業	17,000	199.00	3,383,000
アイシン精機	99,400	1,858.00	184,685,200
マツダ	430,000	227.00	97,610,000
ダイハツ工業	115,000	821.00	94,415,000
愛知機械工業	28,000	169.00	4,732,000
今仙電機製作所	7,900	528.00	4,171,200
本田技研工業	927,900	2,805.00	2,602,759,500
スズキ	219,500	1,853.00	406,733,500
富士重工業	370,000	380.00	140,600,000
ヤマハ発動機	125,600	999.00	125,474,400
ショーワ	23,200	461.00	10,695,200
小糸製作所	55,000	779.00	42,845,000
T B K	16,000	139.00	2,224,000
エクセディ	13,100	1,563.00	20,475,300
ミツバ	23,000	302.00	6,946,000
豊田合成	30,700	1,794.00	55,075,800
愛三工業	13,200	508.00	6,705,600
ヨロズ	7,300	867.00	6,329,100

エフ・シー・シー	16,000	1,190.00	19,040,000
新家工業	27,000	128.00	3,456,000
シマノ	42,100	3,140.00	132,194,000
タカタ	19,400	931.00	18,061,400
テイ・エス テック	17,500	906.00	15,855,000
小野建	9,500	753.00	7,153,500
はるやま商事	6,100	331.00	2,019,100
佐鳥電機	10,300	420.00	4,326,000
カッパ・クリエイト	6,300	1,560.00	9,828,000
エコートレーディング	2,400	792.00	1,900,800
伯東	7,600	606.00	4,605,600
中山福	6,800	522.00	3,549,600
ライトオン	9,300	683.00	6,351,900
ナガイレーベン	5,800	1,770.00	10,266,000
ジーンズメイト	3,400	488.00	1,659,200
菱食	10,400	2,085.00	21,684,000
良品計画	11,400	3,720.00	42,408,000
三城ホールディングス	15,100	897.00	13,544,700
松田産業	7,900	1,086.00	8,579,400
メディセオ・パルタックホールディングス	115,500	1,116.00	128,898,000
アドヴァン	9,300	434.00	4,036,200
S P K	2,700	1,074.00	2,899,800
アズワン	7,000	1,680.00	11,760,000
スズデン	4,200	541.00	2,272,200
尾家産業	3,800	864.00	3,283,200
シモジマ	7,400	1,224.00	9,057,600
ドウシシャ	5,700	1,248.00	7,113,600
コナカ	15,600	248.00	3,868,800
高速	6,400	519.00	3,321,600
ハウス オブ ローゼ	1,100	1,289.00	1,417,900
G - 7ホールディングス	3,500	349.00	1,221,500
イオン北海道	6,700	307.00	2,056,900
コジマ	9,500	292.00	2,774,000
コーナン商事	12,900	944.00	12,177,600
黒田電気	16,700	590.00	9,853,000
ネットワンシステムズ	261	127,800.00	33,355,800
エコス	2,900	642.00	1,861,800
ワタミ	14,100	2,000.00	28,200,000
マルシェ	2,700	672.00	1,814,400
ドン・キホーテ	19,800	1,395.00	27,621,000
丸文	13,000	269.00	3,497,000
メガネトップ	6,370	1,046.00	6,663,020

西松屋チェーン	28,300	703.00	19,894,900
ゼンショー	36,700	476.00	17,469,200
ハピネット	2,900	1,158.00	3,358,200
幸楽苑	6,600	1,119.00	7,385,400
トーマンエレクトロニクス	3,300	998.00	3,293,400
ユニマットライフ	4,200	846.00	3,553,200
ハークスレイ	3,300	788.00	2,600,400
サイゼリヤ	10,800	983.00	10,616,400
エクセル	5,400	909.00	4,908,600
マルカキカイ	4,400	584.00	2,569,600
アルゴグラフィックス	4,500	997.00	4,486,500
ガリバーインターナショナル	2,940	1,450.00	4,263,000
ポプラ	4,100	620.00	2,542,000
ユナイテッドアローズ	14,800	522.00	7,725,600
進和	6,100	1,341.00	8,180,100
エスケイジャパン	6,200	184.00	1,140,800
ダイトエレクトロン	6,300	434.00	2,734,200
ハイデイ日高	5,000	936.00	4,680,000
京都きもの友禅	7,000	628.00	4,396,000
コロワイド	24,500	520.00	12,740,000
田中商事	5,100	341.00	1,739,100
オーハシテクニカ	6,900	664.00	4,581,600
壱番屋	3,800	2,080.00	7,904,000
マクニカ	4,300	1,165.00	5,009,500
白銅	4,600	558.00	2,566,800
トップカルチャー	4,900	295.00	1,445,500
スギホールディングス	17,100	1,845.00	31,549,500
島津製作所	120,000	643.00	77,160,000
JMS	18,000	371.00	6,678,000
アロカ	6,700	768.00	5,145,600
長野計器	6,800	778.00	5,290,400
スター精密	20,700	999.00	20,679,300
東京計器	40,000	120.00	4,800,000
愛知時計電機	12,000	244.00	2,928,000
日本電産トーソク	3,400	719.00	2,444,600
東京精密	20,500	904.00	18,532,000
ニコン	189,000	1,277.00	241,353,000
トプコン	25,600	448.00	11,468,800
オリンパス	119,000	1,952.00	232,288,000
理研計器	9,400	535.00	5,029,000
大日本スクリーン製造	122,000	203.00	24,766,000
キヤノン電子	9,800	1,218.00	11,936,400

タムロン	9,900	1,151.00	11,394,900
HOYA	249,300	1,900.00	473,670,000
ノーリツ鋼機	10,300	764.00	7,869,200
キヤノン	629,600	3,100.00	1,951,760,000
リコー	352,000	1,235.00	434,720,000
日本電産コパル	11,300	679.00	7,672,700
日本電産サンキョー	32,000	415.00	13,280,000
シチズンホールディングス	141,400	480.00	67,872,000
リズム時計工業	56,000	87.00	4,872,000
SRIスポーツ	73	76,400.00	5,577,200
バンダイナムコホールディングス	118,000	1,009.00	119,062,000
共立印刷	13,900	152.00	2,112,800
フランスベッドホールディングス	73,000	127.00	9,271,000
パイロットコーポレーション	108	118,800.00	12,830,400
エイベックス・グループ・ホールディングス	20,500	919.00	18,839,500
トッパン・フォームズ	23,300	1,088.00	25,350,400
フジシールインターナショナル	12,200	1,410.00	17,202,000
タカラトミー	33,500	399.00	13,366,500
スルガ	3,000	939.00	2,817,000
アロン化成	8,000	265.00	2,120,000
タカノ	5,900	626.00	3,693,400
プロネクサス	13,300	657.00	8,738,100
ウッドワン	22,000	259.00	5,698,000
大建工業	52,000	160.00	8,320,000
きもと	9,400	240.00	2,256,000
シーアイ化成	10,000	381.00	3,810,000
凸版印刷	330,000	740.00	244,200,000
大日本印刷	331,000	963.00	318,753,000
図書印刷	23,000	262.00	6,026,000
共同印刷	37,000	226.00	8,362,000
日本写真印刷	16,700	3,400.00	56,780,000
光村印刷	10,000	343.00	3,430,000
藤森工業	7,700	513.00	3,950,100
宝印刷	5,300	837.00	4,436,100
前澤化成工業	8,000	950.00	7,600,000
コンビ	7,500	669.00	5,017,500
アシックス	108,000	711.00	76,788,000
ツツミ	4,100	1,660.00	6,806,000
JSP	7,500	546.00	4,095,000
ニチハ	13,600	666.00	9,057,600
ローランド	7,800	1,089.00	8,494,200
エフピコ	5,700	3,730.00	21,261,000

小松ウオール工業	4,100	1,062.00	4,354,200
ヤマハ	86,500	1,015.00	87,797,500
河合楽器製作所	40,000	81.00	3,240,000
クリナップ	12,200	425.00	5,185,000
ピジョン	6,800	2,435.00	16,558,000
天馬	8,100	920.00	7,452,000
パラマウントベッド	10,700	1,273.00	13,621,100
キングジム	8,600	713.00	6,131,800
リンテック	20,700	1,298.00	26,868,600
信越ポリマー	22,300	422.00	9,410,600
東リ	30,000	171.00	5,130,000
イトーキ	19,000	253.00	4,807,000
任天堂	57,300	30,000.00	1,719,000,000
三菱鉛筆	10,400	1,019.00	10,597,600
タカラスタANDARD	50,000	577.00	28,850,000
コクヨ	56,400	736.00	41,510,400
ナカバヤシ	28,000	199.00	5,572,000
ニフコ	23,600	1,170.00	27,612,000
ダイワ精工	54,000	133.00	7,182,000
サンウエーブ工業	19,000	153.00	2,907,000
岡村製作所	46,000	472.00	21,712,000
日本バルカー工業	44,000	201.00	8,844,000
伊藤忠商事	802,000	530.00	425,060,000
丸紅	937,000	352.00	329,824,000
ムトウ	12,700	472.00	5,994,400
F & A アクアホールディングス	9,300	943.00	8,769,900
三陽商会	54,000	328.00	17,712,000
長瀬産業	56,000	808.00	45,248,000
蝶理	67,000	105.00	7,035,000
豊田通商	107,500	1,157.00	124,377,500
オンワードホールディングス	76,000	677.00	51,452,000
三共生興	22,300	175.00	3,902,500
兼松	228,000	88.00	20,064,000
美津濃	54,000	410.00	22,140,000
ファミリーマート	32,900	2,895.00	95,245,500
三井物産	922,900	1,130.00	1,042,877,000
日本紙パルプ商事	56,000	280.00	15,680,000
東京エレクトロン	79,200	4,100.00	324,720,000
日立ハイテクノロジーズ	37,200	1,426.00	53,047,200
カメイ	14,000	465.00	6,510,000
東都水産	26,000	115.00	2,990,000
スターゼン	36,000	226.00	8,136,000

セイコーホールディングス	39,000	210.00	8,190,000
山善	41,300	301.00	12,431,300
椿本興業	16,000	206.00	3,296,000
住友商事	632,400	925.00	584,970,000
日本ユニシス	26,300	684.00	17,989,200
内田洋行	27,000	302.00	8,154,000
三菱商事	800,500	1,473.00	1,179,136,500
第一実業	23,000	249.00	5,727,000
キヤノンマーケティングジャパン	40,800	1,412.00	57,609,600
西華産業	46,000	215.00	9,890,000
佐藤商事	10,600	541.00	5,734,600
菱洋エレクトロ	10,900	829.00	9,036,100
東京産業	11,000	249.00	2,739,000
ユアサ商事	117,000	99.00	11,583,000
神鋼商事	27,000	156.00	4,212,000
阪和興業	107,000	256.00	27,392,000
カナデン	12,000	436.00	5,232,000
菱電商事	15,000	425.00	6,375,000
ニプロ	26,000	1,510.00	39,260,000
フルサト工業	7,100	777.00	5,516,700
岩谷産業	120,000	221.00	26,520,000
すてきナイスグループ	44,000	165.00	7,260,000
昭光通商	38,000	105.00	3,990,000
ニチモウ	15,000	126.00	1,890,000
富士通ビジネスシステム	6,500	1,232.00	8,008,000
極東貿易	13,000	139.00	1,807,000
イワキ	15,000	191.00	2,865,000
兼松エレクトロニクス	7,200	711.00	5,119,200
三愛石油	28,000	371.00	10,388,000
稲畑産業	28,700	277.00	7,949,900
明和産業	8,500	139.00	1,181,500
ゴールドウイン	26,000	152.00	3,952,000
東京スタイル	38,000	706.00	26,828,000
ユニ・チャーム	23,300	5,850.00	136,305,000
デサント	32,000	364.00	11,648,000
ヤマトインターナショナル	10,900	335.00	3,651,500
東邦ホールディングス	25,100	1,009.00	25,325,900
サンゲツ	18,500	2,075.00	38,387,500
ミツウロコ	17,500	571.00	9,992,500
シナネン	26,000	428.00	11,128,000
伊藤忠エネクス	27,700	520.00	14,404,000
サンリオ	29,900	766.00	22,903,400

サンワテクノス	7,100	373.00	2,648,300
リョーサン	17,200	2,110.00	36,292,000
新光商事	11,600	711.00	8,247,600
トーホー	22,000	331.00	7,282,000
三信電気	13,000	680.00	8,840,000
東陽テクニカ	11,500	833.00	9,579,500
モスフードサービス	15,100	1,510.00	22,801,000
加賀電子	11,700	851.00	9,956,700
三益半導体工業	9,800	1,052.00	10,309,600
ソーダニッカ	10,000	289.00	2,890,000
立花エレテック	7,100	664.00	4,714,400
木曽路	12,200	1,845.00	22,509,000
千趣会	19,300	673.00	12,988,900
ケーヨー	22,200	478.00	10,611,600
アデランスホールディングス	13,100	827.00	10,833,700
上新電機	25,000	508.00	12,700,000
日本瓦斯	11,500	1,348.00	15,502,000
ベスト電器	33,500	283.00	9,480,500
マルエツ	22,000	421.00	9,262,000
ロイヤルホールディングス	17,900	1,035.00	18,526,500
東天紅	11,000	124.00	1,364,000
いなげや	12,000	921.00	11,052,000
島忠	24,700	1,671.00	41,273,700
チヨダ	15,400	1,350.00	20,790,000
ライフコーポレーション	6,900	1,655.00	11,419,500
カスミ	22,000	394.00	8,668,000
リンガーハット	8,100	1,193.00	9,663,300
MrMax	12,700	416.00	5,283,200
テンアライド	7,200	295.00	2,124,000
相鉄ローゼン	8,000	480.00	3,840,000
AOKIホールディングス	11,600	930.00	10,788,000
オークワ	15,000	1,207.00	18,105,000
コメリ	14,700	1,915.00	28,150,500
青山商事	27,300	1,405.00	38,356,500
しまむら	11,100	5,370.00	59,607,000
CFSコーポレーション	13,000	670.00	8,710,000
高島屋	145,000	625.00	90,625,000
松屋	21,600	1,530.00	33,048,000
エイチ・ツー・オー リテイリング	70,000	586.00	41,020,000
丸栄	15,000	173.00	2,595,000
ニッセンホールディングス	26,100	383.00	9,996,300
パルコ	30,600	649.00	19,859,400

丸井グループ	139,800	592.00	82,761,600
クレディセゾン	92,200	1,135.00	104,647,000
原信ナルスホールディングス	6,500	891.00	5,791,500
セディナ	76,350	168.00	12,826,800
ダイエー	49,600	328.00	16,268,800
イズミヤ	35,000	453.00	15,855,000
イオン	432,100	709.00	306,358,900
ユニー	81,000	823.00	66,663,000
イズミ	29,400	1,120.00	32,928,000
東武ストア	14,000	314.00	4,396,000
平和堂	21,800	1,143.00	24,917,400
フジ	11,900	1,779.00	21,170,100
ヤオコー	6,100	2,740.00	16,714,000
ゼビオ	11,300	1,459.00	16,486,700
ケーズホールディングス	18,800	1,462.00	27,485,600
O l y m p i c	7,100	675.00	4,792,500
新生銀行	625,000	130.00	81,250,000
あおぞら銀行	378,000	108.00	40,824,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	6,283,500	507.00	3,185,734,500
りそなホールディングス	345,900	1,337.00	462,468,300
中央三井トラスト・ホールディングス	547,000	327.00	178,869,000
三井住友フィナンシャルグループ	452,300	3,570.00	1,614,711,000
第四銀行	150,000	392.00	58,800,000
北越銀行	121,000	165.00	19,965,000
西日本シティ銀行	349,000	211.00	73,639,000
札幌北洋ホールディングス	162,300	278.00	45,119,400
千葉銀行	423,000	478.00	202,194,000
横浜銀行	740,000	403.00	298,220,000
常陽銀行	416,000	459.00	190,944,000
群馬銀行	250,000	522.00	130,500,000
武蔵野銀行	16,300	2,910.00	47,433,000
千葉興業銀行	20,500	1,004.00	20,582,000
関東つくば銀行	30,500	290.00	8,845,000
東京都民銀行	20,400	1,545.00	31,518,000
七十七銀行	181,000	505.00	91,405,000
青森銀行	67,000	374.00	25,058,000
秋田銀行	73,000	362.00	26,426,000
山形銀行	65,000	459.00	29,835,000
岩手銀行	7,200	4,810.00	34,632,000
東邦銀行	83,000	392.00	32,536,000
荘内銀行	55,000	173.00	9,515,000
東北銀行	57,000	146.00	8,322,000

みちのく銀行	55,000	228.00	12,540,000
ふくおかフィナンシャルグループ	464,000	300.00	139,200,000
静岡銀行	335,000	911.00	305,185,000
十六銀行	139,000	352.00	48,928,000
スルガ銀行	125,000	827.00	103,375,000
八十二銀行	203,000	610.00	123,830,000
山梨中央銀行	72,000	508.00	36,576,000
大垣共立銀行	123,000	448.00	55,104,000
福井銀行	92,000	315.00	28,980,000
北國銀行	124,000	354.00	43,896,000
清水銀行	3,700	4,020.00	14,874,000
滋賀銀行	100,000	550.00	55,000,000
南都銀行	106,000	542.00	57,452,000
百五銀行	106,000	506.00	53,636,000
京都銀行	185,000	846.00	156,510,000
三重銀行	49,000	302.00	14,798,000
池田銀行	9,800	4,140.00	40,572,000
ほくほくフィナンシャルグループ	751,000	178.00	133,678,000
広島銀行	316,000	372.00	117,552,000
山陰合同銀行	65,000	768.00	49,920,000
中国銀行	88,000	1,280.00	112,640,000
鳥取銀行	37,000	268.00	9,916,000
伊予銀行	122,000	1,000.00	122,000,000
百十四銀行	126,000	469.00	59,094,000
四国銀行	78,000	381.00	29,718,000
阿波銀行	96,000	599.00	57,504,000
鹿児島銀行	75,000	680.00	51,000,000
大分銀行	59,000	544.00	32,096,000
宮崎銀行	56,000	392.00	21,952,000
肥後銀行	85,000	563.00	47,855,000
佐賀銀行	66,000	314.00	20,724,000
十八銀行	68,000	325.00	22,100,000
沖縄銀行	8,900	2,970.00	26,433,000
琉球銀行	22,500	809.00	18,202,500
住友信託銀行	1,017,000	400.00	406,800,000
みずほ信託銀行	1,017,000	94.00	95,598,000
八千代銀行	6,400	3,370.00	21,568,000
みずほフィナンシャルグループ	6,030,200	199.00	1,200,009,800
紀陽ホールディングス	424,000	125.00	53,000,000
山口フィナンシャルグループ	100,000	952.00	95,200,000
芙蓉総合リース	11,300	1,476.00	16,678,800
興銀リース	14,900	1,138.00	16,956,200

東京センチュリーリース	25,905	640.00	16,579,200
SBIホールディングス	8,514	12,160.00	103,530,240
日本証券金融	41,100	520.00	21,372,000
大阪証券金融	13,500	185.00	2,497,500
アイフル	62,700	162.00	10,157,400
ポケットカード	10,200	257.00	2,621,400
長野銀行	41,000	244.00	10,004,000
名古屋銀行	104,000	421.00	43,784,000
愛知銀行	3,900	7,130.00	27,807,000
第三銀行	66,000	290.00	19,140,000
中京銀行	50,000	322.00	16,100,000
東日本銀行	57,000	273.00	15,561,000
愛媛銀行	67,000	258.00	17,286,000
トマト銀行	42,000	245.00	10,290,000
みなと銀行	111,000	139.00	15,429,000
京葉銀行	96,000	397.00	38,112,000
関西アーバン銀行	114,000	179.00	20,406,000
栃木銀行	58,000	478.00	27,724,000
北日本銀行	3,600	2,960.00	10,656,000
香川銀行	41,000	418.00	17,138,000
徳島銀行	32,000	523.00	16,736,000
福島銀行	132,000	52.00	6,864,000
大東銀行	72,000	64.00	4,608,000
武富士	66,720	569.00	37,963,680
リコーリース	7,400	1,729.00	12,794,600
イオンクレジットサービス	47,700	990.00	47,223,000
アコム	48,450	2,695.00	130,572,750
プロミス	50,050	1,581.00	79,129,050
ジャックス	65,000	201.00	13,065,000
日立キャピタル	25,300	1,164.00	29,449,200
オリックス	53,130	4,140.00	219,958,200
三菱UFJリース	27,200	2,390.00	65,008,000
ジャフコ	16,500	2,035.00	33,577,500
大和証券グループ本社	711,000	514.00	365,454,000
野村ホールディングス	1,525,800	581.00	886,489,800
新光証券	274,000	230.00	63,020,000
みずほインベスターズ証券	249,000	88.00	21,912,000
岡三証券グループ	91,000	394.00	35,854,000
丸三証券	36,100	557.00	20,107,700
東洋証券	43,000	168.00	7,224,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	127,000	208.00	26,416,000
水戸証券	36,000	255.00	9,180,000

いちよし証券	24,800	515.00	12,772,000
松井証券	81,700	714.00	58,333,800
だいこう証券ビジネス	5,400	677.00	3,655,800
マネックスグループ	565	26,520.00	14,983,800
カブドットコム証券	232	104,100.00	24,151,200
極東証券	15,500	338.00	5,239,000
岩井証券	11,200	734.00	8,220,800
三井住友海上グループホールディングス	255,700	2,525.00	645,642,500
ソニーフィナンシャルホールディングス	381	275,400.00	104,927,400
日本興亜損害保険	413,000	567.00	234,171,000
損害保険ジャパン	500,000	567.00	283,500,000
ニッセイ同和損害保険	118,000	426.00	50,268,000
あいおい損害保険	280,000	418.00	117,040,000
富士火災海上保険	128,000	118.00	15,104,000
東京海上ホールディングス	461,100	2,660.00	1,226,526,000
NECキャピタルソリューション	3,700	697.00	2,578,900
T&Dホールディングス	157,000	2,820.00	442,740,000
三井不動産	476,000	1,297.00	617,372,000
三菱地所	746,000	1,308.00	975,768,000
平和不動産	78,500	245.00	19,232,500
東京建物	164,000	329.00	53,956,000
ダイビル	28,500	788.00	22,458,000
サンケイビル	19,300	455.00	8,781,500
東急不動産	218,000	336.00	73,248,000
京阪神不動産	16,000	339.00	5,424,000
住友不動産	273,000	1,274.00	347,802,000
東宝不動産	14,000	462.00	6,468,000
藤和不動産	69,000	54.00	3,726,000
大京	139,000	82.00	11,398,000
テーオーシー	44,900	352.00	15,804,800
東京楽天地	21,000	384.00	8,064,000
レオパレス21	77,300	702.00	54,264,600
フジ住宅	15,300	275.00	4,207,500
空港施設	12,600	482.00	6,073,200
住友不動産販売	5,200	3,290.00	17,108,000
ゴールドクレスト	8,790	2,415.00	21,227,850
東急リバブル	14,000	492.00	6,888,000
サンヨーハウジング名古屋	61	71,600.00	4,367,600
イオンモール	49,400	1,396.00	68,962,400
リサ・パートナーズ	178	44,150.00	7,858,700
エヌ・ティ・ティ都市開発	667	86,700.00	57,828,900
アトリウム	11,700	145.00	1,696,500

東武鉄道	463,000	511.00	236,593,000
相模鉄道	140,000	400.00	56,000,000
東京急行電鉄	596,000	429.00	255,684,000
京浜急行電鉄	272,000	725.00	197,200,000
小田急電鉄	348,000	791.00	275,268,000
京王電鉄	282,000	567.00	159,894,000
京成電鉄	174,000	489.00	85,086,000
富士急行	30,000	438.00	13,140,000
新京成電鉄	14,000	357.00	4,998,000
東日本旅客鉄道	202,300	5,140.00	1,039,822,000
西日本旅客鉄道	1,011	319,000.00	322,509,000
東海旅客鉄道	906	559,000.00	506,454,000
アートコーポレーション	2,200	1,103.00	2,426,600
西日本鉄道	142,000	372.00	52,824,000
ハマキョウレックス	3,400	1,695.00	5,763,000
サカイ引越センター	2,000	2,145.00	4,290,000
近畿日本鉄道	981,000	415.00	407,115,000
阪急阪神ホールディングス	729,000	452.00	329,508,000
南海電気鉄道	227,000	445.00	101,015,000
京阪電気鉄道	244,000	407.00	99,308,000
名糖運輸	4,500	823.00	3,703,500
名古屋鉄道	380,000	300.00	114,000,000
日本通運	466,000	340.00	158,440,000
ヤマトホールディングス	216,000	990.00	213,840,000
山九	132,000	274.00	36,168,000
日新	41,000	210.00	8,610,000
丸運	7,800	271.00	2,113,800
丸全昭和運輸	33,000	269.00	8,877,000
センコー	38,000	303.00	11,514,000
トナミホールディングス	25,000	258.00	6,450,000
日本梱包運輸倉庫	30,000	832.00	24,960,000
日本石油輸送	12,000	181.00	2,172,000
福山通運	85,000	362.00	30,770,000
セイノーホールディングス	84,000	501.00	42,084,000
神奈川中央交通	13,000	523.00	6,799,000
日立物流	22,600	934.00	21,108,400
日本郵船	584,000	416.00	242,944,000
商船三井	570,000	527.00	300,390,000
川崎汽船	264,000	364.00	96,096,000
新和海運	44,000	240.00	10,560,000
乾汽船	15,500	655.00	10,152,500
飯野海運	59,000	470.00	27,730,000

第一中央汽船	72,000	228.00	16,416,000
全日本空輸	1,120,000	376.00	421,120,000
日本航空	1,582,000	204.00	322,728,000
三菱倉庫	77,000	995.00	76,615,000
三井倉庫	47,000	369.00	17,343,000
住友倉庫	86,000	369.00	31,734,000
澁澤倉庫	33,000	421.00	13,893,000
ヤマタネ	57,000	96.00	5,472,000
東陽倉庫	19,000	179.00	3,401,000
日本トランスシティ	23,000	283.00	6,509,000
ケイヒン	22,000	123.00	2,706,000
安田倉庫	7,800	737.00	5,748,600
東洋埠頭	31,000	135.00	4,185,000
宇徳	7,900	285.00	2,251,500
上組	129,000	659.00	85,011,000
サンリツ	3,000	492.00	1,476,000
キムラユニティー	2,400	711.00	1,706,400
キューソー流通システム	3,000	935.00	2,805,000
郵船航空サービス	8,500	1,000.00	8,500,000
近鉄エクスプレス	9,700	1,866.00	18,100,200
東海運	6,800	253.00	1,720,400
バンテック	50	75,000.00	3,750,000
東京放送ホールディングス	64,200	1,337.00	85,835,400
日本テレビ放送網	10,260	9,510.00	97,572,600
テレビ朝日	271	119,100.00	32,276,100
テレビ東京	4,200	3,750.00	15,750,000
スカパーJ S A Tホールディングス	821	37,950.00	31,156,950
アイ・ティー・シーネットワーク	24	148,000.00	3,552,000
イー・アクセス	487	65,400.00	31,849,800
N E Cモバイリング	4,100	1,592.00	6,527,200
日本電信電話	492,600	3,830.00	1,886,658,000
K D D I	1,663	492,000.00	818,196,000
光通信	13,900	2,065.00	28,703,500
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	10,589	139,000.00	1,471,871,000
学習研究社	36,000	150.00	5,400,000
ゼンリン	15,700	1,076.00	16,893,200
昭文社	6,700	468.00	3,135,600
角川グループホールディングス	9,300	2,040.00	18,972,000
インプレスホールディングス	13,900	110.00	1,529,000
東京電力	684,200	2,415.00	1,652,343,000
中部電力	367,700	2,115.00	777,685,500
関西電力	450,600	2,055.00	925,983,000

中国電力	162,600	2,115.00	343,899,000
北陸電力	111,400	2,335.00	260,119,000
東北電力	271,300	2,100.00	569,730,000
四国電力	114,700	2,725.00	312,557,500
九州電力	239,800	2,130.00	510,774,000
北海道電力	101,600	1,940.00	197,104,000
沖縄電力	7,700	5,120.00	39,424,000
電源開発	78,600	2,890.00	227,154,000
東京瓦斯	1,374,000	349.00	479,526,000
大阪瓦斯	1,164,000	306.00	356,184,000
東邦瓦斯	283,000	461.00	130,463,000
北海道瓦斯	21,000	252.00	5,292,000
西部瓦斯	123,000	254.00	31,242,000
静岡瓦斯	33,500	565.00	18,927,500
アイネット	5,700	479.00	2,730,300
松竹	60,000	670.00	40,200,000
東宝	76,500	1,406.00	107,559,000
エイチ・アイ・エス	10,400	1,795.00	18,668,000
東映	45,000	471.00	21,195,000
葵プロモーション	6,000	475.00	2,850,000
エヌ・ティ・ティ・データ	663	266,400.00	176,623,200
共立メンテナンス	5,100	1,586.00	8,088,600
イチネンホールディングス	13,300	387.00	5,147,100
建設技術研究所	6,200	619.00	3,837,800
燦ホールディングス	2,500	1,777.00	4,442,500
スバル興業	8,000	282.00	2,256,000
東京テアトル	41,000	203.00	8,323,000
吉本興業	17,100	938.00	16,039,800
ホリプロ	4,000	857.00	3,428,000
よみうりランド	27,000	295.00	7,965,000
東京都競馬	78,000	132.00	10,296,000
常磐興産	38,000	157.00	5,966,000
カナモト	14,000	352.00	4,928,000
東京ドーム	87,000	287.00	24,969,000
D T S	10,700	666.00	7,126,200
スクウェア・エニックス・ホールディングス	27,400	1,866.00	51,128,400
シーイーシー	6,800	617.00	4,195,600
日立ソフトウェアエンジニアリング	15,500	1,266.00	19,623,000
カブコン	22,900	1,757.00	40,235,300
日本空港ビルデング	26,300	1,069.00	28,114,700
トランス・コスモス	15,400	494.00	7,607,600
乃村工藝社	22,000	232.00	5,104,000

ジャステック	6,200	481.00	2,982,200
住商情報システム	11,200	1,153.00	12,913,600
藤田観光	33,000	399.00	13,167,000
近畿日本ツーリスト	36,000	110.00	3,960,000
日本管財	4,200	1,308.00	5,493,600
白洋舎	14,000	261.00	3,654,000
セコム	110,100	3,770.00	415,077,000
日本システムウエア	5,800	301.00	1,745,800
セントラル警備保障	5,000	830.00	4,150,000
日立情報システムズ	8,900	1,721.00	15,316,900
アイネス	13,500	495.00	6,682,500
丹青社	11,000	226.00	2,486,000
メイテック	19,100	1,289.00	24,619,900
T K C	10,400	1,934.00	20,113,600
アサツー ディ・ケイ	22,800	1,687.00	38,463,600
富士ソフト	13,400	1,557.00	20,863,800
ソラン	11,600	406.00	4,709,600
応用地質	13,000	1,086.00	14,118,000
船井総合研究所	14,300	476.00	6,806,800
日本システムディベロップメント	19,400	709.00	13,754,600
進学会	5,500	233.00	1,281,500
コナミ	48,600	1,579.00	76,739,400
ベネッセコーポレーション	39,400	3,460.00	136,324,000
イオンディライト	8,400	1,300.00	10,920,000
ナック	2,900	830.00	2,407,000
福井コンピュータ	3,800	266.00	1,010,800
ニチイ学館	27,100	741.00	20,081,100
ダイセキ	16,700	1,572.00	26,252,400
元気寿司	3,300	1,201.00	3,963,300
トラスコ中山	12,300	1,184.00	14,563,200
ヤマダ電機	52,070	4,500.00	234,315,000
オートバックスセブン	17,200	2,750.00	47,300,000
アークランドサカモト	8,200	750.00	6,150,000
ニトリ	23,150	5,510.00	127,556,500
ユーエスシー	4,900	776.00	3,802,400
グルメ杵屋	8,000	618.00	4,944,000
愛眼	8,700	588.00	5,115,600
吉野家ホールディングス	246	108,800.00	26,764,800
日商エレクトロニクス	4,500	997.00	4,486,500
加藤産業	15,500	1,418.00	21,979,000
富士エレクトロニクス	6,300	742.00	4,674,600
松屋フーズ	5,200	1,373.00	7,139,600

J B C Cホールディングス	9,700	563.00	5,461,100
J Kホールディングス	10,400	570.00	5,928,000
ユニダックス	6,500	403.00	2,619,500
サガミチェーン	13,000	918.00	11,934,000
日伝	4,400	2,735.00	12,034,000
杉本商事	5,800	889.00	5,156,200
因幡電機産業	10,300	2,180.00	22,454,000
住金物産	56,000	205.00	11,480,000
プレナス	13,500	1,446.00	19,521,000
ミニストップ	8,000	1,479.00	11,832,000
アークス	12,700	1,314.00	16,687,800
パロー	21,400	738.00	15,793,200
ミスミグループ本社	36,000	1,332.00	47,952,000
江守商事	3,500	528.00	1,848,000
アルテック	4,600	162.00	745,200
ベルク	4,800	885.00	4,248,000
大庄	6,400	1,321.00	8,454,400
タキヒヨー	20,000	438.00	8,760,000
ファーストリテイリング	25,000	11,110.00	277,750,000
ソフトバンク	437,800	1,494.00	654,073,200
スズケン	38,000	2,650.00	100,700,000
サンドラッグ	20,400	1,566.00	31,946,400
ジェコス	8,600	471.00	4,050,600
ヤマザワ	2,800	1,225.00	3,430,000
やまや	2,400	557.00	1,336,800
ベルーナ	8,850	262.00	2,318,700
合 計	151,697,838		115,611,212,520

株式以外の有価証券

該当事項はありません。

2) 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

3) デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

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

[次へ](#)

3. JPM・US・セレクト（適格機関投資家専用）

- 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づき作成しております。
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。
- 当ファンドの計算期間は6ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。
- 当ファンドは、委託会社であるJPモルガン・アセット・マネジメント株式会社の委嘱に基づき、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に準じて、第6特定期間（平成20年4月8日から平成20年10月7日まで）及び第7特定期間（平成20年10月8日から平成21年4月7日まで）の財務諸表について、あらた監査法人による監査を受けております。

1 財務諸表

JPM・US・セレクト（適格機関投資家専用）

(1) 貸借対照表

区分	注記 番号	前期 (平成20年10月7日現在)	当期 (平成21年4月7日現在)
		金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
親投資信託受益証券		30,567,425,267	30,879,816,345
流動資産合計		30,567,425,267	30,879,816,345
資産合計		30,567,425,267	30,879,816,345
負債の部			
流動負債			
未払収益分配金		138,224,402	140,258,306
未払受託者報酬		507,458	501,827
未払委託者報酬		9,387,991	9,283,797
その他未払費用		262,500	262,500
流動負債合計		148,382,351	150,306,430
負債合計		148,382,351	150,306,430
純資産の部			
元本等			
元本	1	34,556,100,537	35,064,576,660
剰余金			
期末欠損金		4,137,057,621	4,335,066,745
（うち分配準備積立金）		(270,761,005)	(77,401,920)
剰余金合計	2	4,137,057,621	4,335,066,745
元本等合計		30,419,042,916	30,729,509,915

純資産合計		30,419,042,916	30,729,509,915
負債・純資産合計		30,567,425,267	30,879,816,345

(2) 損益及び剰余金計算書

区分	注記 番号	前期	当期
		(自平成20年4月8日 至平成20年10月7日)	(自平成20年10月8日 至平成21年4月7日)
		金額(円)	金額(円)
営業収益			
有価証券売買等損益		482,109,679	779,050,826
営業収益合計		482,109,679	779,050,826
営業費用			
受託者報酬		2,886,178	3,015,687
委託者報酬	1	53,394,191	55,790,112
その他費用		1,575,000	1,575,000
営業費用合計		57,855,369	60,380,799
営業利益金額		424,254,310	718,670,027
経常利益金額		424,254,310	718,670,027
当期純利益金額		424,254,310	718,670,027
一部解約に伴う当期純損失金額分配額		-	3,311,783
期首欠損金		3,119,116,182	4,137,057,621
欠損金減少額		-	11,995,937
(当期一部解約に伴う欠損金減少額)		(-)	(11,995,937)
欠損金増加額		698,092,193	98,676,123
(当期追加信託に伴う欠損金増加額)		(698,092,193)	(98,676,123)
分配金	2	744,103,556	833,310,748
期末欠損金		4,137,057,621	4,335,066,745

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	前期 (自平成20年4月8日 至平成20年10月7日)	当期 (自平成20年10月8日 至平成21年4月7日)
有価証券の評価基準 及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、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)

区分	前期 (平成20年10月7日現在)	当期 (平成21年4月7日現在)
1 信託財産に係る期首元本額、期中追加設定元本額及び期中解約元本額		

期首元本額	27,352,008,344円	34,556,100,537円
期中追加設定元本額	7,204,092,193円	608,676,123円
期中一部解約元本額	- 円	100,200,000円
2 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は4,137,057,621円です。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は4,335,066,745円です。
3 特定期間末日における受益権の総数	34,556,100,537口	35,064,576,660口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	前期 (自 平成20年4月8日 至 平成20年10月7日)	当期 (自 平成20年10月8日 至 平成21年4月7日)
1 信託財産の運用の指図に関する権限の全部または一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額	純資産総額に年率0.25%を乗じて得た額	同左
2 分配金の計算過程	(自 平成20年4月8日 至 平成20年5月7日)	(自 平成20年10月8日 至 平成20年11月7日)
費用控除後の配当等収益額	103,299,785円	109,578,254円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	- 円	- 円
収益調整金額	133,641,938円	248,192,127円
分配準備積立金額	366,651,642円	269,975,898円
当ファンドの分配対象収益額	603,593,365円	627,746,279円
当ファンドの期末残存口数	28,029,909,498口	34,455,900,537口
1万口当たり収益分配対象額	215.33円	182.18円
1万口当たり分配金額	40.00円	40.00円
収益分配金金額	112,119,637円	137,823,602円
	(自 平成20年5月8日 至 平成20年6月9日)	(自 平成20年11月8日 至 平成20年12月8日)
費用控除後の配当等収益額	101,633,287円	105,982,025円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	- 円	- 円
収益調整金額	158,627,501円	250,626,284円
分配準備積立金額	357,831,790円	241,730,550円
当ファンドの分配対象収益額	618,092,578円	598,338,859円
当ファンドの期末残存口数	29,377,989,192口	34,618,348,939口
1万口当たり収益分配対象額	210.39円	172.83円
1万口当たり分配金額	40.00円	40.00円
収益分配金金額	117,511,956円	138,473,395円
	(自 平成20年6月10日 至 平成20年7月7日)	(自 平成20年12月9日 至 平成21年1月7日)
費用控除後の配当等収益額	95,141,489円	105,348,013円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	- 円	- 円
収益調整金額	174,435,760円	250,626,284円

分配準備積立金額	341,953,121円	209,239,180円
当ファンドの分配対象収益額	611,530,370円	565,213,477円
当ファンドの期末残存口数	30,246,384,085口	34,618,348,939口
1万口当たり収益分配対象額	202.18円	163.26円
1万口当たり分配金額	40.00円	40.00円
収益分配金金額	120,985,536円	138,473,395円

区分	前期 (自 平成20年 4 月 8 日 至 平成20年10月 7 日)	当期 (自 平成20年10月 8 日 至 平成21年 4 月 7 日)
	(自 平成20年 7 月 8 日 至 平成20年 8 月 7 日)	(自 平成21年 1 月 8 日 至 平成21年 2 月 9 日)
費用控除後の配当等収益額	114,287,815円	105,742,275円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券 売買等損益額	- 円	- 円
収益調整金額	193,136,710円	252,371,221円
分配準備積立金額	316,109,074円	176,113,798円
当ファンドの分配対象収益額	623,533,599円	534,227,294円
当ファンドの期末残存口数	31,307,882,430口	34,747,895,020口
1万口当たり収益分配対象額	199.16円	153.74円
1万口当たり分配金額	40.00円	40.00円
収益分配金金額	125,231,529円	138,991,580円
	(自 平成20年 8 月 8 日 至 平成20年 9 月 8 日)	(自 平成21年 2 月10日 至 平成21年 3 月 9 日)
費用控除後の配当等収益額	126,583,317円	104,838,720円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券 売買等損益額	- 円	- 円
収益調整金額	213,830,313円	253,290,485円
分配準備積立金額	305,165,360円	142,864,493円
当ファンドの分配対象収益額	645,578,990円	500,993,698円
当ファンドの期末残存口数	32,507,624,127口	34,822,617,571口
1万口当たり収益分配対象額	198.59円	143.87円
1万口当たり分配金額	40.00円	40.00円
収益分配金金額	130,030,496円	139,290,470円
	(自 平成20年 9 月 9 日 至 平成20年10月 7 日)	(自 平成21年 3 月10日 至 平成21年 4 月 7 日)
費用控除後の配当等収益額	107,267,226円	109,247,483円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券 売買等損益額	- 円	- 円
収益調整金額	248,913,885円	256,110,089円
分配準備積立金額	301,718,181円	108,412,743円
当ファンドの分配対象収益額	657,899,292円	473,770,315円
当ファンドの期末残存口数	34,556,100,537口	35,064,576,660口
1万口当たり収益分配対象額	190.38円	135.11円
1万口当たり分配金額	40.00円	40.00円
収益分配金金額	138,224,402円	140,258,306円

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	前期 (平成20年10月7日現在)		当期 (平成21年4月7日現在)	
	貸借対照表計上額 (円)	当特定期間の損益 に含まれた評価差 額(円)	貸借対照表計上額 (円)	当特定期間の損益 に含まれた評価差 額(円)
親投資信託受益証券	30,567,425,267	1,389,812,168	30,879,816,345	823,242,430
合計	30,567,425,267	1,389,812,168	30,879,816,345	823,242,430

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

区分	前期 (平成20年10月7日現在)	当期 (平成21年4月7日現在)
1口当たりの純資産額	0.8803円	0.8764円
(1万口当たりの純資産額)	(8,803円)	(8,764円)

(4) 附属明細表

第1 有価証券明細表(平成21年4月7日現在)

(イ) 株式

該当事項はありません。

(ロ) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	口数	評価額	備考
親投資信託 受益証券	日本円	JPM USトレジャリー・インカム・ マザーファンド(適格機関投資家専用)	25,103,500,809	30,879,816,345	
合計			25,103,500,809	30,879,816,345	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第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)

当ファンドは「JPM USトレジャリー・インカム・マザーファンド(適格機関投資家専用)」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、全て同親投資信託の受益証券であります。

尚、同親投資信託の状況は以下の通りであります。

「JPM US Treasury・Income・M&A Fund（適格機関投資家専用）」の状況

尚、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

(1) 貸借対照表

区分	注記 番号	(平成20年10月7日現在)	(平成21年4月7日現在)
		金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
預金		113,634,057	192,018,951
コール・ローン		953,874,504	516,591,503
国債証券	2	36,252,558,347	36,726,025,419
特殊債券		7,315,577,866	6,584,257,392
派生商品評価勘定		78,547,374	15,736,848
未収利息		404,618,934	338,244,456
前払費用		40,954,283	2,169,320
流動資産合計		45,159,765,365	44,375,043,889
資産合計		45,159,765,365	44,375,043,889
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		485,936	1,402,873
前受金		33,380,711	20,597,883
未払解約金		10,906,880	5,129,423
流動負債合計		44,773,527	27,130,179
負債合計		44,773,527	27,130,179
純資産の部			
元本等			
元本	1	37,652,714,013	36,053,375,424
剰余金			
剰余金		7,462,277,825	8,294,538,286
剰余金合計		7,462,277,825	8,294,538,286
元本等合計		45,114,991,838	44,347,913,710
純資産合計		45,114,991,838	44,347,913,710
負債・純資産合計		45,159,765,365	44,375,043,889

(注) 「JPM US Treasury・Income・M&A Fund（適格機関投資家専用）」の計算期間は毎年4月16日から10月15日、及び毎年10月16日から翌年4月15日までであり、当ファンドの特定期間と異なります。上記貸借対照表は平成20年10月7日及び平成21年4月7日における同親投資信託の状況であります。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	(自平成20年4月8日 至平成20年10月7日)	(自平成20年10月8日 至平成21年4月7日)
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券及び特殊債券 個別法に基づき、以下のとおり原則として 時価で評価しております。	国債証券及び特殊債券 個別法に基づき、以下のとおり原則として 時価で評価しております。

	<p>(1)金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における計算期間末日の最終相場（外貨建証券の場合は計算期間末日において知りうる直近の最終相場）で評価しております。 計算期間末日に当該金融商品取引所等の最終相場がない場合には、当該金融商品取引所等における直近の日の最終相場で評価しておりますが、直近の日の最終相場によることが適当でない認められた場合は、当該金融商品取引所等における計算期間末日又は直近の日の気配相場で評価しております。</p> <p>(2)金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融機関の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）又は価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3)時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合又は入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>	<p>(1)金融商品取引所等に上場されている有価証券 同左</p> <p>(2)金融商品取引所等に上場されていない有価証券 同左</p> <p>(3)時価が入手できなかった有価証券 同左</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>(1)デリバティブ取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。</p> <p>(2)為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 為替予約の評価は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。</p>	<p>(1)デリバティブ取引 同左</p> <p>(2)為替予約取引 同左</p>

3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「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条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。ただし、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p>	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>同左</p>
----------------------------	--	------------------------------

（貸借対照表に関する注記）

区分	(平成20年10月7日現在)	(平成21年4月7日現在)
<p>1 本報告書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額、期中追加設定元本額及び期中解約元本額</p> <p>期首元本額</p> <p>期中追加設定元本額</p> <p>期中解約元本額</p>	<p>33,864,641,660円</p> <p>5,898,753,353円</p> <p>2,110,681,000円</p>	<p>37,652,714,013円</p> <p>573,432,661円</p> <p>2,172,771,250円</p>
<p>本報告書における開示対象ファンドの期末における元本の内訳（注）</p> <p>JP M U Sトレジャーリー・インカム・ファンド（3ヶ月決算型）</p> <p>JP M U Sトレジャーリー・インカム・ファンド（毎月決算型）</p> <p>JP M・U S・セレクト（適格機関投資家専用）</p> <p>JP M U Sトレジャーリー・インカム・ファンド（SMA専用）</p> <p>合計</p>	<p>7,019,029,675円</p> <p>5,105,793,303円</p> <p>25,511,121,071円</p> <p>16,769,964円</p> <p>37,652,714,013円</p>	<p>6,326,507,083円</p> <p>4,605,150,180円</p> <p>25,103,500,809円</p> <p>18,217,352円</p> <p>36,053,375,424円</p>
<p>2 差入委託証拠金代用有価証券</p>	<p>先物取引にかかる差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。</p> <p>国債証券</p> <p>664,400.78アメリカドル</p>	<p>先物取引にかかる差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。</p> <p>国債証券</p> <p>618,468.75アメリカドル</p>
<p>3 本報告書における開示対象ファンドの特定期間末日における受益権の総数</p>	<p>37,652,714,013口</p>	<p>36,053,375,424口</p>

（注）当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種類	(平成20年10月7日現在)		(平成21年4月7日現在)	
	貸借対照表計上額 (円)	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)	貸借対照表計上額 (円)	当期間の損益に含まれた評価差額 (円)
国債証券	36,252,558,347	494,318,321	36,726,025,419	1,209,407,161
特殊債券	7,315,577,866	81,210,686	6,584,257,392	314,162,573
合計	43,568,136,213	413,107,635	43,310,282,811	1,523,569,734

(注) 当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の開始日から本報告書における開示対象ファンドの特定期間末日までの期間に対応する金額であります。

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の状況に関する事項

区分	(自平成20年4月8日 至平成20年10月7日)	(自平成20年10月8日 至平成21年4月7日)
1. 取引の内容	当投資信託の利用しているデリバティブ取引は、債券関連では債券先物取引、通貨関連では為替予約取引であります。	同左
2. 取引に対する取組方針	デリバティブ取引は、将来の債券の価格変動及び為替の変動によるリスク回避及び効率的な運用に資することを目的としております。	同左
3. 取引の利用目的	デリバティブ取引は、債券関連では債券の価格変動リスクを回避し、通貨関連では外貨建金銭債権債務の為替変動リスクを回避し、安定的な利益の確保を図る目的で利用しております。	同左
4. 取引に係るリスクの内容	債券先物取引に係るリスクは債券価格の変動によるリスクであります。また、為替予約取引に係るリスクは為替相場の変動によるリスクであります。	同左
5. 取引に係るリスクの管理体制	デリバティブ取引の執行・管理については、取引権限および取引限度額等を定めた規定に従い、運用担当部門が決済担当者の承認を得て行っております。	同左
6. 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。	同左

取引の時価等に関する事項

(債券関連)

区分	種類	(平成20年10月7日現在)				(平成21年4月7日現在)			
		契約額等 (円)	うち 1年超 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)	契約額等 (円)	うち 1年超 (円)	時価 (円)	評価損益 (円)
市場取引	債券先物取引 買建	4,661,903,096	-	4,739,964,534	78,061,438	3,734,745,141	-	3,749,079,116	14,333,975
合計		4,661,903,096	-	4,739,964,534	78,061,438	3,734,745,141	-	3,749,079,116	14,333,975

(注) 1. 先物取引の時価の算定方法

債券先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 債券先物取引の残高は、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。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。
5. 評価損益は、当親投資信託の計算期間の開始日から本報告書における開示対象ファンドの特定期間末日までの期間に対応する金額であります。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

区分	(平成20年10月7日現在)	(平成21年4月7日現在)
1口当たりの純資産額	1,198.2円	1,230.1円
(1万口当たりの純資産額)	(11,982円)	(12,301円)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表（平成21年4月7日現在）

(イ) 株式

該当事項はありません。

(ロ) 株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	銘柄数 比率	券面総額	評価額	備考
国債証券	アメリカドル	US T-BOND 11.25% FEB15		16,100,000.00	24,069,500.00	
		US T-BOND 3.5% FEB39		10,015,000.00	9,551,806.25	
		US T-BOND 5.375% FEB31		11,585,000.00	14,169,903.12	
		US T-BOND 6.5% NOV26		3,390,000.00	4,571,732.81	
		US T-BOND 6.75% AUG26		13,885,000.00	19,191,673.43	
		US T-BOND 7.625% NOV22		190,000.00	270,957.81	
		US T-BOND 8.125% MAY21		5,615,000.00	8,157,542.18	
		US T-BOND 8.75% AUG20		19,065,000.00	28,537,921.87	
		US T-BOND 8.875% FEB20		20,474,000.00	30,339,908.75	
		US T-NOTE 0.875% FEB11		4,500,000.00	4,494,726.58	
		US T-NOTE 1.875% FEB14		3,000,000.00	3,000,234.39	
		US T-NOTE 2% FEB10		5,930,000.00	6,001,576.93	
		US T-NOTE 2.75% FEB19		2,000,000.00	1,967,187.50	
		US T-NOTE 2.75% JUL10		7,180,000.00	7,369,596.87	
		US T-NOTE 2.875% JUN10		15,000,000.00	15,393,750.00	

		US T-NOTE 4% FEB15		44,015,000.00	48,560,924.21	
		US T-NOTE 4.125% AUG12		25,655,000.00	27,881,773.95	
		US T-NOTE 4.5% FEB11		26,910,000.00	28,699,094.66	
		US T-NOTE 4.625% FEB17		5,605,000.00	6,397,582.03	
		US T-NOTE 4.75% MAY14		435,000.00	496,035.93	
		US T-NOTE 4.875% APR11		15,210,000.00	16,420,858.66	
		US T-NOTE 4.875% FEB12		555,000.00	611,280.46	
		US T-NOTE 4.875% JUN12		31,965,000.00	35,416,221.09	
		US T-NOTE 5.125% JUN11		18,449,000.00	20,120,940.62	
		US T-NOTE 6% AUG09		3,310,000.00	3,377,105.08	
	計	銘柄数 :	25	310,038,000.00	365,069,835.18	
					(36,726,025,419)	
		組入時価比率 :	82.8%		84.8%	
	小計				36,726,025,419	
					(36,726,025,419)	
特殊債券	アメリカドル	GNMA POOL NO 598579		1,514,735.18	1,586,507.57	
		GNMA POOL NO 604382		1,667,374.15	1,745,336.89	
		GNMA POOL NO 605401		608,761.51	636,274.66	
		GNMA POOL NO 636834		1,435,387.72	1,500,260.49	
		GNMA POOL NO 651192		560,383.12	593,095.48	
		GNMA POOL NO 653765		580,535.67	614,424.43	
		GNMA POOL NO 655325		539,178.96	570,653.53	
		GNMA2 POOL NO 3736		1,276,902.82	1,332,019.18	
		GNMA2 POOL NO 3748		5,908,772.16	6,163,818.99	
		GNMA2 POOL NO 3760		3,311,105.80	3,454,026.70	
		GNMA2 POOL NO 3807		5,592,395.92	5,807,178.87	
		GNMA2 POOL NO 3819		3,523,062.30	3,658,369.91	
		GNMA2 POOL NO 3853		1,993,705.47	2,095,415.55	
		GNMA2 POOL NO 3866		5,494,227.90	5,774,519.23	
		GNMA2 POOL NO 3891		28,465,774.63	29,917,973.20	
	計	銘柄数 :	15	62,472,303.31	65,449,874.68	
					(6,584,257,392)	
		組入時価比率 :	14.8%		15.2%	
	小計				6,584,257,392	
					(6,584,257,392)	
	合計				43,310,282,811	
					(43,310,282,811)	

(注) 各通貨計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注) 小計・合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

(注) 比率は左より組入時価の純資産に対する比率、および各通貨計欄の合計金額に対する比率であります。

先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下の有価証券が差し入れられております。

US T-NOTE 4.75% MAY14	435,000アメリカドル
US T-NOTE 6% AUG09	120,000アメリカドル

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第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

当表に記載すべき内容は、「デリバティブ取引等に関する注記 取引の時価等に関する事項」に開示しておりますので、記載を省略しております。

4. ピクテ・ユーロ・セレクト・インカム(適格機関投資家専用)

(1) ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) ファンドの計算期間は6か月未満であるため、財務諸表は6か月毎に作成しております。

(3) ファンドは、当社の委嘱に基づき、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に準じて、前特定期間(平成20年4月8日から平成20年10月7日まで)及び、当特定期間(平成20年10月8日から平成21年4月7日まで)の財務諸表について、あらた監査法人による監査を受けております。

財務諸表

ピクテ・ユーロ・セレクト・インカム(適格機関投資家専用)

(1) 貸借対照表

区分	注記 番号	前期 [平成20年10月7日現在]	当期 [平成21年4月7日現在]
		金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
親投資信託受益証券		29,487,181,308	29,548,833,482
流動資産合計		29,487,181,308	29,548,833,482
資産合計		29,487,181,308	29,548,833,482
負債の部			
流動負債			
未払収益分配金		146,204,361	148,498,709
未払受託者報酬		1,020,434	952,758
未払委託者報酬		9,949,222	9,289,387
その他未払費用		1,454,510	254,854
流動負債合計		158,628,527	158,995,708

負債合計		158,628,527	158,995,708
純資産の部			
元本等			
元本		32,489,858,179	32,999,713,178
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金 ()		3,161,305,398	3,609,875,404
(分配準備積立金)		3,841,160,606	3,891,072,744
元本等合計		29,328,552,781	29,389,837,774
純資産合計		29,328,552,781	29,389,837,774
負債純資産合計		29,487,181,308	29,548,833,482

(2) 損益及び剰余金計算書

区分	注記 番号	前期	当期
		自 平成20年4月8日 至 平成20年10月7日	自 平成20年10月8日 至 平成21年4月7日
		金額(円)	金額(円)
営業収益			
有価証券売買等損益		3,757,713,052	583,106,080
営業収益合計		3,757,713,052	583,106,080
営業費用			
受託者報酬		6,277,310	5,675,577
委託者報酬		61,203,714	55,336,875
その他費用		1,454,510	1,518,159
営業費用合計		68,935,534	62,530,611
営業利益又は営業損失()		3,826,648,586	520,575,469
経常利益又は経常損失()		3,826,648,586	520,575,469
当期純利益又は当期純損失()		3,826,648,586	520,575,469
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()			1,848,780
期首剰余金又は期首欠損金()		1,284,734,161	3,161,305,398
剰余金増加額又は欠損金減少額		223,783,877	9,632,720
当期一部解約に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額			9,632,720
当期追加信託に伴う剰余金増加額 又は欠損金減少額		223,783,877	
剰余金減少額又は欠損金増加額		52,155,892	98,854,999
当期追加信託に伴う剰余金減少額 又は欠損金増加額		52,155,892	98,854,999
分配金		791,018,958	881,771,976
期末剰余金又は期末欠損金()		3,161,305,398	3,609,875,404

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	前期	当期
	自 平成20年4月8日 至 平成20年10月7日	自 平成20年10月8日 至 平成21年4月7日

有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、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)

区分	前期 (平成20年10月7日現在)	当期 (平成21年4月7日現在)
1. 元本の推移		
期首元本額	26,155,486,159円	32,489,858,179円
期中追加設定元本額	6,334,372,020円	608,854,999円
期中一部解約元本額	円	99,000,000円
2. 特定期間末日における受益権の総数	32,489,858,179口	32,999,713,178口
3. 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は3,161,305,398円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額を下回っており、その差額は3,609,875,404円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	前期 自平成20年4月8日 至平成20年10月7日	当期 自平成20年10月8日 至平成21年4月7日
1. 主要投資対象である親投資信託受益証券において、信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用	当該親投資信託受益証券に係る信託財産の純資産総額のうち、当ファンドに対応する部分の額の年率0.26%相当額	同左
2. 分配金の計算過程	(平成20年4月8日から平成20年5月7日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(145,653,083円、ファンドに帰属すべき親投資信託受益証券の配当等収益を含む)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(66,154,803円)及び分配準備積立金(2,986,572,032円)より分配対象収益は3,198,379,918円(1万口当たり1,196.76円)であり、うち120,262,188円(1万口当たり45円)を分配金額としております。	(平成20年10月8日から平成20年11月7日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純損失金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(136,621,510円、ファンドに帰属すべき親投資信託受益証券の配当等収益を含む)、解約に伴う当期純損失金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(87,676,988円)及び分配準備積立金(3,829,456,320円)より分配対象収益は4,053,754,818円(1万口当たり1,251.49円)であり、うち145,758,861円(1万口当たり45円)を分配金額としております。

<p>(平成20年5月8日から平成20年6月9日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(165,568,385円、ファンドに帰属すべき親投資信託受益証券の配当等収益を含む)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(133,627,181円)及び分配準備積立金(3,078,117,730円)より分配対象収益は3,377,313,296円(1万口当たり1,211.77円)であり、うち125,417,448円(1万口当たり45円)を分配金額としております。</p>	<p>(平成20年11月8日から平成20年12月8日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(128,367,399円、ファンドに帰属すべき親投資信託受益証券の配当等収益を含む)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(20,073,195円)及び分配準備積立金(3,907,995,957円)より分配対象収益は4,056,436,551円(1万口当たり1,245.96円)であり、うち146,502,418円(1万口当たり45円)を分配金額としております。</p>
<p>(平成20年6月10日から平成20年7月7日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(153,877,741円、ファンドに帰属すべき親投資信託受益証券の配当等収益を含む)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(95,888,518円)及び分配準備積立金(3,243,686,115円)より分配対象収益は3,493,452,374円(1万口当たり1,221.05円)であり、うち128,744,807円(1万口当たり45円)を分配金額としております。</p>	<p>(平成20年12月9日から平成21年1月7日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(137,215,395円、ファンドに帰属すべき親投資信託受益証券の配当等収益を含む)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(0円)及び分配準備積立金(3,909,934,133円)より分配対象収益は4,047,149,528円(1万口当たり1,243.13円)であり、うち146,502,418円(1万口当たり45円)を分配金額としております。</p>
<p>(平成20年7月8日から平成20年8月7日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(182,116,645円、ファンドに帰属すべき親投資信託受益証券の配当等収益を含む)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(107,636,038円)及び分配準備積立金(3,364,707,567円)より分配対象収益は3,654,460,250円(1万口当たり1,238.41円)であり、うち132,790,494円(1万口当たり45円)を分配金額としております。</p>	<p>(平成21年1月8日から平成21年2月9日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(132,172,146円、ファンドに帰属すべき親投資信託受益証券の配当等収益を含む)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(15,625,883円)及び分配準備積立金(3,900,647,110円)より分配対象収益は4,048,445,139円(1万口当たり1,238.60円)であり、うち147,082,621円(1万口当たり45円)を分配金額としております。</p>

	(平成20年8月8日から平成20年9月8日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(175,575,384円、ファンドに帰属すべき親投資信託受益証券の配当等収益を含む)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(129,440,146円)及び分配準備積立金(3,521,669,756円)より分配対象収益は3,826,685,286円(1万口当たり1,251.44円)であり、うち137,599,660円(1万口当たり45円)を分配金額としております。	(平成21年2月10日から平成21年3月9日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(119,997,828円、ファンドに帰属すべき親投資信託受益証券の配当等収益を含む)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(9,220,620円)及び分配準備積立金(3,901,362,518円)より分配対象収益は4,030,580,966円(1万口当たり1,230.27円)であり、うち147,426,949円(1万口当たり45円)を分配金額としております。
	(平成20年9月9日から平成20年10月7日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(152,074,980円、ファンドに帰属すべき親投資信託受益証券の配当等収益を含む)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(234,149,323円)及び分配準備積立金(3,689,085,626円)より分配対象収益は4,075,309,929円(1万口当たり1,254.31円)であり、うち146,204,361円(1万口当たり45円)を分配金額としております。	(平成21年3月10日から平成21年4月7日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(127,814,225円、ファンドに帰属すべき親投資信託受益証券の配当等収益を含む)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(28,603,211円)及び分配準備積立金(3,883,154,017円)より分配対象収益は4,039,571,453円(1万口当たり1,224.10円)であり、うち148,498,709円(1万口当たり45円)を分配金額としております。

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

前期(平成20年10月7日現在)

種類	貸借対照表計上額	最終計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	29,487,181,308円	3,161,155,595円
合計	29,487,181,308円	3,161,155,595円

当期(平成21年4月7日現在)

種類	貸借対照表計上額	最終計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	29,548,833,482円	1,801,872,071円
合計	29,548,833,482円	1,801,872,071円

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(一口当たり情報に関する注記)

区分	前期 (平成20年10月7日現在)	当期 (平成21年4月7日現在)
一口当たり純資産額 (一万口当たり純資産額)	0.9027円 (9,027円)	0.8906円 (8,906円)

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(4) 附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(口)	評価額(円)	備考
親投資信託 受益証券	ピクテ・ユーロ最高格付国債ファンド ・マザーファンド	19,884,813,918	29,548,833,482	
合計		19,884,813,918	29,548,833,482	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第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。

第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

第5 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

第6 借入金明細表

該当事項はありません。

参考情報

ファンドは、「ピクテ・ユーロ最高格付国債ファンド・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同受益証券です。

なお、同投資信託受益証券の状況は以下の通りです。

「ピクテ・ユーロ最高格付国債ファンド・マザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は監査対象外であります。

(1)貸借対照表

区分	注記 番号	[平成20年10月7日現在]	[平成21年4月7日現在]
		金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
預金			2,965,569,578
コール・ローン		446,270,737	202,035,965
国債証券		147,309,920,341	140,456,184,673
派生商品評価勘定		1,763,174,627	126,697,134
未収利息		7,243,242,688	4,169,647,660
前払費用		45,530,765	1,230,032,649
差入委託証拠金		3,183,370,913	1,957,768,499
流動資産合計		159,991,510,071	151,107,936,158
資産合計		159,991,510,071	151,107,936,158
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		88,505,715	536,317,681
未払解約金		255,155,976	34,887,594
流動負債合計		343,661,691	571,205,275
負債合計		343,661,691	571,205,275
純資産の部			
元本等			
元本		109,742,205,412	101,300,992,568
剰余金			
剰余金又は欠損金()		49,905,642,968	49,235,738,315
元本等合計		159,647,848,380	150,536,730,883
純資産合計		159,647,848,380	150,536,730,883
負債純資産合計		159,991,510,071	151,107,936,158

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自平成20年4月8日 至平成20年10月7日	自平成20年10月8日 至平成21年4月7日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(但し、売気配相場は使用しない)、または価格情報会社の提供する価額等で評価しております。	国債証券 同左

2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	(1)為替予約 為替予約の評価は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 (2)先物取引・オプション取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。	(1)為替予約 同左 (2)先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 「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、61条に基づいて、外貨建取引の記録、及び外貨の売買を処理しております。	外貨建取引等の処理基準 同左

(貸借対照表に関する注記)

区分	(平成20年10月7日現在)	(平成21年4月7日現在)
1. 元本の推移		
期首相当日現在元本額	114,530,717,012円	109,742,205,412円
期中追加設定元本額	5,371,639,973円	1,211,494,878円
期中一部解約元本額	10,160,151,573円	9,652,707,722円
元本の内訳		
ピクテ・ユーロ最高格付国債ファンド(毎月決算型)	305,051,745円	280,098,161円
ピクテ・ユーロ最高格付国債ファンド(3ヵ月決算型)	5,745,077,181円	5,269,498,208円
ピクテ・ユーロ最高格付国債インカム・ファンド(毎月決算型)	83,333,924,576円	75,775,809,960円
ピクテ・ユーロ最高格付国債インカム・ファンド(SMA専用)	89,261,816円	90,772,321円
ピクテ・ユーロ・セレクト・インカム(適格機関投資家専用)	20,268,890,094円	19,884,813,918円
合計	109,742,205,412円	101,300,992,568円
2. 本報告書における開示対象ファンドの特定期間末日における受益権の総数	109,742,205,412口	101,300,992,568口

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

(平成20年10月7日現在)

種類	貸借対照表計上額
国債証券	147,309,920,341円
合計	147,309,920,341円

(平成21年4月7日現在)

種類	貸借対照表計上額
国債証券	140,456,184,673円
合計	140,456,184,673円

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の状況に関する事項

区分	自 平成20年4月8日 至 平成20年10月7日	自 平成20年10月8日 至 平成21年4月7日
1. 取引の内容	ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引、債券先物取引、金利先物取引及びオプション取引であります。	ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引、債券先物取引及び金利先物取引であります。
2. 取引に対する取組方針	為替予約取引は、ユーロ建有価証券等の買付代金の支払い及び保有するユーロ建有価証券等の売却代金、償還金、利金等の受取りのため行っています。 債券先物取引、金利先物取引及びオプション取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行い、投機的な取引は行わない方針であります。	為替予約取引は、ユーロ建有価証券等の買付代金の支払い及び保有するユーロ建有価証券等の売却代金、償還金、利金等の受取りのため行っています。 債券先物取引及び金利先物取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行い、投機的な取引は行わない方針であります。
3. 取引の利用目的	為替予約取引は、ユーロ建有価証券等の買付代金の支払い及び保有するユーロ建有価証券等の売却代金、償還金、利金等の受取りのため行っています。 債券先物取引、金利先物取引及びオプション取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、安定的な利益の確保を図る目的で利用します。	為替予約取引は、ユーロ建有価証券等の買付代金の支払い及び保有するユーロ建有価証券等の売却代金、償還金、利金等の受取りのため行っています。 債券先物取引及び金利先物取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、安定的な利益の確保を図る目的で利用します。
4. 取引に係るリスクの内容	ファンドの利用しているデリバティブ取引に係るリスクとしては、金利、為替などの市場価格が変動することによって発生するマーケットリスク及び取引相手先が契約を履行できなくなる場合、すなわちデフォルト状態となった時に発生する取引先リスクがあります。	同左
5. 取引に係るリスク管理体制	デリバティブ取引の管理・執行については、信託約款、法令等及び取引権限・取引限度額等を定めた社内ルールに従い、管理はコンプライアンス部門が、執行は担当者が運用部の承認を得て行っております。	同左
6. 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、または計算上の想定元本であり、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。	同 左

取引の時価等に関する事項

(1) 債券関連

(平成20年10月7日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	58,581,662,907		60,287,036,727	1,705,373,820

合計	58,581,662,907		60,287,036,727	1,705,373,820
----	----------------	--	----------------	---------------

(平成21年4月7日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	39,236,251,822		38,699,934,141	536,317,681
	売建	25,060,025,067		24,933,327,933	126,697,134
合計		64,296,276,889		63,633,262,074	409,620,547

(注)時価の算定方法

・先物取引

1. 債券先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 債券先物取引の残高は、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。

(2)金利関連

(平成20年10月7日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	金利先物取引 買建	15,827,503,391		15,885,304,198	57,800,807
	売建	15,919,053,512	13,380,666,095	16,007,559,227	88,505,715
合計		31,746,556,903	13,380,666,095	31,892,863,425	30,704,908

(平成21年4月7日現在)

該当事項はありません

(注)時価の算定方法

・先物取引

1. 金利先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 金利先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(一口当たり情報に関する注記)

区分	(平成20年10月7日現在)	(平成21年4月7日現在)
一口当たり純資産額 (一万口当たり純資産額)	1.4548円 (14,548円)	1.4860円 (14,860円)

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価金額	備考
国債証券	ユーロ	5.375% DEUTSCHLAND REP 2010/01/04	49,000,000	50,642,970.00	
		5.5%FRANCE O.A.T. 2010/04/25	40,000,000	41,824,800.00	
		5.75% FINNISH GOVT 2011/02/23	40,000,000	43,039,600.00	
		6% DEUTSCHLAND REP 2016/06/20	80,000,000	95,000,000.00	
		6.5% DEUTSCHLAND 2027/07/04	10,450,000	13,458,659.50	
		6.5% FRANCE O.A.T 2011/04/25	141,918,000	155,590,380.12	
		7.5% NETHERLANDS GOVT 2023/01/15	40,000,000	54,230,000.00	
		7.5% NETHERLANDS GOVT 2010/04/15	99,100,000	105,739,700.00	
		8.5% FRANCE O.A.T 2023/04/25	117,750,000	173,336,242.50	
		8.5% FRANCE O.A.T. 2019/10/25	45,000,000	63,323,550.00	
		8.5% FRANCE O.A.T. 2012/12/26	206,080,000	249,964,736.00	
			通貨小計 (邦貨換算) 銘柄数	869,298,000 11銘柄	1,046,150,638.12 (140,456,184,673)
合計		[うち外国証券] 銘柄数		140,456,184,673 [140,456,184,673]	11銘柄

(注)

- 各通貨毎の小計欄の()内の金額は、邦貨換算額であります。
- 合計欄における〔 〕内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算の合計額であり内数で表示してあります
- 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券時価比率	合計額に対する比率
ユーロ	国債証券 11銘柄	100.0%	100.0%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第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

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

5. ピクテ・ハイインカム・ソブリン・ファンド(適格機関投資家専用)

(1) ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2) ファンドの計算期間は6か月未満であるため、財務諸表は6か月毎に作成しております。

(3) ファンドは、当社の委嘱に基づき、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に準じて、

前特定期間(平成20年4月8日から平成20年10月7日まで)及び、当特定期間(平成20年10月8日から平成21年4月7日まで)の財務諸表について、あらた監査法人による監査を受けております。

財務諸表

ピクテ・ハイインカム・ソブリン・ファンド(適格機関投資家専用)

(1) 貸借対照表

区分	注記 番号	前期	当期
		[平成20年10月7日現在]	[平成21年4月7日現在]
		金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
親投資信託受益証券		26,785,456,508	26,213,466,718
流動資産合計		26,785,456,508	26,213,466,718
資産合計		26,785,456,508	26,213,466,718
負債の部			
流動負債			
未払収益分配金		192,388,948	195,934,206
未払受託者報酬		472,585	412,046
未払委託者報酬		16,067,943	14,009,545
その他未払費用		802,142	135,618
流動負債合計		209,731,618	210,491,415
負債合計		209,731,618	210,491,415
純資産の部			
元本等			
元本		32,064,824,680	32,655,701,109
剰余金			
期末剰余金又は期末欠損金()		5,489,099,790	6,652,725,806
(分配準備積立金)		3,604,907,870	3,486,515,845
元本等合計		26,575,724,890	26,002,975,303
純資産合計		26,575,724,890	26,002,975,303
負債純資産合計		26,785,456,508	26,213,466,718

(2) 損益及び剰余金計算書

区分	注記 番号	前期	当期
		自平成20年4月8日 至平成20年10月7日	自平成20年10月8日 至平成21年4月7日
		金額(円)	金額(円)
営業収益			
有価証券売買等損益		2,507,299,595	248,384,815
営業収益合計		2,507,299,595	248,384,815

営業費用			
受託者報酬		2,806,563	2,418,281
委託者報酬		95,423,304	82,221,376
その他費用		802,142	891,220
営業費用合計		99,032,009	85,530,877
営業利益又は営業損失()		2,606,331,604	162,853,938
経常利益又は経常損失()		2,606,331,604	162,853,938
当期純利益又は当期純損失()		2,606,331,604	162,853,938
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()			6,024,833
期首剰余金又は期首欠損金()		1,470,780,093	5,489,099,790
剰余金増加額又は欠損金減少額			18,910,667
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額			18,910,667
剰余金減少額又は欠損金増加額		381,708,660	189,876,429
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		381,708,660	189,876,429
分配金		1,030,279,433	1,161,539,025
期末剰余金又は期末欠損金()		5,489,099,790	6,652,725,806

(3)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	前期	当期
	自平成20年4月8日 至平成20年10月7日	自平成20年10月8日 至平成21年4月7日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、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)

区分	前期	当期
	(平成20年10月7日現在)	(平成21年4月7日現在)
1. 元本の推移		
期首元本額	25,177,116,020円	32,064,824,680円
期中追加設定元本額	6,887,708,660円	699,876,429円
期中一部解約元本額	円	109,000,000円
2. 特定期間末日における受益権 の総数	32,064,824,680口	32,655,701,109口
3. 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元本総額 を下回っており、その差額は 5,489,099,790円であります。	貸借対照表上の純資産額が元本総額 を下回っており、その差額は 6,652,725,806円であります。

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区分	前期		当期	
	自 平成20年 4 月 8 日 至 平成20年10月 7 日		自 平成20年10月 8 日 至 平成21年 4 月 7 日	
1. 主要投資対象である親投資信託受益証券において、信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用	当該親投資信託受益証券に係る信託財産の純資産総額のうち、当ファンドに対応する部分の額の年率0.26%相当額		同左	
2. 分配金の計算過程	(平成20年 4 月 8 日から平成20年 5 月 7 日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(142,871,810円、ファンドに帰属すべき親投資信託受益証券の配当等収益を含む)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(75,760,369円)及び分配準備積立金(2,960,022,280円)より分配対象収益は3,178,654,459円(1万口当たり1,231.54円)であり、うち154,860,040円(1万口当たり60円)を分配金額としております。		(平成20年10月 8 日から平成20年11 月 7 日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純損失金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(155,365,222円、ファンドに帰属すべき親投資信託受益証券の配当等収益を含む)、解約に伴う当期純損失金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(46,842,735円)及び分配準備積立金(3,592,903,339円)より分配対象収益は3,795,111,296円(1万口当たり1,187.58円)であり、うち191,734,948円(1万口当たり60円)を分配金額としております。	
	(平成20年 5 月 8 日から平成20年 6 月 9 日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(151,769,022円、ファンドに帰属すべき親投資信託受益証券の配当等収益を含む)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(149,239,048円)及び分配準備積立金(3,023,794,419円)より分配対象収益は3,324,802,489円(1万口当たり1,228.66円)であり、うち162,360,963円(1万口当たり60円)を分配金額としております。		(平成20年11月 8 日から平成20年12 月 8 日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(149,866,694円、ファンドに帰属すべき親投資信託受益証券の配当等収益を含む)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(22,073,000円)及び分配準備積立金(3,603,376,348円)より分配対象収益は3,775,316,042円(1万口当たり1,174.32円)であり、うち192,891,234円(1万口当たり60円)を分配金額としております。	
	(平成20年 6 月10日から平成20年 7 月 7 日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(132,028,004円、ファンドに帰属すべき親投資信託受益証券の配当等収益を含む)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(96,738,894円)及び分配準備積立金(3,162,441,526円)より分配対象収益は3,391,208,424円(1万口当たり1,216.57円)であり、うち167,247,629円(1万口当たり60円)を分配金額としております。		(平成20年12月 9 日から平成21年 1 月 7 日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(151,002,492円、ファンドに帰属すべき親投資信託受益証券の配当等収益を含む)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(0円)及び分配準備積立金(3,582,424,808円)より分配対象収益は3,733,427,300円(1万口当たり1,161.30円)であり、うち192,891,234円(1万口当たり60円)を分配金額としております。	

<p>(平成20年7月8日から平成20年8月7日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(172,148,273円、ファンドに帰属すべき親投資信託受益証券の配当等収益を含む)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(118,910,434円)及び分配準備積立金(3,223,960,795円)より分配対象収益は3,515,019,502円(1万口当たり1,216.96円)であり、うち173,297,306円(1万口当たり60円)を分配金額としております。</p>	<p>(平成21年1月8日から平成21年2月9日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(152,787,548円、ファンドに帰属すべき親投資信託受益証券の配当等収益を含む)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(16,687,211円)及び分配準備積立金(3,540,536,066円)より分配対象収益は3,710,010,825円(1万口当たり1,148.68円)であり、うち193,785,926円(1万口当たり60円)を分配金額としております。</p>
<p>(平成20年8月8日から平成20年9月8日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(163,705,033円、ファンドに帰属すべき親投資信託受益証券の配当等収益を含む)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(133,961,473円)及び分配準備積立金(3,341,722,196円)より分配対象収益は3,639,388,702円(1万口当たり1,212.28円)であり、うち180,124,547円(1万口当たり60円)を分配金額としております。</p>	<p>(平成21年2月10日から平成21年3月9日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(152,341,877円、ファンドに帰属すべき親投資信託受益証券の配当等収益を含む)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(9,483,849円)及び分配準備積立金(3,516,224,899円)より分配対象収益は3,678,050,625円(1万口当たり1,135.76円)であり、うち194,301,477円(1万口当たり60円)を分配金額としております。</p>
<p>(平成20年9月9日から平成20年10月7日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(145,643,715円、ファンドに帰属すべき親投資信託受益証券の配当等収益を含む)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(239,391,468円)及び分配準備積立金(3,459,264,155円)より分配対象収益は3,844,299,338円(1万口当たり1,198.90円)であり、うち192,388,948円(1万口当たり60円)を分配金額としております。</p>	<p>(平成21年3月10日から平成21年4月7日までの分配金計算期間) 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(168,857,573円、ファンドに帰属すべき親投資信託受益証券の配当等収益を含む)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、信託約款に規定される収益調整金(29,843,330円)及び分配準備積立金(3,483,749,148円)より分配対象収益は3,682,450,051円(1万口当たり1,127.63円)であり、うち195,934,206円(1万口当たり60円)を分配金額としております。</p>

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

前期(平成20年10月7日現在)

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	26,785,456,508円	4,105,011,542円
合計	26,785,456,508円	4,105,011,542円

当期(平成21年4月7日現在)

種類	貸借対照表計上額	当計算期間の損益に 含まれた評価差額
親投資信託受益証券	26,213,466,718円	2,166,220,627円
合計	26,213,466,718円	2,166,220,627円

(デリバティブ取引等に関する注記)

該当事項はありません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(一口当たり情報に関する注記)

区分	前期 (平成20年10月7日現在)	当期 (平成21年4月7日現在)
一口当たり純資産額 (一万口当たり純資産額)	0.8288円 (8,288円)	0.7963円 (7,963円)

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(4) 附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	銘柄	券面総額(口)	評価額(円)	備考
親投資信託 受益証券	ピクテ・エマージング・ソブリン債券ファンド ・マザーファンド	20,317,366,857	26,213,466,718	
合計		20,317,366,857	26,213,466,718	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第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。

第4 不動産等明細表

該当事項はありません。

第5 その他特定資産の明細表

該当事項はありません。

第6 借入金明細表

該当事項はありません。

参考情報

ファンドは、「ピクテ・エマージング・ソブリン債券ファンド・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同受益証券です。

なお、同投資信託受益証券の状況は以下の通りです。

「ピクテ・エマージング・ソブリン債券ファンド・マザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は監査対象外であります。

(1) 貸借対照表

区分	注記 番号	[平成20年10月7日現在]	[平成21年4月7日現在]
		金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
預金		4,698,199,424	2,451,917,195
コール・ローン		1,391,852,201	238,642,831
国債証券		54,859,083,128	54,492,547,383
社債券		2,328,488,224	2,194,380,858
派生商品評価勘定		357,101,220	80,094,846
未収利息		1,199,611,301	1,166,654,006
前払費用		23,998,867	7,412,806
差入委託証拠金		2,525,916,189	317,491,215
流動資産合計		67,384,250,554	60,949,141,140
資産合計		67,384,250,554	60,949,141,140
負債の部			
流動負債			
未払解約金		90,467,441	20,950,728
流動負債合計		90,467,441	20,950,728
負債合計		90,467,441	20,950,728
純資産の部			
元本等			
元本		52,837,758,936	47,223,721,298
剰余金			
剰余金又は欠損金()		14,456,024,177	13,704,469,114
元本等合計		67,293,783,113	60,928,190,412
純資産合計		67,293,783,113	60,928,190,412
負債純資産合計		67,384,250,554	60,949,141,140

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区分	自 平成20年4月8日 至 平成20年10月7日	自 平成20年10月8日 至 平成21年4月7日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券・社債券 個別法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(但し、売気配相場は使用しない)、または価格情報会社の提供する価額等で評価しております。	国債証券・社債券 同左
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	(1)為替予約 為替予約の評価は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物売買相場の仲値によって計算しております。 (2)先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場によっております。	(1)為替予約 同左 (2)先物取引 同左
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 「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、61条に基づいて、外貨建取引の記録、及び外貨の売買を処理しております。	外貨建取引等の処理基準 同左

(貸借対照表に関する注記)

区分	(平成20年10月7日現在)	(平成21年4月7日現在)
1. 元本の推移		
期首相当日現在元本額	52,629,864,410円	52,837,758,936円
期中追加設定元本額	6,033,442,128円	911,921,844円
期中一部解約元本額	5,825,547,602円	6,525,959,482円
元本の内訳		
ピクテ・ハイインカム・ソブリン・ファンド(毎月決算型)為替ヘッジなしコース	27,967,940,280円	23,857,894,635円
ピクテ・NSPB・エマージング・ソブリン・ファンド(3カ月分配型)	3,165,832,516円	2,439,407,803円
ピクテ・ハイインカム・ソブリン・ファンド(毎月決算型)為替ヘッジコース	672,691,771円	609,052,003円
ピクテ・ハイインカム・ソブリン・ファンド(適格機関投資家専用)	21,031,294,369円	20,317,366,857円
合計	52,837,758,936円	47,223,721,298円
2. 本報告書における開示対象ファンドの特定期間末日における受益権の総数	52,837,758,936口	47,223,721,298口

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

(平成20年10月7日現在)

種類	貸借対照表計上額
国債証券	54,859,083,128円
社債券	2,328,488,224円
合計	57,187,571,352円

(平成21年4月7日現在)

種類	貸借対照表計上額
国債証券	54,492,547,383円
社債券	2,194,380,858円
合計	56,686,928,241円

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の状況に関する事項

区分	自平成20年4月8日 至平成20年10月7日	自平成20年10月8日 至平成21年4月7日
1. 取引の内容	ファンドの利用しているデリバティブ取引は、為替予約取引、債券先物取引であります。	同左
2. 取引に対する取組方針	為替予約取引は、外貨建有価証券等の買付代金の支払い及び保有する外貨建有価証券等の売却代金、償還金、利金等の受取りのため行っています。 債券先物取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するために行い、投機的な取引は行わない方針であります。	同左
3. 取引の利用目的	為替予約取引は、外貨建有価証券等の買付代金の支払い及び保有する外貨建有価証券等の売却代金、償還金、利金等の受取りのため行っています。 債券先物取引は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、安定的な利益の確保を図る目的で利用します。	同左
4. 取引に係るリスクの内容	ファンドの利用しているデリバティブ取引に係るリスクとしては、金利、為替などの市場価格が変動することによって発生するマーケットリスク及び取引相手先が契約を履行できなくなる場合、すなわちデフォルト状態となった時に発生する取引先リスクがあります。	同左
5. 取引に係るリスク管理体制	デリバティブ取引の管理・執行については、信託約款、法令等及び取引権限・取引限度額等を定めた社内ルールに従い、管理はコンプライアンス部門が、執行は担当者が運用部の承認を得て行っております。	同左

6. 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、または計算上の想定元本であり、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。	同左
--------------------------	---	----

取引の時価等に関する事項

(1) 債券関連

(平成20年10月7日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	33,459,367,156		33,816,468,376	357,101,220
合計		33,459,367,156		33,816,468,376	357,101,220

(平成21年4月7日現在)

区分	種類	契約額等(円)		時価 (円)	評価損益 (円)
			うち1年超		
市場取引	債券先物取引 買建	13,280,559,713		13,360,654,559	80,094,846
合計		13,280,559,713		13,360,654,559	80,094,846

(注)時価の算定方法

・先物取引

1. 債券先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 債券先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

(関連当事者との取引に関する注記)

該当事項はありません。

(一口当たり情報に関する注記)

区分	(平成20年10月7日現在)	(平成21年4月7日現在)
一口当たり純資産額 (一万口当たり純資産額)	1.2736円 (12,736円)	1.2902円 (12,902円)

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

株式

該当事項はありません。

株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価金額	備考
国債証券	米ドル	1.33% ARGENTINA REP OF 2038/12/31	5,500,000	1,022,065.00	
		10% FED REP OF BRAZIL 2011/08/07	2,000,000	2,304,400.00	
		10.00% REP OF COLOMBIA 2012/01/23	8,600,000	9,857,320.00	
		10.375% REP OF COLOMBIA 2033/01/28	7,150,000	8,324,316.00	
		10.375% REP OF INDONESIA 2014/05/04	3,000,000	3,205,890.00	
		10.5% REP OF COLOMBIA 2010/07/09	500,000	551,255.00	
		10.625%REP OF PHILIPPINE 2025/03/16	9,750,000	12,619,327.50	
		10.75% REP OF VENEZUELA 2013/09/19	4,500,000	3,420,000.00	
		11.00% FED REP.OF BRAZIL 2040/08/17	39,460,000	50,807,906.80	
		11.00% REP OF TURKEY 2013/01/14	8,300,000	9,641,197.00	
		11.50% REP OF TURKEY 2012/01/23	16,000,000	18,567,040.00	
		11.75% REP OF TURKEY 2010/06/15	6,000,000	6,571,980.00	
		11.875% REP OF TURKEY 2030/01/15	9,950,000	14,026,614.50	
		12.25% FED REP.OF BRAZIL 2030/03/06	500,000	769,695.00	
		12.375% REP OF TURKEY 2009/06/15	6,000,000	6,089,880.00	
		12.75% RUSSIAN FEDERATIO 2028/06/24	4,000,000	5,519,120.00	
		12.75%FED REP.OF BRAZIL 2020/01/15	500,000	741,995.00	
		13.625% REP OF VENEZUELA 2018/08/15	11,850,000	8,832,516.00	
		5.625% UNITED MEXICAN 2017/01/15	530,000	537,526.00	
		5.75% REP OF VENEZUELA 2016/02/26	3,750,000	1,968,637.50	
		5.8% REP OF IRAQ 2028/01/15	5,500,000	2,781,955.00	
		5.875% BRAZIL REP OF 2019/01/15	5,500,000	5,419,865.00	
		5.875% SOUTH AFRICA 2022/05/30	1,000,000	910,560.00	
		5.875% UNITED MEXICAN ST 2014/01/15	1,100,000	1,163,624.00	
		6.55% REPUBLIC OF PERU 2037/03/14	937,000	855,040.61	
		6.58% UKRAINE GOVT 2016/11/21	10,800,000	4,844,232.00	
		6.7% PANAMA(REPUBLIC OF) 2036/01/26	7,216,000	6,393,015.20	
		6.875% INDONESIA REP OF 2017/03/09	3,000,000	2,610,930.00	
		6.875% REP OF INDONESIA 2018/01/17	15,000,000	12,239,100.00	
		6.875% REP OF TURKEY 2036/03/17	8,500,000	7,286,965.00	
		6.875% VIETNAM REP OF 2016/01/15	25,000	23,156.25	
		7.125% REPUBLIC OF PERU 2019/03/30	500,000	515,870.00	
		7.25% INDONESIA REP OF 2015/04/20	4,500,000	4,119,390.00	
		7.25% REPUBLIC OF PANAMA 2015/03/15	700,000	727,734.00	
		7.25% URUGUAY REP OF 2011/02/15	2,000,000	2,054,840.00	
		7.375% REP OF COLOMBIA 2019/03/18	3,600,000	3,652,848.00	
		7.375% REP OF TURKEY 2025/02/05	5,750,000	5,475,207.50	
		7.5% REP OF INDONESIA 2016/01/15	8,500,000	8,070,750.00	
		7.5% REPUBLIC OF URUGUAY 2015/03/15	6,750,000	6,872,377.50	
		7.5% RUSSIAN FEDERATION 2030/03/31	26,256,000	25,565,204.64	
		7.5% UTD MEXICAN STS 2033/04/08	17,500,000	18,904,900.00	
		7.65% REP OF VENEZUELA 2025/04/21	4,750,000	2,310,210.00	
		7.65% UKRAINE GOVT 2013/06/11	4,250,000	2,023,850.00	
7.875% REP OF URUGUAY 2033/01/15	1,641,983	1,393,370.35			
8% FED REP OF BRAZIL 2018/01/15	2,450,000	2,703,746.50			

		8% REP OF PHILIPPINES 2016/01/15	6,000,000	6,721,260.00	
		8% REP OF TURKEY 2034/02/14	2,000,000	1,941,840.00	
		8% URUGUAY REP OF 2022/11/18	4,000,000	3,695,000.00	
		8.125% REP OF COLOMBIA 2024/05/21	750,000	762,112.50	
		8.25% REP OF COLOMBIA 2014/12/22	14,100,000	15,786,501.00	
		8.25%REP OF EL SALVADOR 2032/04/10	11,900,000	9,259,747.00	
		8.28% ARGENTINA REP OF 2033/12/31	23,082,028.89	6,540,985.34	
		8.375% REPUBLIC OF PERU 2016/05/03	14,322,000	16,026,461.22	
		8.375% URUGUAY REP OF 2011/09/26	400,000	418,344.00	
		8.5% INDONESIA REP OF 2035/10/12	22,300,000	19,233,750.00	
		8.5% REP OF VENEZUELA 2014/10/08	2,750,000	1,797,345.00	
		8.75% BRAZIL FED REP.OF 2025/02/04	28,850,000	33,683,240.50	
		8.75% MALAYSIA 2009/06/01	18,500,000	18,645,410.00	
		8.75% REPUBLIC OF PERU 2033/11/21	1,000,000	1,127,760.00	
		8.875% BRAZIL REP OF 2019/10/14	250,000	299,035.00	
		8.875% REP OF PHILIPPINE 2015/03/17	6,000,000	6,985,680.00	
		8.875%FED REP.OF BRAZIL 2024/04/15	1,500,000	1,772,550.00	
		8.875%REPUBLIC OF PANAMA 2027/09/30	9,150,000	9,905,881.50	
		9% REP OF TURKEY 2011/06/30	1,000,000	1,092,910.00	
		9.00% REP OF PHILIPPINES 2013/02/15	250,000	290,625.00	
		9.04% DOMINICAN REPUBLIC 2018/01/23	4,371,907.54	2,841,739.90	
		9.25% REP OF URUGUAY 2017/05/17	9,000,000	9,600,480.00	
		9.25% REP OF VENEZUELA 2027/09/15	13,700,000	8,429,884.00	
		9.375% REP OF VENEZUELA 2034/01/13	7,250,000	4,048,762.50	
		9.5% REP OF PHILIPPINES 2030/02/02	20,750,000	25,378,080.00	
		9.5% REP OF TURKEY 2014/01/15	5,000,000	5,639,400.00	
		9.625%REPUBLIC OF PANAMA 2011/02/08	13,100,000	14,376,726.00	
		9.75% REP OF COLOMBIA 2009/04/23	500,000	501,760.00	
		9.875% REPUBLIC OF PERU 2015/02/06	9,500,000	11,306,615.00	
		9.875%REP OF PHILIPPINES 2010/03/16	1,000,000	1,074,760.00	
		REP OF SERBIA 2024/11/01	5,000,000	3,743,750.00	
		REP OF VENEZUELA 2011/04/20	5,900,000	4,449,603.00	
		通貨小計 (邦貨換算)	558,741,919.43	541,675,421.31	
		銘柄数	77銘柄	(54,492,547,383)	
社債券	米ドル	7.175% RSHB CAPTL RUSSIA 2013/05/16	24,300,000	20,275,191.00	
		8% PETROLEOS MEXICA PEME 2019/05/03	1,500,000	1,537,740.00	
		通貨小計 (邦貨換算)	25,800,000	21,812,931.00	
		銘柄数	2銘柄	(2,194,380,858)	
合計		[うち外国証券] 銘柄数	79銘柄	56,686,928,241 [56,686,928,241]	

(注)

- 各通貨毎の小計欄の()内の金額は、邦貨換算額であります。
- 合計欄における〔 〕内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算の合計額であり内数で表示してあります。
- 外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券時価比率	合計額に対する比率
米ドル	国債証券	77銘柄	96.1%
	社債券	2銘柄	3.9%
			100.0%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第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

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

6. LM・オーストラリア毎月分配型ファンド(適格機関投資家専用)

(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。)に準じて作成しております。

なお、財務諸表等規則は、平成20年8月7日付内閣府令第50号及び平成20年12月12日付内閣府令第80号により改正されておりますが、前特定期間(平成20年4月8日から平成20年10月7日まで)については内閣府令第50号附則第2条第1項第1号により、内閣府令第50号改正前の財務諸表等規則及び内閣府令第80号改正前の財務諸表等規則に準じて作成されており、当特定期間(平成20年10月8日から平成21年4月7日まで)については内閣府令第50号附則第2条第1項第1号により、内閣府令第50号改正前の財務諸表等規則及び内閣府令第80号改正後の財務諸表等規則に準じて作成しております。

また、投資信託財産計算規則は、平成20年12月5日付内閣府令第79号により改正されておりますが、前特定期間(平成20年4月8日から平成20年10月7日まで)については改正前の投資信託財産計算規則に準じて作成しており、当特定期間(平成20年10月8日から平成21年4月7日まで)については改正後の投資信託財産計算規則に準じ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)当ファンドの計算期間は6ヵ月未満であるため、財務諸表は6ヵ月ごとに作成しております。

(3)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に準じて、前特定期間(平成20年4月8日から平成20年10月7日まで)及び当特定期間(平成20年10月8日から平成21年4月7日まで)の財務諸表について、新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1 財務諸表

LM・オーストラリア毎月分配型ファンド(適格機関投資家専用)

(1)貸借対照表

(単位：円)

	前期 (平成20年10月7日現在)	当期 (平成21年4月7日現在)
資産の部		

流動資産		
親投資信託受益証券	26,494,137,821	26,000,063,473
流動資産合計	26,494,137,821	26,000,063,473
資産合計	26,494,137,821	26,000,063,473
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	194,959,927	198,630,105
未払受託者報酬	992,520	813,676
未払委託者報酬	12,158,362	9,967,528
その他未払費用	169,904	162,155
流動負債合計	208,280,713	209,573,464
負債合計	208,280,713	209,573,464
純資産の部		
元本等		
元本	32,493,321,263	33,105,017,503
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	6,207,464,155	7,314,527,494
（分配準備積立金）	3,613,582,198	3,088,256,446
純資産合計	26,285,857,108	25,790,490,009
負債純資産合計	26,494,137,821	26,000,063,473

(2) 損益及び剰余金計算書

(単位：円)

	前期 (自 平成20年 4月8日 至 平成20年10月7日)	当期 (自 平成20年10月8日 至 平成21年 4月7日)
営業収益		
有価証券売買等損益	5,803,218,544	309,645,391
営業収益合計	5,803,218,544	309,645,391
営業費用		
受託者報酬	6,369,761	4,868,799
委託者報酬	78,029,561	59,642,683
その他費用	1,087,140	1,007,363
営業費用合計	85,486,462	65,518,845
営業利益又は営業損失（ ）	5,888,705,006	244,126,546
経常利益又は経常損失（ ）	5,888,705,006	244,126,546
当期純利益又は当期純損失（ ）	5,888,705,006	244,126,546
一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）	-	4,823,159
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	526,785,627	6,207,464,155
剰余金増加額又は欠損金減少額	321,748,623	18,148,841

当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	18,148,841
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	321,748,623	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	113,029,380	196,696,240
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	113,029,380	196,696,240
分配金	1,054,264,019	1,177,465,645
期末剰余金又は期末欠損金()	6,207,464,155	7,314,527,494

(3)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	前期 (自平成20年4月8日 至平成20年10月7日)	当期 (自平成20年10月8日 至平成21年4月7日)
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、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)

項目	前期 (平成20年10月7日現在)	当期 (平成21年4月7日現在)
1. 特定期間の末日における受益権の総数	32,493,321,263口	33,105,017,503口
2. 元本の欠損	貸借対照表上の純資産額が元 本総額を下回っており、その差 額は6,207,464,155円でありま す。	貸借対照表上の純資産額が元 本総額を下回っており、その 差額は7,314,527,494円であ ります。
3. 特定期間の末日における1単位当たり の純資産の額		
一口当たり純資産額	0.8090円	0.7791円
(一万口当たり純資産額)	(8,090円)	(7,791円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

項目	前期 (自平成20年4月8日 至平成20年10月7日)	当期 (自平成20年10月8日 至平成21年4月7日)
1. 信託財産の運用の指図に係る権限の全部又は一部を委託するために要する費用として委託者報酬の中から支弁している額	委託者報酬のうち、販売会社へ支払う手数料を除いた額の100分の40相当額を支払っていましたが、平成20年10月1日より100分の50相当額を支払っております。	委託者報酬のうち、販売会社へ支払う手数料を除いた額の100分の50相当額を支払っております。
2. 分配金の計算過程		

	(平成20年4月8日から 平成20年5月7日まで の計算期間)	(平成20年10月8日から 平成20年11月7日まで の計算期間)
費用控除後の配当等収益額	148,079,234円	108,645,646円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券 売買等損益額	- 円	- 円
収益調整金額	1,647,130,117円	2,800,152,431円
分配準備積立金額	3,754,593,585円	3,603,017,121円
当ファンドの分配対象収益額	5,549,802,936円	6,511,815,198円
当ファンドの期末残存口数	26,770,633,557口	32,398,321,263口
1万口当たり収益分配対象額	2,073.08円	2,009.90円
1万口当たり分配金額	60.00円	60.00円
収益分配金金額	160,623,801円	194,389,927円
	(平成20年5月8日から 平成20年6月9日まで の計算期間)	(平成20年11月8日から 平成20年12月8日まで の計算期間)
費用控除後の配当等収益額	165,053,466円	105,969,017円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券 売買等損益額	- 円	- 円
収益調整金額	1,873,157,653円	2,837,528,436円
分配準備積立金額	3,742,049,018円	3,517,272,840円
当ファンドの分配対象収益額	5,780,260,137円	6,460,770,293円
当ファンドの期末残存口数	27,879,233,826口	32,587,965,038口
1万口当たり収益分配対象額	2,073.31円	1,982.55円
1万口当たり分配金額	60.00円	60.00円
収益分配金金額	167,275,402円	195,527,790円
	(平成20年6月10日から 平成20年7月 7日まで の計算期間)	(平成20年12月9日から 平成21年 1月7日まで の計算期間)
費用控除後の配当等収益額	153,403,364円	113,837,388円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券 売買等損益額	- 円	- 円
収益調整金額	2,018,339,071円	2,837,528,436円
分配準備積立金額	3,739,827,082円	3,427,714,067円
当ファンドの分配対象収益額	5,911,569,517円	6,379,079,891円
当ファンドの期末残存口数	28,590,873,034口	32,587,965,038口
1万口当たり収益分配対象額	2,067.62円	1,957.48円
1万口当たり分配金額	60.00円	60.00円
収益分配金金額	171,545,238円	195,527,790円

	(平成20年7月8日から 平成20年8月7日まで の計算期間)	(平成21年1月8日から 平成21年2月9日まで の計算期間)
費用控除後の配当等収益額	160,699,412円	108,752,253円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券 売買等損益額	- 円	- 円
収益調整金額	2,194,640,295円	2,866,142,720円
分配準備積立金額	3,721,685,208円	3,346,023,665円
当ファンドの分配対象収益額	6,077,024,915円	6,320,918,638円
当ファンドの期末残存口数	29,456,316,722口	32,737,779,276口
1万口当たり収益分配対象額	2,063.05円	1,930.76円
1万口当たり分配金額	60.00円	60.00円
収益分配金金額	176,737,900円	196,426,675円
	(平成20年8月8日から 平成20年9月8日まで の計算期間)	(平成21年2月10日から 平成21年3月9日まで の計算期間)
費用控除後の配当等収益額	157,677,992円	104,197,734円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券 売買等損益額	- 円	- 円
収益調整金額	2,410,259,160円	2,883,052,757円
分配準備積立金額	3,705,646,720円	3,258,349,243円
当ファンドの分配対象収益額	6,273,583,872円	6,245,599,734円
当ファンドの期末残存口数	30,520,291,883口	32,827,226,387口
1万口当たり収益分配対象額	2,055.53円	1,902.56円
1万口当たり分配金額	60.00円	60.00円
収益分配金金額	183,121,751円	196,963,358円
	(平成20年9月9日から 平成20年10月7日まで の計算期間)	(平成21年3月10日から 平成21年4月7日まで の計算期間)
費用控除後の配当等収益額	128,339,164円	121,302,932円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券 売買等損益額	- 円	- 円
収益調整金額	2,808,363,279円	2,934,768,307円
分配準備積立金額	3,680,202,961円	3,165,583,619円
当ファンドの分配対象収益額	6,616,905,404円	6,221,654,858円
当ファンドの期末残存口数	32,493,321,263口	33,105,017,503口
1万口当たり収益分配対象額	2,036.38円	1,879.36円
1万口当たり分配金額	60.00円	60.00円
収益分配金金額	194,959,927円	198,630,105円

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（その他の注記）

1 元本の移動

項目	前期	当期
	(自 平成20年 4月8日 至 平成20年10月7日)	(自 平成20年10月8日 至 平成21年 4月7日)
期首元本額	26,196,040,504円	32,493,321,263円
期中追加設定元本額	6,297,280,759円	706,696,240円
期中解約元本額	- 円	95,000,000円

2 売買目的有価証券の貸借対照表計上額等

種類	前期		当期	
	(平成20年10月7日現在)		(平成21年4月7日現在)	
	貸借対照表計上額 (円)	当期の損益に含ま れた評価差額 (円)	貸借対照表計上額 (円)	当期の損益に含ま れた評価差額 (円)
親投資信託受益証券	26,494,137,821	5,753,551,727	26,000,063,473	2,706,418,151
合計	26,494,137,821	5,753,551,727	26,000,063,473	2,706,418,151

3 デリバティブ取引関係

取引の状況に関する事項

該当事項はありません。

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

(4) 附属明細表

第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

通貨	種類	銘柄	総口数(口)	評価額(円)	備考
日本円	親投資信託受 益証券	LM・豪ドル債券マザー ファンド	21,786,545,562	26,000,063,473	
合計			21,786,545,562	26,000,063,473	

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

< 参考情報 >

当ファンドは「LM・豪ドル債券マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同ファンドの受益証券であります。

なお、同ファンドの状況は次の通りであります。

「LM・豪ドル債券マザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。また、LM・豪ドル債券マザーファンドの計算期間はLM・オーストラリア毎月分配型ファンド（適格機関投資家専用）の計算期間とは異なり、毎年6月11日から12月10日まで、及び12月11日から翌年6月10日までであります。

1 財務諸表

LM・豪ドル債券マザーファンド

(1) 貸借対照表

（単位：円）

	（平成20年10月7日現在）	（平成21年4月7日現在）
資産の部		
流動資産		
預金	2,950,911,621	1,978,982,349
コール・ローン	917,540,247	481,459,185
国債証券	9,123,151,520	4,730,001,797
地方債証券	30,040,520,600	30,630,782,503
特殊債券	12,579,439,296	11,931,494,359
社債券	49,282,595,273	55,297,573,420
派生商品評価勘定	7,822,100	12,160,000
未収入金	1,471,268,037	-
未収利息	1,641,810,839	1,618,575,588
前払費用	194,502,985	176,835,081
差入委託証拠金	241,370,723	186,173,357
流動資産合計	108,450,933,241	107,044,037,639
資産合計	108,450,933,241	107,044,037,639
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	47,580,005	26,796,744
未払金	1,844,528,952	-
未払解約金	115,335,969	13,006,027
流動負債合計	2,007,444,926	39,802,771
負債合計	2,007,444,926	39,802,771
純資産の部		
元本等		

元本	90,509,465,804	89,660,758,123
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	15,934,022,511	17,343,476,745
純資産合計	106,443,488,315	107,004,234,868
負債純資産合計	108,450,933,241	107,044,037,639

(2)注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

項目	(自平成20年4月8日 至平成20年10月7日)	(自平成20年10月8日 至平成21年4月7日)
1.有価証券の評価基準 及び評価方法	国債証券・地方債証券・特殊債券・社債 移動平均法(買付約定後、最初の利払日 までは個別法)に基づき、法令及び社団 法人投資信託協会規則に従い、時価評価 しております。	国債証券・地方債証券・特殊債券・社 債証券 同左
2.デリバティブ等の評 価基準及び評価方法	(1)先物取引 個別法に基づき、法令及び社団法人投資 信託協会規則に従い、時価評価しており ます。 (2)為替予約取引 為替予約の評価は、原則として、わが国に おける貸借対照表作成日の対顧客先物売 買相場の仲値によって計算しておりま す。	(1)先物取引 同左 (2)為替予約取引 同左
3.その他財務諸表作成 のための基本となる 重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産 計算規則」(平成12年総理府令第133号) 第60条に基づき、取引発生時の外国通貨 の額をもって記録する方法を採用してお ります。但し、同第61条に基づき、外国通 貨の売却時において、当該外国通貨に加 えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び 外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産 額に対する当該売却外国通貨の割合相当 額を当該外国通貨の売却時の外国為替相 場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に 対する円換算した外貨基金勘定の割合相 当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円 換算した外貨基金勘定を相殺した差額を 為替差損益とする計理処理を採用してお ります。	外貨建取引等の処理基準 同左

(貸借対照表に関する注記)

項目	(平成20年10月7日現在)	(平成21年4月7日現在)
1.本報告書における開示対象ファンドの期末における当該ファンドの受益権の総数	90,509,465,804口	89,660,758,123口
2.本報告書における開示対象ファンドの期末における当該ファンドの		
一口当たり純資産額	1.1760円	1.1934円
(一万口当たり純資産額)	(11,760円)	(11,934円)

(その他の注記)

1 元本の移動等

項目	(自平成20年4月8日 至平成20年10月7日)	(自平成20年10月8日 至平成21年4月7日)
本報告書における開示対象ファンドの期首における当該ファンドの元本額	91,651,516,695円	90,509,465,804円
同期中における追加設定元本額	6,954,809,423円	7,748,716,409円
同期中における解約元本額	8,096,860,314円	8,597,424,090円
元本の内訳		
LM・オーストラリア毎月分配型ファンド	67,980,437,044円	67,874,212,561円
LM・オーストラリア毎月分配型ファンド (適格機関投資家専用)	22,529,028,760円	21,786,545,562円
計	90,509,465,804円	89,660,758,123円

2 売買目的有価証券の貸借対照表計上額等

種類	(平成20年10月7日現在)		(平成21年4月7日現在)	
	貸借対照表計上額 (円)	当期の損益に含ま れた評価差額 (円)	貸借対照表計上額 (円)	当期の損益に含ま れた評価差額 (円)
国債証券	9,123,151,520	773,025,861	4,730,001,797	132,877,404
地方債証券	30,040,520,600	1,442,511,833	30,630,782,503	360,628,839
特殊債券	12,579,439,296	580,696,516	11,931,494,359	312,204,081
社債券	49,282,595,273	297,979,942	55,297,573,420	1,591,526,338
合計	101,025,706,689	3,094,214,152	102,589,852,079	2,397,236,662

3 デリバティブ取引関係

取引の状況に関する事項

項目	(自平成20年4月8日 至平成20年10月7日)	(自平成20年10月8日 至平成21年4月7日)
1.取引の内容	当ファンドの利用しているデリバティブ取引は、債券関連では債券先物取引、通貨関連では為替予約取引であります。	同左

2.取引に対する取組方針	デリバティブ取引は、将来の債券又は為替の変動によるリスク回避を目的としており、投機的な取引は行わない方針であります。	同左
3.取引の利用目的	デリバティブ取引は、債券関連では、有価証券等の価格変動リスクを回避するため、また、通貨関連では、外貨建金銭債権債務の為替変動リスクを回避し、安定的な利益の確保を図る目的で利用しております。	同左
4.取引に係るリスクの内容	債券先物取引は、市場金利の変動によるリスク、為替予約取引は、為替相場の変動によるリスクをそれぞれ有しております。	同左
5.取引に係るリスクの管理体制	デリバティブ取引の管理については、取引権限および取引限度額等を定めた社内ルール等に従い、運用担当部門及び独立した管理部門が行っております。	同左
6.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。	同左

取引の時価等に関する事項

債券関連

区分	種類	（平成20年10月7日現在）				（平成21年4月7日現在）			
		契約額等 （円）	うち1 年超 （円）	時価 （円）	評価損益 （円）	契約額等 （円）	うち1 年超 （円）	時価 （円）	評価損益 （円）
市場 取引	債券先 物取引								
	売建	1,704,413,253	-	1,751,993,258	47,580,005	-	-	-	-
	買建	423,606,537	-	431,428,637	7,822,100	2,719,428,419	-	2,692,631,675	26,796,744
合計		2,128,019,790	-	2,183,421,895	39,757,905	2,719,428,419	-	2,692,631,675	26,796,744

(注) 時価の算定方法

外国先物取引について

- 1) 外国先物取引の残高表示は、契約額によっております。想定元本ベースではありません。
- 2) 貸借対照表作成日に知りうる直近の日の、主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

通貨関連

（平成20年10月7日現在）

該当事項はありません。

区分	種類	（平成21年4月7日現在）			
		契約額等 （円）	うち1年超 （円）	時価 （円）	評価損益 （円）
市場取引 以外の取引	為替予約取引 売建 オーストラリアドル	724,060,000	-	711,900,000	12,160,000
合計		724,060,000	-	711,900,000	12,160,000

(注) 時価の算定方法

為替予約取引について

1. 貸借対照表作成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。

貸借対照表作成日において為替予約の受渡日（以下「当該日」という。）の対顧客先物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。

貸借対照表作成日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 貸借対照表作成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。
- ・ 貸借対照表作成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. 貸借対照表作成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、貸借対照表作成日の対顧客相場の仲値で評価しております。

(3) 附属明細表

第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

次表の通りです。

通貨	種類	銘柄	券面総額	評価額	備考	
オーストラリアドル	国債証券	AUSTRALIA GOVT	16,200,000.00	17,839,764.00		
		AUSTRALIA GOVT	19,520,000.00	21,497,766.40		
		AUSTRALIA GOVT	25,000,000.00	27,085,750.00		
		計		60,720,000.00	66,423,280.40	
		(邦貨換算額)			(4,730,001,797)	
	地方債証券	NEW S WALES TREAS CORP	33,000,000.00	33,020,460.00		
		NEW S WALES TREAS CORP	15,000,000.00	15,383,250.00		
		NEW S WALES TREASURY	6,000,000.00	6,331,620.00		
		NEW S WALES TREASURY	52,100,000.00	54,432,517.00		
		NEW S WALES TREASURY	4,300,000.00	4,382,431.00		
QUEBEC PROVINCE		4,000,000.00	4,011,618.50			
QUEENSLAND TREASURY		40,000,000.00	41,664,800.00			

	QUEENSLAND TREASURY	23,000,000.00	23,962,550.00
	QUEENSLAND TREASURY	38,600,000.00	40,188,004.00
	QUEENSLAND TREASURY	24,000,000.00	24,853,920.00
	QUEENSLAND TREASURY	29,000,000.00	29,835,490.00
	SOUTH AUST GOVT FIN AUTH	2,000,000.00	2,073,380.00
	TASMANIAN PUBLIC FINANCE	3,000,000.00	3,166,800.00
	TREASURY CORP VICTORIA	6,000,000.00	5,913,000.00
	VICTORIA TREASURY	5,500,000.00	5,659,115.00
	VICTORIA TREASURY	54,000,000.00	57,045,060.00
	VICTORIA TREASURY	2,000,000.00	2,041,240.00
	WEST AUSTRALIA TREASURY	20,000,000.00	21,187,000.00
	WEST AUSTRALIA TREASURY	15,000,000.00	16,328,700.00
	WEST AUSTRALIA TREASURY	35,000,000.00	38,666,250.00
計		411,500,000.00	430,147,205.50
(邦貨換算額)			(30,630,782,503)
特殊債券	ALAND 2004-1 A1	6,000,000.00	6,008,400.00
	CSCS 2006-1 A2	7,000,000.00	6,441,820.00
	DEXIA MUNICIPAL AGENCY	5,000,000.00	5,018,075.00
	DEXIA MUNICIPAL AGENCY	17,500,000.00	16,552,620.00
	DOT 2004 FIX	4,000,000.00	4,000,760.00
	EUROFIMA	15,000,000.00	15,030,847.50
	EUROFIMA	5,000,000.00	4,816,925.00
	EUROPEAN INVT BK	10,000,000.00	10,354,816.25
	KFW	10,000,000.00	9,828,526.87
	KOMMUNAL BANKEN	10,000,000.00	10,180,941.25
	KOMMUNAL BANKEN	8,000,000.00	8,309,208.00
	LANDWIRTSCH,RENTENBANK	24,000,000.00	23,987,317.48
	LEDAC 1 B	4,000,000.00	3,924,800.00
	MOF 2 A2	8,000,000.00	7,980,000.00
	MULTI 2005-2 A	15,000,000.00	14,542,050.00
	NIMMT 2006-1 A1	7,000,000.00	6,925,800.00
	REDS 2003-2 B	920,360.82	899,514.64
	RENTENBANK	10,000,000.00	10,277,491.87
	SMHL 2003-1 B	1,000,000.00	992,510.00
	WBT 2004-1 A	1,487,100.21	1,481,211.29
計		168,907,461.03	167,553,635.15
(邦貨換算額)			(11,931,494,359)
社債券	ABN AMRO SUB DT VAR	22,500,000.00	17,652,690.00
	ALINTA NETWORKS HOLDINGS	10,750,000.00	10,732,692.50
	AMER EXPRESS CREDIT CO	8,000,000.00	7,663,432.00
	AMER EXPRESS CREDIT CO	10,000,000.00	8,646,790.00
	AMP FIN SERV	11,000,000.00	11,526,713.00

ASIF II	11,500,000.00	11,245,236.18
AUST & NZ BANK	15,000,000.00	15,020,400.00
AUST & NZ BANKING	2,500,000.00	2,335,575.00
AUST & NZ BANKING FRN	9,500,000.00	9,462,864.50
AUST & NZ BANKING FRN	10,000,000.00	9,703,000.00
AUST & NZ BANKING FRN	10,000,000.00	9,502,700.00
BEAR STEARNS CO INC	15,000,000.00	14,986,737.18
BRISBANE SQUARE FINANCE	10,000,000.00	9,969,230.00
CFS GANDEL RETAIL TRUST	14,500,000.00	13,090,165.00
CIE FIN FONCIER	9,500,000.00	9,597,099.50
CITIGROUP INC	2,000,000.00	1,902,894.00
CITIGROUP INC	10,000,000.00	8,746,960.00
COLONIAL FINANCE LTD	3,000,000.00	3,006,696.56
COLONIAL FINANCE LTD	15,500,000.00	15,310,590.00
COM BK AUSTRALIA	40,000,000.00	40,990,200.00
COM BK AUSTRALIA	5,000,000.00	4,838,600.00
COMMONWEALTH BANK FRN	7,500,000.00	6,955,537.50
COUNTRYWIDE FINANCIAL	18,000,000.00	17,389,080.00
DEUTSCHE BANK LDN FRN	16,500,000.00	16,388,229.00
ELECTRANET PTY LTD I/L	2,000,000.00	2,003,978.00
ELM BV (SWISS REIN) FRN	18,500,000.00	9,324,092.50
GE CAP AUSTRALIA FUNDING	9,000,000.00	8,960,396.05
GE CAP AUSTRALIA FUNDING	6,500,000.00	6,322,680.00
GE CAP AUSTRALIA FUNDING	15,000,000.00	11,112,885.00
GOLDMAN SACHS GROUP INC	9,000,000.00	8,875,809.00
GOLDMAN SACHS GROUP INC	8,500,000.00	7,933,492.00
HBOS PLC	10,000,000.00	8,308,190.00
HYPOREAL INTL AG	8,000,000.00	8,175,136.00
INVESTEC BANK AU LTD	14,000,000.00	13,749,414.00
INVESTEC BANK AU LTD	5,000,000.00	4,817,135.00
JP MORGAN CHASE	3,000,000.00	2,933,547.00
LEASEPLAN AUSTRALIA LTD	18,500,000.00	18,475,928.02
MACQUARIE BANK FRN	6,500,000.00	6,169,156.50
MACQUARIE BANK FRN	10,500,000.00	7,461,258.00
MACQUARIE BANK LTD	10,000,000.00	9,717,530.00
MERRILL LYNCH & CO	4,000,000.00	3,969,000.00
MERRILL LYNCH & CO	6,000,000.00	5,347,560.00
MERRILL LYNCH & CO	6,000,000.00	4,806,186.00
MONUMENTAL GLOBAL FDG	5,000,000.00	4,791,085.00
MORGAN STANLEY	12,000,000.00	11,187,470.24
MORGAN STANLEY	10,000,000.00	8,287,930.00
NATIONAL AUSTRALIA BANK	5,000,000.00	5,396,900.00

		NATIONAL AUSTRALIA BANK	35,000,000.00	35,831,775.00	
		NATIONAL AUSTRALIA BANK	13,400,000.00	13,390,851.98	
		NATIONAL CAPITL TRST III	12,000,000.00	7,182,900.00	
		NATIONAL WEALTH SUB	12,000,000.00	7,191,960.00	
		RABOBANK CAP FD VI FRN	11,000,000.00	7,243,797.00	
		RABOBANK NEDERLAND(AUST)	15,000,000.00	14,700,600.00	
		ROYAL BANK SCOTLAND PLC	15,000,000.00	14,512,005.00	
		ROYAL WOMEN'S HOSPITAL	16,500,000.00	15,458,239.50	
		SPI AUSTRAL FIN PTY LTD	6,500,000.00	6,511,115.00	
		SPI ELECTRICITY & GAS	9,000,000.00	9,084,960.00	
		ST GEORGE BANK	5,000,000.00	5,102,750.00	
		ST GEORGE BANK FRN	8,000,000.00	7,527,600.00	
		ST GEORGE BANK FRN	7,000,000.00	7,006,377.00	
		STOCKLAND TRUST MGMNT	15,000,000.00	14,264,130.00	
		STOCKLAND TRUST MGMNT	3,000,000.00	2,562,627.00	
		SUNCORP-METWAY	10,000,000.00	10,265,750.00	
		SUNCORP-METWAY INSURANCE	4,440,000.00	2,453,677.20	
		SUNCORP-METWAY LTD	15,000,000.00	13,718,100.00	
		TELSTRA CORP LTD	9,500,000.00	9,719,165.00	
		TELSTRA CORP LTD	8,500,000.00	8,725,760.00	
		TELSTRA CORP LTD	9,000,000.00	8,765,100.00	
		TRANSURBAN FINANCE CMPNY	7,000,000.00	7,053,655.00	
		TRANSURBAN FINANCE CMPNY	8,000,000.00	8,082,240.00	
		VERO INSURANCE LTD FRN	10,000,000.00	5,806,010.00	
		WACHOVIA BANK NA	14,000,000.00	9,553,726.00	
		WELLS FARGO &CO	15,000,000.00	14,763,806.25	
		WESTFIELD MANAGEMENT LTD	10,000,000.00	9,681,100.00	
		WESTPAC BANKING	12,000,000.00	11,764,560.00	
		WESTPAC BANKING FRN	15,000,000.00	14,732,850.00	
		WESTPAC BANKING FTF	10,500,000.00	10,069,080.00	
		WOOLWORTHS LTD	9,000,000.00	9,025,110.00	
	計		839,590,000.00	776,542,247.16	
	(邦貨換算額)			(55,297,573,420)	
オーストラリアドル				1,440,666,368.21	
計				(102,589,852,079)	
(邦貨換算額)					
合計				102,589,852,079	
(外貨建証券の邦貨換算額)				(102,589,852,079)	

有価証券明細表注記

外貨建有価証券の内訳

通貨	銘柄数	組入債券時価比率	合計金額に対する比率
----	-----	----------	------------

オーストラリアドル	国債証券 3銘柄	4.6%	100.0%
	地方債証券 20銘柄	29.9%	
	特殊債証券 20銘柄	11.6%	
	社債証券 78銘柄	53.9%	

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

債券関連

「(2)注記表（その他の注記）3 デリバティブ取引関係」の「取引の時価等に関する事項 債券関連」において使用した表が、附属明細表別紙様式第1号の「第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」に求められている項目（記載上の注意を含む）を満たしているため、当該表の添付を省略しております。

通貨関連

「(2)注記表（その他の注記）3 デリバティブ取引関係」の「取引の時価等に関する事項 通貨関連」において使用した表が、附属明細表別紙様式第1号の「第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」に求められている項目（記載上の注意を含む）を満たしているため、当該表の添付を省略しております。

7. ピクテ・グローバル・セレクション・ファンド - グローバル・ユーティリティーズ・エクイティ・ファンド クラスSAM分配型受益証券

当投資信託は、ルクセンブルグの法律にもとづき設立された円建外国証券投資信託です。当投資信託証券は、2008年12月31日付で、ルクセンブルグにおいて一般に公正妥当と認められる会計原則に準拠した財務書類が作成されており、監査人の監査を受けております。以下の「純資産計算書」、「損益計算書および純資産変動計算書」ならびに「投資有価証券およびその他純資産明細表」等は、「住信 毎月分配パッケージファンド」が投資対象とする「ピクテ・グローバル・セレクション・ファンド - グローバル・ユーティリティーズ・エクイティ・ファンド クラスSAM分配型受益証券」の財務諸表から委託者が抜粋したものです。

純資産計算書2008年12月31日現在

日本円

資産

投資有価証券取得原価	1,815,554,311,802.00
投資にかかる未実現純利益 / 損失	(636,638,321,497.00)
投資有価証券時価評価額（注2）	1,178,915,990,305.00
現金預金	34,976,746,063.37
未収利益、純額	6,116,111.00
創立費用（注2）	0.00
先渡取引にかかる未実現純利益（注10）	0.00

為替予約契約にかかる未実現純利益(注11)	0.00
	1,213,898,852,479.37
負債	
管理報酬および投資顧問料(注4)	1,169,718,571.00
当座借越	0.00
未払年次税(注3)	30,350,766.00
その他の未払報酬(注7)	811,324,682.00
為替予約契約にかかる未実現純損失(注11)	0.00
	2,011,394,019.00
2008年12月31日現在純資産合計	1,211,887,458,460.37
2007年12月31日現在純資産合計	2,487,696,054,638.48
2006年12月31日現在純資産合計	1,900,824,623,787.00

添付の注記は、本財務諸表との不可分一体です。

2008年12月31日損益計算書および純資産変動計算書

日本円

期首現在の純資産	2,487,696,054,638.48
収益	
CDSにかかる利息	0.00
配当金、純額	69,405,264,376.00
債券利息、純額	0.00
預金利息	112,645,905.00
その他の収益	18,509,166.00
	69,536,419,447.00
費用	
CDSにかかる利息	0.00
管理報酬および投資顧問料(注4)	6,848,170,328.00
保管報酬、銀行手数料および利息	2,885,132,988.73
サービス報酬	1,885,158,445.00
管理事務費用、監査費用およびその他の費用	19,379,025.00
年次税(注3)	158,390,098.00
	11,796,230,884.73
投資純利益	57,740,188,562.27
投資対象売却にかかる実現純利益/損失	(81,741,925,666.59)
先渡取引にかかる実現純利益/損失	0.00

外国為替にかかる実現純利益 / 損失	(3,085,056,880.79)
先渡取引にかかる実現純利益 / 損失	0.00
実現純利益 / (損失)	(27,086,793,985.11)
以下にかかる未実現純評価利益 / 損失の変動 :	
- 投資	(1,079,229,917,196.00)
- 先物為替予約	0.00
- 先渡取引	0.00
運用による純資産の増加 / 減少	(1,106,316,711,181.11)
受益証券発行手取額	111,661,156,079.00
受益証券買戻費用	(215,841,109,302.00)
分配金支払	(65,311,931,774.00)
期末現在の純資産	1,211,887,458,460.37

添付の注記は、本財務諸表との不可分一体です。

投資有価証券およびその他純資産明細表
2008年12月31日現在(単位:円)

銘柄	保有数	時価(注2)	純資産に対する比率(%)
1. 公認の証券取引所への上場を認可されたまたは他の統制市場で取引される顕微性のある有価証券			
株式			
<i>オーストラリア</i>			
DUET GROUP QUADRUPLE STAPLED	29,526,152.00	3,080,704,070.00	0.25
		3,080,704,070.00	0.25
<i>オーストリア</i>			
TELEKOM AUSTRIA	4,350,000.00	5,734,139,052.00	0.47
		5,734,139,052.00	0.47
<i>ブラジル</i>			
CEMIG MINAS GERAIS PFD	3,980,000.00	4,767,915,345.00	0.39
SABESP	5,446,472.00	5,786,949,066.00	0.48
TRACTEBEL ENERGIA	6,932,900.00	4,773,968,389.00	0.39
		15,328,832,800.00	1.26
<i>カナダ</i>			
TELUS NVTG	2,250,000.00	5,448,442,273.00	0.45
TRANSALTA	10,065,100.00	17,289,324,624.00	1.43
TRANSCANADA	2,520,000.00	5,982,422,537.00	0.49
		28,720,189,434.00	2.37
<i>フィンランド</i>			
FORTUM	6,787,247.00	13,146,997,646.00	1.08
		13,146,997,646.00	1.08
<i>フランス</i>			
ELECTRICITE DE FRANCE	1,200,000.00	6,311,983,160.00	0.52
GDF SUEZ	10,957,727.00	48,124,642,437.00	3.98
SECHILLENNE-SIDEC	1,369,432.00	5,419,026,604.00	0.45
SUEZ ENVIRONNEMENT	3,217,430.00	4,778,027,216.00	0.39
VEOLIA ENVIRONNEMENT	2,789,523.00	7,750,147,553.00	0.64
VINCI	1,924,000.00	7,197,798,550.00	0.59
		79,581,625,520.00	6.57
<i>ドイツ</i>			
DEUTSCHE TELEKOM NOM.	14,300,000.00	19,654,626,706.00	1.62
E.ON NOM.	10,624,000.00	38,651,178,060.00	3.19
R. W. E. 'A'	3,735,301.00	30,421,829,959.00	2.51
R.W.E. PFD N-VTG	3,193,322.00	21,888,133,926.00	1.81
		110,595,768,651.00	9.13
<i>香港</i>			
CLP HOLDINGS	9,700,000.00	5,940,534,900.00	0.49
HONGKONG ELECTRIC	52,032,500.00	26,000,778,448.00	2.15
		31,941,313,348.00	2.64
<i>イタリア</i>			
ACEA	3,887,762.00	4,764,442,455.00	0.39
ENEL ENTE NAZION. ENERGIA ELETTR.	47,450,600.00	26,936,736,413.00	2.22
SNAM RETE GAS	89,273,600.00	45,371,222,304.00	3.74
T. E. R. N. A	99,775,100.00	30,042,314,019.00	2.48
		107,114,715,191.00	8.83

添付の注記は、本財務諸表との不可分一体です。

投資有価証券およびその他純資産明細表
2008年12月31日現在(単位:円)

銘柄	保有数	時価(注2)	純資産に対する比率(%)
<i>日本</i>			
NTT DOCOMO	90,000.00	15,876,000,000.00	1.31
		15,876,000,000.00	1.31
<i>メキシコ</i>			
AMERICA MOVIL ADR (R. 20 SHS 'L')	2,913,000.00	8,106,866,302.00	0.67
		8,106,866,302.00	0.67
<i>オランダ</i>			
KPN KONINKLIJKE	26,979,800.00	35,478,342,344.00	2.93
		35,478,342,344.00	2.93
<i>ポルトガル</i>			
EDP (ELECTRIC. DE PORTUGAL) NOM.	77,294,500.00	26,238,162,395.00	2.17
		26,238,162,395.00	2.17
<i>スペイン</i>			
ENAGAS	6,860,700.00	13,745,410,798.00	1.13
IBERDROLA	22,640,700.00	18,873,730,263.00	1.56
RED ELECTRICA CORPORACION	1,400,000.00	6,443,930,304.00	0.53
TELEFONICA	6,505,000.00	13,140,887,157.00	1.08
		52,203,958,522.00	4.30
<i>スウェーデン</i>			
TELE2 'B'	2,601,551.00	2,137,482,977.00	0.18
		2,137,482,977.00	0.18
<i>スイス</i>			
SWISSCOM NOM.	457,000.00	13,315,166,161.00	1.10
		13,315,166,161.00	1.10
<i>イギリス</i>			
CENTRICA (NEW)	122,861,865.00	42,397,510,047.00	3.50
NATIONAL GRID (NEW)	49,808,012.00	44,150,872,202.00	3.64
NORTHUMBRIAN WATER	25,342,500.00	7,899,746,305.00	0.65
PENNON GROUP (NEW)	17,422,708.00	11,181,123,636.00	0.92
SCOTTISH & SOUTHERN ENERGY	22,902,200.00	35,807,625,670.00	2.95
SEVERN TRENT (NEW)	11,277,933.00	17,072,363,503.00	1.41
UNITED UTILITIES GROUP	21,548,066.00	17,141,256,604.00	1.41
VODAFONE GROUP (NEW)	36,050,000.00	6,362,795,990.00	0.53
		182,013,293,957.00	15.01
<i>アメリカ合衆国</i>			
ALLIANT ENERGY	4,853,800.00	12,463,306,686.00	1.03
AMERICAN ELECTRIC POWER	10,085,900.00	29,313,509,092.00	2.42
AT & T	5,300,000.00	13,251,026,381.00	1.09
CENTERPOINT ENERGY	15,562,000.00	17,351,628,583.00	1.43
CONSOLIDATED EDISON	6,486,100.00	22,397,004,432.00	1.85
DOMINION RESOURCES	3,640,000.00	11,480,788,400.00	0.95
DUKE ENERGY	16,395,056.00	21,765,295,869.00	1.80
EMBARQ -WHEN ISSUED-	2,208,000.00	6,715,592,214.00	0.55
ENTERGY	889,300.00	6,592,575,031.00	0.54
ENTERPRISE PRODUCTS PARTNERS	5,675,000.00	10,155,888,407.00	0.84
EXELON	3,528,600.00	16,922,956,150.00	1.40
FIRSTENERGY	4,994,200.00	21,131,631,930.00	1.74

添付の注記は、本財務諸表との不可分一体です。

投資有価証券およびその他純資産明細表
2008年12月31日現在(単位:円)

銘柄	保有数	時価(注2)	純資産に対する比率(%)
FPL GROUP	7,122,723.00	31,735,260,306.00	2.62
FRONTIER COMMUNICATIONS 'B'	8,781,000.00	6,579,933,291.00	0.54
KINDER MORGAN ENERGY PARTNERS	3,886,600.00	15,853,540,205.00	1.31
MAGELLAN MIDSTREAM PARTNERS	1,940,000.00	4,902,791,552.00	0.40
NSTAR	4,709,000.00	15,263,872,312.00	1.26
PEPCO HOLDINGS	4,171,000.00	6,491,396,174.00	0.54
PG & E	3,500,000.00	12,051,092,390.00	0.99
PROGRESS ENERGY	9,231,300.00	32,441,753,287.00	2.68
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP	6,733,400.00	17,204,733,019.00	1.42
QWEST COMMUNICATIONS INT.	22,000,000.00	6,736,833,052.00	0.56
SOUTHERN	13,931,600.00	45,635,032,641.00	3.78
SPECTRA ENERGY	8,078,528.00	10,993,870,037.00	0.91
VERIZON COMMUNICATIONS	4,880,000.00	14,512,795,584.00	1.20
XCEL ENERGY	18,859,600.00	30,761,313,453.00	2.54
		440,705,420,478.00	36.39
株式合計		1,171,318,978,848.00	96.66
権利			
フランス			
GDF SUEZ STRIP VVPR	630,105.00	80,563.00	0.00
		80,563.00	0.00
権利合計		80,563.00	0.00
合計Ⅰ.		1,171,319,059,411.00	96.66
Ⅱ. その他の譲渡性のある有価証券			
株式			
カナダ			
TELUS CORPORATION	2,205,000.00	5,723,397,699.00	0.47
		5,723,397,699.00	0.47
合計Ⅱ.		5,723,397,699.00	0.47
Ⅲ. 投資ファンド受益証券			
イギリス			
ECOFIN WATER & POWER OPPORT.	11,689,462.00	1,873,533,195.00	0.15
		1,873,533,195.00	0.15
合計Ⅲ.		1,873,533,195.00	0.15
投資有価証券合計		1,178,915,990,305.00	97.28
現金預金		34,976,746,063.37	2.89
その他の純負債		-2,005,277,908.00	-0.17
純資産合計		1,211,887,458,460.37	100.00

添付の注記は、本財務諸表との不可分一体です。

投資有価証券の地域別分類および業種別分類
2008年12月31日現在

地域別分類		業種別分類	
(純資産に対する比率%)		(純資産に対する比率%)	
アメリカ合衆国	36.39	公益事業	70.28
イギリス	15.16	通信	14.57
ドイツ	9.13	持株および金融会社	10.42
イタリア	8.83	環境保全および廃棄物管理	0.64
フランス	6.57	エレクトロニクスおよび電気機器	0.63
スペイン	4.30	建設および建築資材	0.59
オランダ	2.93	投資ファンド受益証券	0.15
カナダ	2.84		97.28
香港	2.64		
ポルトガル	2.17		
日本	1.31		
ブラジル	1.26		
スイス	1.10		
フィンランド	1.08		
メキシコ	0.67		
オーストリア	0.47		
オーストラリア	0.25		
スウェーデン	0.18		
	97.28		

添付の注記は、本財務諸表との不可分一体です。

財務諸表に対する注記 2008年12月31日現在

注1—一般事項

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド(以下「ファンド」という)は、ルクセンブルグのアンブレラ型契約型投資信託("Fonds Commun de Placement")です。ファンドは、共同所有者の利益のために運用される有価証券およびその他の資産を共有する共有持分型投資信託です。

ファンドは、2002年12月20日に改正された契約型投資信託法(Undertaking for Collective Investment)の第II部に基づく契約型投資信託としての資格を有しています。

ファンドは、ルクセンブルグ大公国の法律に基づき1998年10月6日に設立され、ルクセンブルグに登録上の事務所を有するビクテ・グローバル・セレクション・ファンド・マネージメント(ルクセンブルグ)エス・エイにより管理されています。約款は、1998年11月21日にルクセンブルグ大公国メモリアル・ルクイ・デ・ソシエテ・エ・アソシオン紙(「メモリアル」)に公告されました。本約款の申請は、ルクセンブルグ地方裁判所登記所で行われ、同登記所で閲覧することができます。改訂約款は、1999年5月12日、1999年5月31日、2000年1月27日、2000年12月23日、2002年1月22日、2002年6月11日、2002年10月10日、2002年11月28日、2003年1月8日、2003年3月26日、2003年10月4日、2003年12月6日、2004年6月9日、2004年11月10日、2004年12月10日、2005年2月11日、2005年4月16日、2005年5月4日、2005年10月13日、2005年12月27日、2006年6月8日、2006年9月19日、2006年10月21日、2006年12月15日、2007年3月23日、2007年5月26日、2008年2月21日、2008年6月24日および2008年10月15日付けのメモリアルに公告されました。

管理会社は、ルクセンブルグの商業記録簿に第B66415番として登録されています。

2008年6月11日、管理会社の取締役会はサブ・ファンド、ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-リソース・リッチ・カントリーズ・ソブリン・ファンドの新設を承認することを決議しました。

2008年9月25日、管理会社の取締役会はビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-グローバル・ユーティリティーズ・エクイティ・ファンドのシェアクラスとしてクラスPY(分配型)受益証券の新設を承認し、ファンドの目録見書のクラスA(分配型)受益証券およびクラスI(分配型)受益証券へのリファレンスを削除することを決議しました。

2008年12月31日現在、ビクテ・グローバル・セレクション・ファンドには以下の9つのサブ・ファンドが含まれています。

- ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-ヨーロッパ・ボンド・ファンド、ユーロ(EUR)建て
- ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-ユーロ・キャッシュ・ファンド、ユーロ(EUR)建て
- ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-グローバル・グロウイング・マーケット・ファンド、日本円(JPY)建て
- ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-グローバル・ユーティリティーズ・エクイティ・ファンド、日本円(JPY)建て
- ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-好配当世界公共株ファンド、米ドル(USD)建て
- ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-グローバル・インカム・ストック・ファンド、日本円(JPY)建て
- ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-グローバル・エマージング・ソブリン・ファンド、日本円(JPY)建て;
- ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-グローバル・ハイ・イールド・エマージング・エクイティーズ・ファンド、日本円(JPY)建て
- ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-リソース・リッチ・カントリーズ・ソブリン・ファンド、2008年6月24日設定、日本円(JPY)建て

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-ヨーロッパ・ボンド・ファンドは、以下の2種類のクラス受益証券を有しています。

投資有価証券の地域別分類および業種別分類
2008年12月31日現在

地域別分類		業種別分類	
(純資産に対する比率%)		(純資産に対する比率%)	
アメリカ合衆国	36.39	公益事業	70.28
イギリス	15.16	通信	14.57
ドイツ	9.13	持株および金融会社	10.42
イタリア	8.83	環境保全および廃棄物管理	0.64
フランス	6.57	エレクトロニクスおよび電気機器	0.63
スペイン	4.30	建設および建築資材	0.59
オランダ	2.93	投資ファンド受益証券	0.15
カナダ	2.84		97.28
香港	2.64		
ポルトガル	2.17		
日本	1.31		
ブラジル	1.26		
スイス	1.10		
フィンランド	1.08		
メキシコ	0.67		
オーストリア	0.47		
オーストラリア	0.25		
スウェーデン	0.18		
	97.28		

添付の注記は、本財務諸表との不可分一体です。

財務諸表に対する注記 2008年12月31日現在

- クラス A 受益証券（「クラス A 受益証券」）
- クラス「P（分配型）」受益証券（「クラス P 分配型受益証券」）

クラス P（分配型）受益証券への投資は、日本における主たる販売会社である SMBC フレンド証券株式会社を通じて申し込みが行われた場合にのみ受け付けられます。クラス P（分配型）受益証券の他のクラス受益証券への転換またはその逆の転換はできないことがあります。

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド・ユーロ・キャッシュ・ファンドは、以下の 3 種類のクラス受益証券を有しています。

- クラス A 受益証券（「クラス A 受益証券」）
- クラス「P（元本成長型）」受益証券（P 元本成長型受益証券）
- クラス「P（分配型）」受益証券（「クラス P 分配型受益証券」）

P 元本成長型受益証券およびクラス P 分配型受益証券（あわせて「クラス P 受益証券」）への投資は、日本における主たる販売会社である住友信託銀行株式会社に申し込みが行われた場合にのみ受け付けられます。クラス P 受益証券の他のクラス受益証券への転換またはその逆の転換はできないことがあります。

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド・グローバル・グローイング・マーケット・ファンドは、以下のクラス受益証券を有しています。

- クラス「P」受益証券（「P 受益証券」）

当サブ・ファンドのクラス「P」受益証券は、日本における主たる販売会社である日興コーディアル証券株式会社を通じて申し込みを行う投資者に対してのみ販売されます。クラス「P」受益証券は、日本においてビクテ・グローバル・セレクション・ファンド・グローバル・グローイング・マーケット・ファンド・日興ビクテ・グローバル・グローイング・マーケット・ファンド、またはビクテ・グローバル・セレクション・ファンド・日興ビクテ・グローバル・グローイング・マーケット・ファンドと呼ばれることがあります。クラス P 受益証券は他のクラス受益証券に転換できないことがあります。

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド・グローバル・ユーティリティーズ・エクイティ・ファンドは、5 種類のクラス受益証券を有しています。

- クラス「P（分配型）」受益証券（P 分配型受益証券）
- クラス「ST（分配型）」受益証券（ST 分配型受益証券）
- クラス「SAM（分配型）」受益証券（SAM 分配型受益証券）
- クラス「PY（分配型）」受益証券（PY 分配型受益証券）
- クラス P 分配型ユーロ受益証券（P 分配型受益証券-ユーロ）

クラス P（分配型）受益証券は、日本においてビクテ・グループによって販売されるファンド・オブ・ファンズに対してのみ販売され、年率 0.01%の軽減ルクセンブルグ「年次税」を課されます。

クラス ST（分配型）受益証券は、日本において新光投信株式会社により販売されるファンド・オブ・ファンズに対してのみ販売され、年率 0.01%の軽減ルクセンブルグ「年次税」を課されます。

クラス SAM（分配型）受益証券は、日本において住信アセットマネジメント株式会社により販売されるファンド・オブ・ファンズに対してのみ販売され、年率 0.01%の軽減ルクセンブルグ「年次税」を課されます。

クラス P（分配型）受益証券-ユーロは、ビクテ・プライベート・バンキングの顧客に対してのみ販売されます。当クラスは、その資産に対して年率 0.05%の軽減ルクセンブルグ「年次税」が課されます。

PY 分配型受益証券は 10 月 30 日に当初募集価格一口当たり 10,000 円で販売を開始しました。

クラス P（分配型）受益証券、クラス ST（分配型）受益証券、クラス SAM（分配型）受益証券、クラス P（分配型）受益証券-ユーロおよびクラス PY（分配型）受益証券の他のクラス受益証券への転換またはその逆の転換はできないことがあります。

財務諸表に対する注記 2008年12月31日現在

- クラス A 受益証券（「クラス A 受益証券」）
- クラス「P（分配型）」受益証券（「クラス P 分配型受益証券」）

クラス P（分配型）受益証券への投資は、日本における主たる販売会社である SMBC フレンド証券株式会社を通じて申し込みが行われた場合にのみ受け付けられます。クラス P（分配型）受益証券の他のクラス受益証券への転換またはその逆の転換はできないことがあります。

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド・ユーロ・キャッシュ・ファンドは、以下の 3 種類のクラス受益証券を有しています。

- クラス A 受益証券（「クラス A 受益証券」）
- クラス「P（元本成長型）」受益証券（P 元本成長型受益証券）
- クラス「P（分配型）」受益証券（「クラス P 分配型受益証券」）

P 元本成長型受益証券およびクラス P 分配型受益証券（あわせて「クラス P 受益証券」）への投資は、日本における主たる販売会社である住友信託銀行株式会社に申し込みが行われた場合にのみ受け付けられます。クラス P 受益証券の他のクラス受益証券への転換またはその逆の転換はできないことがあります。

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド・グローバル・グローイング・マーケット・ファンドは、以下のクラス受益証券を有しています。

- クラス「P」受益証券（「P 受益証券」）

当サブ・ファンドのクラス「P」受益証券は、日本における主たる販売会社である日興コーディアル証券株式会社を通じて申し込みを行う投資者に対してのみ販売されます。クラス「P」受益証券は、日本においてビクテ・グローバル・セレクション・ファンド・グローバル・グローイング・マーケット・ファンド・日興ビクテ・グローバル・グローイング・マーケット・ファンド、またはビクテ・グローバル・セレクション・ファンド・日興ビクテ・グローバル・グローイング・マーケット・ファンドと呼ばれることがあります。クラス P 受益証券は他のクラス受益証券に転換できないことがあります。

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド・グローバル・ユーティリティーズ・エクイティ・ファンドは、5 種類のクラス受益証券を有しています。

- クラス「P（分配型）」受益証券（P 分配型受益証券）
- クラス「ST（分配型）」受益証券（ST 分配型受益証券）
- クラス「SAM（分配型）」受益証券（SAM 分配型受益証券）
- クラス「PY（分配型）」受益証券（PY 分配型受益証券）
- クラス P 分配型ユーロ受益証券（P 分配型受益証券-ユーロ）

クラス P（分配型）受益証券は、日本においてビクテ・グループによって販売されるファンド・オブ・ファンズに対してのみ販売され、年率 0.01%の軽減ルクセンブルグ「年次税」を課されます。

クラス ST（分配型）受益証券は、日本において新光投信株式会社により販売されるファンド・オブ・ファンズに対してのみ販売され、年率 0.01%の軽減ルクセンブルグ「年次税」を課されます。

クラス SAM（分配型）受益証券は、日本において住信アセットマネジメント株式会社により販売されるファンド・オブ・ファンズに対してのみ販売され、年率 0.01%の軽減ルクセンブルグ「年次税」を課されます。

クラス P（分配型）受益証券-ユーロは、ビクテ・プライベート・バンキングの顧客に対してのみ販売されます。当クラスは、その資産に対して年率 0.05%の軽減ルクセンブルグ「年次税」が課されます。

PY 分配型受益証券は 10 月 30 日に当初募集価格一口当たり 10,000 円で販売を開始しました。

クラス P（分配型）受益証券、クラス ST（分配型）受益証券、クラス SAM（分配型）受益証券、クラス P（分配型）受益証券-ユーロおよびクラス PY（分配型）受益証券の他のクラス受益証券への転換またはその逆の転換はできないことがあります。

財務諸表に対する注記 2008年12月31日現在

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド・好配当世界公共株ファンドは、以下のクラス受益証券を有しています。

- クラス「P（分配型）」受益証券（「クラスP分配型受益証券」）

当サブ・ファンドのクラス「P（分配型）」受益証券は、三菱UFJ証券株式会社を通じてのみ販売され、他のクラス受益証券への転換またはその逆の転換はできないことがあります。

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド・グローバル・インカム・ストック・ファンドは、以下の2種類のクラス受益証券を有しています。

- A分配型受益証券（「クラスA（分配型）受益証券」）

- P分配型受益証券（「クラスP（分配型）受益証券」）

クラスA（分配型）受益証券およびクラスP（分配型）受益証券の他のクラス受益証券への転換またはその逆の転換はできないことがあります。

2008年12月31日現在で、クラスP（分配型）受益証券のみが発行されています。

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド・グローバル・エマージング・ソブリン・ファンドは、以下の2種類のクラス受益証券を有しています。

- A分配型受益証券（「クラスA（分配型）受益証券」）

- P分配型受益証券（「クラスP（分配型）受益証券」）

クラスP（分配型）受益証券は、日本においてビクテ・グループによって販売されるファンド・オブ・ファンズに対してのみ販売され、年率0.01%の軽減ルクセンブルグ「年次税」を課されます。

クラスA（分配型）受益証券およびクラスP（分配型）受益証券の他のクラス受益証券への転換またはその逆の転換はできないことがあります。

2008年12月31日現在で、クラスP（分配型）受益証券のみが発行されています。

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・エマージング・エクイティーズ・ファンドは、以下の3種類のクラス受益証券を有しています。

- A分配型受益証券（「クラスA（分配型）受益証券」）

- P分配型受益証券（「クラスP（分配型）受益証券」）

- SAM分配型受益証券（「クラスSAM（分配型）受益証券」）

2008年12月31日現在で、クラスP（分配型）受益証券およびクラスSAM（分配型）受益証券のみが発行されています。

クラスP（分配型）受益証券は、日本においてビクテ・グループによって販売されるファンド・オブ・ファンズに対してのみ販売され、年率0.01%の軽減ルクセンブルグ「年次税」を課されます。

クラスSAM（分配型）受益証券は、日本において住信アセットマネジメント株式会社により販売されるファンド・オブ・ファンズに対してのみ販売され、年率0.01%の軽減ルクセンブルグ「年次税」を課されます。

クラスA（分配型）受益証券、クラスP（分配型）受益証券およびクラスSAM（分配型）受益証券の他のクラス受益証券への転換またはその逆の転換はできないことがあります。

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド・リソース・リッチ・カンTRIES・ソブリン・ファンドは、以下の2種類のクラス受益証券を有しています。

- A分配型受益証券（「クラスA（分配型）受益証券」）

- P分配型受益証券（「クラスP（分配型）受益証券」）

財務諸表に対する注記 2008年12月31日現在

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド・好配当世界公共株ファンドは、以下のクラス受益証券を有しています。

- クラス「P(分配型)」受益証券(「クラスP分配型受益証券」)

当サブ・ファンドのクラス「P(分配型)」受益証券は、三菱UFJ証券株式会社を通じてのみ販売され、他のクラス受益証券への転換またはその逆の転換はできないことがあります。

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド・グローバル・インカム・ストック・ファンドは、以下の2種類のクラス受益証券を有しています。

- A分配型受益証券(「クラスA(分配型)受益証券」)

- P分配型受益証券(「クラスP(分配型)受益証券」)

クラスA(分配型)受益証券およびクラスP(分配型)受益証券の他のクラス受益証券への転換またはその逆の転換はできないことがあります。

2008年12月31日現在で、クラスP(分配型)受益証券のみが発行されています。

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド・グローバル・エマージング・ソブリン・ファンドは、以下の2種類のクラス受益証券を有しています。

- A分配型受益証券(「クラスA(分配型)受益証券」)

- P分配型受益証券(「クラスP(分配型)受益証券」)

クラスP(分配型)受益証券は、日本においてビクテ・グループによって販売されるファンド・オブ・ファンズに対してのみ販売され、年率0.01%の軽減ルクセンブルグ「年次税」を課されます。

クラスA(分配型)受益証券およびクラスP(分配型)受益証券の他のクラス受益証券への転換またはその逆の転換はできないことがあります。

2008年12月31日現在で、クラスP(分配型)受益証券のみが発行されています。

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・エマージング・エクイティーズ・ファンドは、以下の3種類のクラス受益証券を有しています。

- A分配型受益証券(「クラスA(分配型)受益証券」)

- P分配型受益証券(「クラスP(分配型)受益証券」)

- SAM分配型受益証券(「クラスSAM(分配型)受益証券」)

2008年12月31日現在で、クラスP(分配型)受益証券およびクラスSAM(分配型)受益証券のみが発行されています。

クラスP(分配型)受益証券は、日本においてビクテ・グループによって販売されるファンド・オブ・ファンズに対してのみ販売され、年率0.01%の軽減ルクセンブルグ「年次税」を課されます。

クラスSAM(分配型)受益証券は、日本において住信アセットマネジメント株式会社により販売されるファンド・オブ・ファンズに対してのみ販売され、年率0.01%の軽減ルクセンブルグ「年次税」を課されます。

クラスA(分配型)受益証券、クラスP(分配型)受益証券およびクラスSAM(分配型)受益証券の他のクラス受益証券への転換またはその逆の転換はできないことがあります。

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド・リソース・リッチ・カントリーーズ・ソブリン・ファンドは、以下の2種類のクラス受益証券を有しています。

- A分配型受益証券(「クラスA(分配型)受益証券」)

- P分配型受益証券(「クラスP(分配型)受益証券」)

財務諸表に対する注記 2008年12月31日現在

クラス P（分配型）受益証券は、日本においてビクテ・グループによって販売されるファンド・オブ・ファンズに対してのみ販売され、年率 0.01%の軽減ルクセンブルグ「年次税」を課されます。

クラス A（分配型）受益証券およびクラス P（分配型）受益証券の他のクラス受益証券への転換またはその逆の転換はできないことがあります。

2008年12月31日現在で、クラス P（分配型）受益証券のみが発行されています。

財務諸表に対する注記 2008年12月31日現在

クラス P（分配型）受益証券は、日本においてビクテ・グループによって販売されるファンド・オブ・ファンズに対してのみ販売され、年率 0.01%の軽減ルクセンブルグ「年次税」を課されます。

クラス A（分配型）受益証券およびクラス P（分配型）受益証券の他のクラス受益証券への転換またはその逆の転換はできないことがあります。

2008年12月31日現在で、クラス P（分配型）受益証券のみが発行されています。

財務諸表に対する注記 2008年12月31日現在

注2—重要な会計方針の要約

a) 一般事項

財務諸表は、ルクセンブルグにおいて適用されている法定の報告要求に従い表示されています。

b) 創立費

創立費は、5年を最大とする期間にわたり償却されます。

c) 各サブ・ファンドの外国通貨換算

サブ・ファンドの基準通貨以外の通貨建て現金預金、その他の純資産および投資有価証券の時価評価額は、年度末現在の実勢為替レートでサブ・ファンドの基準通貨に換算されます。

サブ・ファンドの基準通貨以外の通貨建て収益および費用は、支払い日の実勢為替レートでサブ・ファンドの基準通貨に換算されます。

為替損益は、損益計算書に含まれています。

d) ファンドの連結財務諸表

ファンドの連結財務諸表は、ユーロで表示されています。ユーロ以外の通貨建ての各サブ・ファンドの会計項目は、年度末現在の実勢為替レートでユーロに換算されています。

e) ファンド資産の評価

- (1) 証券取引所に上場されているまたは他の規制市場で取引されている有価証券は、かかる取引所または市場における最終価格で評価されます。有価証券が複数の取引所または市場で取引されている場合には、かかる有価証券の主要市場である取引所または市場における最終価格により決定されます。
- (2) 取引所に上場されていない有価証券または他の統制市場で取引されていない有価証券は、直近の最終取引価格で評価されます。
- (3) 取引価格が入手できない有価証券、または(1)および/または(2)に記載される価格が公正な市場価格を反映していない有価証券は、合理的に予想される売却価格に基づき、慎重かつ誠実に評価されます。
- (4) 短期流動資産は、償却後原価で評価されます。
- (5) オープン・エンド型投資信託の受益証券または株式は入手可能な最新の純資産価額に基づいて評価され、決定された価格が公正価値を表さない場合には、当該価格は取締役会が公正かつ慎重な判断基準を用いて決定します。
- (6) 取引所に上場されていない短期金融商品、または統制市場、EU加盟国以外の証券取引所もしくは他の統制市場で取引されていない短期金融商品で、満期までの残存期間が12ヵ月を超えない商品は額面に発生済利息を加えた額で評され、合計額は線形法を用いて償却されます。

f) 投資有価証券にかかる実現純損益

有価証券売却にかかる実現損益は、平均原価に基づき計算されます。

g) 組入有価証券の取得原価

サブ・ファンドの基準通貨以外の通貨建て有価証券の取得原価は、取得日の実勢為替レートで計算されます。

財務諸表に対する注記 2008年12月31日現在

注2—重要な会計方針の要約

a) 一般事項

財務諸表は、ルクセンブルグにおいて適用されている法定の報告要求に従い表示されています。

b) 創立費

創立費は、5年を最大とする期間にわたり償却されます。

c) 各サブ・ファンドの外国通貨換算

サブ・ファンドの基準通貨以外の通貨建て現金預金、その他の純資産および投資有価証券の時価評価額は、年度末現在の実勢為替レートでサブ・ファンドの基準通貨に換算されます。

サブ・ファンドの基準通貨以外の通貨建て収益および費用は、支払い日の実勢為替レートでサブ・ファンドの基準通貨に換算されます。

為替損益は、損益計算書に含まれています。

d) ファンドの連結財務諸表

ファンドの連結財務諸表は、ユーロで表示されています。ユーロ以外の通貨建ての各サブ・ファンドの会計項目は、年度末現在の実勢為替レートでユーロに換算されています。

e) ファンド資産の評価

- (1) 証券取引所に上場されているまたは他の規制市場で取引されている有価証券は、かかる取引所または市場における最終価格で評価されます。有価証券が複数の取引所または市場で取引されている場合には、かかる有価証券の主要市場である取引所または市場における最終価格により決定されます。
- (2) 取引所に上場されていない有価証券または他の統制市場で取引されていない有価証券は、直近の最終取引価格で評価されます。
- (3) 取引価格が入手できない有価証券、または(1)および/または(2)に記載される価格が公正な市場価格を反映していない有価証券は、合理的に予想される売却価格に基づき、慎重かつ誠実に評価されます。
- (4) 短期流動資産は、償却後原価で評価されます。
- (5) オープン・エンド型投資信託の受益証券または株式は入手可能な最新の純資産価額に基づいて評価され、決定された価格が公正価値を表さない場合には、当該価格は取締役会が公正かつ慎重な判断基準を用いて決定します。
- (6) 取引所に上場されていない短期金融商品、または統制市場、EU加盟国以外の証券取引所もしくは他の統制市場で取引されていない短期金融商品で、満期までの残存期間が12ヵ月を超えない商品は額面に発生済利息を加えた額で評され、合計額は線形法を用いて償却されます。

f) 投資有価証券にかかる実現純損益

有価証券売却にかかる実現損益は、平均原価に基づき計算されます。

g) 組入有価証券の取得原価

サブ・ファンドの基準通貨以外の通貨建て有価証券の取得原価は、取得日の実勢為替レートで計算されます。

財務諸表に対する注記 2008年12月31日現在**h) 収益**

一般的に、配当は、権利落ち日に計上されます。利息は、発生基準で計上されます。

i) 為替予約取引の評価

未決済の為替予約から発生する未実現損益は、評価日において同日現在適用される先渡為替価格を基準に決定され、損益計算書に含まれます。

j) 先渡取引の評価

先渡取引の評価は、入手可能な最終価格に基づき行われます。当該価格および取引価格の間の差異により発生する当該取引にかかる未実現利益または損失は、損益計算書に含まれます。

k) 金利スワップの評価

スワップ契約に関連してサブ・ファンドにより受領および支払が行われるキャッシュ・フローは、かかるキャッシュ・フローの満期に対応するゼロ・クーポン・スワップ・レートにより、評価日に現在価値に変換されます。スワップ契約の価値は、これら 2 つの現在価値間の転換による差異に相当します。

l) Valuation of credit default swaps

ISDA マスターアグリーメントに基づいたクレジット・デフォルト・スワップ（「CDS」）契約をこの種の取引に専門性を持っている主要な金融機関との間で締結しています。

CDS の評価の決定に用いられる要素は、回収率、デフォルトの確率およびリプレースメント・スプレッドです。リプレースメント・スプレッドとは当該 CDS を再度設定する場合の保険料です。

CDS の評価には参照債券に適用されるゼロイールドカーブとの比較における当該 CDS による信用保護の現在価値が反映されます。

注 3—「年次税」

ルクセンブルグにおける現行法規に従い、ファンドには、いかなる所得税も課せられません。ただし、ファンドの純資産は「年次税」（年率 0.05%）の対象であり、年次税は四半期毎に各四半期末現在の純資産に基づいて計算されます。かかる税金は、契約型投資信託に関する 2002 年 12 月 20 日に改定されたルクセンブルグ法第 129 条に規定され、その範囲内における「機関投資家」に受益者が限定されるクラス受益証券に帰属する純資産に関しては、0.01%まで軽減されます。ルクセンブルグにおける他の契約型投資信託の受益証券に投資される純資産額については、本「年次税」が免除されますが、ただし、これはかかる受益証券に対して既に同税が課せられている場合に限られます。

財務諸表に対する注記 2008年12月31日現在**h) 収益**

一般的に、配当は、権利落ち日に計上されます。利息は、発生基準で計上されます。

i) 為替予約取引の評価

未決済の為替予約から発生する未実現損益は、評価日において同日現在適用される先渡為替価格を基準に決定され、損益計算書に含まれます。

j) 先渡取引の評価

先渡取引の評価は、入手可能な最終価格に基づき行われます。当該価格および取引価格の間の差異により発生する当該取引にかかる未実現利益または損失は、損益計算書に含まれます。

k) 金利スワップの評価

スワップ契約に関連してサブ・ファンドにより受領および支払が行われるキャッシュ・フローは、かかるキャッシュ・フローの満期に対応するゼロ・クーポン・スワップ・レートにより、評価日に現在価値に変換されます。スワップ契約の価値は、これら 2 つの現在価値間の転換による差異に相当します。

l) Valuation of credit default swaps

ISDA マスターアグリーメントに基づいたクレジット・デフォルト・スワップ（「CDS」）契約をこの種の取引に専門性を持っている主要な金融機関との間で締結しています。

CDS の評価の決定に用いられる要素は、回収率、デフォルトの確率およびリプレースメント・スプレッドです。リプレースメント・スプレッドとは当該 CDS を再度設定する場合の保険料です。

CDS の評価には参照債券に適用されるゼロイールドカーブとの比較における当該 CDS による信用保護の現在価値が反映されます。

注 3—「年次税」

ルクセンブルグにおける現行法規に従い、ファンドには、いかなる所得税も課せられません。ただし、ファンドの純資産は「年次税」（年率 0.05%）の対象であり、年次税は四半期毎に各四半期末現在の純資産に基づいて計算されます。かかる税金は、契約型投資信託に関する 2002 年 12 月 20 日に改定されたルクセンブルグ法第 129 条に規定され、その範囲内における「機関投資家」に受益者が限定されるクラス受益証券に帰属する純資産に関しては、0.01%まで軽減されます。ルクセンブルグにおける他の契約型投資信託の受益証券に投資される純資産額については、本「年次税」が免除されますが、ただし、これはかかる受益証券に対して既に同税が課せられている場合に限られます。

財務諸表に対する注記 2008年12月31日現在

注4-管理報酬および投資顧問料

管理会社は、各サブ・ファンドの資産から、当該四半期中の各サブ・ファンド/クラスに帰属する平均純資産額を基準に以下の平均料率で計算される四半期毎の報酬を受領する権利を有します。

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-ヨーロッパ・ボンド・ファンド:

-クラスA受益証券:		年率0.50%
-クラスP(分配型)受益証券:	2億ユーロ以下の部分	年率0.45%
	2億ユーロ超の部分	年率0.40%

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-ユーロ・キャッシュ・ファンド:

-クラスA受益証券:		年率0.20%
-クラスP(元本成長型)受益証券:	2億ユーロ以下の部分	年率0.25%
	2億ユーロ超の部分	年率0.20%
	3億ユーロ超の部分	年率0.15%
-クラスP(分配型)受益証券:	2億ユーロ以下の部分	年率0.25%
	2億ユーロ超の部分	年率0.20%
	3億ユーロ超の部分	年率0.15%

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-グローバル・グローイング・マーケット・ファンド:

-クラスP受益証券:	年率1.00%
------------	---------

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-グローバル・ユーティリティーズ・エクイティ・ファンド:

-クラスP(分配型)受益証券-ユーロ:	年率1.60%
-クラスP(分配型)受益証券:	年率0.35%
-クラスST(分配型)受益証券:	年率0.70%
-クラスSAM(分配型)受益証券:	年率0.70%
-クラスPY(分配型)受益証券:	年率0.35%

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-好配当世界公共株ファンド:

-クラスP(分配型)受益証券:	年率0.70%
-----------------	---------

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-グローバル・インカム・ストック・ファンド:

-クラスA(分配型)受益証券:	年率0.35%
-クラスP(分配型)受益証券:	年率0.35%

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-グローバル・エマージング・ソブリン・ファンド:

-クラスA(分配型)受益証券:	年率0.30%
-クラスP(分配型)受益証券:	年率0.30%

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-グローバル・ハイ・イールド・エマージング・エクイティーズ・ファンド:

財務諸表に対する注記 2008年12月31日現在

注4-管理報酬および投資顧問料

管理会社は、各サブ・ファンドの資産から、当該四半期中の各サブ・ファンド/クラスに帰属する平均純資産額を基準に以下の平均料率で計算される四半期毎の報酬を受領する権利を有します。

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-ヨーロッパ・ボンド・ファンド:

-クラスA受益証券:		年率0.50%
-クラスP(分配型)受益証券:	2億ユーロ以下の部分	年率0.45%
	2億ユーロ超の部分	年率0.40%

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-ユーロ・キャッシュ・ファンド:

-クラスA受益証券:		年率0.20%
-クラスP(元本成長型)受益証券:	2億ユーロ以下の部分	年率0.25%
	2億ユーロ超の部分	年率0.20%
	3億ユーロ超の部分	年率0.15%
-クラスP(分配型)受益証券:	2億ユーロ以下の部分	年率0.25%
	2億ユーロ超の部分	年率0.20%
	3億ユーロ超の部分	年率0.15%

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-グローバル・グローイング・マーケット・ファンド:

-クラスP受益証券:	年率1.00%
------------	---------

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-グローバル・ユーティリティーズ・エクイティ・ファンド:

-クラスP(分配型)受益証券-ユーロ:	年率1.60%
-クラスP(分配型)受益証券:	年率0.35%
-クラスST(分配型)受益証券:	年率0.70%
-クラスSAM(分配型)受益証券:	年率0.70%
-クラスPY(分配型)受益証券:	年率0.35%

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-好配当世界公共株ファンド:

-クラスP(分配型)受益証券:	年率0.70%
-----------------	---------

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-グローバル・インカム・ストック・ファンド:

-クラスA(分配型)受益証券:	年率0.35%
-クラスP(分配型)受益証券:	年率0.35%

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-グローバル・エマージング・ソブリン・ファンド:

-クラスA(分配型)受益証券:	年率0.30%
-クラスP(分配型)受益証券:	年率0.30%

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-グローバル・ハイ・イールド・エマージング・エクイティーズ・ファンド:

財務諸表に対する注記 2008年12月31日現在

-クラスA(分配型)受益証券:	年率0.40%
-クラスP(分配型)受益証券:	年率0.40%
-クラスSAM(分配型)受益証券:	年率0.85%

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-リソース・リッチ・カントリーズ・ソブリン・ファンド:

-クラスA(分配型)受益証券:	年率0.30%
-クラスP(分配型)受益証券:	年率0.30%

投資顧問会社への報酬は、管理会社により負担されます。

注5-販売報酬

管理会社により任命された日本国外の販売会社は、サブ・ファンドの資産から、関連四半期中のサブ・ファンド/クラスに帰属する平均純資産額を基準に以下の比例料率で計算され四半期毎に支払われる報酬を受領する権利を有します。

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-ユーロ・キャッシュ・ファンド: クラスA受益証券: 年率0.20%上限

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-ヨーロッパ・ボンド・ファンド: クラスA受益証券: 年率0.50%上限

日本国外の販売会社は、上述の販売報酬を受領する権利を2001年6月18日の発行をもって不特定期間放棄することを決定しました。

日本における主たる販売会社は、前述のサブ・ファンドの資産から、関連四半期中のサブ・ファンド/クラスに帰属する平均純資産額を基準に以下の比例料率で計算される報酬を受領する権利を有します。

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド: ヨーロッパ・ボンド・ファンド クラスP (分配型) 受益証券:	2億ユーロ以下の部分 2億ユーロ超の部分	年率0.49% 年率0.54%
ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド: ユーロ・キャッシュ・ファンド クラスP(元本成長型) 受益証券:		年率0.40%
ユーロ・キャッシュ・ファンド クラスP(分配型) 受益証券:		年率0.40%
ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド: グローバル・グローイング・マーケット・ファンド クラスP 受益証券:		年率0.70%
ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド: 好配当世界公共株ファンド クラスP(分配型) 受益証券:		年率0.50%

注6-代行協会員報酬

管理会社の代行協会員は、以下の比例料率により、該当するクラスP受益証券の資産から四半期毎に支払われる報酬を受領する権利を有します。

- ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-ヨーロッパ・ボンド・ファンド: クラスP(分配型) 受益証券: 年率0.06%
- ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-ユーロ・キャッシュ・ファンド: クラスP(元本成長型) 受益証券およびクラスP(分配型) 受益証券: 年率0.10%
- ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-グローバル・グローイング・マーケット・ファンド: クラスP 受益証券: 年率0.10%
- ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-好配当世界公共株ファンド: クラスP(分配型) 受益証券: 年率0.20%

財務諸表に対する注記 2008年12月31日現在

-クラス A (分配型) 受益証券:	年率 0.40%
-クラス P (分配型) 受益証券:	年率 0.40%
-クラス SAM (分配型) 受益証券:	年率 0.85%

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-リソース・リッチ・カントリーズ・ソブリン・ファンド:

-クラス A (分配型) 受益証券:	年率 0.30%
-クラス P (分配型) 受益証券:	年率 0.30%

投資顧問会社への報酬は、管理会社により負担されます。

注5-販売報酬

管理会社により任命された日本国外の販売会社は、サブ・ファンドの資産から、関連四半期中のサブ・ファンド/クラスに帰属する平均純資産額を基準に以下の比例料率で計算され四半期毎に支払われる報酬を受領する権利を有します。

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-ユーロ・キャッシュ・ファンド: クラス A 受益証券: 年率 0.20% 上限

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-ヨーロッパ・ボンド・ファンド: クラス A 受益証券: 年率 0.50% 上限

日本国外の販売会社は、上述の販売報酬を受領する権利を 2001 年 6 月 18 日の発行をもって不特定期間放棄することを決定しました。

日本における主たる販売会社は、前述のサブ・ファンドの資産から、関連四半期中のサブ・ファンド/クラスに帰属する平均純資産額を基準に以下の比例料率で計算される報酬を受領する権利を有します。

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド: ヨーロッパ・ボンド・ファンド クラス P (分配型) 受益証券:	2 億ユーロ以下の部分 2 億ユーロ超の部分	年率 0.49% 年率 0.54%
ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド: ユーロ・キャッシュ・ファンド クラス P (元本成長型) 受益証券:		年率 0.40%
ユーロ・キャッシュ・ファンド クラス P (分配型) 受益証券:		年率 0.40%
ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド: グローバル・グローイング・マーケット・ファンド クラス P 受益証券:		年率 0.70%
ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド: 好配当世界公共株ファンド クラス P (分配型) 受益証券:		年率 0.50%

注6-代行協会員報酬

管理会社の代行協会員は、以下の比例料率により、該当するクラス P 受益証券の資産から四半期毎に支払われる報酬を受領する権利を有します。

- ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-ヨーロッパ・ボンド・ファンド: クラス P (分配型) 受益証券: 年率 0.06%
- ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-ユーロ・キャッシュ・ファンド: クラス P (元本成長型) 受益証券およびクラス P (分配型) 受益証券: 年率 0.10%
- ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-グローバル・グローイング・マーケット・ファンド: クラス P 受益証券: 年率 0.10%
- ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-好配当世界公共株ファンド: クラス P (分配型) 受益証券: 年率 0.20%

財務諸表に対する注記 2008年12月31日現在

注7—その他の未払報酬

2008年12月31日現在、その他の未払い報酬には主に保管報酬、管理事務費用、監査費用、販売会社報酬および代行協会員報酬が含まれています。

注8—申込手数料および買戻手数料

販売会社に対する申込手数料が、一口当たり受益証券の純資産価格の最高3%で計算され、請求されます。

以下の受益証券には、申込手数料は課せられません。

- ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド・ユーロ・キャッシュ・ファンド・サブ・ファンドクラスP受益証券
- ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド・グローバル・ユーティリティーズ・エクイティ・ファンド・サブ・ファンドクラスP(分配型)受益証券、クラスST(分配型)受益証券、クラスSAM(分配型)受益証券、クラスP(分配型)受益証券・ユーロ、クラスPY(分配型)受益証券
- ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド・グローバル・インカム・ストック・ファンド・サブ・ファンドクラスA(分配型)受益証券、クラスP(分配型)受益証券
- ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド・グローバル・エマージング・ソブリン・ファンド・サブ・ファンドクラスA(分配型)受益証券、クラスP(分配型)受益証券
- ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・エマージング・エクイティーズ・ファンド・サブ・ファンドクラスA(分配型)受益証券、クラスP(分配型)受益証券、クラスSAM(分配型)受益証券
- ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド・リソース・リッチ・カンTRIES・ソブリン・ファンド・サブ・ファンドクラスA(分配型)受益証券、クラスP(分配型)受益証券

各サブ・ファンドの受益証券は、一口当たり純資産価格で買戻されます。買戻手数料は課せられません。

管理会社は、ファンドの目論見書に定義される「希薄化課金」を課することができる場合があります。

ただし、希薄化課金は、受益証券一口当たり純資産価格の2%を超過することはありません。

注9—2008年12月31日現在の為替レート

2008年12月31日現在、以下の為替レートによりサブ・ファンドの純資産額がユーロに変換されました。

1ユーロ	127.855760	日本円
1ユーロ	1.419600	米ドル

注10—先渡取引

2008年12月31日現在、未決済の先渡取引は以下の通りです。

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド・ヨーロッパ・ボンド・ファンド

			ユーロでの残高
		期日	
EURO-BOBL (0,1M) FUT. (5Y)	7取引 購入	06/03/2009	814,730.50
EURO-SCHATZ (0,1M) FUT. (2Y)	6取引 購入	06/03/2009	644,880.00
EURO-BUND (0,1M) FUT. (10Y)	2取引 購入	06/03/2009	249,940.00

財務諸表に対する注記 2008年12月31日現在

注7—その他の未払報酬

2008年12月31日現在、その他の未払い報酬には主に保管報酬、管理事務費用、監査費用、販売会社報酬および代行協会員報酬が含まれています。

注8—申込手数料および買戻手数料

販売会社に対する申込手続料が、一口当り受益証券の純資産価格の最高3%で計算され、請求されます。

以下の受益証券には、申込手数料は課せられません。

- ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド・ユーロ・キャッシュ・ファンド・サブ・ファンドクラスP受益証券
- ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド・グローバル・ユーティリティーズ・エクイティ・ファンド・サブ・ファンドクラスP(分配型)受益証券、クラスST(分配型)受益証券、クラスSAM(分配型)受益証券、クラスP(分配型)受益証券・ユーロ、クラスPY(分配型)受益証券
- ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド・グローバル・インカム・ストック・ファンド・サブ・ファンドクラスA(分配型)受益証券、クラスP(分配型)受益証券
- ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド・グローバル・エマージング・ソブリン・ファンド・サブ・ファンドクラスA(分配型)受益証券、クラスP(分配型)受益証券
- ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド・グローバル・ハイ・イールド・エマージング・エクイティーズ・ファンド・サブ・ファンドクラスA(分配型)受益証券、クラスP(分配型)受益証券、クラスSAM(分配型)受益証券
- ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド・リソース・リッチ・カンツリーズ・ソブリン・ファンド・サブ・ファンドクラスA(分配型)受益証券、クラスP(分配型)受益証券

各サブ・ファンドの受益証券は、一口当り純資産価格で買戻しされます。買戻し手数料は課せられません。

管理会社は、ファンドの目論見書に定義される「希薄化課金」を課することができる場合があります。

ただし、希薄化課金は、受益証券一口当り純資産価格の2%を超過することはありません。

注9—2008年12月31日現在の為替レート

2008年12月31日現在、以下の為替レートによりサブ・ファンドの純資産額がユーロに変換されました。

1 ユーロ	127.855760	日本円
1 ユーロ	1.419600	米ドル

注10—先渡取引

2008年12月31日現在、未決済の先渡取引は以下の通りです。

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド・ヨーロッパ・ボンド・ファンド

			ユーロでの残高
		期日	
EURO-BOBL (0,1M) FUT. (5Y)	7取引 購入	06/03/2009	814,730.50
EURO-SCHATZ (0,1M) FUT. (2Y)	6取引 購入	06/03/2009	644,880.00
EURO-BUND (0,1M) FUT. (10Y)	2取引 購入	06/03/2009	249,940.00

財務諸表に対する注記 2008年12月31日現在

2008年12月31日現在、これらの契約にかかる未実現純利益は7,522.50ユーロであり、同金額は純資産計算書に含まれています。

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-リソース・リッチ・カンTRIES・ソブリン・ファンド:

			期日	ユーロでの残高
CANADIAN (0,1M) FUT. 10Y	18取引	購入	20/03/2009	2,281,859.82
AUSTRALIA BOND 10Y FUT (0,1M)	14取引	購入	16/03/2009	1,625,785.98
AUSTRALIA BOND 10Y FUT (0,1M)	25取引	購入	16/03/2009	2,684,273.25
LONG GILT LIF. FUT. (0,1M) 10Y	11取引	購入	27/03/2009	1,349,480.00

2008年12月31日現在、これらの契約にかかる未実現純利益は22,568,072.00円であり、同金額は純資産計算書に含まれています。

注11-為替予約契約

2008年12月31日現在の為替予約契約残高は、以下の通りです。

購入		売却		期日
人民元	13,000,000.00	米ドル	2,047,258.28	26/03/2009
インドネシ				
アルピア	10,000,000,030.81	米ドル	1,070,098.45	15/01/2009
米ドル	1,945,366.04	人民元	13,000,000.00	26/03/2009
		インドネシ		
米ドル	204,527.42	アルピア	2,800,000,000.00	15/01/2009
		ハンガリー・フォリ		
米ドル	6,848,455.43	ント	1,378,936,500.00	19/02/2009

2008年12月31日現在、これらの契約にかかる未実現純利益は66,150,306.54円であり、同金額は純資産計算書に含まれています。

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-リソース・リッチ・カンTRIES・ソブリン・

購入		売却		期日
アルゼンチン・ペソ	7,600,000.00	米ドル	2,085,048.01	25/02/2009
ブラジル・レアル	773,070.01	米ドル	327,713.26	05/01/2009
ブラジル・レアル	1,090,000.01	米ドル	433,920.31	05/01/2009
ブラジル・レアル	370,000.00	米ドル	155,887.93	05/01/2009
ブラジル・レアル	936,615.99	米ドル	381,125.53	03/03/2009
チリペソ	779,999,998.00	米ドル	1,158,997.69	12/03/2009
コロンビア・ペソ	1,010,000,001.42	米ドル	432,551.20	26/01/2009
コロンビア・ペソ	2,570,000,003.86	米ドル	1,176,470.59	13/02/2009
インドネシ				
アルピア	11,776,999,949.95	米ドル	1,118,962.70	15/01/2009
インドネシ				
アルピア	5,100,000,011.75	米ドル	398,440.29	12/01/2009
メキシコペソ	8,799,999.96	米ドル	662,655.24	19/02/2009

財務諸表に対する注記 2008年12月31日現在

2008年12月31日現在、これらの契約にかかる未実現純利益は7,522.50ユーロであり、同金額は純資産計算書に含まれています。

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-リソース・リッチ・カンTRIES・ソブリン・ファンド:

		期日	ユーロでの残高
CANADIAN (0,1M) FUT. 10Y	18取引 購入	20/03/2009	2,281,859.82
AUSTRALIA BOND 10Y FUT (0,1M)	14取引 購入	16/03/2009	1,625,785.98
AUSTRALIA BOND 10Y FUT (0,1M)	25取引 購入	16/03/2009	2,684,273.25
LONG GILT LIF. FUT. (0,1M) 10Y	11取引 購入	27/03/2009	1,349,480.00

2008年12月31日現在、これらの契約にかかる未実現純利益は22,568,072.00円であり、同金額は純資産計算書に含まれています。

注11-為替予約契約

2008年12月31日現在の為替予約契約残高は、以下の通りです。

購入		売却		期日
人民元	13,000,000.00	米ドル	2,047,258.28	26/03/2009
インドネシ				
アルピア	10,000,000,030.81	米ドル	1,070,098.45	15/01/2009
米ドル	1,945,366.04	人民元	13,000,000.00	26/03/2009
		インドネシ		
米ドル	204,527.42	アルピア	2,800,000,000.00	15/01/2009
		ハンガリ		
		ー・フォリ		
米ドル	6,848,455.43	ント	1,378,936,500.00	19/02/2009

2008年12月31日現在、これらの契約にかかる未実現純利益は66,150,306.54円であり、同金額は純資産計算書に含まれています。

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-リソース・リッチ・カンTRIES・ソブリン・ンド:

	購入	売却	期日
アルゼンチ			
ン・ベソ	7,600,000.00	米ドル	2,085,048.01
ブラジル・			
レアル	773,070.01	米ドル	327,713.26
ブラジル・			
レアル	1,090,000.01	米ドル	433,920.31
ブラジル・			
レアル	370,000.00	米ドル	155,887.93
レアル	936,615.99	米ドル	381,125.53
チリベソ	779,999,998.00	米ドル	1,158,997.69
コロンビ			
ア・ベソ	1,010,000,001.42	米ドル	432,551.20
コロンビ			
ア・ベソ	2,570,000,003.86	米ドル	1,176,470.59
インドネシ			
アルピア	11,776,999,949.95	米ドル	1,118,962.70
インドネシ			
アルピア	5,100,000,011.75	米ドル	398,440.29
メキシコベ			
ソ	8,799,999.96	米ドル	662,655.24

財務諸表に対する注記 2008年12月31日現在

マレーシ ア・リング ット	900,000.01	米ドル	279,028.50	06/04/2009
マレーシ ア・リング ット	2,150,000.00	米ドル	605,126.69	20/01/2009
ロシア・ル ーブル	35,999,999.95	米ドル	1,237,547.35	16/01/2009
マレーシ ア・リング ット	962,128.45	米ドル	3,100,000.00	06/04/2009
マレーシ ア・リング ット	1,260,183.80	米ドル	11,776,500,014.00	15/01/2009
マレーシ ア・リング ット	441,555.35	米ドル	5,100,000,000.00	12/01/2009
マレーシ ア・リング ット	463,644.85	米ドル	1,083,074,360.00	13/02/2009
マレーシ ア・リング ット	328,638.50	米ドル	770,000,000.00	20/01/2009
マレーシ ア・リング ット	711,952.93	米ドル	1,675,237,000.00	13/02/2009
マレーシ ア・リング ット	507,666.28	米ドル	6,949,999,990.00	15/01/2009
マレーシ ア・リング ット	157,134.83	米ドル	396,454.00	05/01/2009
マレーシ ア・リング ット	358,565.74	米ドル	900,000.00	05/01/2009
マレーシ ア・リング ット	217,575.27	米ドル	510,000,000.00	13/02/2009
マレーシ ア・リング ット	196,459.52	米ドル	614,235.00	09/02/2009
マレーシ ア・リング ット	770,295.43	米ドル	10,416,320.00	19/02/2009
マレーシ ア・リング ット	355,553.07	米ドル	4,000,000,000.00	15/01/2009
マレーシ ア・リング ット	281,440.42	米ドル	3,200,000,000.00	15/01/2009
マレーシ ア・リング ット	390,256.67	米ドル	936,616.00	05/01/2009
南アフリ カ・ランド	2,508,935.97	米ドル	242,958.57	19/02/2009

2008年12月31日現在、これらの契約にかかる未実現純利益は916,657.26円であり、同金額は純資産計算書に含まれています。

注12—分配金の支払

2008年12月31日終了年度中、以下の分配金が支払われました。

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド、ヨーロピアン・ボンド・ファンド：クラスP（分配型）受益証券：

2008年1月	ユーロ	0.03	一口当り
2008年2月	ユーロ	0.03	一口当り
2008年3月	ユーロ	0.03	一口当り
2008年4月	ユーロ	0.03	一口当り

財務諸表に対する注記 2008年12月31日現在

マレーシ ア・リング ット	900,000.01	米ドル	279,028.50	06/04/2009
マレーシ ア・リング ット	2,150,000.00	米ドル	605,126.69	20/01/2009
ロシア・ル ーブル	35,999,999.95	米ドル	1,237,547.35	16/01/2009
マレーシ ア・リング ット	962,128.45	米ドル	3,100,000.00	06/04/2009
マレーシ ア・リング ット	1,260,183.80	米ドル	11,776,500,014.00	15/01/2009
マレーシ ア・リング ット	441,555.35	米ドル	5,100,000,000.00	12/01/2009
マレーシ ア・リング ット	463,644.85	米ドル	1,083,074,360.00	13/02/2009
マレーシ ア・リング ット	328,638.50	米ドル	770,000,000.00	20/01/2009
マレーシ ア・リング ット	711,952.93	米ドル	1,675,237,000.00	13/02/2009
マレーシ ア・リング ット	507,666.28	米ドル	6,949,999,990.00	15/01/2009
マレーシ ア・リング ット	157,134.83	米ドル	396,454.00	05/01/2009
マレーシ ア・リング ット	358,565.74	米ドル	900,000.00	05/01/2009
マレーシ ア・リング ット	217,575.27	米ドル	510,000,000.00	13/02/2009
マレーシ ア・リング ット	196,459.52	米ドル	614,235.00	09/02/2009
マレーシ ア・リング ット	770,295.43	米ドル	10,416,320.00	19/02/2009
マレーシ ア・リング ット	355,553.07	米ドル	4,000,000,000.00	15/01/2009
マレーシ ア・リング ット	281,440.42	米ドル	3,200,000,000.00	15/01/2009
マレーシ ア・リング ット	390,256.67	米ドル	936,616.00	05/01/2009
南アフリ カ・ランド	2,508,935.97	米ドル	242,958.57	19/02/2009

2008年12月31日現在、これらの契約にかかる未実現純利益は916,657.26円であり、同金額は純資産計算書に含まれています。

注12—分配金の支払

2008年12月31日終了年度中、以下の分配金が支払われました。

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド- ヨーロピアン・ボンド・ファンド：クラスP（分配型）受益証券：

2008年1月	ユーロ	0.03	一口当り
2008年2月	ユーロ	0.03	一口当り
2008年3月	ユーロ	0.03	一口当り
2008年4月	ユーロ	0.03	一口当り

財務諸表に対する注記 2008年12月31日現在

2008年5月	ユーロ	0.03	一口当り
2008年6月	ユーロ	0.03	一口当り
2008年7月	ユーロ	0.03	一口当り
2008年8月	ユーロ	0.03	一口当り
2008年9月	ユーロ	0.03	一口当り
2008年10月	ユーロ	0.03	一口当り
2008年11月	ユーロ	0.03	一口当り
2008年12月	ユーロ	0.03	一口当り

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-ユーロ・キャッシュ・ファンド：クラス P (分配型)受益証券：

2008年1月	ユーロ	0.000034	一口当り
2008年2月	ユーロ	0.000032	一口当り
2008年3月	ユーロ	0.000025	一口当り
2008年4月	ユーロ	0.000027	一口当り
2008年5月	ユーロ	0.000032	一口当り
2008年6月	ユーロ	0.000029	一口当り
2008年7月	ユーロ	0.000028	一口当り
2008年8月	ユーロ	0.000034	一口当り
2008年9月	ユーロ	0.000031	一口当り
2008年10月	ユーロ	0.000028	一口当り
2008年11月	ユーロ	0.000026	一口当り
2008年12月	ユーロ	0.000017	一口当り

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-グローバル・ユーティリティーズ・エクイティ・ファンド：クラス ST (分配型) 受益証券：

2008年1月	日本円	40	一口当り
2008年2月	日本円	40	一口当り
2008年3月	日本円	40	一口当り
2008年4月	日本円	40	一口当り
2008年5月	日本円	40	一口当り
2008年6月	日本円	40	一口当り
2008年7月	日本円	40	一口当り
2008年8月	日本円	40	一口当り
2008年9月	日本円	40	一口当り
2008年10月	日本円	40	一口当り
2008年11月	日本円	40	一口当り
2008年12月	日本円	40	一口当り

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-グローバル・ユーティリティーズ・エクイティ・ファンド：クラス P (分配型) 受益証券-ユーロ：

2008年2月	ユーロ	4.63	一口当り
---------	-----	------	------

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-グローバル・ユーティリティーズ・エクイティ・ファンド：クラス P (分配型) 受益証券：

2008年1月	日本円	40	一口当り
2008年2月	日本円	40	一口当り
2008年3月	日本円	40	一口当り
2008年4月	日本円	40	一口当り
2008年5月	日本円	40	一口当り
2008年6月	日本円	40	一口当り

財務諸表に対する注記 2008年12月31日現在

2008年5月	ユーロ	0.03	一口当り
2008年6月	ユーロ	0.03	一口当り
2008年7月	ユーロ	0.03	一口当り
2008年8月	ユーロ	0.03	一口当り
2008年9月	ユーロ	0.03	一口当り
2008年10月	ユーロ	0.03	一口当り
2008年11月	ユーロ	0.03	一口当り
2008年12月	ユーロ	0.03	一口当り

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-ユーロ・キャッシュ・ファンド：クラス P (分配型)受益証券：

2008年1月	ユーロ	0.000034	一口当り
2008年2月	ユーロ	0.000032	一口当り
2008年3月	ユーロ	0.000025	一口当り
2008年4月	ユーロ	0.000027	一口当り
2008年5月	ユーロ	0.000032	一口当り
2008年6月	ユーロ	0.000029	一口当り
2008年7月	ユーロ	0.000028	一口当り
2008年8月	ユーロ	0.000034	一口当り
2008年9月	ユーロ	0.000031	一口当り
2008年10月	ユーロ	0.000028	一口当り
2008年11月	ユーロ	0.000026	一口当り
2008年12月	ユーロ	0.000017	一口当り

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-グローバル・ユーティリティーズ・エクイティ・ファンド：クラス ST (分配型) 受益証券：

2008年1月	日本円	40	一口当り
2008年2月	日本円	40	一口当り
2008年3月	日本円	40	一口当り
2008年4月	日本円	40	一口当り
2008年5月	日本円	40	一口当り
2008年6月	日本円	40	一口当り
2008年7月	日本円	40	一口当り
2008年8月	日本円	40	一口当り
2008年9月	日本円	40	一口当り
2008年10月	日本円	40	一口当り
2008年11月	日本円	40	一口当り
2008年12月	日本円	40	一口当り

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-グローバル・ユーティリティーズ・エクイティ・ファンド：クラス P (分配型) 受益証券-ユーロ：

2008年2月	ユーロ	4.63	一口当り
---------	-----	------	------

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-グローバル・ユーティリティーズ・エクイティ・ファンド：クラス P (分配型) 受益証券：

2008年1月	日本円	40	一口当り
2008年2月	日本円	40	一口当り
2008年3月	日本円	40	一口当り
2008年4月	日本円	40	一口当り
2008年5月	日本円	40	一口当り
2008年6月	日本円	40	一口当り

財務諸表に対する注記 2008年12月31日現在

2008年7月	日本円	40	一口当り
2008年8月	日本円	40	一口当り
2008年9月	日本円	40	一口当り
2008年10月	日本円	40	一口当り
2008年11月	日本円	40	一口当り
2008年12月	日本円	40	一口当り

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-グローバル・ユーティリティーズ・エクイティ・ファンド：クラスSAM（分配型）受益証券：

2008年1月	日本円	40	一口当り
2008年2月	日本円	40	一口当り
2008年3月	日本円	40	一口当り
2008年4月	日本円	40	一口当り
2008年5月	日本円	40	一口当り
2008年6月	日本円	40	一口当り
2008年7月	日本円	40	一口当り
2008年8月	日本円	40	一口当り
2008年9月	日本円	40	一口当り
2008年10月	日本円	40	一口当り
2008年11月	日本円	40	一口当り
2008年12月	日本円	40	一口当り

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-グローバル・ユーティリティーズ・エクイティ・ファンド：クラスI（分配型）受益証券：

2008年2月	米ドル	1.02	一口当り
---------	-----	------	------

財務諸表に対する注記 2008年12月31日現在

2008年7月	日本円	40	一口当り
2008年8月	日本円	40	一口当り
2008年9月	日本円	40	一口当り
2008年10月	日本円	40	一口当り
2008年11月	日本円	40	一口当り
2008年12月	日本円	40	一口当り

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-グローバル・ユーティリティーズ・エクイティ・ファンド：クラスSAM（分配型）受益証券：

2008年1月	日本円	40	一口当り
2008年2月	日本円	40	一口当り
2008年3月	日本円	40	一口当り
2008年4月	日本円	40	一口当り
2008年5月	日本円	40	一口当り
2008年6月	日本円	40	一口当り
2008年7月	日本円	40	一口当り
2008年8月	日本円	40	一口当り
2008年9月	日本円	40	一口当り
2008年10月	日本円	40	一口当り
2008年11月	日本円	40	一口当り
2008年12月	日本円	40	一口当り

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-グローバル・ユーティリティーズ・エクイティ・ファンド：クラスI（分配型）受益証券：

2008年2月	米ドル	1.02	一口当り
---------	-----	------	------

財務諸表に対する注記 2008年12月31日現在

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-好配当世界公共株ファンド：クラスP(分配型)受益証券：

2008年1月	米ドル	0.03	一口当り
2008年2月	米ドル	0.03	一口当り
2008年3月	米ドル	0.03	一口当り
2008年4月	米ドル	0.03	一口当り
2008年5月	米ドル	0.03	一口当り
2008年6月	米ドル	0.59	一口当り
2008年7月	米ドル	0.03	一口当り
2008年8月	米ドル	0.03	一口当り
2008年9月	米ドル	0.03	一口当り
2008年10月	米ドル	0.03	一口当り
2008年11月	米ドル	0.03	一口当り
2008年12月	米ドル	0.03	一口当り

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-グローバル・インカム・ストック・ファンド：クラスP（分配型）受益証券：

2008年1月	日本円	60	一口当り
2008年2月	日本円	60	一口当り
2008年3月	日本円	60	一口当り
2008年4月	日本円	60	一口当り
2008年5月	日本円	60	一口当り
2008年6月	日本円	60	一口当り
2008年7月	日本円	60	一口当り
2008年8月	日本円	60	一口当り
2008年9月	日本円	60	一口当り
2008年10月	日本円	60	一口当り
2008年11月	日本円	60	一口当り
2008年12月	日本円	60	一口当り

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-グローバル・エマージング・ソブリン・ファンド：クラスP（分配型）受益証券：

2008年1月	日本円	60	一口当り
2008年2月	日本円	60	一口当り
2008年3月	日本円	60	一口当り
2008年4月	日本円	60	一口当り
2008年5月	日本円	60	一口当り
2008年6月	日本円	60	一口当り
2008年7月	日本円	60	一口当り
2008年8月	日本円	60	一口当り
2008年9月	日本円	60	一口当り
2008年10月	日本円	60	一口当り
2008年11月	日本円	60	一口当り
2008年12月	日本円	60	一口当り

財務諸表に対する注記 2008年12月31日現在

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-好配当世界公共株ファンド：クラスP(分配型)受益証券：

2008年1月	米ドル	0.03	一口当り
2008年2月	米ドル	0.03	一口当り
2008年3月	米ドル	0.03	一口当り
2008年4月	米ドル	0.03	一口当り
2008年5月	米ドル	0.03	一口当り
2008年6月	米ドル	0.59	一口当り
2008年7月	米ドル	0.03	一口当り
2008年8月	米ドル	0.03	一口当り
2008年9月	米ドル	0.03	一口当り
2008年10月	米ドル	0.03	一口当り
2008年11月	米ドル	0.03	一口当り
2008年12月	米ドル	0.03	一口当り

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-グローバル・インカム・ストック・ファンド：クラスP(分配型)受益証券：

2008年1月	日本円	60	一口当り
2008年2月	日本円	60	一口当り
2008年3月	日本円	60	一口当り
2008年4月	日本円	60	一口当り
2008年5月	日本円	60	一口当り
2008年6月	日本円	60	一口当り
2008年7月	日本円	60	一口当り
2008年8月	日本円	60	一口当り
2008年9月	日本円	60	一口当り
2008年10月	日本円	60	一口当り
2008年11月	日本円	60	一口当り
2008年12月	日本円	60	一口当り

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-グローバル・エマージング・ソブリン・ファンド：クラスP(分配型)受益証券：

2008年1月	日本円	60	一口当り
2008年2月	日本円	60	一口当り
2008年3月	日本円	60	一口当り
2008年4月	日本円	60	一口当り
2008年5月	日本円	60	一口当り
2008年6月	日本円	60	一口当り
2008年7月	日本円	60	一口当り
2008年8月	日本円	60	一口当り
2008年9月	日本円	60	一口当り
2008年10月	日本円	60	一口当り
2008年11月	日本円	60	一口当り
2008年12月	日本円	60	一口当り

財務諸表に対する注記 2008年12月31日現在

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-グローバル・ハイ・イールド・エマージ
ング・エクイティーズ・ファンド：クラスP(分配型) 受益証券：

2008年1月	日本円	60	一口当り
2008年2月	日本円	60	一口当り
2008年3月	日本円	60	一口当り
2008年4月	日本円	60	一口当り
2008年5月	日本円	60	一口当り
2008年6月	日本円	60	一口当り
2008年7月	日本円	60	一口当り
2008年8月	日本円	60	一口当り
2008年9月	日本円	60	一口当り
2008年10月	日本円	60	一口当り
2008年11月	日本円	60	一口当り
2008年12月	日本円	60	一口当り

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-グローバル・ハイ・イールド・エマージ
ング・エクイティーズ・ファンド：クラスSAM(分配型) 受益証券：

2008年1月	日本円	60	一口当り
2008年2月	日本円	60	一口当り
2008年3月	日本円	60	一口当り
2008年4月	日本円	60	一口当り
2008年5月	日本円	60	一口当り
2008年6月	日本円	60	一口当り
2008年7月	日本円	60	一口当り
2008年8月	日本円	60	一口当り
2008年9月	日本円	60	一口当り
2008年10月	日本円	60	一口当り
2008年11月	日本円	60	一口当り
2008年12月	日本円	60	一口当り

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-リソース・リッチ・カンTRIES・ソブリ
ン・ファンド：クラスP(分配型) 受益証券：

2008年8月	日本円	80	一口当り
2008年9月	日本円	80	一口当り
2008年10月	日本円	80	一口当り
2008年11月	日本円	80	一口当り
2008年12月	日本円	80	一口当り

財務諸表に対する注記 2008年12月31日現在

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド- グローバル・ハイ・イールド・エマージング・エクイティーズ・ファンド：クラスP（分配型）受益証券：

2008年1月	日本円	60	一口当り
2008年2月	日本円	60	一口当り
2008年3月	日本円	60	一口当り
2008年4月	日本円	60	一口当り
2008年5月	日本円	60	一口当り
2008年6月	日本円	60	一口当り
2008年7月	日本円	60	一口当り
2008年8月	日本円	60	一口当り
2008年9月	日本円	60	一口当り
2008年10月	日本円	60	一口当り
2008年11月	日本円	60	一口当り
2008年12月	日本円	60	一口当り

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド- グローバル・ハイ・イールド・エマージング・エクイティーズ・ファンド：クラスSAM（分配型）受益証券：

2008年1月	日本円	60	一口当り
2008年2月	日本円	60	一口当り
2008年3月	日本円	60	一口当り
2008年4月	日本円	60	一口当り
2008年5月	日本円	60	一口当り
2008年6月	日本円	60	一口当り
2008年7月	日本円	60	一口当り
2008年8月	日本円	60	一口当り
2008年9月	日本円	60	一口当り
2008年10月	日本円	60	一口当り
2008年11月	日本円	60	一口当り
2008年12月	日本円	60	一口当り

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-リソース・リッチ・カンTRIES・ソブリン・ファンド：クラスP（分配型）受益証券：

2008年8月	日本円	80	一口当り
2008年9月	日本円	80	一口当り
2008年10月	日本円	80	一口当り
2008年11月	日本円	80	一口当り
2008年12月	日本円	80	一口当り

財務諸表に対する注記 2008年12月31日現在

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド- グローバル・ハイ・イールド・エマージング・エクイティーズ・ファンド：クラスP（分配型）受益証券：

2008年1月	日本円	60	一口当り
2008年2月	日本円	60	一口当り
2008年3月	日本円	60	一口当り
2008年4月	日本円	60	一口当り
2008年5月	日本円	60	一口当り
2008年6月	日本円	60	一口当り
2008年7月	日本円	60	一口当り
2008年8月	日本円	60	一口当り
2008年9月	日本円	60	一口当り
2008年10月	日本円	60	一口当り
2008年11月	日本円	60	一口当り
2008年12月	日本円	60	一口当り

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド- グローバル・ハイ・イールド・エマージング・エクイティーズ・ファンド：クラスSAM（分配型）受益証券：

2008年1月	日本円	60	一口当り
2008年2月	日本円	60	一口当り
2008年3月	日本円	60	一口当り
2008年4月	日本円	60	一口当り
2008年5月	日本円	60	一口当り
2008年6月	日本円	60	一口当り
2008年7月	日本円	60	一口当り
2008年8月	日本円	60	一口当り
2008年9月	日本円	60	一口当り
2008年10月	日本円	60	一口当り
2008年11月	日本円	60	一口当り
2008年12月	日本円	60	一口当り

ビクテ・グローバル・セレクション・ファンド-リソース・リッチ・カンTRIES・ソブリン・ファンド：クラスP（分配型）受益証券：

2008年8月	日本円	80	一口当り
2008年9月	日本円	80	一口当り
2008年10月	日本円	80	一口当り
2008年11月	日本円	80	一口当り
2008年12月	日本円	80	一口当り

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

	前期 (自平成20年4月15日 至平成20年10月14日)	当期 (自平成20年10月15日 至平成21年4月14日)
1.資産の評価基準及び評価方法	投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価評価して おります。時価評価にあたっては、原 則として、本ファンドの基準価額計 算日の前営業日の基準価額で評価し ております。	投資信託受益証券 同左
2.収益及び費用の計上基準	受取配当金 原則として、当該投資信託受益証券 の配当落ち日において100%で計上 しております。	受取配当金 同左

(貸借対照表に関する注記)

	前期 (平成20年10月14日現在)	当期 (平成21年4月14日現在)
1.期首元本額	181,150,087,994円	229,317,508,745円
期中追加設定元本額	53,895,369,335円	18,960,785,832円
期中一部解約元本額	5,727,948,584円	7,752,615,279円
期末元本額	229,317,508,745円	240,525,679,298円
2.元本の欠損	純資産額は、元本を 58,045,148,434円下回っており ます。	純資産額は、元本を 60,960,517,751円下回っており ます。
3.特定期間末日における受益権の総数	229,317,508,745口	240,525,679,298口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

	前期 (自平成20年4月15日 至平成20年10月14日)	当期 (自平成20年10月15日 至平成21年4月14日)
分配金の計 算過程	平成20年4月15日から平成20年5月14日までの 計算期間末において、経費控除後の配当等収益 (762,752,543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 (9,783,236,572円)及び分配準備積立金 (8,437,814,283円)により、分配対象収益は 18,983,803,398円(1万口当たり1,014円33 銭)であり、うち1,310,081,915円(1万口当 たり70円)を分配金額としております。	平成20年10月15日から平成20年11月14日ま での計算期間末において、経費控除後の配当等収 益(841,377,656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(12,253,111,388円)及び分配準備積立金 (5,780,994,251円)により、分配対象収益は 18,875,483,295円(1万口当たり814円94銭) であり、うち1,389,706,743円(1万口当 たり60円)を分配金額としております。

<p>平成20年5月15日から平成20年6月16日までの計算期間末において、経費控除後の配当等収益（783,785,737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（10,574,163,347円）及び分配準備積立金（7,875,734,706円）により、分配対象収益は19,233,683,790円（1万口当たり984円76銭）であり、うち1,367,188,982円（1万口当たり70円）を分配金額としております。</p>	<p>平成20年11月15日から平成20年12月15日までの計算期間末において、経費控除後の配当等収益（850,702,215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（11,010,203,030円）及び分配準備積立金（6,580,127,060円）により、分配対象収益は18,441,032,305円（1万口当たり791円64銭）であり、うち1,397,678,636円（1万口当たり60円）を分配金額としております。</p>
<p>平成20年6月17日から平成20年7月14日までの計算期間末において、経費控除後の配当等収益（722,789,693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（11,159,245,674円）及び分配準備積立金（7,272,922,500円）により、分配対象収益は19,154,957,867円（1万口当たり951円01銭）であり、うち1,409,910,290円（1万口当たり70円）を分配金額としております。</p>	<p>平成20年12月16日から平成21年1月14日までの計算期間末において、経費控除後の配当等収益（851,864,957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（11,104,266,106円）及び分配準備積立金（6,001,852,308円）により、分配対象収益は17,957,983,371円（1万口当たり768円18銭）であり、うち1,402,625,016円（1万口当たり60円）を分配金額としております。</p>
<p>平成20年7月15日から平成20年8月14日までの計算期間末において、経費控除後の配当等収益（733,975,855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（11,925,248,366円）及び分配準備積立金（6,562,973,724円）により、分配対象収益は19,222,197,945円（1万口当たり916円40銭）であり、うち1,468,297,988円（1万口当たり70円）を分配金額としております。</p>	<p>平成21年1月15日から平成21年2月16日までの計算期間末において、経費控除後の配当等収益（851,084,027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（11,209,431,572円）及び分配準備積立金（5,427,401,584円）により、分配対象収益は17,487,917,183円（1万口当たり744円57銭）であり、うち1,409,228,034円（1万口当たり60円）を分配金額としております。</p>
<p>平成20年8月15日から平成20年9月16日までの計算期間末において、経費控除後の配当等収益（755,724,845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（12,777,183,938円）及び分配準備積立金（5,809,863,581円）により、分配対象収益は19,342,772,364円（1万口当たり881円44銭）であり、うち1,536,105,596円（1万口当たり70円）を分配金額としております。</p>	<p>平成21年2月17日から平成21年3月16日までの計算期間末において、経費控除後の配当等収益（958,614,250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（11,366,396,264円）及び分配準備積立金（4,841,545,410円）により、分配対象収益は17,166,555,924円（1万口当たり725円29銭）であり、うち1,420,106,785円（1万口当たり60円）を分配金額としております。</p>
<p>平成20年9月17日から平成20年10月14日までの計算期間末において、経費控除後の配当等収益（838,088,578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（13,635,343,066円）及び分配準備積立金（4,980,563,323円）により、分配対象収益は19,453,994,967円（1万口当たり848円34銭）であり、うち1,605,222,561円（1万口当たり70円）を分配金額としております。</p>	<p>平成21年3月17日から平成21年4月14日までの計算期間末において、経費控除後の配当等収益（970,282,020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（11,638,713,262円）及び分配準備積立金（4,367,193,140円）により、分配対象収益は16,976,188,422円（1万口当たり705円79銭）であり、うち1,443,154,075円（1万口当たり60円）を分配金額としております。</p>

（有価証券に関する注記）

前期（平成20年10月14日現在）

売買目的有価証券の貸借対照表計上額及び最終の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)	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	170,796,039,209	33,536,817,986
合 計	170,796,039,209	33,536,817,986

当期(平成21年4月14日現在)

売買目的有価証券の貸借対照表計上額及び最終の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)	最終の計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
投資信託受益証券	178,142,739,204	11,403,101,588
合 計	178,142,739,204	11,403,101,588

(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

前 期 (自 平成20年 4月15日 至 平成20年10月14日)	当 期 (自 平成20年10月15日 至 平成21年 4月14日)
該当事項はありません。	同左

取引の時価等に関する事項

前 期 (平成20年10月14日現在)	当 期 (平成21年4月14日現在)
該当事項はありません。	同左

(関連当事者との取引に関する注記)

前 期 (自 平成20年 4月15日 至 平成20年10月14日)	当 期 (自 平成20年10月15日 至 平成21年 4月14日)
当特定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)

前 期 (平成20年10月14日現在)	当 期 (平成21年4月14日現在)
1口当たり純資産額 = 0.7469円	1口当たり純資産額 = 0.7466円

(4)【附属明細表】(平成21年4月14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）
投資信託 受益証券	住信 FOFs用外国債券オープン （適格機関投資家専用）	44,366,041,357	37,449,375,509
	住信 FOFs用日本株式インデックス・オープン （適格機関投資家専用）	25,687,115,035	12,846,126,229
	JPM・US・セレクト（適格機関投資家専用）	35,167,270,316	30,806,528,796
	ピクテ・ユーロ・セレクト・インカム （適格機関投資家専用）	33,102,282,487	28,934,705,121
	ピクテ・ハイインカム・ソブリン・ファンド （適格機関投資家専用）	32,768,218,274	26,365,308,423
	LM・オーストラリア毎月分配型ファンド （適格機関投資家専用）	33,220,198,785	26,303,753,397
	グローバル・ユーティリティーズ・エクイティ・ ファンド クラスSAM分配型受益証券	1,888,773	15,436,941,729
合 計		204,313,015,027	178,142,739,204

2) 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

3) デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

[次へ](#)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】（平成21年5月29日現在）

資産総額	183,161,972,521 円
負債総額	157,311,632 円
純資産総額（ - ）	183,004,660,889 円
発行済口数	247,685,229,318 口
1口当たり純資産額（ / ）	0.7389 円

第5【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期特定期間 （平成17年10月21日～平成18年 4月14日）	99,598,692,932	938,557,614	98,660,135,318
第2期特定期間 （平成18年 4月15日～平成18年10月16日）	51,325,241,723	2,611,569,939	147,373,807,102
第3期特定期間 （平成18年10月17日～平成19年 4月16日）	10,967,075,152	9,138,420,831	149,202,461,423
第4期特定期間 （平成19年 4月17日～平成19年10月15日）	13,091,645,130	8,031,321,576	154,262,784,977
第5期特定期間 （平成19年10月16日～平成20年 4月14日）	31,731,537,090	4,844,234,073	181,150,087,994
第6期特定期間 （平成20年 4月15日～平成20年10月14日）	53,895,369,335	5,727,948,584	229,317,508,745
第7期特定期間 （平成20年10月15日～平成21年 4月14日）	18,960,785,832	7,752,615,279	240,525,679,298

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

第三部【特別情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(イ) 資本金の額

本書提出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

(1) 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、取締役会長が招集し、その議長となります。取締役会長を置かないときまたは事故があるときは、取締役社長がこれにあたり、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。

(2) 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21年5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（公募）は次のとおりです。

	本数（本）	純資産額の合計額（百万円）
追加型株式投資信託	86	720,385
追加型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	0	0
単位型公社債投資信託	0	0
合計	86	720,385

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19年4月1日至平成20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20年4月1日至平成21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19年4月1日至平成20年3月31日）及び当事業年度（自平成20年4月1日至平成21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20年3月31日現在)		当事業年度 (平成21年3月31日現在)	
資産の部				
流動資産				
現金及び預金	2	4,809,141	2	4,620,293
有価証券		322,773		324,008
前払費用		32,941		33,583
未収委託者報酬		1,075,693		762,027
未収運用受託報酬		48,435		37,916
未収還付法人税等		-		108,554

未収消費税等	-	13,438
繰延税金資産	71,628	26,084
その他	3,946	4,235
流動資産合計	6,364,560	5,930,144
固定資産		
有形固定資産		
建物	81,174	63,983
器具備品	59,007	40,445
有形固定資産合計	140,181	104,428
無形固定資産		
ソフトウェア	43,275	83,031
その他無形固定資産	166	146
無形固定資産合計	43,441	83,178
投資その他の資産		
投資有価証券	261,726	294,353
敷金・保証金	238,033	238,033
会員権	2,500	-
長期前払費用	570	225
繰延税金資産	23,832	55,356
その他の投資	285	255
投資その他の資産合計	526,947	588,223
固定資産合計	710,570	775,830
資産合計	7,075,130	6,705,974

(単位：千円)

	前事業年度 (平成20年3月31日現在)	当事業年度 (平成21年3月31日現在)
負債の部		
流動負債		
預り金	14,005	17,703
未払金	610,747	465,995
未払収益分配金	100	130
未払手数料	2 520,902	2 361,950
その他未払金	89,745	103,914
未払費用	2 158,863	2 85,253
未払法人税等	618,530	-
未払消費税等	71,360	-

賞与引当金	59,936	79,979
流動負債合計	1,533,444	648,932
固定負債		
退職給付引当金	44,738	91,962
固定負債合計	44,738	91,962
負債合計	1,578,182	740,894
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	44,500	47,500
その他利益剰余金		
別途積立金	3,100,000	4,100,000
繰越利益剰余金	2,054,686	1,542,542
利益剰余金合計	5,199,186	5,690,042
株主資本合計	5,499,186	5,990,042
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	2,238	24,962
評価・換算差額等合計	2,238	24,962
純資産合計	5,496,948	5,965,080
負債・純資産合計	7,075,130	6,705,974

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	(自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	11,628,333	9,373,528
運用受託報酬	105,668	99,489
営業収益合計	11,734,002	9,473,018
営業費用		
支払手数料	1 5,656,622	1 4,753,041
広告宣伝費	380,399	227,750
公告費	2,022	2,934
調査費	1,197,613	881,688

調査費	95,038	80,845
委託調査費	1,100,389	798,694
図書費	2,185	2,148
営業雑経費	617,898	650,350
通信費	11,892	10,965
印刷費	166,508	177,337
協会費	8,220	10,450
諸会費	456	586
情報機器関連費	364,302	400,645
その他営業雑経費	66,519	50,366
営業費用合計	7,854,556	6,515,764
一般管理費		
給料	1,153,815	1,346,925
役員報酬	41,177	39,900
給料・手当	972,284	1,127,586
賞与	140,354	179,439
退職給付費用	41,193	65,654
役員退職慰労金	1,830	-
福利費	107,788	149,509
交際費	1,943	1,777
旅費交通費	56,876	54,749
租税公課	19,959	16,216
不動産賃借料	139,555	238,033
寄付金	-	3,960
減価償却費	37,057	60,600
諸経費	281,363	158,896
一般管理費合計	1,841,384	2,096,324
営業利益	2,038,060	860,928

(単位：千円)

	前事業年度	当事業年度
	(自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	(自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	2,531	2,532
有価証券利息	1,582	1,544
受取利息	1 8,213	1 12,425

投資有価証券売却益		88		291
その他		3,682		5,943
営業外収益合計		16,099		22,737
営業外費用				
支払保証料	1	125	1	64
投資有価証券売却損		-		2,275
投資有価証券評価損		-		637
固定資産除却損		-	2	24
その他		7		1,759
営業外費用合計		133		4,762
経常利益		2,054,026		878,903
特別損失				
減損損失		13,397		-
特別損失合計		13,397		-
税引前当期純利益		2,040,628		878,903
法人税、住民税及び事業税		877,218		328,438
法人税等調整額		46,164		29,609
法人税等合計		831,053		358,047
当期純利益		1,209,574		520,856

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	当事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)
株主資本		
資本金		
前期末残高	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	41,500	44,500
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	44,500	47,500
その他利益剰余金		
別途積立金		
前期末残高	2,100,000	3,100,000
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	3,100,000	4,100,000
繰越利益剰余金		
前期末残高	1,878,111	2,054,686
当期変動額		
剰余金の配当	33,000	33,000
当期純利益	1,209,574	520,856
別途積立金の積立	1,000,000	1,000,000
当期変動額合計	176,574	512,143
当期末残高	2,054,686	1,542,542
利益剰余金合計		
前期末残高	4,019,611	5,199,186
当期変動額		
剰余金の配当	30,000	30,000
当期純利益	1,209,574	520,856
当期変動額合計	1,179,574	490,856
当期末残高	5,199,186	5,690,042
株主資本合計		
前期末残高	4,319,611	5,499,186
当期変動額		
剰余金の配当	30,000	30,000
当期純利益	1,209,574	520,856
当期変動額合計	1,179,574	490,856
当期末残高	5,499,186	5,990,042

(単位：千円)

	前事業年度 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	当事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21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	40	2,238
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	2,278	22,724
当期変動額合計	2,278	22,724
当期末残高	2,238	24,962
評価・換算差額等合計		
前期末残高	40	2,238
当期変動額		
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	2,278	22,724
当期変動額合計	2,278	22,724
当期末残高	2,238	24,962
純資産合計		
前期末残高	4,319,652	5,496,948
当期変動額		
剰余金の配当	30,000	30,000
当期純利益	1,209,574	520,856
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	2,278	22,724
当期変動額合計	1,177,296	468,132
当期末残高	5,496,948	5,965,080

重要な会計方針

期別	前事業年度 (自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日)	当事業年度 (自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日)
1 有価証券の評価 基準及び評価方法	<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>(会計方針の変更)</p>	<p>有形固定資産</p> <p>同 左</p>

	<p>法人税法の改正（（所得税法等の一部を改正する法律 平成19年3月30日 法律第6号）及び（法人税法施行令の一部を改正する政令 平成19年3月30日 政令第83号））に伴い、平成19年4月1日以降に取得したのものについては、改正後の法人税法に基づく方法に変更しております。</p> <p>当該変更に伴う損益に与える影響は軽微であります。</p> <p>（追加情報）</p> <p>平成19年3月31日以前に取得したのものについては、償却可能限度額まで償却が終了した翌年から5年間で均等償却する方法によっております。</p> <p>当該変更に伴う損益に与える影響は軽微であります。</p> <p>無形固定資産</p> <p>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>	-	
		-	
			無形固定資産
			同左
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>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。</p>	<p>（1）賞与引当金</p> <p>同左</p> <p>（2）退職給付引当金</p> <p>同左</p>	
4 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>消費税等の会計処理</p> <p>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。</p>	同左	

会計方針の変更

前事業年度 (自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日)	当事業年度 (自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日)
	リース取引に関する会計基準

-	<p>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。</p>
---	--

表示方法の変更

前事業年度 (自 平成19年4月 1日 至 平成20年3月31日)	当事業年度 (自 平成20年4月 1日 至 平成21年3月31日)
<p>金融商品取引法の施行に伴い、表示科目をより明瞭にするため、以下の表示方法の変更を行っております。</p> <p>(貸借対照表)</p> <p>前事業年度において「未収投資顧問料」として表示しておりました投資一任契約の未収運用受託報酬は、当事業年度においては「未収運用受託報酬」として表示しております。</p> <p>(損益計算書)</p> <p>前事業年度において「投資顧問料」として表示しておりました投資一任契約の運用受託報酬は、当事業年度においては「運用受託報酬」として表示しております。</p>	-

注記事項

(貸借対照表関係)

前事業年度 (平成20年3月31日現在)	当事業年度 (平成21年3月31日現在)												
<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="padding-left: 20px;">建 物</td> <td style="text-align: right;">5,783千円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">器具備品</td> <td style="text-align: right;">63,941千円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 40px;">計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">69,724千円</td> </tr> </table>	建 物	5,783千円	器具備品	63,941千円	計	69,724千円	<p>1 有形固定資産の減価償却累計額</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="padding-left: 20px;">建 物</td> <td style="text-align: right;">24,134千円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">器具備品</td> <td style="text-align: right;">93,840千円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 40px;">計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">117,974千円</td> </tr> </table>	建 物	24,134千円	器具備品	93,840千円	計	117,974千円
建 物	5,783千円												
器具備品	63,941千円												
計	69,724千円												
建 物	24,134千円												
器具備品	93,840千円												
計	117,974千円												
<p>2 関係会社に対するものは次のとおりであります。</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="padding-left: 20px;">預金</td> <td style="text-align: right;">3,075,396千円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">未払手数料</td> <td style="text-align: right;">455,445千円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">未払費用</td> <td style="text-align: right;">152,424千円</td> </tr> </table>	預金	3,075,396千円	未払手数料	455,445千円	未払費用	152,424千円	<p>2 関係会社に対するものは次のとおりであります。</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="padding-left: 20px;">預金</td> <td style="text-align: right;">2,832,577千円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">未払手数料</td> <td style="text-align: right;">305,246千円</td> </tr> <tr> <td style="padding-left: 20px;">未払費用</td> <td style="text-align: right;">80,084千円</td> </tr> </table>	預金	2,832,577千円	未払手数料	305,246千円	未払費用	80,084千円
預金	3,075,396千円												
未払手数料	455,445千円												
未払費用	152,424千円												
預金	2,832,577千円												
未払手数料	305,246千円												
未払費用	80,084千円												

(損益計算書関係)

前事業年度 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	当事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)														
<p>1 関係会社に対するものは次のとおりであります。</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 30%;">支払手数料</td> <td style="text-align: right;">5,362,458千円</td> </tr> <tr> <td>受取利息</td> <td style="text-align: right;">6,195千円</td> </tr> <tr> <td>支払保証料</td> <td style="text-align: right;">125千円</td> </tr> </table>	支払手数料	5,362,458千円	受取利息	6,195千円	支払保証料	125千円	<p>1 関係会社に対するものは次のとおりであります。</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 30%;">支払手数料</td> <td style="text-align: right;">4,504,556千円</td> </tr> <tr> <td>受取利息</td> <td style="text-align: right;">5,343千円</td> </tr> <tr> <td>支払保証料</td> <td style="text-align: right;">64千円</td> </tr> </table> <p>2 固定資産除却損の内容は、次のとおりであります。</p> <table style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 30%;">器具備品</td> <td style="text-align: right;">24千円</td> </tr> </table>	支払手数料	4,504,556千円	受取利息	5,343千円	支払保証料	64千円	器具備品	24千円
支払手数料	5,362,458千円														
受取利息	6,195千円														
支払保証料	125千円														
支払手数料	4,504,556千円														
受取利息	5,343千円														
支払保証料	64千円														
器具備品	24千円														

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自 平成19年4月1日 至 平成20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19年6月29日 定時株主総会	普通株式	30,000	5,000	平成19年3月31日	平成19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20年6月30日 定時株主総会	普通株式	30,000	利益剰余金	5,000	平成20年3月31日	平成20年6月30日

当事業年度（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

（リ - ス取引関係）

前事業年度 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	当事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)
該当事項はありません。	同左

（有価証券関係）

前事業年度（平成20年3月31日現在）

1. 時価のある有価証券

区分	取得原価（千円）	貸借対照表計上額（千円）	差額（千円）
その他有価証券 その他	66,000	62,226	3,774
計	66,000	62,226	3,774

2. 当期中に売却したその他有価証券（自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日）

売却額（千円）	売却益の合計（千円）	売却損の合計（千円）
4,088	88	-

3. 時価評価されていない主な有価証券

区分	貸借対照表計上額（千円）
その他有価証券 非上場株式	199,500
MMF	322,773
計	522,273

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21年3月31日現在）

1．その他有価証券で時価のあるもの

区分	当事業年度 (平成21年3月31日現在)		
	取得原価 (千円)	貸借対照表 計上額(千円)	差額 (千円)
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

区分	当事業年度 (自平成20年4月1日 至平成21年3月31日)
売却額(千円)	16,166
売却益の合計(千円)	291
売却損の合計(千円)	2,275

3．時価評価されていない主な有価証券

区分	当事業年度 (平成21年3月31日現在)
	貸借対照表計上額(千円)
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。

(デリバティブ取引関係)

前事業年度	当事業年度

(自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	(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。	同左

(退職給付関係)

前事業年度 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)	当事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)
<p>1. 採用している退職給付制度の概要 当社は、確定給付型の制度として退職一時金制度を、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 退職給付債務 44,738千円 退職給付引当金 44,738千円</p> <p>(1) 当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。 (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 退職給付費用 41,193千円</p> <p>(1) 当社は、退職給付債務の算定にあたり、簡便法を採用しております。 (2) 金額には確定拠出年金への掛金支払額9,051千円を含んでおります。</p> <p>4. 退職給付債務等の計算基礎 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>1. 採用している退職給付制度の概要 同左</p> <p>2. 退職給付債務及びその他に関する事項 退職給付債務 91,962千円 退職給付引当金 91,962千円</p> <p>(1) 同左 (2) 同左</p> <p>3. 退職給付費用に関する事項 退職給付費用 65,654千円</p> <p>(1) 同左 (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 同左</p>

(税効果会計関係)

前事業年度 (平成20年3月31日現在)	当事業年度 (平成21年3月31日現在)																				
<p>1. 繰延税金資産の発生 の主な原因別の内訳</p> <p>(繰延税金資産)</p> <table style="width: 100%;"> <tr> <td>未払事業税</td> <td style="text-align: right;">47,126千円</td> </tr> <tr> <td>賞与引当金損金算入限度超過額</td> <td style="text-align: right;">24,388千円</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;">18,203千円</td> </tr> <tr> <td>その他</td> <td style="text-align: right;">5,742千円</td> </tr> <tr> <td>繰延税金資産 合計</td> <td style="text-align: right; border-top: 1px solid black;">95,460千円</td> </tr> </table>	未払事業税	47,126千円	賞与引当金損金算入限度超過額	24,388千円	退職給付引当金損金算入限度超過額	18,203千円	その他	5,742千円	繰延税金資産 合計	95,460千円	<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%;"> <tr> <td>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; border-top: 1px solid black;">87,900千円</td> </tr> </table> <p>(繰延税金負債)</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
未払事業税	47,126千円																				
賞与引当金損金算入限度超過額	24,388千円																				
退職給付引当金損金算入限度超過額	18,203千円																				
その他	5,742千円																				
繰延税金資産 合計	95,460千円																				
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
	差引 繰延税金資産の純額	81,441千円
2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳	2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳	
法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため、注記を省略しております。	同左	

(持分法損益等)

前事業年度 (平成20年3月31日現在)	当事業年度 (平成21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19年4月1日 至 平成20年3月31日）

(1) 親会社及び法人主要株主等

属性	会社等の名称	住所	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	関係内容		取引の内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
						役員の兼任等	事業上の関係				
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%	兼任 1人	営業上の取引	投信販売 代行手数料	5,362,458	未払 手数料	455,445
								投資助言費用 の支払	846,909	その他 未払金	318
										未払費用	152,424

(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。

(2) 役員及び個人主要株主等

該当事項はありません。

(3) 子会社等

該当事項はありません。

(4) 兄弟会社等

該当事項はありません。

当事業年度（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）

（1株当たり情報）

前事業年度 (自 平成19年4月1日 至 平成20年3月31日)		当事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)	
1株当たり純資産額	916,158円04銭	1株当たり純資産額	994,180円05銭
1株当たり当期純利益	201,595円78銭	1株当たり当期純利益	86,809円36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19年4月1日 至 平成20年3月31日)	当事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)
当期純利益	1,209,574千円	520,856千円
普通株主に帰属しない金額	-	-
普通株式に係る当期純利益	1,209,574千円	520,856千円
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19年4月1日 至 平成20年3月31日)	当事業年度 (自 平成20年4月1日 至 平成21年3月31日)
該当事項はありません。	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。

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。）、

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。）、

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。
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。
上記 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】

(1)住友信託銀行株式会社(「受託者」および「指定販売会社」)

資本金の額

平成21年3月末日現在 287,537百万円

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。

2【関係業務の概要】

(1)「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

その他上記の業務に付随する業務

(2)「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

その他上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。指定販売会社が引き受ける業務については、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

(なお、受付時間は営業日の午前9時～午後5時(わが国の取引所が半休日の場合は午前9時～正午))

とします。)

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。）

その他の上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21年3月末日現在）

業務の概要：銀行法にもとづき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律にもとづき信託業務を営んでいます。

第3【参考情報】

本ファンドについては、当該特定期間において次の書類を提出しています。

提出年月日	書類名
平成20年10月28日	臨時報告書
平成21年1月5日	有価証券報告書
平成21年1月5日	有価証券届出書
平成21年1月28日	臨時報告書

独立監査人の監査報告書

平成21年5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
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」に掲げられている住信 毎月分配パッケージファンドの平成20年10月15日から平成21年4月14日までの特定期間の財務諸表、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、住信 毎月分配パッケージファンドの平成21年4月14日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定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。

独立監査人の監査報告書

平成20年11月14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 白川 芳樹
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」に掲げられている住信 毎月分配パッケージファンドの平成20年4月15日から平成20年10月14日までの特定期間の財務諸表、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、住信 毎月分配パッケージファンドの平成20年10月14日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定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. 前特定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20年6月30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 白川 芳樹 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている住信アセットマネジメント株式会社の平成19年4月1日から平成20年3月31日までの第22期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書及び株主資本等変動計算書について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。

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

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

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

以上

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